

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2023年9月12日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 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
【事務連絡者氏名】	西脇 保宏 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	D C ダイワ・ターゲットイヤー2040
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

DCダイワ・ターゲットイヤー2040

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(5)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(6)【申込単位】

1円以上1円単位

(7)【申込期間】

2023年9月13日から2024年3月11日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8)【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12)【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

(注1) 商品分類の定義

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

(注2) 属性区分の定義

投資対象 資産	株式	一般	大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
		大型株	目論見書等において、主として大型株に投資する旨の記載があるもの
		中小型株	目論見書等において、主として中小型株に投資する旨の記載があるもの
	債券	一般	公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのもの
		公債	目論見書等において、日本国または各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。)に主として投資する旨の記載があるもの
		社債	目論見書等において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるもの
		その他債券	目論見書等において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるもの
		格付等クレジットによる属性	目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載があるもの
	不動産投信	目論見書等において、主として不動産投信(リート)に投資する旨の記載があるもの	
	その他資産	目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信(リート)以外に投資する旨の記載があるもの	
	資産複合	目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの	
	資産複合 資産配 分固定型	目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの	
	資産複合 資産配 分変更型	目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの	
決算頻度	年1回	目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの	
	年2回	目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの	
	年4回	目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの	
	年6回(隔月)	目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの	
	年12回(毎月)	目論見書等において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるもの	
	日々	目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの	
	その他	上記属性にあてはまらないすべてのもの	

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

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

< 信託金の限度額 >

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

< ファンドの特色 >

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

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

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

< 2023年6月時点の基本配分比率 >

	わが国の株式	海外の株式	わが国のリート	海外のリート	わが国の債券	海外の債券
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	32%	17%	7%	7%	21%	16%

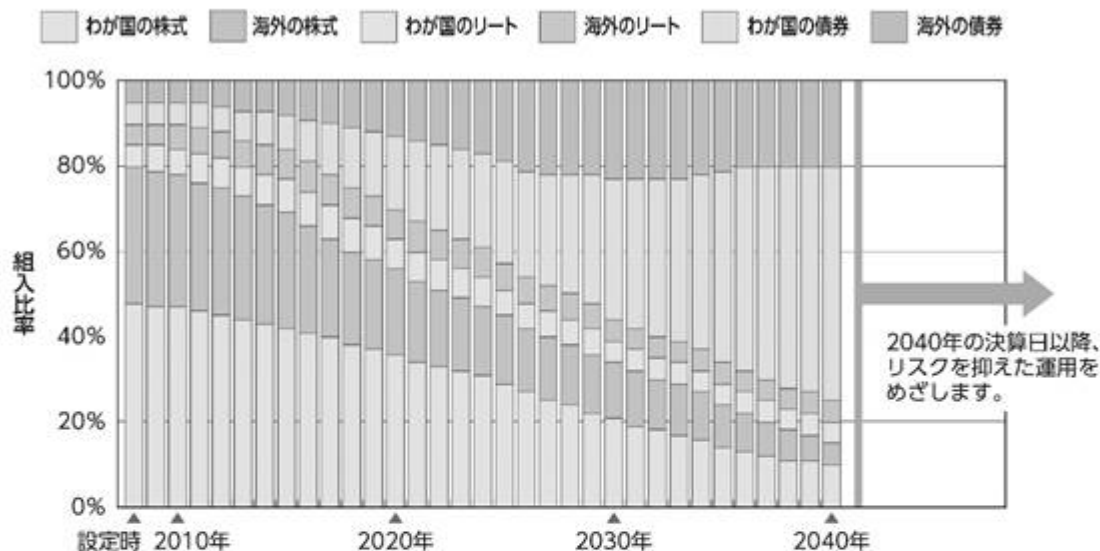
< 当初設定時の基本配分比率 >

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

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

※実際の資産配分比率とは異なる場合があります。

ファンドの基本配分比率のイメージ



- (注1) 2023年6月現在で計画している基本配分比率であり、将来の基本配分比率は市況動向等により変更となる場合があります。2022年以前は過去の基本配分比率を示しています。
- (注2) 解約資金対応等のためファンドにおいて現金等を保有する必要性があるため、実際の資産別実質組入比率の推移は、上記の資産配分とは異なることがあります。
- (注3) 組入有価証券等の価格変動により、ファンドの実際の資産別実質組入比率が、その時点での基本配分比率から乖離することがあります。なお、こうした乖離が一定水準以上となった場合には、基本配分比率の変更計画に基づく定期的なポートフォリオの見直し以外のタイミングであっても、その時点でポートフォリオの調整（リバランス）を行なう場合があります。
- (注4) 投資環境によっては、「わが国の債券」への投資に代えて「わが国の短期債券および短期金融資産」へ投資する場合があります。

2

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

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

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

運用プロセス



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

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

東証株価指数（TOPIX）とは

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

3

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

運用プロセス



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

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

MSCIコクサイ指数とは

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

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

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

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

運用プロセス



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

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

東証REIT指数とは

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

【算出方法の概要】

指数：算出時の時価総額^(注1) ÷ 基準時の時価総額^(注2) × 1,000

(注1) 算出対象銘柄ごとに、価格に指数算出用上場口数を乗じ、これを全銘柄合計したものです。

(注2) 2003年3月31日の終値により算出された時価総額とします。ただし、算出対象銘柄数の増減など市況変動によらない時価総額の増減や増資などが発生する場合は、連続性を維持するため、基準時の時価総額を修正します。なお、配当込み指数の算出に際しては、権利落(金銭の分配)についても、基準時の時価総額の修正が行なわれます。

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

5

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

運用プロセス



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

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

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

S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）とは

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

【特徴】

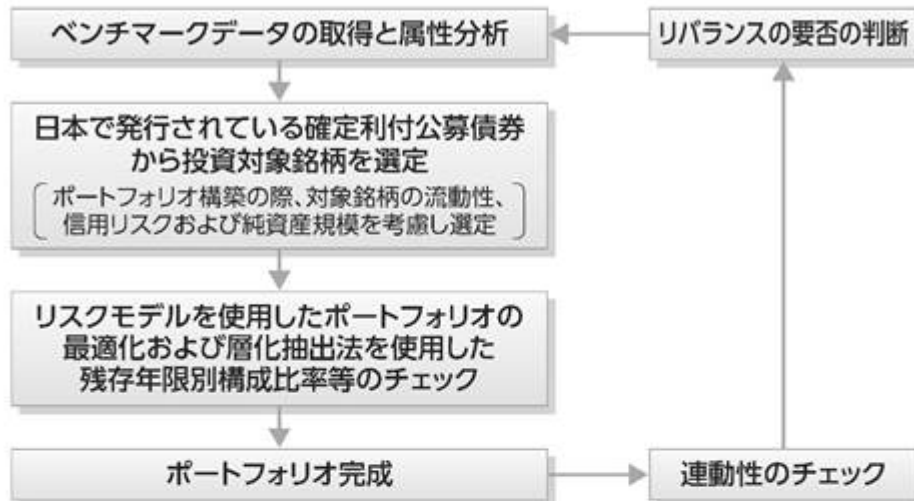
- 世界に上場する各国のREIT制度に基づいて設立・運営されている銘柄を幅広く採用しています。
- 1989年から過去データを算出しています。
- 配当込み指数値、配当利回りデータ等を算出しています。

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

6

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

運用プロセス



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

(注1) リスクモデルとは…

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

(注2) 層化抽出法とは…

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

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

NOMURA－BPI総合指数とは

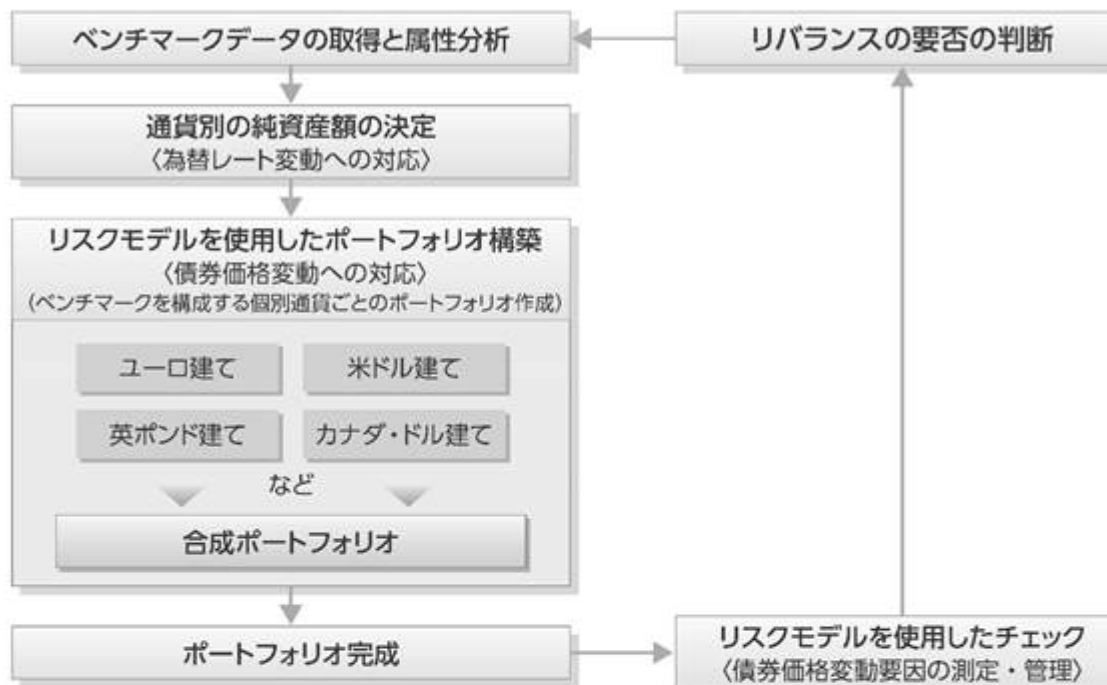
NOMURA－BPIは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表わすために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

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

7

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

運用プロセス



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

①為替レート変動への対応

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

②債券価格変動への対応

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

③債券価格変動要因の測定・管理

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

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

FTSE世界国債インデックスとは

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

8

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

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

NOMURA-BPI総合短期指数とは

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

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

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

ファンドの仕組み

- 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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

〈2040年の決算日前日まで〉



※ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドに投資することがあります。

〈2040年の決算日から〉



- 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

9

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

10

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

〈分配方針〉

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益とします。
- ②原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行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

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

2008年2月28日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金（注）、償還金など	お申込金（ 3）
お取扱窓口	販売会社	<p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1）に基づき、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集の取扱い</p> <p>一部解約請求に関する事務</p> <p>収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務</p> <p style="text-align: right;">など</p>
1	収益分配金、償還金など	お申込金（ 3）

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

(注) 収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

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

< 委託会社の概況（2023年6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】

主要投資対象

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

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

投資態度

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

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

当初設定時の基本配分比率

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

外国株式インデックスマザーファンドの受益証券信託財産の純資産総額の32%

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

ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンドの受益証券

.....信託財産の純資産総額の 5%

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(B P I)の受益証券

.....信託財産の純資産総額の 5%

外国債券インデックスマザーファンドの受益証券信託財産の純資産総額の 5%

ハ. 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

(2) 【投資対象】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

3. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

1. 預金

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

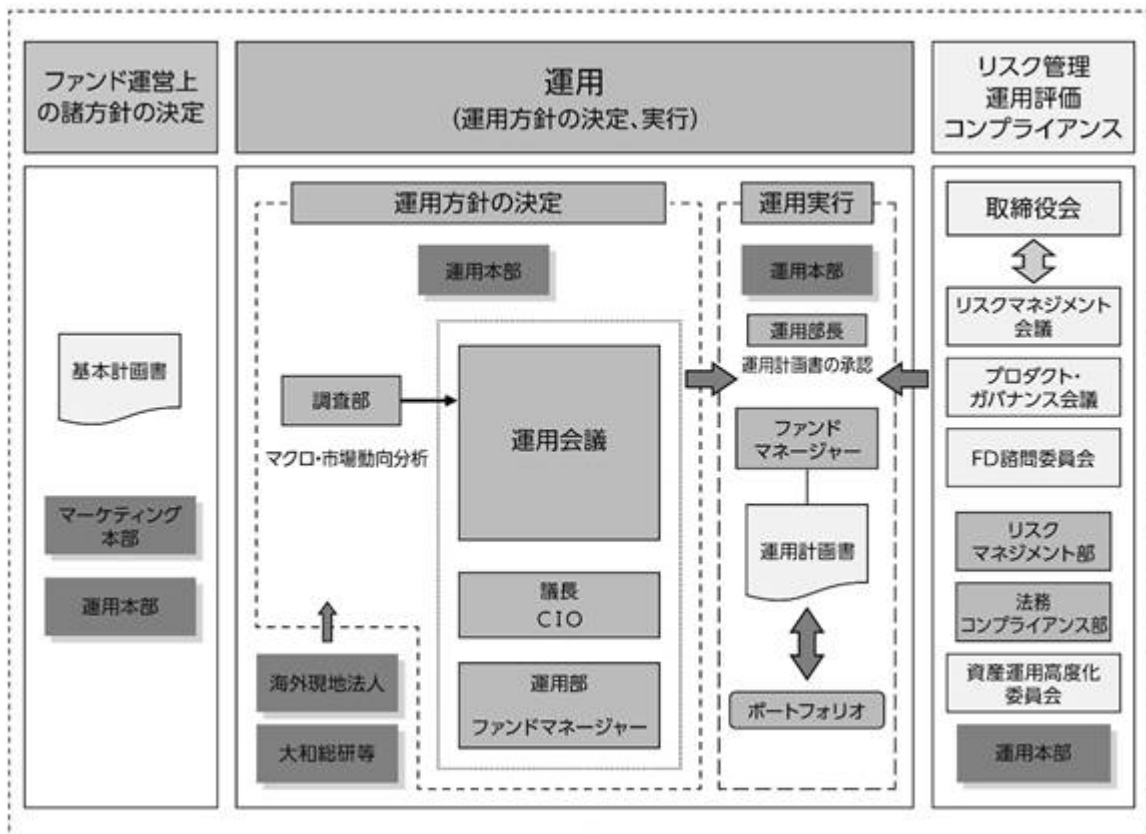
3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

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

職務権限

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

イ．CIO (Chief Investment Officer) (1名)

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

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

ロ．Deputy-CIO (0~5名程度)

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー (0~5名程度)

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

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

次のとおり各会議体等において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体等の事務局となる部署の人員は35～45名程度です。

イ．リスクマネジメント会議

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

ロ．プロダクト・ガバナンス会議

経営会議の分科会として、運用状況・商品性及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・決定した上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・報告を行います。

ハ．FD諮問委員会

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

ニ．資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は2023年6月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

分配対象額は、経費控除後の配当等収益とします。

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

外国為替予約取引（信託約款）

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

信用リスク集中回避（信託約款）

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

資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

<参考> 各マザーファンドの概要

1. トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

投資態度

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

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

(3) 主な投資制限

株式への投資には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

2. 外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

外国の株式（預託証券を含みます。）を主要投資対象とします。

投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

1. 外国通貨表示の株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
19. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

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

1. 預金

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

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

3. ダイワJ - REITマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

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

投資態度

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

(2) 投資対象

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

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

株式

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券

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

外貨建資産

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

先物取引

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

4. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

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

投資態度

- イ．主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券に投資し、ベンチマーク（S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）をいいます。以下同じ。）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
- ロ．組入銘柄はベンチマーク構成銘柄とし、不動産投資信託証券の組入比率を高位に保ちます。
- ハ．運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ニ．保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
- ホ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．為替手形

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

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

なお、前3.の証券および前4.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引

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

5. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

(3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

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

スワップ取引

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

金利先渡取引

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

6．ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

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

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

12. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
14. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの
委託会社は、信託金を、前に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。
 1. 預金
 2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

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

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

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

金利先渡取引

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

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

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

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

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

7. 外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

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

(2) 投資対象

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

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

14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
19. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの
委託会社は、信託金を、前に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。
 1. 預金
 2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

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

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

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

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません

3【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動(価格変動リスク・信用リスク)

株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。株価は、短期的または長期的に大きく下落することがあります(発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投

資資金が回収できなくなることもあります。）。組入銘柄の株価が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

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

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

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

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

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

外貨建資産の円換算価値は、資産自体の価格変動のほか、当該外貨の円に対する為替レートの変動の影響を受けます。為替レートは、各国の金利動向、政治・経済情勢、為替市場の需給その他の

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

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

ロ．カンントリー・リスク

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

その他

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

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

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、お買付けの申込みの受け付けを中止することがあります。

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

(3)その他の留意点

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

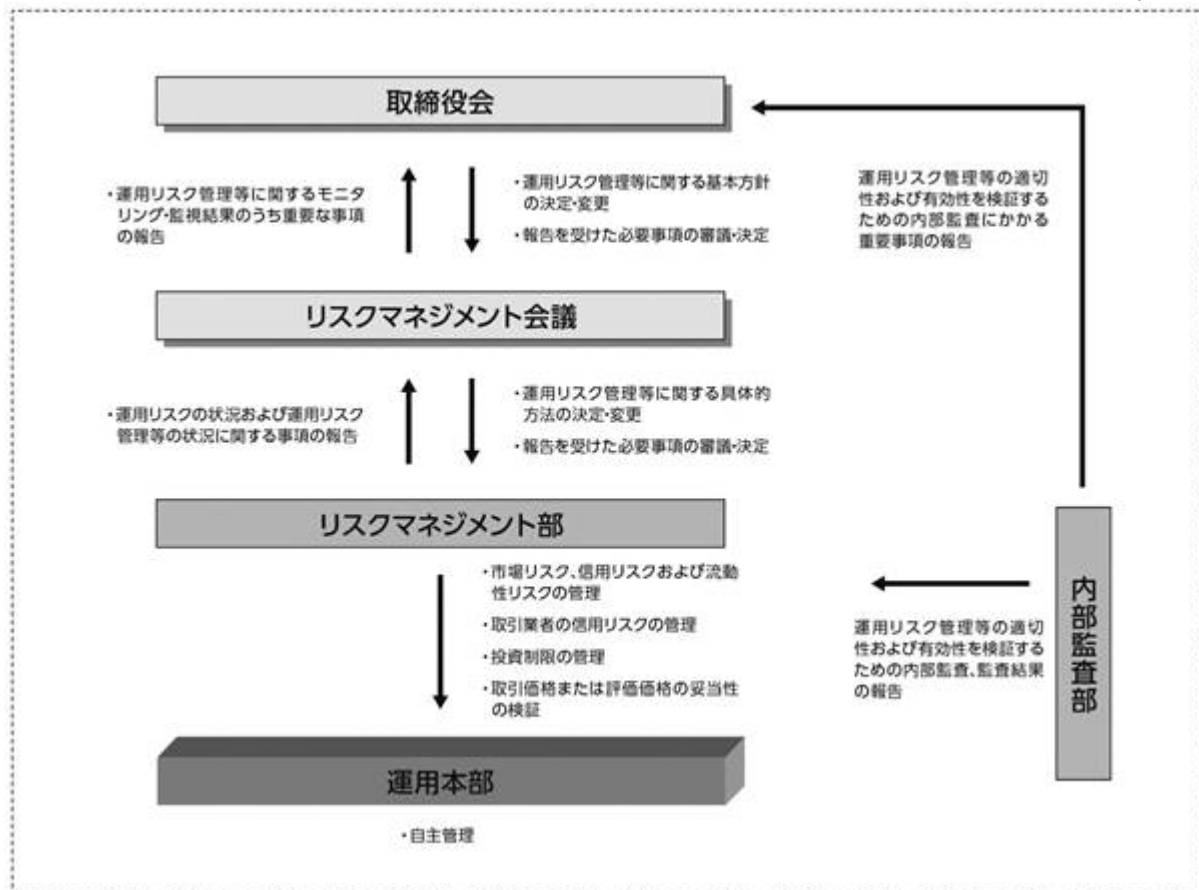
流動性リスクに関する事項

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

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

(4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



流動性リスクに対する管理体制

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

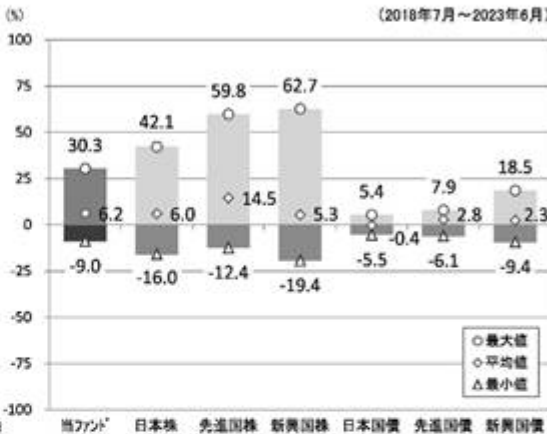
参 考 情 報

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

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・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

※指数について

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

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

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

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

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

< 第1計算期間から2016年3月11日まで >

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

< 2016年3月12日から第18計算期間まで >

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

< 第19計算期間から第28計算期間まで >

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

< 第29計算期間から第33計算期間まで >

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

< 第34計算期間以降 >

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

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

<マザーファンドより支弁する手数料等>

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

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

イ．収益分配金に対する課税

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

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。

<注1> 個別元本について

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

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

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

個別元本について、詳しくは販売会社にお問合わせ下さい。

<注2> 収益分配金の課税について

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

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

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

（ ）上記は、2023年6月末日現在のもので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】（2023年6月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	357,004,481	99.81
内 日本	357,004,481	99.81
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	695,016	0.19
純資産総額	357,699,497	100.00

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

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

(2)【投資資産】（2023年6月30日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	70,680,230	1.3594 96,086,929	1.6263 114,947,258	32.14
2	ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	69,272,819	1.0431 72,258,692	1.0445 72,355,459	20.23
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	12,433,772	4.1640 51,774,759	5.0230 62,454,836	17.46
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	17,087,509	3.1342 53,556,675	3.3512 57,263,660	16.01
5	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	7,833,304	2.9949 23,460,504	3.2773 25,672,087	7.18
6	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	7,421,222	3.3127 24,584,820	3.2759 24,311,181	6.80

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第6計算期間末 (2013年12月18日)	9,736,661	9,736,661	1.1001	1.1001
第7計算期間末 (2014年12月18日)	13,831,791	13,831,791	1.2972	1.2972
第8計算期間末 (2015年12月18日)	22,270,544	22,270,544	1.3817	1.3817
第9計算期間末 (2016年12月19日)	28,966,940	28,966,940	1.4141	1.4141
第10計算期間末 (2017年12月18日)	37,746,883	37,746,883	1.5802	1.5802
第11計算期間末 (2018年12月18日)	45,018,917	45,018,917	1.4875	1.4875
第12計算期間末 (2019年12月18日)	77,674,021	77,674,021	1.6805	1.6805
第13計算期間末 (2020年12月18日)	119,539,263	119,539,263	1.7292	1.7292
第14計算期間末 (2021年12月20日)	238,841,582	238,841,582	1.9765	1.9765
2022年6月末日	258,865,391	-	1.9682	-

7月末日	266,857,757	-	2.0196	-
8月末日	283,362,586	-	2.0248	-
9月末日	274,904,685	-	1.9452	-
10月末日	290,103,400	-	2.0326	-
11月末日	294,636,100	-	2.0282	-
第15計算期間末 (2022年12月19日)	290,922,352	290,922,352	1.9868	1.9868
12月末日	284,913,814	-	1.9456	-
2023年1月末日	297,000,187	-	1.9949	-
2月末日	304,110,622	-	2.0205	-
3月末日	310,331,794	-	2.0194	-
4月末日	317,919,683	-	2.0585	-
5月末日	343,796,197	-	2.1092	-
6月末日	357,699,497	-	2.2108	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
2022年12月20日 ~ 2023年6月19日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第6計算期間	43.9
第7計算期間	17.9
第8計算期間	6.5
第9計算期間	2.3
第10計算期間	11.7
第11計算期間	5.9
第12計算期間	13.0

第13計算期間	2.9
第14計算期間	14.3
第15計算期間	0.5
2022年12月20日～ 2023年6月19日	10.7

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第6計算期間	4,772,167	334,316
第7計算期間	2,261,839	449,310
第8計算期間	6,366,392	910,747
第9計算期間	5,468,224	1,102,640
第10計算期間	7,259,647	3,856,478
第11計算期間	9,247,574	2,870,316
第12計算期間	21,843,305	5,886,469
第13計算期間	45,072,340	22,164,723
第14計算期間	70,739,694	19,025,186
第15計算期間	57,094,084	31,512,786
2022年12月20日～ 2023年6月19日	24,251,257	8,158,132

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2023年6月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	246,134,869,730	96.64
内 日本	246,134,869,730	96.64
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	8,565,873,259	3.36
純資産総額	254,700,742,989	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)	8,419,840,000	3.31
内 日本	8,419,840,000	3.31

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

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

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

(2) 投資資産 (2023年6月30日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	4,135,200	2,033.81 8,410,235,304	2,308.50 9,546,109,200	3.75
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	532,700	10,452.29 5,567,935,342	12,965.00 6,906,455,500	2.71
3	キーエンス	日本	株式	電気機器	75,300	51,929.92 3,910,323,513	67,850.00 5,109,105,000	2.01
4	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,645,000	743.59 3,453,991,232	1,065.00 4,946,925,000	1.94
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	24,194,900	156.92 3,796,731,171	170.50 4,125,230,450	1.62
6	三菱商事	日本	株式	卸売業	485,800	4,406.33 2,140,595,381	6,930.00 3,366,594,000	1.32
7	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	542,000	4,430.14 2,401,136,608	6,159.00 3,338,178,000	1.31
8	日立	日本	株式	電気機器	369,900	6,769.01 2,503,857,309	8,896.00 3,290,630,400	1.29
9	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	159,400	13,859.02 2,209,129,036	20,560.00 3,277,264,000	1.29
10	任天堂	日本	株式	その他製品	475,500	6,131.82 2,915,682,205	6,542.00 3,110,721,000	1.22
11	三井物産	日本	株式	卸売業	565,500	3,373.02 1,907,444,767	5,411.00 3,059,920,500	1.20
12	武田薬品	日本	株式	医薬品	668,400	3,874.50 2,589,716,751	4,527.00 3,025,846,800	1.19
13	第一三共	日本	株式	医薬品	658,000	4,251.60 2,797,552,867	4,550.00 2,993,900,000	1.18
14	信越化学	日本	株式	化学	627,000	3,224.78 2,021,942,778	4,768.00 2,989,536,000	1.17
15	伊藤忠	日本	株式	卸売業	491,000	3,845.03 1,887,912,091	5,687.00 2,792,317,000	1.10

16	HOYA	日本	株式	精密機器	159,500	14,484.65 2,310,303,195	17,075.00 2,723,462,500	1.07
17	本田技研	日本	株式	輸送用機器	612,200	3,541.73 2,168,248,773	4,341.00 2,657,560,200	1.04
18	ダイキン工業	日本	株式	機械	90,800	24,083.63 2,186,793,783	29,265.00 2,657,262,000	1.04
19	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	573,100	4,367.55 2,503,047,779	4,563.00 2,615,055,300	1.03
20	KDDI	日本	株式	情報・通信業	583,600	4,349.41 2,538,318,419	4,450.00 2,597,020,000	1.02
21	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	372,600	5,515.22 2,054,972,299	6,773.00 2,523,619,800	0.99
22	東京海上HD	日本	株式	保険業	733,100	2,646.40 1,940,078,747	3,315.00 2,430,226,500	0.95
23	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,072,700	1,686.25 1,808,848,465	2,199.00 2,358,867,300	0.93
24	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	409,700	4,094.72 1,677,608,207	5,601.00 2,294,729,700	0.90
25	SMC	日本	株式	機械	24,700	63,577.10 1,570,354,589	79,480.00 1,963,156,000	0.77
26	村田製作所	日本	株式	電気機器	228,400	7,411.58 1,692,806,521	8,236.00 1,881,102,400	0.74
27	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	1,213,800	1,503.42 1,824,854,446	1,540.00 1,869,252,000	0.73
28	ファナック	日本	株式	電気機器	367,200	4,367.88 1,603,888,494	5,032.00 1,847,750,400	0.73
29	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	274,600	5,978.27 1,641,635,440	6,205.00 1,703,893,000	0.67
30	三菱電機	日本	株式	電気機器	786,100	1,402.81 1,102,753,239	2,027.00 1,593,424,700	0.63

(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	96.64%
合計	96.64%

(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	0.28%
建設業	1.94%
食料品	3.28%
繊維製品	0.42%
パルプ・紙	0.16%
化学	5.84%
医薬品	5.01%
石油・石炭製品	0.40%
ゴム製品	0.73%
ガラス・土石製品	0.66%
鉄鋼	0.84%
非鉄金属	0.64%
金属製品	0.50%
機械	5.40%
電気機器	17.71%
輸送用機器	7.70%
精密機器	2.49%
その他製品	2.27%
電気・ガス業	1.23%
陸運業	2.82%
海運業	0.53%
空運業	0.50%
倉庫・運輸関連業	0.13%
情報・通信業	7.97%
卸売業	6.62%
小売業	4.18%
銀行業	5.89%
証券、商品先物取引業	0.68%
保険業	2.21%
その他金融業	1.10%
不動産業	1.72%
サービス業	4.68%
合計	96.64%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 050 9月	買建	368	8,266,880,200	8,419,840,000	3.31%

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

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

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2023年6月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	346,069,843,805	92.85
内 香港	2,632,850,347	0.71
内 シンガポール	1,391,510,263	0.37
内 イスラエル	686,230,972	0.18
内 ノルウェー	689,417,156	0.18
内 スウェーデン	3,540,847,073	0.95
内 デンマーク	3,269,192,304	0.88
内 イギリス	15,035,061,130	4.03
内 アイルランド	811,777,744	0.22
内 オランダ	4,724,118,999	1.27
内 ベルギー	887,613,679	0.24
内 フランス	12,347,980,448	3.31
内 ドイツ	8,617,879,632	2.31
内 スイス	9,989,302,621	2.68
内 ポルトガル	214,298,793	0.06
内 スペイン	2,674,863,279	0.72
内 イタリア	2,560,693,878	0.69
内 フィンランド	886,044,060	0.24
内 オーストリア	174,180,333	0.05

	内 カナダ	11,571,868,323	3.10
	内 アメリカ	256,628,589,399	68.85
	内 オーストラリア	6,516,075,581	1.75
	内 ニュージーランド	219,447,791	0.06
投資証券		7,554,925,129	2.03
	内 香港	131,108,668	0.04
	内 シンガポール	151,152,493	0.04
	内 イギリス	125,037,739	0.03
	内 ベルギー	28,833,178	0.01
	内 フランス	116,132,212	0.03
	内 カナダ	30,518,106	0.01
	内 アメリカ	6,351,099,077	1.70
	内 オーストラリア	621,043,656	0.17
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		19,097,487,253	5.12
純資産総額		372,722,256,187	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)	19,038,481,842	5.11
内 イギリス	1,012,935,606	0.27
内 ドイツ	3,648,012,535	0.98
内 カナダ	1,157,805,634	0.31
内 アメリカ	12,380,433,306	3.32
内 オーストラリア	839,294,761	0.23
為替予約取引(買建)	10,379,833,220	2.78
内 日本	10,379,833,220	2.78

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

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

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

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

(2) 投資資産 (2023年6月30日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
-----	----	----	----	----------------------	-------------------	-------------------	-----------------

1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	737,400	20,662.95 15,236,924,865	27,488.65 20,270,133,533	5.44
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	329,400	35,363.35 11,648,723,654	48,578.89 16,001,889,495	4.29
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	430,200	13,587.15 5,845,200,950	18,544.22 7,977,723,874	2.14
4	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	115,080	24,066.45 2,769,582,770	59,187.81 6,811,334,072	1.83
5	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	133,350	26,764.57 3,569,060,718	37,334.92 4,978,612,249	1.34
6	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	277,400	13,927.01 3,863,372,367	17,268.30 4,790,228,917	1.29
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	249,940	13,893.95 3,472,680,080	17,400.24 4,349,018,460	1.17
8	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	103,100	16,530.01 1,704,253,492	40,819.03 4,208,442,478	1.13
9	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	43,466	76,173.39 3,310,957,567	69,079.03 3,002,589,361	0.81
10	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	60,550	45,678.37 2,765,830,327	48,848.58 2,957,781,573	0.79
11	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネル ギー	188,905	16,034.15 3,028,944,724	15,470.43 2,922,442,146	0.78
12	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	121,000	25,381.22 3,071,128,158	23,792.85 2,878,935,939	0.77
13	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	136,470	19,851.59 2,709,165,872	20,795.91 2,838,018,616	0.76
14	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	75,750	30,507.63 2,310,962,842	33,974.05 2,573,534,803	0.69
15	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	37,585	52,785.20 1,983,937,136	67,346.40 2,531,214,636	0.68
16	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	19,412	77,512.08 1,504,665,286	125,064.02 2,427,742,840	0.65

17	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	109,867	21,054.28 2,313,176,718	21,658.60 2,379,566,087	0.64
18	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	39,600	50,013.14 1,980,523,528	56,208.27 2,225,847,623	0.60
19	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	122,379	17,899.82 2,190,567,345	17,234.43 2,109,132,896	0.57
20	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	47,150	45,751.15 2,157,168,614	44,630.82 2,104,343,248	0.56
21	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	118,221	15,776.07 1,865,070,113	16,462.16 1,946,173,561	0.52
22	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	18,154	89,011.69 1,615,920,556	105,339.84 1,912,339,455	0.51
23	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネル ギー	83,718	26,169.82 2,190,897,282	22,653.23 1,896,483,745	0.51
24	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	株式	ヘルスケア	79,858	18,828.40 1,503,599,326	22,573.48 1,802,673,605	0.48
25	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	64,200	26,410.79 1,695,573,811	26,660.76 1,711,620,869	0.46
26	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	フランス	株式	一般消費 財・サービ ス	12,431	111,991.82 1,392,172,148	134,748.00 1,675,052,388	0.45
27	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	191,450	9,033.45 1,729,482,332	8,702.29 1,666,055,297	0.45
28	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	20,660	76,446.84 1,579,394,571	77,089.73 1,592,673,886	0.43
29	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	82,172	22,809.24 1,874,291,878	19,317.01 1,587,317,978	0.43
30	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需品	69,000	22,085.89 1,523,928,994	22,369.05 1,543,464,947	0.41

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	92.85%
投資証券	2.03%
合計	94.88%

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

八 . 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	4.57%
素材	3.84%
資本財・サービス	9.63%
一般消費財・サービス	10.06%
生活必需品	7.04%
ヘルスケア	12.37%
金融	14.05%
情報技術	21.56%
コミュニケーション・サービス	6.67%
公益事業	2.74%
不動産	0.34%
合計	92.85%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 EMINI SEP 23	買建	385	12,252,559,629	12,380,433,306	3.32%
	イギリス	FTSE 100 INDEX SEP 23	買建	74	1,028,241,843	1,012,935,606	0.27%
	オーストラ リア	SPI 200 SEP 23	買建	49	833,277,579	839,294,761	0.23%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX SEP 23	買建	44	1,154,273,296	1,157,805,634	0.31%
	ドイツ	SWISS MKT IX SEP 23	買建	51	931,905,115	921,374,935	0.25%
		EURO STOXX 50 SEP 23	買建	395	2,713,881,062	2,726,637,600	0.73%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2023年7 月	買建	44,600,000	6,265,773,250	6,459,707,900	1.73%
		英ポンド買/円売 2023年 7月	買建	3,100,000	542,703,380	566,570,880	0.15%
		豪ドル買/円売 2023年7 月	買建	6,300,000	574,324,400	602,824,950	0.16%

スイス・フラン買/円売 2023年7月	買建	4,100,000	630,564,580	660,638,330	0.18%
ユーロ買/円売 2023年7 月	買建	8,000,000	1,203,969,950	1,259,896,800	0.34%
カナダ・ドル買/円売 2023年7月	買建	7,600,000	782,633,230	830,194,360	0.22%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワJ-REITマザーファンド

(1) 投資状況（2023年6月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	454,115,265,400	97.78
内 日本	454,115,265,400	97.78
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,331,790,352	2.22
純資産総額	464,447,055,752	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	10,320,800,000	2.22
内 日本	10,320,800,000	2.22

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

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

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

(2) 投資資産（2023年6月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	50,382	559,984.26 28,213,127,363	566,000.00 28,516,212,000	6.14
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	44,287	548,366.34 24,285,500,418	548,000.00 24,269,276,000	5.23
3	野村不動産マスターF	日本	投資証券	139,660	149,311.05 20,852,782,326	166,100.00 23,197,526,000	4.99
4	日本プロロジスリート	日本	投資証券	75,096	292,136.26 21,938,265,080	289,300.00 21,725,272,800	4.68
5	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	217,906	99,637.24 21,711,554,092	96,300.00 20,984,347,800	4.52
6	GLP投資法人	日本	投資証券	145,608	149,548.37 21,775,439,373	142,100.00 20,690,896,800	4.45
7	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	65,100	274,809.71 17,890,112,217	276,200.00 17,980,620,000	3.87
8	オリックス不動産投資	日本	投資証券	86,051	172,637.16 14,855,601,112	177,400.00 15,265,447,400	3.29
9	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	43,182	319,509.58 13,797,062,693	344,000.00 14,854,608,000	3.20
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	96,608	144,671.57 13,976,431,077	145,400.00 14,046,803,200	3.02
11	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	129,776	70,761.16 9,183,100,740	83,900.00 10,888,206,400	2.34
12	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	190,088	54,640.45 10,386,494,389	57,200.00 10,873,033,600	2.34
13	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	29,536	346,086.83 10,222,020,763	348,500.00 10,293,296,000	2.22
14	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	139,273	74,709.57 10,405,026,129	73,500.00 10,236,565,500	2.20
15	産業ファンド	日本	投資証券	65,895	141,541.67 9,326,888,634	151,600.00 9,989,682,000	2.15
16	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	14,912	594,102.16 8,859,251,455	649,000.00 9,677,888,000	2.08
17	API投資法人	日本	投資証券	22,657	371,540.91 8,418,002,485	402,500.00 9,119,442,500	1.96
18	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	29,120	293,041.26 8,533,361,685	312,500.00 9,100,000,000	1.96

19	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	25,130	315,833.95 7,936,907,206	346,500.00 8,707,545,000	1.87
20	三井不ロジパーク	日本	投資証券	17,061	458,939.53 7,829,967,436	500,000.00 8,530,500,000	1.84
21	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	52,870	155,851.62 8,239,875,236	151,100.00 7,988,657,000	1.72
22	イオンリート投資	日本	投資証券	49,579	144,984.67 7,188,195,426	155,400.00 7,704,576,600	1.66
23	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	16,024	476,613.18 7,637,249,699	468,000.00 7,499,232,000	1.61
24	森ヒルズリート	日本	投資証券	50,785	148,254.64 7,529,112,315	147,400.00 7,485,709,000	1.61
25	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	日本	投資証券	31,672	203,213.67 6,436,183,393	234,300.00 7,420,749,600	1.60
26	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	20,652	308,104.50 6,362,974,197	345,000.00 7,124,940,000	1.53
27	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	59,846	111,443.85 6,669,469,191	114,400.00 6,846,382,400	1.47
28	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	40,407	148,465.74 5,999,055,316	161,000.00 6,505,527,000	1.40
29	三菱地所物流REIT	日本	投資証券	14,837	397,805.27 5,902,236,927	413,000.00 6,127,681,000	1.32
30	森トラストリート投資法人	日本	投資証券	80,382	68,841.00 5,533,577,968	72,000.00 5,787,504,000	1.25

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	97.78%
合計	97.78%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指数先物取引	日本	TREIT先物 050 9月	買建	5,600	10,339,336,000	10,320,800,000	2.22%

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

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

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2023年6月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	8,426,893	0.03
内 イギリス	8,426,893	0.03
投資信託受益証券	404,835,278	1.25
内 アメリカ	404,835,278	1.25
投資証券	31,107,861,849	95.96
内 ガーンジー	59,116,336	0.18
内 韓国	69,646,873	0.21
内 香港	405,805,363	1.25
内 シンガポール	1,181,535,051	3.64
内 イスラエル	38,434,796	0.12
内 イギリス	1,340,605,754	4.14
内 アイルランド	9,817,799	0.03
内 オランダ	51,535,587	0.16
内 ベルギー	266,343,081	0.82
内 フランス	474,740,756	1.46
内 ドイツ	12,159,625	0.04
内 スペイン	108,003,692	0.33
内 イタリア	2,637,586	0.01
内 カナダ	517,388,500	1.60
内 アメリカ	24,356,375,561	75.14
内 オーストラリア	2,089,495,740	6.45
内 ニュージーランド	124,219,749	0.38

コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	894,781,152	2.76
純資産総額	32,415,905,172	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	893,863,215	2.76
内 ドイツ	218,717,280	0.67
内 アメリカ	675,145,935	2.08
為替予約取引(買建)	412,980,197	1.27
内 日本	412,980,197	1.27

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

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

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

(2) 投資資産 (2023年6月30日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	156,588	16,632.52 2,604,470,071	17,616.28 2,758,498,836	8.51
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	15,858	98,646.99 1,564,346,024	112,661.57 1,786,587,331	5.51
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	26,831	42,162.94 1,131,277,498	41,842.66 1,122,680,520	3.46
4	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	114,155	9,021.13 1,029,811,397	8,731.29 996,721,300	3.07
5	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	84,279	10,204.54 860,039,935	11,655.74 982,334,626	3.03
6	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	55,446	16,869.00 935,323,064	16,639.05 922,568,899	2.85
7	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	49,402	15,655.00 773,390,725	16,221.48 801,373,614	2.47
8	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	170,284	4,834.11 823,182,619	4,549.78 774,755,793	2.39
9	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	24,078	24,903.91 599,637,695	27,263.91 656,460,656	2.03

10	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	300,258	1,793.00 538,372,173	1,926.89 578,564,858	1.78
11	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	57,824	9,184.68 531,095,736	9,485.24 548,474,853	1.69
12	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	22,900	22,243.20 509,369,686	21,454.17 491,300,500	1.52
13	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	98,572	4,635.76 456,966,130	4,948.50 487,784,400	1.50
14	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	67,835	6,582.25 446,515,142	6,904.42 468,361,588	1.44
15	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	26,697	21,294.82 568,510,986	16,437.51 438,832,373	1.35
16	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	19,782	23,251.46 459,961,863	22,048.62 436,165,985	1.35
17	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	33,600	11,991.68 402,921,686	12,048.66 404,835,278	1.25
18	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	49,449	7,800.60 385,736,337	8,142.63 402,645,326	1.24
19	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	21,095	20,809.39 438,975,668	18,641.36 393,239,580	1.21
20	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	10,883	31,195.03 339,495,731	33,792.81 367,767,252	1.13
21	LINK REIT	香港	投資証券	448,100	956.46 428,596,553	807.52 361,851,953	1.12
22	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	36,269	11,260.64 408,417,129	9,794.07 355,221,288	1.10
23	UDR INC	アメリカ	投資証券	52,467	5,911.67 310,174,577	6,217.17 326,196,321	1.01
24	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	アメリカ	投資証券	44,538	7,443.35 331,515,804	7,040.71 313,579,338	0.97
25	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	105,112	3,215.73 338,023,335	2,856.30 300,231,721	0.93
26	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	120,602	2,660.13 320,826,821	2,419.88 291,842,742	0.90
27	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	29,680	9,512.79 282,342,974	9,624.43 285,653,266	0.88
28	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	18,103	16,824.49 304,574,991	15,747.36 285,074,529	0.88
29	LIFE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	14,428	15,406.78 222,291,024	19,177.82 276,697,692	0.85

30	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	アメリカ	投資証券	53,277	4,726.09 251,796,889	5,115.24 272,525,025	0.84
----	--------------------------	------	------	--------	-------------------------	-------------------------	------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	0.03%
投資信託受益証券	1.25%
投資証券	95.96%
合計	97.24%

(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
不動産	0.03%
合計	0.03%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	アメリカ	DOW JONES US REAL ESTATE SEP 23	買建	139	663,115,238	675,145,935	2.08%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE SEP 23	買建	270	230,000,274	218,717,280	0.67%
為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2023年7 月	買建	470,000	69,643,848	74,018,937	0.23%
		米ドル買/円売 2023年7 月	買建	2,340,000	329,006,419	338,961,260	1.05%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2023年6月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	416,724,380	99.27
内 日本	416,724,380	99.27
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,080,285	0.73
純資産総額	419,804,665	100.00

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

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

(2) 投資資産（2023年6月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	144 5年国債	日本	国債証券	117,000,000	100.27 117,322,430	100.36 117,425,880	0.100000 2025/06/20	27.97
2	142 5年国債	日本	国債証券	79,000,000	100.20 79,165,310	100.30 79,243,320	0.100000 2024/12/20	18.88
3	335 10年国債	日本	国債証券	62,000,000	100.90 62,560,120	100.75 62,468,100	0.500000 2024/09/20	14.88
4	148 5年国債	日本	国債証券	48,000,000	100.17 48,081,980	100.22 48,106,560	0.005000 2026/06/20	11.46
5	342 10年国債	日本	国債証券	43,000,000	100.29 43,126,760	100.48 43,210,270	0.100000 2026/03/20	10.29
6	146 5年国債	日本	国債証券	42,000,000	100.18 42,078,660	100.45 42,191,940	0.100000 2025/12/20	10.05
7	143 5年国債	日本	国債証券	11,000,000	100.25 11,028,510	100.32 11,035,750	0.100000 2025/03/20	2.63
8	145 5年国債	日本	国債証券	7,000,000	100.34 7,024,080	100.41 7,028,700	0.100000 2025/09/20	1.67
9	147 5年国債	日本	国債証券	6,000,000	100.17 6,010,620	100.23 6,013,860	0.005000 2026/03/20	1.43

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	99.27%
合計	99.27%

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2023年6月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	260,482,886,369	97.53
内 ユーロ	87,622,781,660	32.81
内 中国	13,408,254,149	5.02
内 シンガポール	1,073,582,919	0.40
内 マレーシア	1,363,967,310	0.51
内 イスラエル	691,159,306	0.26
内 ノルウェー	403,094,391	0.15
内 スウェーデン	504,409,460	0.19
内 デンマーク	803,361,785	0.30
内 イギリス	12,372,624,765	4.63
内 ポーランド	1,263,219,205	0.47
内 カナダ	5,002,110,638	1.87
内 アメリカ	129,193,006,523	48.37
内 メキシコ	2,305,233,676	0.86
内 オーストラリア	3,973,584,825	1.49
内 ニューージーランド	502,495,757	0.19
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	6,609,514,587	2.47

純資産総額	267,092,400,956	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)	2,387,217,138	0.89
内 日本	2,387,217,138	0.89
為替予約取引(売建)	46,382,700	0.02
内 日本	46,382,700	0.02

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

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

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

(2) 投資資産（2023年6月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,400,000	85.43 1,288,240,789	85.46 1,288,738,395	1.875000 2032/02/15	0.48
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	82.21 1,275,462,241	82.11 1,273,895,334	1.125000 2031/02/15	0.48
3	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	92.61 1,275,654,642	91.45 1,259,650,646	2.750000 2032/08/15	0.47
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,300,000	92.98 1,253,802,764	92.51 1,247,451,767	2.875000 2032/05/15	0.47
5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	81.65 1,219,448,254	81.92 1,223,405,756	1.250000 2031/08/15	0.46
6	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	81.92 1,187,885,897	82.28 1,193,050,215	1.375000 2031/11/15	0.45
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	80.69 1,146,653,704	80.79 1,148,031,979	0.875000 2030/11/15	0.43
8	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	98.67 1,144,591,645	97.17 1,127,198,656	3.500000 2033/02/15	0.42
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,700,000	84.81 1,069,829,593	84.86 1,070,498,142	1.625000 2031/05/15	0.40
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	91.87 1,029,610,327	92.25 1,033,812,681	1.625000 2026/05/15	0.39

11	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,500,000	92.85 1,009,771,980	94.21 1,024,463,092	0.375000 2024/09/15	0.38
12	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,700,000	102.85 999,197,784	101.95 990,405,086	4.125000 2032/11/15	0.37
13	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,899,000	102.76 955,416,008	99.32 923,425,637	2.750000 2027/10/25	0.35
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	79.30 919,816,560	79.56 922,901,947	0.625000 2030/08/15	0.35
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	94.46 917,615,611	94.17 914,847,027	2.875000 2028/08/15	0.34
16	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	89.29 906,291,892	89.91 912,584,458	1.125000 2026/10/31	0.34
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	94.65 892,033,576	94.33 889,027,208	2.875000 2028/05/15	0.33
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	92.84 888,446,233	92.60 886,149,592	2.625000 2029/02/15	0.33
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	85.09 863,654,683	85.75 870,312,624	0.750000 2028/01/31	0.33
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,350,000	94.24 867,673,371	93.95 865,049,414	2.750000 2028/02/15	0.32
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,400,000	93.27 865,513,745	93.13 864,205,355	2.375000 2027/05/15	0.32
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,162,000	96.29 860,300,055	96.72 864,141,797	2.375000 2024/08/15	0.32
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	90.33 851,348,657	91.32 860,688,188	0.250000 2025/06/30	0.32
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	90.21 850,246,008	90.57 853,638,774	1.500000 2027/01/31	0.32
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,921,000	95.78 822,334,953	96.02 824,343,810	2.250000 2024/11/15	0.31
26	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	93.37 812,271,677	93.05 809,513,967	2.750000 2029/05/31	0.30
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	94.50 800,170,812	94.50 800,196,214	2.250000 2025/11/15	0.30
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	94.82 795,765,018	94.96 796,973,469	2.125000 2025/05/15	0.30
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	94.92 790,452,490	95.17 792,534,184	2.000000 2025/02/15	0.30
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,900,000	92.58 792,010,049	92.44 790,778,214	2.250000 2027/08/15	0.30

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.53%
合計	97.53%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2023年7月	買建	201,000	36,327,429	36,752,153	0.01%
		オフショア人民元買/円売 2023年7月	買建	70,000,000	1,381,694,290	1,395,377,400	0.52%
		メキシコ・ペソ買/円売 2023年7月	買建	25,235,000	195,982,580	213,192,850	0.08%
		ユーロ買/円売 2023年7月	買建	1,729,000	270,123,582	272,361,024	0.10%
		シンガポール・ドル買/円売 2023年7月	買建	264,000	27,108,708	28,211,198	0.01%
		米ドル買/円売 2023年7月	買建	3,046,000	435,061,859	441,322,513	0.17%
		マレーシア・リングgit売/円買 2023年7月	売建	1,500,000	46,410,000	46,382,700	0.02%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

●DCダイワ・ターゲットイヤー 2040

2023年6月30日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	22,108円
純資産総額	3.5億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	4.8%
3カ月間	9.5%
6カ月間	13.6%
1年間	12.3%
3年間	41.5%
5年間	42.3%
設定来	121.1%

※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4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期	第12期	第13期	第14期	第15期
	11年12月	12年12月	13年12月	14年12月	15年12月	16年12月	17年12月	18年12月	19年12月	20年12月	21年12月	22年12月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
国内株式・先物	2,146	32.1%	日本円	59.3%	直接利回り(%)	トヨタ自動車	日本	1.2%	
国内債券	9	20.1%	米ドル	26.4%	最終利回り(%)	TOPIX先物 0509月	日本	1.1%	
外国株式・先物	1,221	17.1%	ユーロ	7.3%	修正デュレーション	APPLE INC	アメリカ	0.9%	
外国債券	960	15.6%	英ポンド	1.8%	残存年数	ソニーグループ	日本	0.9%	
外国リート・先物	327	7.4%	豪ドル	1.1%	債券格付別構成	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.7%	
国内リート・先物	61	6.8%	カナダドル	1.1%	AAA	90.4%	PROLOGIS INC	アメリカ	0.6%
外国投資信託等	8	0.1%	オフショア人民元	0.9%	AA	5.6%	EQUINIX INC	アメリカ	0.4%
			スイス・フラン	0.5%	A	3.9%	日本ビルファンド	日本	0.4%
			シンガポール・ドル	0.4%	BBB	-	ジャパンリアルエステイト	日本	0.4%
			その他	1.2%	BB	-	野村不動産マスターF	日本	0.3%
コール・ローン、その他	3.1%								
合計	4,732	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	7.0%	

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

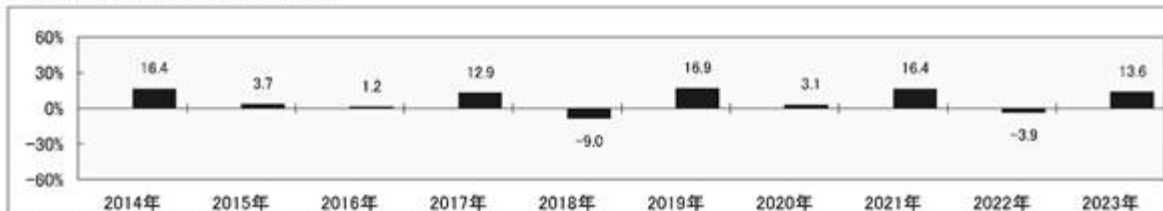
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2023年は6月30日までの騰落率を表示しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

---(参考情報) ファンドの総経費率---

	総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	0.41%	0.40%	0.02%

※対象期間は2021年12月21日～2022年12月19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口当たり)を乗じた数で除した値(年率)です。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受け付けを中止することができます。

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

2【換金（解約）手続等】

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。

<一部解約>

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ

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

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

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・ マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

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

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

(5)【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、信託期間中において信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したとき、あるいは、第34計算期間以降に受益権の口数が5億口を下ることとなった場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2.の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 前2.から前4.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2.から前4.までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
6. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。

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

信託約款の変更等

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

反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書(投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告

書)を計算期間の末日および償還時に作成し、信託財産にかかる知れている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。

2. 委託会社は、運用報告書(全体版)(投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書)を作成し、委託会社のホームページに掲載します。

・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書(全体版)の交付の請求があった場合には、これを交付します。

公告

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

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

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

関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

<収益分配金にかかる請求権>

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

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

<償還金にかかる請求権>

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

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

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

<換金請求権>

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

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間（2021年12月21日から2022年12月19日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

DCダイワ・ターゲットイヤー2040

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 2021年12月20日現在	第15期 2022年12月19日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	904,299	1,120,805
親投資信託受益証券	238,371,745	290,343,432
未収入金	16,000	357,000
流動資産合計	239,292,044	291,821,237
資産合計	239,292,044	291,821,237
負債の部		
流動負債		
未払解約金	21,336	335,238
未払受託者報酬	34,997	45,979
未払委託者報酬	385,461	506,255
その他未払費用	8,668	11,413
流動負債合計	450,462	898,885
負債合計	450,462	898,885
純資産の部		
元本等		
元本	1,120,843,564	1,146,424,862
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	117,998,018	144,497,490
（分配準備積立金）	28,159,838	22,413,661
元本等合計	238,841,582	290,922,352
純資産合計	238,841,582	290,922,352
負債純資産合計	239,292,044	291,821,237

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第14期		第15期	
	自	2020年12月19日 至 2021年12月20日	自	2021年12月21日 至 2022年12月19日
営業収益				
有価証券売買等損益		20,631,910		1,211,687
営業収益合計		20,631,910		1,211,687
営業費用				
支払利息		32		145
受託者報酬		58,753		86,113
委託者報酬		647,226		948,245
その他費用		14,533		21,372
営業費用合計		720,544		1,055,875
営業利益		19,911,366		155,812
経常利益		19,911,366		155,812
当期純利益		19,911,366		155,812
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()		2,297,833		372,333
期首剰余金又は期首欠損金()		50,410,207		117,998,018
剰余金増加額又は欠損金減少額		64,483,446		56,772,879
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		64,483,446		56,772,879
剰余金減少額又は欠損金増加額		14,509,168		30,801,552
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		14,509,168		30,801,552
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		117,998,018		144,497,490

(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15期	
	自 2021年12月21日	至 2022年12月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2021年12月18日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2021年12月20日としており、2022年12月18日が休日のため、当計算期間末日を2022年12月19日としております。このため、当計算期間は364日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第14期	第15期
	2021年12月20日現在	2022年12月19日現在
1. 1 期首元本額	69,129,056円	120,843,564円
期中追加設定元本額	70,739,694円	57,094,084円
期中一部解約元本額	19,025,186円	31,512,786円
2. 計算期間末日における受益権の総数	120,843,564口	146,424,862口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第14期	第15期
	自 2020年12月19日 至 2021年12月20日	自 2021年12月21日 至 2022年12月19日

1 分配金の計算過程	<p>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（17,613,551円）、投資信託約款に規定される収益調整金（95,526,314円）及び分配準備積立金（10,546,287円）より分配可能額は123,686,152円（1万口当たり10,235.23円）であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益であり、分配を行っておりません。</p>	<p>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（528,259円）、投資信託約款に規定される収益調整金（127,983,827円）及び分配準備積立金（21,885,402円）より分配可能額は150,397,488円（1万口当たり10,271.31円）であります。なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益であり、分配を行っておりません。</p>
------------	--	--

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	第15期 自 2021年12月21日 至 2022年12月19日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	---

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第15期 2022年12月19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
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14期 2021年12月20日現在	第15期 2022年12月19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	18,335,637	1,291,910
合計	18,335,637	1,291,910

(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14期 2021年12月20日現在	第15期 2022年12月19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15期 自 2021年12月21日 至 2022年12月19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14期 2021年12月20日現在	第15期 2022年12月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9765円 (19,765円)	1.9868円 (19,868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	70,612,808	95,637,987	
	外国株式インデックスマザーファンド	12,252,667	50,786,079	
	外国債券インデックスマザーファンド	14,065,842	44,152,678	
	ダイワJ - R E I Tマザーファンド	6,178,591	20,600,658	
	ダイワ・グローバルR E I Tインデッ クス・マザーファンド	6,626,997	19,932,018	
	ダイワ短期日本債券インデックスマ ザーファンド	56,797,404	59,234,012	
親投資信託受益証券 合計			290,343,432	
合計			290,343,432	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワJ - R E I Tマザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンド」受益証券、「ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド」受益証券及び「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

		2021年12月20日現在	2022年12月19日現在
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		7,179,034,125	10,825,381,928
株式	2 3	182,600,770,840	197,542,891,460
派生商品評価勘定		-	275,600
未収配当金		14,675,780	21,088,470
未収利息		256,140	423,892
前払金		3,040,000	7,400,000
その他未収収益	4	3,225,355	3,908,422
流動資産合計		189,801,002,240	208,401,369,772
資産合計		189,801,002,240	208,401,369,772
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		51,781,600	22,884,700
未払金		1,884,400	-
未払解約金		335,456,741	37,423,620
受入担保金		4,575,987,570	7,604,153,067
流動負債合計		4,965,110,311	7,664,461,387
負債合計		4,965,110,311	7,664,461,387
純資産の部			
元本等			
元本	1	139,719,409,192	148,213,575,565
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		45,116,482,737	52,523,332,820
元本等合計		184,835,891,929	200,736,908,385
純資産合計		184,835,891,929	200,736,908,385
負債純資産合計		189,801,002,240	208,401,369,772

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年12月21日 至 2022年12月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年12月20日現在	2022年12月19日現在
1. 1 期首	2020年12月19日	2021年12月21日
期首元本額	133,497,261,446円	139,719,409,192円
期中追加設定元本額	22,185,108,638円	21,664,467,396円
期中一部解約元本額	15,962,960,892円	13,170,301,023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	2,978,638,277円	2,874,974,472円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	5,607,664,681円	4,748,856,911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	923,930円	917,439円

ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	24,862,174円	22,001,280円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	393,869,554円	268,786,587円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	21,795,176円	20,586,631円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	711,960,045円	565,944,626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)	258,479,084円	473,487,596円
D-I's TOPIXイン デックス	45,380,499円	29,456,553円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	156,996,161円	224,512,137円
iFree TOPIXイン デックス	4,963,260,757円	6,338,589,470円
iFree 8資産バランス	3,417,146,307円	4,293,637,156円
iFree 年金バランス	555,794,606円	796,167,702円
DCダイワ日本株式インデッ クス	66,550,525,465円	69,222,715,190円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	3,090,855,667円	3,294,383,038円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	4,277,017,878円	4,747,389,276円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	4,166,224,676円	4,674,145,045円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	6,020,536,360円	6,699,274,926円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	57,114,876円	57,539,012円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	60,560,892円	70,612,808円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	1,584,089,956円	2,769,204,947円
ダイワつみたてインデックス バランス30	10,529,649円	11,751,428円

ダイワつみたてインデックス バランス50	10,044,699円	10,389,851円
ダイワつみたてインデックス バランス70	19,885,938円	26,305,509円
ダイワ国内株式インデックス (ラップ専用)	721,017円	2,226,064,649円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	112,385,430円	77,693,100円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	130,510,052円	34,559,946円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	5,933,455,693円	5,037,989,016円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	526,703,681円	454,758,876円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	75,481,125円	62,260,889円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	141,439,467円	104,389,988円
ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	200,986,677円	201,590,167円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	10,254,224,365円	11,564,090,549円
ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	1,693,854,823円	2,005,467,634円
ダイワファンドラップオンラ インTOPPIXインデック ス	2,722,760,705円	3,201,715,760円
ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,175,396,118円	1,200,348,955円
ダイワライフスタイル25	151,975,951円	132,554,281円
ダイワライフスタイル50	602,441,788円	550,577,889円
ダイワライフスタイル75	481,386,482円	419,565,009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)	10,531,528,511円	8,698,319,267円
計	139,719,409,192円	148,213,575,565円
2. 期末日における受益権の総数	139,719,409,192口	148,213,575,565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 4,212,804,300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 7,162,022,940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 957,120,000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 884,260,000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2,813,260円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3,368,060円が含まれております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年12月21日 至 2022年12月19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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所(外国の取引所)における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年12月19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	2021年12月20日現在	2022年12月19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	11,214,867,666	947,914,652
合計	11,214,867,666	947,914,652

（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（2021年9月22日から2021年12月20日まで、及び2022年9月21日から2022年12月19日まで）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	2021年12月20日 現在				2022年12月19日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	2,223,960,000	-	2,172,240,000	51,720,000	3,155,600,000	-	3,133,080,000	22,520,000

合計	2,223,960,000	-	2,172,240,000	51,720,000	3,155,600,000	-	3,133,080,000	22,520,000
----	---------------	---	---------------	------------	---------------	---	---------------	------------

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2021年12月20日現在	2022年12月19日現在
1口当たり純資産額	1.3229円	1.3544円
(1万口当たり純資産額)	(13,229円)	(13,544円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	3,800	3,700.00	14,060,000	
ニッスイ	99,300	530.00	52,629,000	
マルハニチロ	15,300	2,410.00	36,873,000	
雪国まいたけ	8,500	995.00	8,457,500	
カネコ種苗	3,300	1,436.00	4,738,800	
サカタのタネ	12,600	4,450.00	56,070,000	貸付株式数 4,400株
ホクト	8,800	1,872.00	16,473,600	
ホクリヨウ	1,300	681.00	885,300	貸付株式数 400株
ショーボンドHD	13,400	5,770.00	77,318,000	
ミライト・ワン	34,000	1,520.00	51,680,000	
タマホーム	7,000	2,553.00	17,871,000	貸付株式数 2,600株
サンヨーホームズ	1,200	705.00	846,000	貸付株式数 400株
日本アクア	4,100	889.00	3,644,900	貸付株式数 1,500株
ファーストコーポレーション	2,400	711.00	1,706,400	貸付株式数 800株
ベステラ	2,100	916.00	1,923,600	貸付株式数 800株
キャンディル	2,100	497.00	1,043,700	貸付株式数 800株
住石ホールディングス	15,300	403.00	6,165,900	貸付株式数 7,100株
日鉄鉱業	4,000	3,030.00	12,120,000	

三井松島HLDGS	4,500	3,070.00	13,815,000	貸付株式数	1,700株
INPEX	367,300	1,426.00	523,769,800	貸付株式数	146,700株
石油資源開発	11,500	3,910.00	44,965,000		
K&Oエナジーグループ	4,400	2,131.00	9,376,400		
ダイセキ環境ソリューション	2,000	816.00	1,632,000	貸付株式数	700株
第一カッター興業	2,500	1,052.00	2,630,000		
明豊ファシリティワークス	3,600	707.00	2,545,200	貸付株式数	1,200株
安藤・間	57,300	834.00	47,788,200		
東急建設	27,900	645.00	17,995,500		
コムシスホールディングス	33,600	2,408.00	80,908,800		
ビーアールホールディングス	16,100	332.00	5,345,200	貸付株式数	4,900株
高松コンストラクションGP	6,400	1,899.00	12,153,600		
東建コーポレーション	3,200	7,490.00	23,968,000		
ソネック	1,100	954.00	1,049,400	貸付株式数	400株 (100株)
ヤマウラ	4,900	1,009.00	4,944,100	貸付株式数	700株
オリエンタル白石	35,300	282.00	9,954,600		
大成建設	69,000	4,205.00	290,145,000		
大林組	248,100	1,007.00	249,836,700		
清水建設	208,700	718.00	149,846,600		
飛島建設	8,100	1,006.00	8,148,600		
長谷工コーポレーション	71,600	1,508.00	107,972,800		
松井建設	6,400	566.00	3,622,400	貸付株式数	400株
銭高組	900	2,618.00	2,356,200	貸付株式数	300株
鹿島建設	153,900	1,506.00	231,773,400		
不動テトラ	5,100	1,471.00	7,502,100		
大末建設	2,500	1,170.00	2,925,000	貸付株式数	900株
鉄建建設	5,300	1,769.00	9,375,700		
西松建設	11,700	3,950.00	46,215,000	貸付株式数	5,800株
三井住友建設	55,500	418.00	23,199,000	貸付株式数	400株
大豊建設	2,900	3,980.00	11,542,000		
佐田建設	4,600	455.00	2,093,000	貸付株式数	1,200株
ナカノフドー建設	4,800	318.00	1,526,400	貸付株式数	1,500株
奥村組	11,100	2,946.00	32,700,600		
東鉄工業	9,500	2,596.00	24,662,000		
イチケン	1,600	1,771.00	2,833,600		

富士ピー・エス	3,500	439.00	1,536,500	貸付株式数 1,400株 (200株)
浅沼組	5,500	2,963.00	16,296,500	
戸田建設	85,300	721.00	61,501,300	
熊谷組	12,000	2,577.00	30,924,000	
北野建設	1,300	2,467.00	3,207,100	
植木組	2,100	1,317.00	2,765,700	貸付株式数 700株
矢作建設	9,300	766.00	7,123,800	
ピーエス三菱	9,400	607.00	5,705,800	
日本ハウスHLDGS	13,500	377.00	5,089,500	貸付株式数 100株
大東建託	25,500	14,120.00	360,060,000	
新日本建設	9,500	737.00	7,001,500	
東亜道路	1,400	5,900.00	8,260,000	
日本道路	1,400	5,950.00	8,330,000	
東亜建設	5,900	2,286.00	13,487,400	
日本国土開発	20,600	568.00	11,700,800	
若築建設	3,100	2,891.00	8,962,100	
東洋建設	22,300	838.00	18,687,400	
五洋建設	97,800	632.00	61,809,600	貸付株式数 700株
世紀東急	9,500	770.00	7,315,000	
福田組	2,600	4,645.00	12,077,000	貸付株式数 1,000株
日本ドライケミカル	1,600	1,506.00	2,409,600	貸付株式数 600株
住友林業	53,300	2,431.00	129,572,300	
日本基礎技術	4,400	486.00	2,138,400	
巴コーポレーション	7,900	395.00	3,120,500	貸付株式数 300株
大和ハウス	194,000	3,163.00	613,622,000	
ライト工業	13,200	1,938.00	25,581,600	
積水ハウス	217,500	2,413.00	524,827,500	
日特建設	7,100	908.00	6,446,800	
北陸電気工事	5,100	662.00	3,376,200	
ユアテック	15,900	720.00	11,448,000	
日本リーテック	4,700	788.00	3,703,600	
四電工	3,000	1,710.00	5,130,000	
中電工	11,100	2,060.00	22,866,000	
関電工	38,300	866.00	33,167,800	
きんでん	48,700	1,439.00	70,079,300	
東京エネシス	6,800	913.00	6,208,400	
トーエネック	2,400	3,415.00	8,196,000	貸付株式数 100株
住友電設	6,700	2,385.00	15,979,500	
日本電設工業	11,500	1,582.00	18,193,000	

エクシオグループ	33,600	2,174.00	73,046,400	
新日本空調	3,800	1,861.00	7,071,800	貸付株式数 1,100株
日本工営	5,200	3,315.00	17,238,000	
九電工	16,800	3,195.00	53,676,000	
三機工業	15,500	1,561.00	24,195,500	
日揮ホールディングス	68,700	1,757.00	120,705,900	
中外炉工業	2,200	1,628.00	3,581,600	
ヤマト	5,900	691.00	4,076,900	
太平電業	4,300	3,155.00	13,566,500	
高砂熱学	16,700	1,771.00	29,575,700	
三晃金属	1,000	2,996.00	2,996,000	
NEC ネットエスアイ	23,700	1,640.00	38,868,000	
朝日工業社	2,900	2,113.00	6,127,700	
明星工業	12,300	750.00	9,225,000	
大気社	8,400	3,470.00	29,148,000	
ダイダン	4,800	2,167.00	10,401,600	
日比谷総合設備	6,000	1,892.00	11,352,000	
ニッポン	18,800	1,596.00	30,004,800	
日清製粉G本社	64,600	1,529.00	98,773,400	
日東富士製粉	1,200	4,360.00	5,232,000	
昭和産業	6,100	2,432.00	14,835,200	
鳥越製粉	5,600	631.00	3,533,600	貸付株式数 1,100株
中部飼料	9,500	1,028.00	9,766,000	貸付株式数 3,100株
フィード・ワン	10,100	672.00	6,787,200	
東洋精糖	1,300	851.00	1,106,300	
日本甜菜糖	4,100	1,624.00	6,658,400	
DM三井製糖ホールディ	6,800	1,998.00	13,586,400	貸付株式数 100株
塩水港精糖	8,500	195.00	1,657,500	貸付株式数 2,800株
日新製糖	3,500	1,876.00	6,566,000	貸付株式数 1,400株
LIFULL	24,700	230.00	5,681,000	
MIXI	16,500	2,420.00	39,930,000	貸付株式数 100株
ジェイエイシーリクルー メント	6,600	2,553.00	16,849,800	
日本M&Aセンターホル デ	124,800	1,690.00	210,912,000	
メンバーズ	2,100	2,044.00	4,292,400	貸付株式数 800株
中広	1,100	381.00	419,100	貸付株式数 400株
UTグループ	10,700	2,333.00	24,963,100	
アイティメディア	2,800	1,696.00	4,748,800	貸付株式数 1,300株
E・Jホールディングス	4,600	1,306.00	6,007,600	貸付株式数 1,800株

夢真ビーネックスグループ	26,600	1,811.00	48,172,600		
コシダカホールディングス	21,800	1,072.00	23,369,600	貸付株式数	8,500株
アルトナー	1,700	1,002.00	1,703,400		
パソナグループ	8,800	1,938.00	17,054,400		
C D S	1,800	1,810.00	3,258,000		
リンクアンドモチベーション	21,000	670.00	14,070,000	貸付株式数	8,200株
エス・エム・エス	27,700	3,395.00	94,041,500		
サニーサイドアップG	2,500	583.00	1,457,500	貸付株式数	800株
パーソルホールディングス	81,500	3,005.00	244,907,500		
リニカル	4,100	692.00	2,837,200	貸付株式数	1,600株
クックパッド	19,600	198.00	3,880,800	貸付株式数	7,300株
エスクリ	2,900	315.00	913,500	貸付株式数	1,300株
アイ・ケイ・ケイホールディング	3,500	627.00	2,194,500	貸付株式数	1,400株
森永製菓	14,400	3,860.00	55,584,000		
中村屋	1,700	3,100.00	5,270,000	貸付株式数	600株
江崎グリコ	20,000	3,670.00	73,400,000		
名糖産業	2,700	1,612.00	4,352,400	貸付株式数	1,200株
井村屋グループ	3,800	2,252.00	8,557,600		
不二家	4,800	2,590.00	12,432,000	貸付株式数	1,800株
山崎製パン	46,600	1,596.00	74,373,600		
第一屋製パン	1,300	396.00	514,800	貸付株式数	300株
モロゾフ	2,200	3,535.00	7,777,000		
亀田製菓	4,400	4,410.00	19,404,000		
寿スピリッツ	7,400	7,550.00	55,870,000	貸付株式数	2,600株
カルビー	31,900	3,035.00	96,816,500		
森永乳業	12,700	4,720.00	59,944,000		
六甲バター	5,000	1,351.00	6,755,000	貸付株式数	2,000株
ヤクルト	49,800	8,730.00	434,754,000		
明治ホールディングス	43,200	6,660.00	287,712,000		
雪印メグミルク	16,800	1,749.00	29,383,200		
プリマハム	9,300	2,095.00	19,483,500		
日本ハム	27,300	3,665.00	100,054,500		
林兼産業	2,200	443.00	974,600		
丸大食品	6,900	1,416.00	9,770,400	貸付株式数	2,300株
S Foods	7,700	2,931.00	22,568,700	貸付株式数	2,400株
柿安本店	2,700	2,132.00	5,756,400	貸付株式数	300株
伊藤ハム米久HLDGS	54,000	686.00	37,044,000		
学情	3,300	1,453.00	4,794,900	貸付株式数	1,100株

スタジオアリス	3,700	2,051.00	7,588,700	貸付株式数 1,400株 (100株)
クロスキャット	4,000	1,459.00	5,836,000	貸付株式数 1,200株
シミックホールディングス	4,000	1,690.00	6,760,000	貸付株式数 1,500株
エプコ	1,400	735.00	1,029,000	貸付株式数 600株
システナ	119,600	418.00	49,992,800	
N J S	1,600	2,043.00	3,268,800	
デジタルアーツ	4,500	5,960.00	26,820,000	
日鉄ソリューションズ	12,100	3,255.00	39,385,500	
総合警備保障	27,000	3,500.00	94,500,000	
キューブシステム	4,100	1,084.00	4,444,400	貸付株式数 1,500株 (200株)
いちご	80,100	302.00	24,190,200	
日本駐車場開発	83,100	291.00	24,182,100	貸付株式数 29,400株
コア	3,100	1,448.00	4,488,800	貸付株式数 600株
カカクコム	54,400	2,108.00	114,675,200	
アイロムグループ	2,600	2,487.00	6,466,200	
セントケア・ホールディング グ	4,700	842.00	3,957,400	
サイネックス	1,600	550.00	880,000	貸付株式数 400株
ルネサンス	5,100	876.00	4,467,600	貸付株式数 2,000株
ディップ	12,700	3,905.00	49,593,500	貸付株式数 4,000株
S B Sホールディングス	6,300	2,915.00	18,364,500	貸付株式数 700株
デジタルホールディングス	5,600	1,218.00	6,820,800	貸付株式数 1,600株
新日本科学	7,700	2,319.00	17,856,300	貸付株式数 3,000株
キャリアデザインセンター	1,500	1,592.00	2,388,000	
ベネフィット・ワン	33,700	2,033.00	68,512,100	貸付株式数 5,400株
エムスリー	143,800	3,829.00	550,610,200	
ツカダ・グローバルH O L D	4,500	367.00	1,651,500	貸付株式数 600株
プラス	1,000	1,090.00	1,090,000	貸付株式数 300株
アウトソーシング	43,400	983.00	42,662,200	
ウェルネット	6,300	624.00	3,931,200	貸付株式数 2,500株
ワールドホールディングス	3,300	2,798.00	9,233,400	貸付株式数 400株
ディー・エヌ・エー	31,000	1,796.00	55,676,000	
博報堂D Y H L D G S	92,800	1,304.00	121,011,200	
ぐるなび	13,300	403.00	5,359,900	
タカミヤ	9,700	376.00	3,647,200	
ジャパンベストレスキュー S	4,500	854.00	3,843,000	

ファンコミュニケーションズ	14,000	431.00	6,034,000	
ライク	2,700	1,995.00	5,386,500	
ビジネス・ブレークスルー	2,500	382.00	955,000	貸付株式数 1,000株
エスプール	20,900	923.00	19,290,700	
WDBホールディングス	3,700	2,145.00	7,936,500	
手間いらず	1,200	4,995.00	5,994,000	
ティア	4,100	421.00	1,726,100	貸付株式数 300株
CDG	700	1,101.00	770,700	貸付株式数 200株
アドウェイズ	10,000	509.00	5,090,000	貸付株式数 4,300株
バリューコマース	5,500	1,900.00	10,450,000	
インフォマート	75,600	414.00	31,298,400	
サッポロホールディングス	22,900	3,485.00	79,806,500	
アサヒグループホールディングン	161,100	4,241.00	683,225,100	貸付株式数 63,600株
麒麟HD	314,500	2,089.00	656,990,500	
宝ホールディングス	47,500	1,080.00	51,300,000	
オエノンホールディングス	20,600	277.00	5,706,200	貸付株式数 8,200株
養命酒	2,300	1,807.00	4,156,100	
コカ・コーラボトラーズJHD	54,400	1,453.00	79,043,200	
サントリー食品インター	49,100	4,600.00	225,860,000	
ダイドーグループHD	3,900	4,885.00	19,051,500	貸付株式数 1,500株
伊藤園	26,000	4,985.00	129,610,000	
キーコーヒー	7,900	2,077.00	16,408,300	
ユニカフェ	2,300	982.00	2,258,600	貸付株式数 900株
ジャパンフーズ	1,000	1,092.00	1,092,000	貸付株式数 400株
日清オイリオグループ	9,700	3,215.00	31,185,500	
不二製油グループ	16,300	2,055.00	33,496,500	貸付株式数 100株
かどや製油	800	3,515.00	2,812,000	貸付株式数 100株
J-オイルミルズ	7,100	1,508.00	10,706,800	
ローソン	18,600	4,890.00	90,954,000	
サンエー	5,700	4,290.00	24,453,000	
カワチ薬品	5,800	2,172.00	12,597,600	貸付株式数 300株
エービーシー・マート	10,900	7,140.00	77,826,000	
ハードオフコーポレーション	3,000	1,385.00	4,155,000	
高千穂交易	2,600	2,167.00	5,634,200	貸付株式数 1,000株
アスクル	18,100	1,618.00	29,285,800	貸付株式数 4,200株
ゲオホールディングス	7,900	1,984.00	15,673,600	

アダストリア	9,000	1,960.00	17,640,000	貸付株式数	3,600株
ジーフット	3,700	292.00	1,080,400	貸付株式数	1,800株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,000	402.00	402,000	貸付株式数	300株
オルバヘルスケアHLDGS	1,500	1,566.00	2,349,000	貸付株式数	300株
伊藤忠食品	1,700	4,930.00	8,381,000		
くら寿司	8,800	3,170.00	27,896,000	貸付株式数	3,400株
キャンドウ	2,700	2,189.00	5,910,300	貸付株式数	1,200株
エレマテック	6,700	1,547.00	10,364,900		
IKホールディングス	2,300	411.00	945,300	貸付株式数	800株
パルグループHLDGS	7,300	2,278.00	16,629,400		
エディオン	29,500	1,264.00	37,288,000	貸付株式数	14,000株 (300株)
あらた	5,700	4,015.00	22,885,500	貸付株式数	1,900株
サーラコーポレーション	15,600	708.00	11,044,800	貸付株式数	6,200株
ワッツ	3,500	702.00	2,457,000	貸付株式数	1,400株
トーメンデバイス	1,100	5,590.00	6,149,000		
ハローズ	3,400	2,903.00	9,870,200	貸付株式数	1,300株
JPホールディングス	21,100	291.00	6,140,100	貸付株式数	1,200株
フジオフードG本社	6,200	1,391.00	8,624,200	貸付株式数	2,400株 (100株)
あみやき亭	1,800	2,900.00	5,220,000	貸付株式数	600株
東京エレクトロンデバイス	2,800	7,070.00	19,796,000	貸付株式数	200株
ひらまつ	15,900	185.00	2,941,500	貸付株式数	5,000株
円谷フィールズホールディ	6,400	2,544.00	16,281,600	貸付株式数	2,500株
双日	79,500	2,511.00	199,624,500		
アルフレッサホールディングス	74,700	1,665.00	124,375,500		
大黒天物産	2,700	5,220.00	14,094,000	貸付株式数	1,000株 (100株)
ハニーズホールディングス	6,500	1,279.00	8,313,500	貸付株式数	2,100株
ファーマライズHD	1,500	654.00	981,000	貸付株式数	500株
キッコーマン	46,200	7,400.00	341,880,000		
味の素	170,600	4,445.00	758,317,000		
ブルドックソ - ス	2,800	1,750.00	4,900,000	貸付株式数	1,100株
キューピー	37,500	2,429.00	91,087,500		
ハウス食品G本社	21,400	2,759.00	59,042,600		
カゴメ	32,500	3,040.00	98,800,000	貸付株式数	2,700株
焼津水産化工	3,000	840.00	2,520,000	貸付株式数	1,000株

アリアケジャパン	6,100	4,555.00	27,785,500		
ピエトロ	1,000	1,820.00	1,820,000	貸付株式数	400株
エバラ食品工業	1,900	3,035.00	5,766,500	貸付株式数	500株
やまみ	600	1,347.00	808,200		
ニチレイ	31,900	2,763.00	88,139,700		
横浜冷凍	20,200	1,055.00	21,311,000	貸付株式数	200株
東洋水産	35,200	5,370.00	189,024,000		
イトアンドHLDGS	2,900	2,289.00	6,638,100	貸付株式数	1,100株
大冷	900	1,885.00	1,696,500	貸付株式数	300株
ヨシムラ・フード・HLDGS	4,400	580.00	2,552,000	貸付株式数	1,600株
日清食品HD	24,800	10,540.00	261,392,000		
永谷園ホールディングス	3,400	2,010.00	6,834,000		
一正蒲鉾	2,900	722.00	2,093,800	貸付株式数	1,000株
フジッコ	7,100	1,900.00	13,490,000		
ロックフィールド	8,500	1,511.00	12,843,500	貸付株式数	3,200株
日本たばこ産業	458,800	2,825.00	1,296,110,000	貸付株式数	144,800株
ケンコーマヨネーズ	4,700	1,492.00	7,012,400	貸付株式数	1,600株
わらべや日洋HD	5,100	1,884.00	9,608,400		
なとり	4,400	2,043.00	8,989,200	貸付株式数	1,500株
イフジ産業	1,200	973.00	1,167,600	貸付株式数	200株
ファーマフーズ	10,800	1,455.00	15,714,000	貸付株式数	4,200株
北の達人コーポ	29,800	281.00	8,373,800	貸付株式数	11,700株 (2,600株)
ユーグレナ	44,900	1,015.00	45,573,500	貸付株式数	4,700株
紀文食品	5,400	959.00	5,178,600	貸付株式数	2,300株
ピクルスホールディングス	4,100	1,067.00	4,374,700		
スター・マイカ・HLDGS	6,200	706.00	4,377,200		
SREホールディングス	3,400	4,215.00	14,331,000	貸付株式数	1,300株
ADワークスグループ	17,200	154.00	2,648,800	貸付株式数	6,500株 (1,000株)
片倉工業	6,500	1,785.00	11,602,500	貸付株式数	2,600株
グンゼ	5,400	3,995.00	21,573,000	貸付株式数	600株
ヒューリック	162,700	1,130.00	183,851,000		
神栄	1,100	808.00	888,800		
ラサ商事	3,200	1,058.00	3,385,600		
アルペン	6,200	1,994.00	12,362,800	貸付株式数	2,400株
ハブ	2,500	597.00	1,492,500	貸付株式数	900株

ラクーンホールディングス	7,100	1,144.00	8,122,400	貸付株式数	2,700株
クオールホールディングス	10,300	1,165.00	11,999,500	貸付株式数	4,000株
アルコニックス	9,900	1,320.00	13,068,000		
神戸物産	58,000	3,465.00	200,970,000	貸付株式数	22,700株
ソリトンシステムズ	3,600	1,033.00	3,718,800	貸付株式数	1,400株
ジーンズホールディングス	4,500	4,525.00	20,362,500	貸付株式数	100株
ビックカメラ	49,700	1,254.00	62,323,800	貸付株式数	11,000株
D C Mホールディングス	45,600	1,166.00	53,169,600		
ペッパーフードサービス	15,500	169.00	2,619,500	貸付株式数	6,200株
ハイパー	1,400	529.00	740,600	貸付株式数	500株
M o n o t a R O	106,200	1,930.00	204,966,000		
東京一番フーズ	2,000	494.00	988,000	貸付株式数	600株
D Dホールディングス	4,900	662.00	3,243,800	貸付株式数	1,300株
あい ホールディングス	11,900	2,171.00	25,834,900		
ディーブイエックス	2,500	1,014.00	2,535,000	貸付株式数	1,000株
きちりホールディングス	2,100	592.00	1,243,200	貸付株式数	700株
アークランドサービスHD	6,100	2,212.00	13,493,200	貸付株式数	2,400株 (100株)
J . フロント リテイ リング	93,200	1,163.00	108,391,600		
ドトール・日レスHD	13,200	1,710.00	22,572,000		
マツキヨココカラ&カン パニー	45,400	6,260.00	284,204,000		
ブロンコビリー	4,000	2,504.00	10,016,000	貸付株式数	1,500株
Z O Z O	49,500	3,255.00	161,122,500		
トレジャー・ファクトリー	2,200	2,495.00	5,489,000	貸付株式数	700株
物語コーポレーション	4,200	6,350.00	26,670,000	貸付株式数	1,600株
三越伊勢丹HD	126,100	1,342.00	169,226,200		
東洋紡	31,100	1,012.00	31,473,200		
ユニチカ	21,800	248.00	5,406,400		
富士紡ホールディングス	2,800	3,445.00	9,646,000		
日清紡ホールディングス	58,100	996.00	57,867,600		
倉敷紡績	5,200	2,185.00	11,362,000		
ダイワボウHD	30,600	1,994.00	61,016,400		
シキボウ	3,700	985.00	3,644,500		
日東紡績	8,400	1,969.00	16,539,600		
トヨタ紡織	29,900	1,806.00	53,999,400		
マクニカホールディングス	18,400	3,470.00	63,848,000		
H a m e e	3,000	721.00	2,163,000	貸付株式数	1,100株

マーケットエンタープライズ	800	999.00	799,200	貸付株式数	300株
ラクト・ジャパン	2,900	2,091.00	6,063,900	貸付株式数	900株 (400株)
ウエルシアHD	38,900	3,065.00	119,228,500		
クリエイトSDH	12,400	3,255.00	40,362,000	貸付株式数	3,700株
グリムス	3,100	1,961.00	6,079,100	貸付株式数	1,300株 (100株)
バイタルKSKHD	11,000	840.00	9,240,000		
八洲電機	5,900	1,021.00	6,023,900	貸付株式数	2,200株 (400株)
メディアスホールディングス	5,100	707.00	3,605,700	貸付株式数	1,700株
レスターホールディングス	7,100	2,093.00	14,860,300		
ジューテックHD	1,800	1,174.00	2,113,200		
丸善CHI HD	9,100	327.00	2,975,700	貸付株式数	3,200株
大光	3,300	670.00	2,211,000	貸付株式数	1,300株 (100株)
OCHIホールディングス	1,700	1,207.00	2,051,900	貸付株式数	700株
TOKAIホールディングス	37,100	857.00	31,794,700		
黒谷	2,000	588.00	1,176,000	貸付株式数	800株
ミサワ	1,400	619.00	866,600	貸付株式数	500株
ティーライフ	1,000	1,317.00	1,317,000	貸付株式数	400株
Cominix	1,000	728.00	728,000	貸付株式数	400株
エー・ピーホールディングス	1,700	458.00	778,600	貸付株式数	500株
三洋貿易	7,600	1,104.00	8,390,400		
チムニー	2,300	1,121.00	2,578,300	貸付株式数	900株
シュッピン	5,600	1,296.00	7,257,600	貸付株式数	2,400株
ビューティガレージ	1,300	3,115.00	4,049,500	貸付株式数	400株
オイシックス・ラ・大地	10,100	1,944.00	19,634,400	貸付株式数	4,100株
ウイン・パートナーズ	6,000	981.00	5,886,000	貸付株式数	2,000株
ネクステージ	17,100	2,656.00	45,417,600	貸付株式数	6,100株
ジョイフル本田	24,000	1,852.00	44,448,000	貸付株式数	7,300株
鳥貴族ホールディングス	2,700	2,154.00	5,815,800	貸付株式数	1,000株
ホットランド	5,600	1,456.00	8,153,600	貸付株式数	2,200株 (2,000株)
すかいらくHD	102,400	1,585.00	162,304,000	貸付株式数	40,200株

S F Pホールディングス	4,100	1,746.00	7,158,600	貸付株式数 (100株)	1,600株
綿半ホールディングス	5,800	1,328.00	7,702,400	貸付株式数	1,600株
日本毛織	20,000	994.00	19,880,000	貸付株式数	8,000株
ダイトウボウ	10,900	85.00	926,500	貸付株式数	5,500株
トーア紡コーポレーション	2,600	359.00	933,400	貸付株式数	900株
ダイドーリミテッド	10,300	248.00	2,554,400	貸付株式数 (1,000株)	4,600株
ヨシックスホールディングス	1,500	2,116.00	3,174,000	貸付株式数	600株
ユナイテッド・スーパー マケ	24,300	1,123.00	27,288,900	貸付株式数	9,300株
三栄建築設計	3,300	1,528.00	5,042,400		
野村不動産HLDGS	43,600	3,105.00	135,378,000		
三重交通グループHD	14,700	485.00	7,129,500	貸付株式数	1,800株
サムティ	11,100	2,267.00	25,163,700	貸付株式数	4,100株
地主	5,300	1,977.00	10,478,100	貸付株式数	2,000株
プレサンスコーポレーショ ン	9,200	1,561.00	14,361,200	貸付株式数	900株
フィル・カンパニー	1,200	992.00	1,190,400		
ハウスコム	1,000	1,081.00	1,081,000	貸付株式数	400株
JPMC	3,400	1,030.00	3,502,000		
サンセイランディック	1,800	850.00	1,530,000	貸付株式数	400株
エストラスト	900	585.00	526,500	貸付株式数	200株
フージャースHD	10,600	760.00	8,056,000		
オープンハウスグループ	25,500	5,440.00	138,720,000		
東急不動産HD	209,800	694.00	145,601,200		
飯田GHD	61,100	2,112.00	129,043,200		
イーランド	1,000	1,568.00	1,568,000	貸付株式数	400株
帝国繊維	8,000	1,643.00	13,144,000	貸付株式数	3,100株
日本コークス工業	63,600	86.00	5,469,600	貸付株式数	23,300株
ゴルフダイジェスト・オン	3,400	1,524.00	5,181,600	貸付株式数	1,500株
ミタチ産業	1,900	1,149.00	2,183,100	貸付株式数	100株
B E E N O S	4,200	2,471.00	10,378,200	貸付株式数	300株
あさひ	6,300	1,364.00	8,593,200	貸付株式数	2,400株
日本調剤	5,100	1,192.00	6,079,200	貸付株式数	2,000株
コスモス薬品	8,500	13,840.00	117,640,000	貸付株式数	3,300株
シップヘルスケアHD	26,700	2,699.00	72,063,300	貸付株式数	9,000株
トーエル	3,200	733.00	2,345,600	貸付株式数	1,300株
ソフトクリエイイトHD	2,900	3,195.00	9,265,500		

セブン&アイ・HLDGS	258,100	5,669.00	1,463,168,900		
クリエイト・レストランツ・ホール	56,400	924.00	52,113,600	貸付株式数	22,100株
明治電機工業	2,600	1,053.00	2,737,800	貸付株式数	600株
ツルハホールディングス	18,300	9,260.00	169,458,000	貸付株式数	7,200株
デリカフーズHLDGS	3,000	475.00	1,425,000	貸付株式数	1,200株
スターティアホールディングス	1,500	1,018.00	1,527,000	貸付株式数	600株
サンマルクホールディングス	6,000	1,690.00	10,140,000		
フェリシモ	1,700	1,015.00	1,725,500	貸付株式数	200株
トリドールホールディングス	18,600	2,720.00	50,592,000	貸付株式数	7,300株
帝人	68,000	1,307.00	88,876,000		
東レ	474,500	755.10	358,294,950		
クラレ	111,700	1,104.00	123,316,800		
旭化成	442,200	981.20	433,886,640		
TOKYO BASE	7,800	276.00	2,152,800	貸付株式数	3,000株
稲葉製作所	4,100	1,383.00	5,670,300	貸付株式数	1,400株
宮地エンジニアリングG	2,100	3,435.00	7,213,500		
トーカロ	20,100	1,200.00	24,120,000		
アルファCO	2,600	933.00	2,425,800	貸付株式数	800株
SUMCO	139,100	1,970.00	274,027,000	貸付株式数	33,200株
川田テクノロジーズ	1,800	3,340.00	6,012,000		
RS TECHNOLOGIES	2,400	8,130.00	19,512,000	貸付株式数	900株
ジェイテックコーポレーション	1,000	3,000.00	3,000,000	貸付株式数	300株
信和	3,900	786.00	3,065,400		
ビーロット	4,700	585.00	2,749,500	貸付株式数	2,000株
ファーストブラザーズ	1,500	868.00	1,302,000	貸付株式数	600株
AND DOホールディングス	4,100	853.00	3,497,300	貸付株式数	1,600株
シーアールイー	3,200	1,237.00	3,958,400	貸付株式数	1,100株
プロパティエージェント	800	1,296.00	1,036,800	貸付株式数	300株
ケイアイスター不動産	3,400	4,830.00	16,422,000	貸付株式数	1,300株
アグレ都市デザイン	1,200	1,584.00	1,900,800	貸付株式数	400株
ジェイ・エス・ビー	1,700	3,985.00	6,774,500		
ロードスターキャピタル	3,000	1,733.00	5,199,000	貸付株式数	1,100株
テンポイノベーション	2,100	992.00	2,083,200	貸付株式数	800株

グローバルリンクマネジメン ト	1,300	1,320.00	1,716,000	貸付株式数	500株
フェイスネットワーク	900	1,344.00	1,209,600	貸付株式数	300株
住江織物	1,200	1,796.00	2,155,200		
日本フェルト	3,700	405.00	1,498,500	貸付株式数	1,700株
イチカワ	700	1,314.00	919,800	貸付株式数	100株
エコナックホールディング ス	12,000	90.00	1,080,000	貸付株式数	1,800株
日東製網	700	1,410.00	987,000	貸付株式数	100株
芦森工業	1,400	1,191.00	1,667,400		
アツギ	3,900	410.00	1,599,000		
ウイルプラスHLDGS	1,300	1,060.00	1,378,000	貸付株式数	500株
JMホールディングス	6,300	1,698.00	10,697,400	貸付株式数	100株
コメダホールディングス	18,300	2,471.00	45,219,300	貸付株式数	5,600株
サツドラホールディングス	3,400	700.00	2,380,000	貸付株式数	1,300株
アレンザホールディングス	5,600	990.00	5,544,000	貸付株式数	2,200株
串カツ田中HLDGS	2,000	1,728.00	3,456,000	貸付株式数	700株
バロックジャパン	4,800	813.00	3,902,400	貸付株式数	2,000株
クスリのアオキHLDGS	7,500	8,290.00	62,175,000	貸付株式数	2,900株
ダイニック	1,600	616.00	985,600	貸付株式数	800株
共和レザー	3,800	502.00	1,907,600	貸付株式数	1,400株
ピーバンドットコム	900	524.00	471,600	貸付株式数	300株
力の源HD	4,200	910.00	3,822,000	貸付株式数	300株
FOOD & LIFE CO MPAN	43,000	2,653.00	114,079,000		
アセンテック	2,400	462.00	1,108,800	貸付株式数	900株
セーレン	13,700	2,553.00	34,976,100	貸付株式数	5,600株
ソトー	2,200	827.00	1,819,400	貸付株式数	1,100株
東海染工	500	1,129.00	564,500		
小松マテーレ	10,400	783.00	8,143,200		
ワコールホールディングス	13,700	2,317.00	31,742,900		
ホギメディカル	9,500	3,450.00	32,775,000		
クラウディアHLDGS	1,600	286.00	457,600	貸付株式数	500株
TSIホールディングス	25,200	439.00	11,062,800		
マツオカコーポレーション	1,800	1,105.00	1,989,000		
ワールド	9,000	1,260.00	11,340,000		
TIS	79,800	3,745.00	298,851,000		
JNSホールディングス	3,000	335.00	1,005,000	貸付株式数	1,400株
グリー	38,100	702.00	26,746,200	貸付株式数	14,900株
GMOペパボ	1,000	1,900.00	1,900,000	貸付株式数	400株

コーエーテクモHD	44,500	2,305.00	102,572,500		
三菱総合研究所	3,500	4,810.00	16,835,000		
ボルテージ	2,100	325.00	682,500	貸付株式数	800株
電算	800	1,603.00	1,282,400	貸付株式数	200株
AGS	2,700	675.00	1,822,500	貸付株式数	1,200株
ファインデックス	5,600	517.00	2,895,200	貸付株式数	2,200株
ブレインパッド	7,100	826.00	5,864,600	貸付株式数	700株
KLab	13,900	424.00	5,893,600	貸付株式数	5,400株
ポールトゥウィンホール ディン	12,200	825.00	10,065,000		
ネクソン	183,400	2,970.00	544,698,000		
アイスタイル	22,700	584.00	13,256,800	貸付株式数	8,900株
エムアップホールディング ス	8,700	1,359.00	11,823,300	貸付株式数	3,400株
エイチーム	5,100	803.00	4,095,300		
エニグモ	9,000	614.00	5,526,000	貸付株式数	2,000株
テクノスジャパン	5,800	482.00	2,795,600	貸付株式数	300株
enish	5,300	393.00	2,082,900	貸付株式数	2,000株
コロプラ	27,400	652.00	17,864,800	貸付株式数	10,100株
オルトプラス	5,400	211.00	1,139,400	貸付株式数	2,100株
ブロードリーフ	41,600	435.00	18,096,000	貸付株式数	2,000株
クロス・マーケティングG	2,900	742.00	2,151,800	貸付株式数	1,100株
デジタルハーツHLDGS	4,400	1,863.00	8,197,200	貸付株式数	100株
システム情報	6,300	872.00	5,493,600	貸付株式数	100株
メディアドゥ	2,900	1,819.00	5,275,100		
じげん	20,800	386.00	8,028,800		
ブイキューブ	8,500	771.00	6,553,500	貸付株式数	3,300株 (100株)
エンカレッジ・テクノロジ	1,300	508.00	660,400	貸付株式数	600株
サイバーリンクス	2,300	975.00	2,242,500	貸付株式数	1,000株
ディー・エル・イー	4,300	350.00	1,505,000		
フィックスターズ	8,000	1,292.00	10,336,000		
CARTA HOLDING GS	3,400	1,610.00	5,474,000	貸付株式数	1,300株
オブティム	5,800	1,102.00	6,391,600	貸付株式数	2,300株 (1,900株)
セレス	2,800	910.00	2,548,000	貸付株式数	1,000株
SHIFT	5,200	26,450.00	137,540,000	貸付株式数	2,000株
特種東海製紙	3,400	2,801.00	9,523,400	貸付株式数	1,300株
ティーガイア	7,400	1,650.00	12,210,000	貸付株式数	2,200株

セック	1,000	2,838.00	2,838,000	貸付株式数	100株
テクマトリックス	13,000	1,737.00	22,581,000		
プロシップ	3,100	1,530.00	4,743,000	貸付株式数	800株
ガンホー・オンライン・エンター	21,700	2,125.00	46,112,500	貸付株式数	7,300株
GMOペイメントゲートウェイ	16,200	11,900.00	192,780,000		
ザッパラス	2,500	363.00	907,500	貸付株式数	900株
システムリサーチ	2,200	2,138.00	4,703,600	貸付株式数	300株
インターネットイニシアティブ	39,600	2,524.00	99,950,400		
さくらインターネット	8,000	509.00	4,072,000	貸付株式数	3,100株
ヴィンクス	2,100	1,582.00	3,322,200		
GMOグローバルサインHD	2,200	3,910.00	8,602,000	貸付株式数	800株
SRAホールディングス	3,600	3,040.00	10,944,000		
システムインテグレータ	2,100	450.00	945,000	貸付株式数	900株
朝日ネット	7,500	568.00	4,260,000		
eBASE	10,000	583.00	5,830,000	貸付株式数	300株
アバントグループ	9,000	1,424.00	12,816,000	貸付株式数	3,300株
アドソル日進	2,900	1,432.00	4,152,800	貸付株式数	1,100株
ODKソリューションズ	1,500	616.00	924,000	貸付株式数	600株
フリービット	4,300	1,005.00	4,321,500	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
コムチュア	9,400	2,650.00	24,910,000	貸付株式数	800株
サイバーコム	1,100	1,428.00	1,570,800	貸付株式数	400株
アステリア	5,600	760.00	4,256,000	貸付株式数	2,100株
アイル	4,000	1,923.00	7,692,000	貸付株式数	1,500株
王子ホールディングス	295,300	537.00	158,576,100		
日本製紙	36,500	969.00	35,368,500		
三菱製紙	7,900	280.00	2,212,000	貸付株式数	3,000株
北越コーポレーション	44,700	782.00	34,955,400	貸付株式数	17,600株
中越パルプ	2,600	941.00	2,446,600	貸付株式数	900株
巴川製紙	2,500	661.00	1,652,500	貸付株式数	800株
大王製紙	31,300	1,048.00	32,802,400		
阿波製紙	1,100	308.00	338,800	貸付株式数	500株
マークライنز	3,900	2,678.00	10,444,200		
メディカル・データ・ピジ	10,600	981.00	10,398,600	貸付株式数	3,800株
gumi	11,600	760.00	8,816,000	貸付株式数	4,100株
ショーケース	1,600	338.00	540,800	貸付株式数	600株

モバイルファクトリー	1,500	888.00	1,332,000	貸付株式数	500株
テラスカイ	3,000	2,632.00	7,896,000		
デジタル・インフォメーション	3,700	1,945.00	7,196,500		
P C Iホールディングス	2,900	1,004.00	2,911,600	貸付株式数	200株
アイビーシー	1,100	420.00	462,000	貸付株式数	400株
ネオジャパン	2,400	1,016.00	2,438,400	貸付株式数	900株
P R T I M E S	1,800	2,476.00	4,456,800	貸付株式数	600株
ラクス	33,600	1,704.00	57,254,400		
ランドコンピュータ	1,600	910.00	1,456,000	貸付株式数	300株
ダブルスタンダード	2,900	2,085.00	6,046,500	貸付株式数	1,100株
オープンドア	5,000	1,800.00	9,000,000	貸付株式数	1,900株
マイネット	2,300	402.00	924,600	貸付株式数	700株
アカツキ	3,400	2,211.00	7,517,400		
ベネフィットジャパン	400	1,263.00	505,200	貸付株式数	200株
U B I C O Mホールディングス	2,200	2,161.00	4,754,200	貸付株式数	800株
カナミックネットワーク	10,700	604.00	6,462,800		
ノムラシステムコーポレーション	6,500	120.00	780,000	貸付株式数	2,900株
レンゴー	64,400	914.00	58,861,600		
トーモク	4,000	1,605.00	6,420,000		
ザ・パック	5,200	2,420.00	12,584,000	貸付株式数	2,000株
チェンジ	17,400	2,370.00	41,238,000		
シンクロ・フード	4,400	458.00	2,015,200	貸付株式数	1,700株
オークネット	3,700	1,855.00	6,863,500	貸付株式数	1,500株
キャピタル・アセット・プラン	1,300	577.00	750,100	貸付株式数	500株
セグエグループ	1,900	854.00	1,622,600	貸付株式数	700株
エイトレッド	1,100	1,409.00	1,549,900	貸付株式数	500株
マクロミル	16,100	1,042.00	16,776,200		
ビーグリー	1,200	1,230.00	1,476,000	貸付株式数	600株
オロ	2,100	1,820.00	3,822,000	貸付株式数	800株
ユーザーローカル	2,500	1,434.00	3,585,000	貸付株式数	1,000株
テモナ	1,300	280.00	364,000	貸付株式数	500株
ニーズウェル	2,100	782.00	1,642,200	貸付株式数	500株
マネーフォワード	17,100	4,385.00	74,983,500	貸付株式数	6,200株 (100株)
サインポスト	2,700	728.00	1,965,600	貸付株式数	700株
昭和電工	68,500	2,168.00	148,508,000	貸付株式数	300株

住友化学	524,900	479.00	251,427,100		
住友精化	3,100	4,220.00	13,082,000	貸付株式数	400株
日産化学	33,600	6,420.00	215,712,000		
ラサ工業	2,800	1,953.00	5,468,400		
クレハ	6,000	8,460.00	50,760,000	貸付株式数	2,100株
多木化学	2,800	4,865.00	13,622,000	貸付株式数	1,000株
テイカ	5,100	1,206.00	6,150,600		
石原産業	12,900	1,075.00	13,867,500	貸付株式数	100株
片倉コープアグリ	1,800	1,560.00	2,808,000		
日本曹達	7,600	4,255.00	32,338,000	貸付株式数	900株
東ソー	94,400	1,603.00	151,323,200		
トクヤマ	22,800	1,848.00	42,134,400		
セントラル硝子	11,300	3,105.00	35,086,500		
東亜合成	36,800	1,123.00	41,326,400		
大阪ソーダ	4,300	4,240.00	18,232,000		
関東電化	13,900	956.00	13,288,400	貸付株式数	100株
デンカ	25,700	3,140.00	80,698,000		
イビデン	41,000	5,160.00	211,560,000		
信越化学	121,300	17,235.00	2,090,605,500		
日本カ - バイド	2,900	1,265.00	3,668,500	貸付株式数	900株
電算システムHD	3,400	2,203.00	7,490,200	貸付株式数	1,200株
堺化学	5,600	1,808.00	10,124,800	貸付株式数	1,700株
第一稀元素化学工	6,500	1,078.00	7,007,000	貸付株式数	1,800株
エア・ウォーター	66,500	1,543.00	102,609,500		
日本酸素HLDGS	68,600	2,065.00	141,659,000		
日本化学工業	2,500	1,783.00	4,457,500		
東邦アセチレン	1,500	1,104.00	1,656,000		
日本パ - カライジング	35,000	960.00	33,600,000		
高压ガス	11,200	655.00	7,336,000		
チタン工業	1,100	1,555.00	1,710,500	貸付株式数	200株
四国化成	8,600	1,344.00	11,558,400		
戸田工業	1,600	2,658.00	4,252,800	貸付株式数	600株
ステラケミファ	4,300	2,552.00	10,973,600	貸付株式数	1,300株
保土谷化学	2,000	2,910.00	5,820,000		
日本触媒	10,700	5,330.00	57,031,000		
大日精化	5,200	1,714.00	8,912,800		
カネカ	16,100	3,360.00	54,096,000		
協和キリン	85,700	3,075.00	263,527,500		
三菱瓦斯化学	52,700	1,890.00	99,603,000		
三井化学	59,400	3,130.00	185,922,000		

J S R	66,100	2,767.00	182,898,700	
東京応化工業	12,400	6,600.00	81,840,000	
大阪有機化学	5,300	2,011.00	10,658,300	
三菱ケミカルグループ	477,500	703.50	335,921,250	
K Hネオケム	11,700	2,713.00	31,742,100	
ダイセル	103,500	979.00	101,326,500	
住友ベ-クライト	10,500	4,165.00	43,732,500	
積水化学	147,000	1,866.00	274,302,000	
日本ゼオン	42,300	1,318.00	55,751,400	
アイカ工業	17,700	3,235.00	57,259,500	
U B E	36,200	1,963.00	71,060,600	
積水樹脂	10,200	1,803.00	18,390,600	
タキロンシーアイ	16,700	511.00	8,533,700	
旭有機材	4,900	2,741.00	13,430,900	
ニチバン	4,300	1,786.00	7,679,800	貸付株式数 1,500株
リケンテクノス	16,100	487.00	7,840,700	
大倉工業	3,200	1,987.00	6,358,400	貸付株式数 1,300株
積水化成成品	14,500	396.00	5,742,000	
群栄化学	1,800	2,344.00	4,219,200	貸付株式数 100株
タイガース ポリマー	6,200	405.00	2,511,000	
ミライアル	2,100	1,520.00	3,192,000	貸付株式数 800株
ダイキアクシス	2,600	704.00	1,830,400	貸付株式数 900株
ダイキョーニシカワ	16,600	571.00	9,478,600	
竹本容器	2,200	755.00	1,661,000	貸付株式数 900株
森六ホールディングス	3,800	1,715.00	6,517,000	
恵和	2,300	3,340.00	7,682,000	
日本化薬	53,700	1,182.00	63,473,400	貸付株式数 200株
カーリットホールディングス	6,400	706.00	4,518,400	貸付株式数 2,500株
ソルクシーズ	5,600	371.00	2,077,600	貸付株式数 2,300株
C Lホールディングス	2,000	795.00	1,590,000	貸付株式数 700株
プレステージ・インター	30,700	705.00	21,643,500	
フェイス	2,000	515.00	1,030,000	貸付株式数 700株
プロトコーポレーション	8,900	1,234.00	10,982,600	貸付株式数 1,400株
ハイマックス	2,200	1,430.00	3,146,000	
アミューズ	3,900	1,762.00	6,871,800	
野村総合研究所	145,700	3,215.00	468,425,500	
ドリームインキュベータ	2,200	2,332.00	5,130,400	貸付株式数 800株
サイバネットシステム	5,900	920.00	5,428,000	
クイック	5,600	2,031.00	11,373,600	

T A C	3,800	211.00	801,800	貸付株式数 800株 (400株)
C Eホールディングス	3,500	574.00	2,009,000	
日本システム技術	3,000	1,588.00	4,764,000	貸付株式数 200株
電通グループ	76,400	4,170.00	318,588,000	
インテージホールディングス	9,600	1,400.00	13,440,000	貸付株式数 3,800株
テイクアンドギヴニーズ	2,500	1,418.00	3,545,000	
東邦システムサイエンス	1,900	995.00	1,890,500	貸付株式数 700株
びあ	2,500	3,155.00	7,887,500	貸付株式数 900株
イオンファンタジー	3,100	2,896.00	8,977,600	貸付株式数 1,200株
ソースネクスト	36,100	286.00	10,324,600	貸付株式数 14,200株
シーティーエス	8,100	861.00	6,974,100	
ネクシィーズグループ	2,200	686.00	1,509,200	貸付株式数 800株
インフォコム	9,200	2,027.00	18,648,400	
メディカルシステムネットワーク	6,400	410.00	2,624,000	
日本精化	4,100	2,299.00	9,425,900	貸付株式数 2,100株
扶桑化学工業	6,500	3,500.00	22,750,000	
トリケミカル	9,400	2,197.00	20,651,800	
シンプレクスHD	11,900	2,216.00	26,370,400	
H E R O Z	2,300	1,017.00	2,339,100	貸付株式数 900株 (700株)
ラクスル	10,000	3,465.00	34,650,000	貸付株式数 3,900株
メルカリ	31,900	2,764.00	88,171,600	貸付株式数 12,500株
I P S	2,300	2,902.00	6,674,600	貸付株式数 900株
F I G	8,200	436.00	3,575,200	貸付株式数 3,200株 (1,300株)
システムサポート	3,000	1,438.00	4,314,000	貸付株式数 600株
A D E K A	24,600	2,205.00	54,243,000	
日油	21,800	5,440.00	118,592,000	
ミヨシ油脂	2,700	995.00	2,686,500	貸付株式数 1,000株
新日本理化	10,200	247.00	2,519,400	貸付株式数 2,200株
ハリマ化成グループ	5,500	835.00	4,592,500	
イーソル	4,500	853.00	3,838,500	貸付株式数 1,800株
アルテリア・ネットワークス	6,600	1,253.00	8,269,800	貸付株式数 700株
東海ソフト	1,100	922.00	1,014,200	貸付株式数 400株
ウイングアーク1ST	7,300	2,126.00	15,519,800	

ヒト・コミュニケーションズHD	1,900	1,612.00	3,062,800	貸付株式数	700株
サーバーワークス	1,400	2,604.00	3,645,600	貸付株式数	500株
東名	500	1,600.00	800,000	貸付株式数	100株
ヴィッツ	700	1,014.00	709,800	貸付株式数	200株
トビラシステムズ	1,800	907.00	1,632,600	貸付株式数	700株
Sansan	26,500	1,535.00	40,677,500	貸付株式数	10,400株
Link-U	1,300	897.00	1,166,100	貸付株式数	500株
ギフトィ	7,600	2,262.00	17,191,200	貸付株式数	3,000株
花王	172,600	5,339.00	921,511,400		
第一工業製薬	2,700	1,932.00	5,216,400		
石原ケミカル	3,500	1,249.00	4,371,500		
日華化学	3,000	874.00	2,622,000	貸付株式数	1,100株
ニイタカ	1,400	2,150.00	3,010,000	貸付株式数	500株
三洋化成	4,400	4,075.00	17,930,000		
ベース	2,400	3,605.00	8,652,000	貸付株式数	100株
JMDC	11,600	4,660.00	54,056,000		
武田薬品	628,100	4,112.00	2,582,747,200		
アステラス製薬	680,200	2,106.00	1,432,501,200		
住友ファーマ	52,500	1,023.00	53,707,500		
塩野義製薬	90,700	6,777.00	614,673,900		
わかもと製薬	6,600	230.00	1,518,000	貸付株式数	2,900株
日本新薬	16,700	7,680.00	128,256,000		
中外製薬	222,100	3,543.00	786,900,300		
科研製薬	12,000	3,910.00	46,920,000	貸付株式数	500株
エーザイ	86,300	9,392.00	810,529,600		
理研ビタミン	6,000	1,798.00	10,788,000		
ロート製薬	34,300	4,515.00	154,864,500		
小野薬品	136,800	3,390.00	463,752,000		
久光製薬	15,700	3,790.00	59,503,000		
有機合成薬品	5,800	301.00	1,745,800	貸付株式数	1,300株
持田製薬	8,400	3,410.00	28,644,000	貸付株式数	100株
参天製薬	135,500	1,111.00	150,540,500		
扶桑薬品	2,300	2,021.00	4,648,300		
日本ケミファ	700	1,671.00	1,169,700		
ツムラ	22,200	3,010.00	66,822,000		
日医工	10,400	114.00	1,185,600	貸付株式数	8,800株
テルモ	221,000	3,894.00	860,574,000		
HUグループHD	21,200	2,761.00	58,533,200		
キッセイ薬品工業	10,800	2,506.00	27,064,800		

生化学工業	13,300	938.00	12,475,400	貸付株式数	4,500株
栄研化学	11,400	1,845.00	21,033,000		
鳥居薬品	3,800	2,890.00	10,982,000		
J C R ファーマ	24,000	1,778.00	42,672,000		
東和薬品	10,800	2,110.00	22,788,000		
富士製薬工業	4,500	993.00	4,468,500		
ゼリア新薬工業	9,700	2,277.00	22,086,900	貸付株式数	800株
第一三共	618,400	4,437.00	2,743,840,800		
キョーリン製薬HD	15,200	1,732.00	26,326,400	貸付株式数	100株
大幸薬品	12,800	429.00	5,491,200	貸付株式数	4,600株
ダイト	5,300	2,488.00	13,186,400		
大塚ホールディングス	162,300	4,501.00	730,512,300		
大正製薬HD	15,700	5,590.00	87,763,000		
ペプチドリーム	34,300	1,596.00	54,742,800		
大日本塗料	9,400	760.00	7,144,000	貸付株式数	3,100株
日本ペイントHOLD	313,500	1,122.00	351,747,000		
関西ペイント	64,800	1,750.00	113,400,000		
神東塗料	9,900	127.00	1,257,300	貸付株式数	1,800株
中国塗料	13,500	998.00	13,473,000		
日本特殊塗料	4,400	866.00	3,810,400		
藤倉化成	10,800	408.00	4,406,400	貸付株式数	100株
太陽ホールディングス	10,800	2,426.00	26,200,800		
D I C	27,600	2,431.00	67,095,600	貸付株式数	11,000株
サカタインクス	16,000	1,098.00	17,568,000	貸付株式数	1,400株
東洋インキSCホールディングン	14,100	1,872.00	26,395,200	貸付株式数	5,600株
T & K TOKA	6,600	1,087.00	7,174,200		
アルプス技研	6,300	2,123.00	13,374,900		
サニックス	11,500	230.00	2,645,000	貸付株式数	5,000株 (5,000株)
ダイオーズ	300	1,496.00	448,800		
日本空調サービス	7,700	698.00	5,374,600		
オリエンタルランド	77,000	19,230.00	1,480,710,000		
フォーカスシステムズ	5,200	1,009.00	5,246,800		
ダスキン	16,200	2,955.00	47,871,000		
パーク24	54,400	2,200.00	119,680,000		
明光ネットワークジャパン	9,300	623.00	5,793,900	貸付株式数	3,700株
ファルコホールディングス	3,200	1,739.00	5,564,800	貸付株式数	400株
クレスコ	5,500	1,776.00	9,768,000	貸付株式数	2,100株
フジ・メディア・HD	67,900	1,065.00	72,313,500		

秀英予備校	1,500	436.00	654,000	貸付株式数	800株
田谷	1,200	536.00	643,200	貸付株式数	600株
ラウンドワン	60,900	520.00	31,668,000		
リゾートトラスト	28,800	2,362.00	68,025,600		
オービック	23,700	20,460.00	484,902,000		
ジャストシステム	10,200	2,982.00	30,416,400		
TDCソフト	5,900	1,496.00	8,826,400		
Zホールディングス	1,010,500	349.20	352,866,600		
ビー・エム・エル	9,000	3,385.00	30,465,000		
トレンドマイクロ	41,000	6,450.00	264,450,000		
りらいあコミュニケーション	12,000	1,005.00	12,060,000		
IDホールディングス	4,600	904.00	4,158,400		
リソー教育	33,000	355.00	11,715,000	貸付株式数	200株
日本オラクル	13,600	8,100.00	110,160,000		
早稲田アカデミー	3,900	1,119.00	4,364,100	貸付株式数	500株
アルファシステムズ	2,200	4,195.00	9,229,000		
フューチャー	17,700	1,658.00	29,346,600		
CAC HOLDINGS	4,300	1,481.00	6,368,300		
SBテクノロジー	3,000	1,928.00	5,784,000		
トーセ	1,800	762.00	1,371,600	貸付株式数	100株
ユー・エス・エス	74,800	2,199.00	164,485,200		
オービックビジネスC	14,000	4,435.00	62,090,000		
伊藤忠テクノソリューションズ	38,100	3,190.00	121,539,000		
アイティフォー	9,300	843.00	7,839,900		
東京個別指導学院	8,500	530.00	4,505,000	貸付株式数	3,300株
東計電算	1,000	5,620.00	5,620,000	貸付株式数	300株
サイバーエージェント	174,100	1,164.00	202,652,400		
楽天グループ	336,800	614.00	206,795,200		
エクスネット	900	1,020.00	918,000		
クリーク・アンド・リバー社	4,300	2,048.00	8,806,400		
モーニングスター	12,100	466.00	5,638,600	貸付株式数	4,800株
テー・オー・ダブリュー	14,900	296.00	4,410,400	貸付株式数	4,200株
大塚商会	40,200	4,335.00	174,267,000	貸付株式数	13,500株
サイボウズ	9,800	2,586.00	25,342,800	貸付株式数	200株
山田コンサルティンググループ	3,700	1,142.00	4,225,400	貸付株式数	600株
セントラルスポーツ	2,700	2,371.00	6,401,700	貸付株式数	1,000株
パラカ	2,400	1,918.00	4,603,200	貸付株式数	600株
電通国際情報サービス	8,600	4,135.00	35,561,000	貸付株式数	3,800株
ACCESS	8,400	852.00	7,156,800	貸付株式数	900株

デジタルガレージ	12,600	4,190.00	52,794,000		
イーエムシステムズ	11,800	831.00	9,805,800		
ウェザーニューズ	2,500	7,180.00	17,950,000	貸付株式数	1,000株
C I J	6,300	920.00	5,796,000	貸付株式数	2,400株
ビジネスエンジニアリング	1,500	2,406.00	3,609,000	貸付株式数	600株
日本エンタープライズ	7,100	137.00	972,700	貸付株式数	2,900株
WOWOW	3,900	1,242.00	4,843,800	貸付株式数	700株
スカラ	6,900	744.00	5,133,600		
インテリジェント ウェイブ	3,700	722.00	2,671,400	貸付株式数	1,500株
フルキャストホールディングス	7,000	2,970.00	20,790,000		
エン・ジャパン	13,200	2,358.00	31,125,600		
あすか製薬HD	7,200	1,267.00	9,122,400		
サイイグループHD	16,100	4,050.00	65,205,000		
富士フイルムHLDS	136,200	7,027.00	957,077,400		
コニカミノルタ	159,000	538.00	85,542,000		
資生堂	148,200	6,209.00	920,173,800		
ライオン	84,900	1,492.00	126,670,800		
高砂香料	4,900	2,668.00	13,073,200	貸付株式数	1,700株
マンダム	15,300	1,414.00	21,634,200		
ミルボン	10,500	5,510.00	57,855,000	貸付株式数	2,200株
ファンケル	31,000	2,501.00	77,531,000		
コーセー	14,400	14,000.00	201,600,000		
コタ	6,000	1,703.00	10,218,000		
シーボン	800	1,583.00	1,266,400	貸付株式数	400株
ポーラ・オルビスHD	36,400	1,845.00	67,158,000	貸付株式数	11,500株
ノエビアホールディングス	6,300	5,820.00	36,666,000		
アジュバンホールディング	1,600	946.00	1,513,600	貸付株式数	600株
新日本製薬	4,100	1,371.00	5,621,100	貸付株式数	1,400株
エステー	5,400	1,518.00	8,197,200	貸付株式数	2,000株
アグロカネショウ	3,000	1,680.00	5,040,000	貸付株式数	1,000株
コニシ	12,200	1,670.00	20,374,000		
長谷川香料	14,600	3,015.00	44,019,000		
星光PMC	4,400	537.00	2,362,800	貸付株式数	100株
小林製薬	21,700	8,310.00	180,327,000		
荒川化学工業	6,800	990.00	6,732,000	貸付株式数	1,200株
メック	5,800	2,320.00	13,456,000	貸付株式数	600株
日本高純度化学	2,000	2,491.00	4,982,000		
タカラバイオ	18,900	1,755.00	33,169,500		

J C U	8,000	3,325.00	26,600,000		
新田ゼラチン	4,400	949.00	4,175,600	貸付株式数	1,700株
O A T アグリオ	2,900	1,617.00	4,689,300	貸付株式数	1,100株
デクセリアルズ	20,500	2,962.00	60,721,000	貸付株式数	8,000株
アース製薬	6,400	5,180.00	33,152,000		
北興化学	7,200	854.00	6,148,800		
大成ラミック	2,200	2,991.00	6,580,200		
クミアイ化学	28,000	944.00	26,432,000		
日本農薬	13,100	722.00	9,458,200	貸付株式数	5,100株
富士興産	1,600	1,132.00	1,811,200		
ニチレキ	8,600	1,255.00	10,793,000		
ユシロ化学	3,500	791.00	2,768,500		
ビーピー・カストロール	2,700	920.00	2,484,000		
富士石油	14,400	257.00	3,700,800	貸付株式数	5,700株
M O R E S C O	2,800	1,141.00	3,194,800	貸付株式数	1,000株
出光興産	78,800	3,050.00	240,340,000		
E N E O S ホールディングス	1,282,700	449.00	575,932,300		
コスモエネルギーH L D G S	26,900	3,630.00	97,647,000		
テスホールディングス	7,500	1,045.00	7,837,500	貸付株式数	2,800株
インフロニアH D	72,700	1,013.00	73,645,100		
横浜ゴム	40,300	2,150.00	86,645,000		
T O Y O T I R E	40,800	1,570.00	64,056,000		
ブリヂストン	226,700	4,895.00	1,109,696,500		
住友ゴム	69,600	1,180.00	82,128,000		
藤倉コンポジット	5,200	851.00	4,425,200	貸付株式数	2,400株
オカモト	4,200	3,810.00	16,002,000		
W O W W O R L D G R O U P	1,200	1,084.00	1,300,800	貸付株式数	400株
アキレス	4,800	1,276.00	6,124,800	貸付株式数	500株
フ コ ク	3,600	1,072.00	3,859,200		
ニッタ	7,800	2,910.00	22,698,000		
クリエートメディック	3,200	895.00	2,864,000	貸付株式数	700株
住友理工	15,100	599.00	9,044,900		
三ツ星ベルト	10,500	3,450.00	36,225,000		
バンドー化学	12,400	981.00	12,164,400	貸付株式数	100株
A G C	72,200	4,575.00	330,315,000		
日本板硝子	36,100	615.00	22,201,500		
石塚硝子	1,300	1,444.00	1,877,200	貸付株式数	400株

有沢製作所	11,600	1,308.00	15,172,800	
日本山村硝子	2,200	565.00	1,243,000	貸付株式数 700株
日本電気硝子	29,000	2,496.00	72,384,000	
オハラ	3,300	1,101.00	3,633,300	貸付株式数 1,200株
住友大阪セメント	10,000	3,105.00	31,050,000	
太平洋セメント	45,100	2,038.00	91,913,800	
リソルホールディングス	700	4,560.00	3,192,000	貸付株式数 300株
日本ヒューム	6,800	651.00	4,426,800	
日本コンクリート	14,900	226.00	3,367,400	貸付株式数 100株
三谷セキサン	2,900	3,980.00	11,542,000	
アジアパイルHD	12,100	543.00	6,570,300	
東海カーボン	59,600	1,128.00	67,228,800	
日本カーボン	4,100	4,390.00	17,999,000	
東洋炭素	4,600	3,940.00	18,124,000	
ノリタケ	3,500	4,015.00	14,052,500	
TOTO	46,800	4,695.00	219,726,000	
日本碍子	84,100	1,758.00	147,847,800	
日本特殊陶業	54,000	2,584.00	139,536,000	
ダントーホールディングス	5,000	238.00	1,190,000	貸付株式数 2,000株
MARUWA	2,600	16,710.00	43,446,000	
品川リフラクトリーズ	2,000	3,850.00	7,700,000	
黒崎播磨	1,400	4,950.00	6,930,000	
ヨータイ	4,700	1,404.00	6,598,800	
東京窯業	5,700	269.00	1,533,300	貸付株式数 2,800株
ニッカトー	2,800	476.00	1,332,800	
フジインコーポレーテッド	5,700	7,030.00	40,071,000	
クニミネ工業	1,800	843.00	1,517,400	貸付株式数 900株
エーアンドエーマテリアル	800	878.00	702,400	
ニチアス	18,000	2,403.00	43,254,000	貸付株式数 800株
日本製鉄	327,000	2,245.00	734,115,000	
神戸製鋼所	146,800	626.00	91,896,800	
中山製鋼所	14,900	763.00	11,368,700	
合同製鐵	3,500	2,036.00	7,126,000	
JFEホールディングス	195,200	1,558.00	304,121,600	
東京製鐵	20,500	1,220.00	25,010,000	貸付株式数 8,000株
共英製鋼	8,200	1,243.00	10,192,600	貸付株式数 3,000株
大和工業	12,100	4,490.00	54,329,000	貸付株式数 100株
東京鐵鋼	3,300	1,397.00	4,610,100	貸付株式数 1,100株
大阪製鐵	3,300	1,074.00	3,544,200	

淀川製鋼所	8,300	2,545.00	21,123,500	貸付株式数	400株
丸一鋼管	22,300	2,778.00	61,949,400		
モリ工業	1,600	2,807.00	4,491,200		
大同特殊鋼	9,100	4,325.00	39,357,500		
日本高周波	1,900	318.00	604,200	貸付株式数	900株
日本冶金工	5,300	4,255.00	22,551,500		
山陽特殊製鋼	7,200	2,177.00	15,674,400		
愛知製鋼	4,100	2,170.00	8,897,000		
日本金属	1,500	930.00	1,395,000	貸付株式数	700株
大平洋金属	5,200	1,971.00	10,249,200		
新日本電工	46,400	375.00	17,400,000		
栗本鉄工所	3,300	1,751.00	5,778,300		
虹 技	800	921.00	736,800	貸付株式数	100株
日本鑄鉄管	800	928.00	742,400	貸付株式数	300株
日本製鋼所	19,700	2,794.00	55,041,800		
三菱製鋼	4,600	1,015.00	4,669,000		
日亜鋼業	6,600	248.00	1,636,800	貸付株式数	200株
日本精線	1,000	4,225.00	4,225,000	貸付株式数	400株
エンビプロHD	5,000	740.00	3,700,000	貸付株式数	1,900株
大紀アルミニウム	10,400	1,285.00	13,364,000		
日本軽金属HD	19,700	1,520.00	29,944,000		
三井金属	21,300	3,130.00	66,669,000		
東邦亜鉛	4,300	2,133.00	9,171,900		
三菱マテリアル	48,700	2,140.00	104,218,000		
住友鉱山	84,700	4,670.00	395,549,000		
DOWAホールディングス	16,400	4,275.00	70,110,000		
古河機金	10,600	1,309.00	13,875,400		
エス・サイエンス	42,800	26.00	1,112,800	貸付株式数	13,600株
大阪チタニウム	10,700	4,195.00	44,886,500	貸付株式数	4,100株
東邦チタニウム	13,200	3,100.00	40,920,000	貸付株式数	5,100株
UACJ	10,200	2,224.00	22,684,800		
CKサンエツ	1,800	4,040.00	7,272,000	貸付株式数	600株
古河電工	24,500	2,632.00	64,484,000		
住友電工	252,000	1,565.50	394,506,000		
フジクラ	78,200	1,124.00	87,896,800		
昭和電線HLDGS	8,100	1,832.00	14,839,200		
東京特殊電線	1,000	5,660.00	5,660,000		
タツタ電線	15,000	424.00	6,360,000	貸付株式数	900株
カナレ電気	1,000	1,485.00	1,485,000	貸付株式数	400株
平河ビューテック	4,100	1,144.00	4,690,400	貸付株式数	1,400株

いよぎんホールディング	82,800	693.00	57,380,400	
しずおかフィナンシャル	157,700	973.00	153,442,100	
ちゅうぎんフィナンシャ	58,400	940.00	54,896,000	
リョービ	7,700	1,206.00	9,286,200	
アーレステイ	7,800	455.00	3,549,000	
アサヒHD	29,500	2,001.00	59,029,500	
東洋製罐グループHD	47,900	1,611.00	77,166,900	
ホッカホホールディングス	5,000	1,350.00	6,750,000	貸付株式数 1,400株
コロナ	3,900	865.00	3,373,500	
横河ブリッジHLDGS	9,700	1,882.00	18,255,400	
駒井ハルテック	1,300	1,539.00	2,000,700	
高田機工	800	2,435.00	1,948,000	貸付株式数 200株
三和ホールディングス	67,200	1,243.00	83,529,600	
文化シャツタ-	21,000	1,103.00	23,163,000	貸付株式数 8,900株
三協立山	10,400	543.00	5,647,200	
アルインコ	5,400	1,029.00	5,556,600	貸付株式数 1,800株
東洋シャツタ-	1,700	512.00	870,400	貸付株式数 200株
LIXIL	106,400	2,034.00	216,417,600	
日本フィルコン	7,100	456.00	3,237,600	貸付株式数 1,200株
ノーリツ	10,700	1,498.00	16,028,600	
長府製作所	7,200	1,961.00	14,119,200	
リンナイ	13,300	9,840.00	130,872,000	
ユニプレス	12,500	798.00	9,975,000	
ダイニチ工業	3,500	656.00	2,296,000	
日東精工	11,200	510.00	5,712,000	
三洋工業	800	1,800.00	1,440,000	貸付株式数 300株
岡 部	11,400	715.00	8,151,000	
ジーテクト	8,000	1,460.00	11,680,000	
東 プ レ	12,800	1,176.00	15,052,800	
高周波熱錬	12,600	682.00	8,593,200	貸付株式数 2,600株
東京製綱	4,400	855.00	3,762,000	
サンコール	6,400	638.00	4,083,200	貸付株式数 2,500株
モリテックスチル	5,500	233.00	1,281,500	貸付株式数 2,300株
パイオラックス	10,000	1,679.00	16,790,000	
エイチワン	7,200	640.00	4,608,000	
日本発条	64,300	869.00	55,876,700	
中央発条	4,900	717.00	3,513,300	
アドバネクス	1,200	1,077.00	1,292,400	貸付株式数 400株
三浦工業	29,900	3,130.00	93,587,000	
タ ク マ	22,000	1,263.00	27,786,000	

テクノプロ・ホールディング	48,800	3,650.00	178,120,000		
アトラグループ	1,600	201.00	321,600	貸付株式数	600株
インターワークス	1,700	366.00	622,200	貸付株式数	800株
アイ・アールジャパンHD	3,800	1,843.00	7,003,400	貸付株式数	1,400株
K e e P e r 技研	5,200	4,015.00	20,878,000		
ファーストロジック	1,100	886.00	974,600	貸付株式数	400株
三機サービス	1,300	902.00	1,172,600	貸付株式数	400株
G u n o s y	4,500	667.00	3,001,500	貸付株式数	1,700株
デザインワン・ジャパン	2,200	209.00	459,800	貸付株式数	900株 (100株)
イー・ガーディアン	2,800	2,723.00	7,624,400		
リブセンス	3,300	309.00	1,019,700	貸付株式数	1,300株
ジャパンマテリアル	22,300	2,342.00	52,226,600		
ベクトル	11,400	1,319.00	15,036,600	貸付株式数	300株
ウチヤマホールディングス	3,300	272.00	897,600	貸付株式数	1,400株
チャームケアコーポレー ション	6,100	1,203.00	7,338,300	貸付株式数	2,100株
キャリアリンク	2,700	3,080.00	8,316,000	貸付株式数	1,000株
I B J	4,500	900.00	4,050,000	貸付株式数	2,000株
アサンテ	3,500	1,594.00	5,579,000	貸付株式数	1,000株
バリューHR	6,300	1,616.00	10,180,800	貸付株式数	2,500株
M & A キャピタルパート ナー	6,700	4,595.00	30,786,500	貸付株式数	2,600株
ライドオンエクスプレスH D	2,600	1,087.00	2,826,200	貸付株式数	100株
E R I ホールディングス	2,000	1,123.00	2,246,000	貸付株式数	800株
アビスト	1,100	2,922.00	3,214,200	貸付株式数	400株
シグマクス・ホールディ ンク	11,100	1,390.00	15,429,000		
ウィルグループ	6,100	1,224.00	7,466,400		
エスクローAJ	7,600	149.00	1,132,400	貸付株式数	300株
メドピア	5,700	1,562.00	8,903,400	貸付株式数	2,200株
レアジョブ	1,400	960.00	1,344,000	貸付株式数	400株
リクルートホールディング ス	538,800	4,206.00	2,266,192,800		
エラン	9,700	965.00	9,360,500		
ツガミ	15,900	1,205.00	19,159,500		
オークマ	7,200	5,020.00	36,144,000		
芝浦機械	7,900	2,616.00	20,666,400		

アマダ	114,200	1,068.00	121,965,600	
アイダエンジニア	14,600	808.00	11,796,800	貸付株式数 5,700株
TAKISAWA	1,600	1,075.00	1,720,000	貸付株式数 400株
FUJII	31,100	2,020.00	62,822,000	
牧野フライス	7,900	4,595.00	36,300,500	貸付株式数 3,000株
オーエスジー	34,100	1,910.00	65,131,000	
ダイジェット	400	841.00	336,400	貸付株式数 100株
旭ダイヤモンド	20,600	691.00	14,234,600	
DMG森精機	43,400	1,819.00	78,944,600	
ソディック	19,600	738.00	14,464,800	
ディスコ	11,500	39,950.00	459,425,000	
日東工器	3,700	1,518.00	5,616,600	
日進工具	6,000	1,071.00	6,426,000	貸付株式数 200株
パンチ工業	5,700	415.00	2,365,500	
富士ダイス	2,900	585.00	1,696,500	貸付株式数 800株
土木管理総合試験	2,800	310.00	868,000	貸付株式数 100株
日本郵政	953,400	1,056.00	1,006,790,400	
ベルシステム24HLDGS	9,800	1,371.00	13,435,800	貸付株式数 4,200株
鎌倉新書	8,200	977.00	8,011,400	貸付株式数 3,200株 (100株)
SMN	1,700	484.00	822,800	貸付株式数 600株
一蔵	900	456.00	410,400	貸付株式数 400株
グローバルキッズCOMP	1,100	579.00	636,900	
エアトリ	4,700	2,494.00	11,721,800	貸付株式数 1,700株
アトラエ	5,700	1,326.00	7,558,200	
ストライク	3,600	4,505.00	16,218,000	
ソラスト	20,100	733.00	14,733,300	
セラク	2,600	1,179.00	3,065,400	貸付株式数 100株
インソース	9,000	3,025.00	27,225,000	
豊田自動織機	51,800	7,470.00	386,946,000	
豊和工業	3,800	934.00	3,549,200	貸付株式数 1,200株
ニデックオーケーケー	2,800	985.00	2,758,000	
石川製作所	1,800	1,506.00	2,710,800	貸付株式数 800株
東洋機械金属	4,600	548.00	2,520,800	貸付株式数 700株
津田駒工業	1,100	598.00	657,800	貸付株式数 500株
エンシュウ	1,300	682.00	886,600	貸付株式数 600株
島精機製作所	11,400	1,974.00	22,503,600	
オプトラン	10,600	2,420.00	25,652,000	
NCホールディングス	1,500	2,008.00	3,012,000	

イワキポンプ	4,700	1,254.00	5,893,800		
フリュー	7,500	1,168.00	8,760,000	貸付株式数	900株
ヤマシンフィルタ	17,800	482.00	8,579,600	貸付株式数	200株
日阪製作所	6,300	822.00	5,178,600		
やまびこ	11,600	1,139.00	13,212,400		
野村マイクロ・サイエンス	2,400	4,680.00	11,232,000		
平田機工	3,400	5,740.00	19,516,000		
ペガサスミシン製造	7,700	896.00	6,899,200		
マルマエ	3,400	1,663.00	5,654,200	貸付株式数	1,300株 (900株)
タツモ	3,900	1,726.00	6,731,400	貸付株式数	1,200株
ナプテスコ	44,800	3,350.00	150,080,000	貸付株式数	15,100株
三井海洋開発	9,000	1,360.00	12,240,000		
レオン自動機	7,500	1,106.00	8,295,000	貸付株式数	200株
S M C	23,100	59,860.00	1,382,766,000		
ホソカワミクロン	5,500	2,802.00	15,411,000		
ユニオンツール	3,100	3,345.00	10,369,500		
オイレス工業	11,200	1,471.00	16,475,200	貸付株式数	3,900株
日精エーエスビー	3,200	4,675.00	14,960,000	貸付株式数	1,200株
サト - ホールディングス	9,900	1,956.00	19,364,400		
技研製作所	7,500	3,045.00	22,837,500		
日本エアーテック	3,500	1,235.00	4,322,500	貸付株式数	1,200株
カワタ	1,900	838.00	1,592,200		
日精樹脂工業	5,100	963.00	4,911,300		
オカダアイヨン	2,100	1,545.00	3,244,500	貸付株式数	800株
ワイエイシイホールディングス	3,000	1,591.00	4,773,000	貸付株式数	1,200株
小松製作所	335,000	3,035.00	1,016,725,000		
住友重機械	42,300	2,825.00	119,497,500		
日立建機	28,500	3,060.00	87,210,000		
日工	10,100	612.00	6,181,200		
巴工業	3,400	2,402.00	8,166,800	貸付株式数	1,200株
井関農機	6,500	1,247.00	8,105,500		
T O W A	7,300	1,861.00	13,585,300	貸付株式数	2,800株
丸山製作所	1,000	1,544.00	1,544,000	貸付株式数	400株
北川鉄工所	2,800	1,188.00	3,326,400		
シンニッタン	12,700	221.00	2,806,700		
ローツェ	3,700	7,990.00	29,563,000	貸付株式数	1,400株
タカキタ	1,900	457.00	868,300	貸付株式数	1,000株 (100株)

クボタ	378,400	1,959.50	741,474,800	
荏原実業	3,600	2,328.00	8,380,800	
東洋エンジニア	9,100	570.00	5,187,000	
三菱化工機	2,200	2,076.00	4,567,200	
月島機械	9,600	971.00	9,321,600	貸付株式数 4,000株
帝国電機製作所	5,300	2,241.00	11,877,300	
東京機械	1,600	562.00	899,200	
新東工業	13,900	660.00	9,174,000	
渋谷工業	6,600	2,393.00	15,793,800	
アイチ コーポレーション	9,900	767.00	7,593,300	貸付株式数 100株
小森コーポレーション	16,400	824.00	13,513,600	
鶴見製作所	5,400	2,010.00	10,854,000	
住友精密	1,000	3,645.00	3,645,000	
日本ギア工業	4,000	315.00	1,260,000	貸付株式数 900株
酒井重工業	1,100	3,450.00	3,795,000	
荏原製作所	29,200	5,010.00	146,292,000	貸付株式数 11,100株
石井鉄工所	800	2,413.00	1,930,400	貸付株式数 100株
西島製作所	6,100	1,492.00	9,101,200	
北越工業	7,100	1,267.00	8,995,700	
ダイキン工業	85,400	21,400.00	1,827,560,000	
オルガノ	9,800	3,170.00	31,066,000	
ト - ヨ - カネツ	2,700	2,529.00	6,828,300	
栗田工業	40,000	5,800.00	232,000,000	
椿本チエイン	10,300	3,040.00	31,312,000	
大同工業	2,700	735.00	1,984,500	
日 機 装	17,500	999.00	17,482,500	
木村化工機	5,400	710.00	3,834,000	貸付株式数 2,300株
レイズネクスト	10,000	1,257.00	12,570,000	
アネスト岩田	12,100	880.00	10,648,000	貸付株式数 100株
ダイフク	36,900	6,740.00	248,706,000	
サムコ	2,300	3,930.00	9,039,000	貸付株式数 800株
加藤製作所	3,300	728.00	2,402,400	
油研工業	900	1,819.00	1,637,100	
タダノ	37,700	948.00	35,739,600	
フジテック	26,200	3,180.00	83,316,000	
C K D	19,900	1,998.00	39,760,200	
平和	23,800	2,452.00	58,357,600	
理想科学工業	6,300	2,104.00	13,255,200	貸付株式数 2,400株
S A N K Y O	14,000	5,330.00	74,620,000	
日本金銭機械	7,700	1,089.00	8,385,300	

マースグループHLDGS	4,100	2,336.00	9,577,600	
フクシマガリレイ	5,300	4,200.00	22,260,000	
オーイズミ	2,700	422.00	1,139,400	貸付株式数 100株
ダイコク電機	3,800	1,984.00	7,539,200	貸付株式数 1,000株
竹内製作所	13,000	3,015.00	39,195,000	
アマノ	20,200	2,451.00	49,510,200	
JUKI	11,000	682.00	7,502,000	
サンデン	10,400	207.00	2,152,800	貸付株式数 4,200株
ジャノメ	7,200	593.00	4,269,600	貸付株式数 2,700株
ブラザー工業	95,500	2,077.00	198,353,500	
マックス	8,700	1,977.00	17,199,900	
モリタホールディングス	12,300	1,140.00	14,022,000	
グローリー	18,400	2,176.00	40,038,400	
新晃工業	7,200	1,448.00	10,425,600	
大和冷機工業	11,000	1,120.00	12,320,000	
セガサミーホールディングス	57,500	1,931.00	111,032,500	
日本ピストンリング	2,200	1,225.00	2,695,000	
リケン	2,700	2,253.00	6,083,100	
TPR	8,300	1,226.00	10,175,800	
ツバキ・ナカシマ	17,600	1,035.00	18,216,000	
ホシザキ	46,000	4,525.00	208,150,000	
大豊工業	5,900	670.00	3,953,000	貸付株式数 2,300株
日本精工	130,400	716.00	93,366,400	
NTN	142,200	279.00	39,673,800	
ジェイテクト	63,300	948.00	60,008,400	
不二越	5,300	3,745.00	19,848,500	
ミネベアミツミ	124,300	2,171.00	269,855,300	
日本トムソン	18,400	564.00	10,377,600	
THK	40,900	2,624.00	107,321,600	
ユーシン精機	5,300	673.00	3,566,900	
前澤給装工業	5,000	941.00	4,705,000	貸付株式数 200株
イーグル工業	7,800	1,067.00	8,322,600	
前澤工業	4,700	613.00	2,881,100	
日本ピラ-工業	6,700	2,827.00	18,940,900	
キッツ	27,300	822.00	22,440,600	
日立	358,900	7,019.00	2,519,119,100	
東芝	137,600	4,424.00	608,742,400	
三菱電機	738,900	1,345.00	993,820,500	
富士電機	43,500	5,420.00	235,770,000	

東洋電機製造	2,300	870.00	2,001,000		
安川電機	84,800	4,440.00	376,512,000		
シンフォニア テクノロ ジー	7,800	1,501.00	11,707,800	貸付株式数	100株
明電舎	10,800	1,949.00	21,049,200		
オリジン	1,600	1,237.00	1,979,200	貸付株式数	700株
山洋電気	3,100	5,870.00	18,197,000		
デンヨー	5,400	1,517.00	8,191,800		
PHCホールディングス	9,900	1,526.00	15,107,400		
ベイカレントコンサルティ ング	57,600	4,665.00	268,704,000	貸付株式数	2,100株
ORCHESTRA HL DGS	1,600	1,885.00	3,016,000	貸付株式数	400株
アイモバイル	3,800	1,150.00	4,370,000	貸付株式数	300株
キャリアインデックス	2,500	328.00	820,000	貸付株式数	800株
MS - J a p a n	2,300	999.00	2,297,700	貸付株式数	1,000株
船場	1,600	748.00	1,196,800	貸付株式数	100株
ジャパンエレベーターSH D	26,000	1,618.00	42,068,000		
フルテック	1,000	1,226.00	1,226,000	貸付株式数	400株
グリーンズ	2,700	1,041.00	2,810,700	貸付株式数	1,000株
ツナググループHLDGS	2,100	537.00	1,127,700	貸付株式数	800株
GAMEWITH	2,000	353.00	706,000	貸付株式数	800株
MS&CONSULTIN G	800	625.00	500,000	貸付株式数	300株
ウェルビー	5,400	727.00	3,925,800	貸付株式数	2,100株
エル・ティー・エス	900	3,010.00	2,709,000	貸付株式数	300株
ミダックホールディングス	4,400	2,691.00	11,840,400	貸付株式数	1,700株
日総工産	5,400	571.00	3,083,400	貸付株式数	2,200株
キュービーネットHLDG S	3,700	1,367.00	5,057,900		
RPAホールディングス	9,700	277.00	2,686,900	貸付株式数	4,000株
三桜工業	10,800	633.00	6,836,400		
マキタ	88,900	3,205.00	284,924,500		
東芝テック	10,600	3,530.00	37,418,000		
芝浦メカトロニクス	1,400	10,990.00	15,386,000		
マブチモーター	17,800	3,905.00	69,509,000		
日本電産	173,600	7,701.00	1,336,893,600		
ユーエムシーエレクトロニ クス	5,200	501.00	2,605,200		

トレックス・セミコンダクター	3,400	2,783.00	9,462,200	貸付株式数	1,300株
東光高岳	4,300	1,839.00	7,907,700	貸付株式数	200株
ダブル・スコープ	23,400	1,475.00	34,515,000	貸付株式数	8,700株 (100株)
宮越ホールディングス	3,200	730.00	2,336,000	貸付株式数	1,200株
ダイヘン	6,500	4,015.00	26,097,500		
ヤーマン	13,900	1,430.00	19,877,000	貸付株式数	5,400株
JVCケンウッド	64,600	395.00	25,517,000		
ミマキエンジニアリング	6,700	626.00	4,194,200		
I - P E X	3,900	1,257.00	4,902,300	貸付株式数	400株
日新電機	17,200	1,317.00	22,652,400		
大崎電気	16,600	545.00	9,047,000	貸付株式数	100株
オムロン	65,300	6,727.00	439,273,100		
日東工業	9,600	2,304.00	22,118,400	貸付株式数	100株
I D E C	10,500	3,180.00	33,390,000	貸付株式数	100株
正興電機製作所	2,700	1,018.00	2,748,600	貸付株式数	1,000株
不二電機工業	1,100	1,130.00	1,243,000	貸付株式数	600株 (100株)
ジーエス・ユアサ コーポ	23,500	2,095.00	49,232,500		
サクサホールディングス	1,400	1,227.00	1,717,800	貸付株式数	600株
メルコホールディングス	1,900	3,035.00	5,766,500	貸付株式数	700株
テクノメディカ	2,100	1,668.00	3,502,800	貸付株式数	600株
ダイヤモンドエレクトリック H D	2,200	1,511.00	3,324,200	貸付株式数	800株
日本電気	101,100	4,705.00	475,675,500		
富士通	71,200	17,865.00	1,271,988,000		
沖電気	32,300	713.00	23,029,900		
岩崎通信機	3,100	785.00	2,433,500	貸付株式数	500株
電気興業	3,300	2,006.00	6,619,800		
サンケン電気	6,600	6,790.00	44,814,000		
ナカヨ	1,000	1,127.00	1,127,000	貸付株式数	400株
アイホン	4,300	1,855.00	7,976,500	貸付株式数	1,400株
ルネサスエレクトロニクス	466,600	1,251.00	583,716,600		
セイコーエプソン	95,100	2,040.00	194,004,000		
ワコム	56,600	616.00	34,865,600	貸付株式数	15,800株
アルバック	17,000	5,910.00	100,470,000		
アクセル	2,600	1,485.00	3,861,000	貸付株式数	1,100株
E I Z O	5,200	3,370.00	17,524,000		
ジャパンディスプレイ	61,700	41.00	2,529,700		

日本信号	16,200	1,024.00	16,588,800	貸付株式数	200株
京三製作所	14,800	407.00	6,023,600		
能美防災	9,600	1,561.00	14,985,600		
ホーチキ	5,200	1,408.00	7,321,600		
星和電機	2,900	448.00	1,299,200		
エレコム	17,000	1,378.00	23,426,000		
パナソニック ホールディ ンク	844,300	1,210.00	1,021,603,000		
シャープ	85,900	960.00	82,464,000	貸付株式数	33,800株 (500株)
アンリツ	50,000	1,395.00	69,750,000		
富士通ゼネラル	20,200	3,110.00	62,822,000		
ソニーグループ	500,700	10,745.00	5,380,021,500		
T D K	113,200	4,645.00	525,814,000		
帝国通信工業	3,200	1,401.00	4,483,200	貸付株式数	300株
タムラ製作所	30,600	775.00	23,715,000	貸付株式数	11,600株
アルプスアルパイン	63,800	1,265.00	80,707,000		
池上通信機	2,100	535.00	1,123,500	貸付株式数	800株
日本電波工業	8,600	1,796.00	15,445,600	貸付株式数	2,300株
鈴木	4,100	884.00	3,624,400		
メイコー	7,800	2,824.00	22,027,200	貸付株式数	3,300株
日本トリム	1,600	2,461.00	3,937,600		
ローランド ディー . ジー .	4,000	2,960.00	11,840,000		
フオスタ - 電機	6,500	863.00	5,609,500		
S M K	1,700	2,372.00	4,032,400	貸付株式数	200株
ヨコオ	5,700	2,331.00	13,286,700	貸付株式数	2,100株
ティアック	10,800	120.00	1,296,000	貸付株式数	4,000株
ホシデン	17,100	1,582.00	27,052,200		
ヒロセ電機	11,800	17,690.00	208,742,000		
日本航空電子	14,700	2,202.00	32,369,400	貸付株式数	5,500株
T O A	8,100	783.00	6,342,300	貸付株式数	100株
マクセル	15,400	1,390.00	21,406,000		
古野電気	9,300	1,003.00	9,327,900		
スミダコーポレーション	6,500	1,456.00	9,464,000		
アイコム	2,700	2,679.00	7,233,300	貸付株式数	1,000株
リオン	2,900	1,911.00	5,541,900		
横河電機	78,000	2,387.00	186,186,000		
新電元工業	2,700	3,115.00	8,410,500		
アズビル	49,500	3,680.00	182,160,000		

東亜ディーケーケー	3,800	820.00	3,116,000	貸付株式数	1,500株
日本光電工業	32,500	3,195.00	103,837,500		
チノール	3,100	1,733.00	5,372,300	貸付株式数	700株
共和電業	8,400	362.00	3,040,800		
日本電子材料	4,700	1,446.00	6,796,200	貸付株式数	1,300株
堀場製作所	15,700	6,140.00	96,398,000		
アドバンテスト	55,800	9,390.00	523,962,000		
小野測器	3,800	393.00	1,493,400	貸付株式数	700株
エスベック	5,900	1,924.00	11,351,600		
キーエンス	70,800	55,350.00	3,918,780,000		
日置電機	3,700	6,520.00	24,124,000	貸付株式数	800株
シスメックス	61,000	8,523.00	519,903,000		
日本マイクロニクス	11,700	1,410.00	16,497,000		
メガチップス	5,800	2,566.00	14,882,800		
OBARA GROUP	3,300	3,530.00	11,649,000	貸付株式数	1,400株
IMAGICA GROUP	5,900	682.00	4,023,800		
澤藤電機	800	1,155.00	924,000	貸付株式数	300株
デンソー	146,000	7,006.00	1,022,876,000		
原田工業	3,100	844.00	2,616,400	貸付株式数	1,200株 (1,000株)
コーセル	9,300	969.00	9,011,700		
イリソ電子工業	6,500	4,385.00	28,502,500	貸付株式数	200株
オプテックスグループ	13,000	2,010.00	26,130,000		
千代田インテグレ	2,800	2,359.00	6,605,200		
レーザーテック	34,900	24,015.00	838,123,500		
スタンレー電気	50,400	2,658.00	133,963,200		
岩崎電気	2,200	2,354.00	5,178,800		
ウシオ電機	37,000	1,733.00	64,121,000		
岡谷電機	5,100	256.00	1,305,600	貸付株式数	2,100株
ヘリオステクノH	6,300	426.00	2,683,800	貸付株式数	2,500株
エノモト	1,800	1,736.00	3,124,800	貸付株式数	600株
日本セラミック	7,200	2,544.00	18,316,800		
遠藤照明	3,100	721.00	2,235,100		
古河電池	5,200	1,126.00	5,855,200	貸付株式数	2,200株
双信電機	2,800	402.00	1,125,600	貸付株式数	1,400株
山一電機	6,200	1,730.00	10,726,000		
図研	6,100	3,130.00	19,093,000	貸付株式数	1,700株
日本電子	17,700	3,995.00	70,711,500		
カシオ	52,600	1,319.00	69,379,400		

ファナック	69,400	20,600.00	1,429,640,000		
日本シイエムケイ	15,000	520.00	7,800,000	貸付株式数	700株
エンプラス	2,000	4,195.00	8,390,000		
大真空	8,700	745.00	6,481,500	貸付株式数	3,300株 (100株)
ローム	32,700	10,500.00	343,350,000		
浜松ホトニクス	56,800	6,880.00	390,784,000		
三井ハイテック	7,300	6,910.00	50,443,000	貸付株式数	100株
新光電気工業	25,100	3,650.00	91,615,000	貸付株式数	9,800株
京セラ	110,000	6,781.00	745,910,000		
協栄産業	700	1,810.00	1,267,000		
太陽誘電	34,500	4,135.00	142,657,500		
村田製作所	214,700	7,094.00	1,523,081,800		
双葉電子工業	12,800	548.00	7,014,400	貸付株式数	300株
日東電工	51,500	8,270.00	425,905,000		
北陸電気工業	2,500	1,259.00	3,147,500		
東海理化電機	20,000	1,444.00	28,880,000		
ニチコン	14,500	1,320.00	19,140,000	貸付株式数	5,600株
日本ケミコン	7,000	1,696.00	11,872,000		
K O A	10,700	2,021.00	21,624,700	貸付株式数	3,800株
三井E & S H D	21,700	391.00	8,484,700		
日立造船	58,600	867.00	50,806,200		
三菱重工業	125,000	5,412.00	676,500,000		
川崎重工業	53,400	3,165.00	169,011,000		
I H I	45,100	3,930.00	177,243,000		
名村造船所	18,100	417.00	7,547,700	貸付株式数	7,100株
サノヤスホールディングス	8,400	126.00	1,058,400	貸付株式数	3,800株
スプリックス	2,500	907.00	2,267,500		
マネジメントソリューションズ	4,000	3,885.00	15,540,000	貸付株式数	1,500株
プロレド・パートナーズ	1,800	498.00	896,400	貸付株式数	700株
AND FACTORY	2,100	359.00	753,900	貸付株式数	700株
テノ・ホールディングス	900	531.00	477,900	貸付株式数	300株
フロンティア・マネジメント	2,400	1,338.00	3,211,200		
ピアラ	1,200	623.00	747,600	貸付株式数	400株
コプロ・ホールディングス	1,200	995.00	1,194,000	貸付株式数	400株
ギークス	1,000	846.00	846,000	貸付株式数	500株
カーブスホールディングス	22,400	905.00	20,272,000	貸付株式数	6,100株

フォーラムエンジニアリング	4,100	854.00	3,501,400	
FAST FITNESS JAP	2,500	1,148.00	2,870,000	貸付株式数 500株
日本車輛	2,600	1,948.00	5,064,800	
三菱ロジスネクスト	11,200	826.00	9,251,200	貸付株式数 4,200株
近畿車輛	800	1,060.00	848,000	
一家ホールディングス	1,700	619.00	1,052,300	貸付株式数 600株
フルサト・マルカHD	7,400	3,590.00	26,566,000	貸付株式数 2,900株
ヤマエグループHD	4,200	1,450.00	6,090,000	
ジャパクラフトホールディ	2,400	647.00	1,552,800	貸付株式数 900株
FPG	28,200	1,160.00	32,712,000	
島根銀行	2,200	450.00	990,000	貸付株式数 800株
じもとホールディングス	4,500	393.00	1,768,500	
全国保証	18,200	5,030.00	91,546,000	貸付株式数 7,200株
めぶきフィナンシャルG	346,300	306.00	105,967,800	
ジャパンインベストメントA	5,700	1,211.00	6,902,700	貸付株式数 2,300株
東京きらぼしFG	8,900	2,329.00	20,728,100	
九州フィナンシャルG	122,800	407.00	49,979,600	
かんぼ生命保険	84,600	2,167.00	183,328,200	
ゆうちょ銀行	198,500	1,044.00	207,234,000	貸付株式数 72,300株
あんしん保証	3,400	256.00	870,400	貸付株式数 1,300株
富山第一銀行	17,200	534.00	9,184,800	
コンコルディア・フィナンシャル	384,800	488.00	187,782,400	
ジェイリース	2,300	2,910.00	6,693,000	貸付株式数 900株
西日本フィナンシャルHD	44,100	869.00	38,322,900	
イントラスト	2,700	800.00	2,160,000	
日本モーゲージサービス	3,900	864.00	3,369,600	貸付株式数 1,600株
Casa	2,700	867.00	2,340,900	貸付株式数 700株
アルヒ	5,300	1,000.00	5,300,000	
プレミアグループ	11,700	1,830.00	21,411,000	
日産自動車	1,005,500	450.70	453,178,850	
いすゞ自動車	205,800	1,690.00	347,802,000	
トヨタ自動車	3,886,700	1,910.00	7,423,597,000	
日野自動車	91,300	570.00	52,041,000	
三菱自動車工業	276,100	582.00	160,690,200	
エフテック	4,700	519.00	2,439,300	

レシップホールディングス	2,600	475.00	1,235,000	貸付株式数	1,100株
GMB	1,300	747.00	971,100	貸付株式数	500株
ファルテック	1,100	600.00	660,000	貸付株式数	200株
武蔵精密工業	17,300	1,682.00	29,098,600		
日産車体	12,400	836.00	10,366,400	貸付株式数	4,800株
新明和工業	22,100	1,039.00	22,961,900		
極東開発工業	12,400	1,366.00	16,938,400		
トピー工業	5,700	1,613.00	9,194,100		
ティラド	1,800	2,589.00	4,660,200		
タチエス	11,100	1,090.00	12,099,000		
N O K	27,400	1,194.00	32,715,600		
フタバ産業	18,700	351.00	6,563,700		
K Y B	6,800	3,335.00	22,678,000		
市光工業	10,200	381.00	3,886,200		
大同メタル工業	13,500	483.00	6,520,500		
プレス工業	31,000	425.00	13,175,000		
ミクニ	8,000	336.00	2,688,000	貸付株式数	3,100株
太平洋工業	16,200	1,056.00	17,107,200		
河西工業	9,200	144.00	1,324,800	貸付株式数	1,200株
アイシン	54,600	3,615.00	197,379,000		
マ ッ ダ	234,100	1,052.00	246,273,200		
今仙電機製作所	4,300	655.00	2,816,500	貸付株式数	1,500株
本田技研	575,400	3,218.00	1,851,637,200		
スズキ	130,000	4,632.00	602,160,000		
S U B A R U	224,000	2,237.00	501,088,000		
安永	3,000	697.00	2,091,000	貸付株式数	1,200株
ヤマハ発動機	111,300	3,255.00	362,281,500		
小糸製作所	85,200	2,023.00	172,359,600		
T B K	5,900	244.00	1,439,600		
エクセディ	11,500	1,615.00	18,572,500		
ミツバ	13,100	499.00	6,536,900		
豊田合成	20,700	2,144.00	44,380,800		
愛三工業	11,600	699.00	8,108,400		
盟和産業	900	930.00	837,000		
日本プラスト	5,200	431.00	2,241,200	貸付株式数	500株
ヨ ロ ズ	6,400	723.00	4,627,200	貸付株式数	200株
エフ・シー・シー	12,600	1,362.00	17,161,200	貸付株式数	4,500株
新家工業	1,600	2,228.00	3,564,800		
シマノ	29,000	22,020.00	638,580,000		
テイ・エス テック	32,400	1,570.00	50,868,000		

33FG	6,200	1,457.00	9,033,400	
第四北越フィナンシャルG	10,900	2,582.00	28,143,800	
ひろぎんHLDGS	91,600	623.00	57,066,800	
マーキュリアホールディングス	4,100	589.00	2,414,900	貸付株式数 800株
おきなわFG	6,600	2,075.00	13,695,000	
ダイレクトマーケティングミクス	8,400	1,469.00	12,339,600	
ポピンズ	1,100	1,602.00	1,762,200	貸付株式数 600株
LITALICO	5,700	2,363.00	13,469,100	
十六FG	9,000	2,640.00	23,760,000	
北國FHD	5,900	4,470.00	26,373,000	貸付株式数 1,000株
ネットプロHD	23,000	527.00	12,121,000	貸付株式数 6,800株
プロクレアホールディングス	8,500	2,091.00	17,773,500	
あいちフィナンシャルグル	9,900	2,152.00	21,304,800	
ジャムコ	3,800	1,618.00	6,148,400	貸付株式数 1,800株
小野建	6,800	1,452.00	9,873,600	
はるやまHLDGS	3,300	436.00	1,438,800	貸付株式数 1,200株
南陽	1,300	1,966.00	2,555,800	貸付株式数 500株
ノジマ	24,400	1,339.00	32,671,600	
佐鳥電機	4,600	1,360.00	6,256,000	
カッパ・クリエイト	11,700	1,373.00	16,064,100	貸付株式数 4,500株
エコートレーディング	1,500	648.00	972,000	貸付株式数 500株
伯東	4,300	4,125.00	17,737,500	
コンドーテック	5,600	983.00	5,504,800	貸付株式数 2,000株
中山福	3,700	325.00	1,202,500	貸付株式数 1,300株
ライトオン	5,600	604.00	3,382,400	貸付株式数 2,200株
ナガイレーベン	9,500	2,031.00	19,294,500	
三菱食品	6,900	3,160.00	21,804,000	
良品計画	96,600	1,479.00	142,871,400	
パリミキホールディングス	9,600	272.00	2,611,200	貸付株式数 3,600株
松田産業	5,700	2,356.00	13,429,200	
第一興商	14,500	3,975.00	57,637,500	
メディパルHD	77,300	1,742.00	134,656,600	
アドヴァングループ	7,100	871.00	6,184,100	貸付株式数 900株
SPK	3,200	1,394.00	4,460,800	
萩原電気HLDGS	2,800	2,473.00	6,924,400	
アルビス	2,500	2,375.00	5,937,500	貸付株式数 800株
アズワン	10,800	5,780.00	62,424,000	

スズデン	2,600	2,247.00	5,842,200		
尾家産業	1,800	910.00	1,638,000	貸付株式数	300株
シモジマ	5,000	945.00	4,725,000	貸付株式数	1,500株
ドウシシャ	7,800	1,569.00	12,238,200		
小津産業	1,600	1,470.00	2,352,000	貸付株式数	600株 (100株)
コナカ	8,400	334.00	2,805,600		
高速	3,800	1,748.00	6,642,400		
ハウス ローゼ	900	1,639.00	1,475,100	貸付株式数	300株
G - 7ホールディングス	9,300	1,512.00	14,061,600		
たけびし	2,700	1,536.00	4,147,200	貸付株式数	1,000株
イオン北海道	11,100	1,139.00	12,642,900	貸付株式数	4,600株
コジマ	14,400	601.00	8,654,400	貸付株式数	5,600株
ヒマラヤ	2,300	935.00	2,150,500	貸付株式数	900株
コーナン商事	10,100	3,315.00	33,481,500	貸付株式数	4,300株
ネットワンシステムズ	26,400	3,405.00	89,892,000		
エコス	2,700	1,828.00	4,935,600	貸付株式数	1,000株
ワタミ	9,000	1,033.00	9,297,000	貸付株式数	2,500株
マルシェ	2,500	395.00	987,500	貸付株式数	900株
リックス	1,900	2,210.00	4,199,000	貸付株式数	600株
システムソフト	24,400	96.00	2,342,400	貸付株式数	6,700株
パンパシフィックHD	168,000	2,342.00	393,456,000		
丸文	6,700	987.00	6,612,900		
西松屋チェーン	16,600	1,436.00	23,837,600	貸付株式数	6,500株
ゼンショーホールディングス	41,000	3,365.00	137,965,000	貸付株式数	13,500株
ハピネット	6,300	1,903.00	11,988,900		
幸楽苑ホールディングス	4,900	1,006.00	4,929,400	貸付株式数	1,900株
ハークスレイ	2,700	798.00	2,154,600	貸付株式数	1,000株
橋本総業HLDS	3,000	1,012.00	3,036,000		
日本ライフライン	22,000	940.00	20,680,000		
サイゼリヤ	12,500	2,947.00	36,837,500	貸付株式数	3,700株
タカショー	6,400	703.00	4,499,200	貸付株式数	2,500株
V Tホールディングス	28,400	503.00	14,285,200		
アルゴグラフィックス	6,500	3,835.00	24,927,500		
魚力	2,300	2,127.00	4,892,100	貸付株式数	800株
IDOM	22,600	701.00	15,842,600	貸付株式数	3,300株
日本エム・ディ・エム	4,300	961.00	4,132,300		
ポプラ	1,400	145.00	203,000	貸付株式数	700株
フジ・コーポレーション	4,100	1,330.00	5,453,000	貸付株式数	1,400株

ユナイテッドアローズ	8,000	1,803.00	14,424,000	貸付株式数	2,800株
進和	4,900	1,978.00	9,692,200	貸付株式数	1,700株
エスケイジャパン	1,800	532.00	957,600		
ダイترون	2,900	2,382.00	6,907,800		
ハイデイ日高	11,100	1,954.00	21,689,400	貸付株式数	3,000株
シークス	10,700	1,367.00	14,626,900	貸付株式数	4,100株
YU - WA C R E A T I O N H	4,600	200.00	920,000	貸付株式数	500株
コロワイド	34,500	1,766.00	60,927,000	貸付株式数	13,500株 (2,200株)
ピーシーデポコーポ	8,200	271.00	2,222,200	貸付株式数	3,100株
田中商事	2,100	568.00	1,192,800	貸付株式数	500株
オーハシテクニカ	3,700	1,399.00	5,176,300	貸付株式数	1,400株
壱番屋	5,900	4,590.00	27,081,000	貸付株式数	2,300株
白銅	2,700	2,472.00	6,674,400	貸付株式数	1,000株
トップカルチャー	2,800	196.00	548,800	貸付株式数	700株
P L A N T	1,400	632.00	884,800	貸付株式数	100株
スギホールディングス	15,100	6,250.00	94,375,000		
ダイコー通産	700	1,061.00	742,700	貸付株式数	200株
薬王堂ホールディングス	4,200	2,665.00	11,193,000	貸付株式数	1,500株
島津製作所	86,100	3,915.00	337,081,500		
J M S	7,200	518.00	3,729,600		
クボテック	2,400	211.00	506,400	貸付株式数	600株
長野計器	5,300	1,117.00	5,920,100		
ブイ・テクノロジー	3,600	2,657.00	9,565,200		
スター精密	13,200	1,700.00	22,440,000		
東京計器	5,600	1,285.00	7,196,000	貸付株式数	2,100株
愛知時計	2,700	1,351.00	3,647,700		
インターアクション	4,300	1,571.00	6,755,300	貸付株式数	1,500株 (100株)
オーバル	6,300	479.00	3,017,700	貸付株式数	2,900株
東京精密	15,500	4,500.00	69,750,000		
マニー	31,000	2,193.00	67,983,000	貸付株式数	10,500株
ニコン	110,000	1,235.00	135,850,000		
トプコン	37,100	1,552.00	57,579,200		
オリンパス	442,400	2,576.00	1,139,622,400		
理研計器	4,400	4,625.00	20,350,000	貸付株式数	2,100株
S C R E E Nホールディン グス	12,100	9,050.00	109,505,000		
キヤノン電子	7,600	1,554.00	11,810,400		

タムロン	5,300	3,405.00	18,046,500	
HOYA	152,900	13,580.00	2,076,382,000	
シード	4,300	490.00	2,107,000	貸付株式数 600株
ノーリツ鋼機	6,700	2,768.00	18,545,600	
A & D ホロンホールディングス	10,400	1,037.00	10,784,800	
朝日インテック	93,400	2,348.00	219,303,200	
キヤノン	388,200	3,045.00	1,182,069,000	
リコー	182,400	1,030.00	187,872,000	
シチズン時計	77,800	586.00	45,590,800	
リズム	2,200	1,706.00	3,753,200	
大研医器	6,700	451.00	3,021,700	貸付株式数 2,100株
メニコン	24,300	2,875.00	69,862,500	
シンシア	700	552.00	386,400	貸付株式数 200株
KYORITSU	10,100	122.00	1,232,200	
中本パックス	2,100	1,570.00	3,297,000	貸付株式数 700株
スノーピーク	12,100	2,222.00	26,886,200	貸付株式数 4,700株 (100株)
パラマウントベッドHD	16,300	2,531.00	41,255,300	貸付株式数 6,000株
トランザクション	5,400	1,201.00	6,485,400	貸付株式数 2,100株
粧美堂	2,000	357.00	714,000	貸付株式数 700株
ニホンフラッシュ	6,500	881.00	5,726,500	貸付株式数 900株
前田工織	7,700	3,030.00	23,331,000	貸付株式数 2,700株
永大産業	7,600	222.00	1,687,200	
アートネイチャー	7,200	768.00	5,529,600	貸付株式数 300株
バンダイナムコHLDGS	64,700	8,710.00	563,537,000	
アイフィスジャパン	2,000	609.00	1,218,000	貸付株式数 700株
SHOEI	7,500	5,450.00	40,875,000	
フランスベッドHLDGS	8,500	926.00	7,871,000	貸付株式数 3,400株
マーベラス	11,500	667.00	7,670,500	
パイロットコーポレーション	11,100	4,740.00	52,614,000	
萩原工業	4,600	1,213.00	5,579,800	貸付株式数 1,600株
エイベックス	12,100	1,602.00	19,384,200	貸付株式数 4,500株
フジシールインターナショナル	14,300	1,740.00	24,882,000	貸付株式数 4,500株
タカラトミー	32,700	1,274.00	41,659,800	貸付株式数 3,000株
広済堂ホールディングス	4,700	2,103.00	9,884,100	
エステールホールディングス	1,600	639.00	1,022,400	貸付株式数 700株

レック	10,000	861.00	8,610,000		
タカノ	2,600	671.00	1,744,600	貸付株式数	1,000株
三光合成	10,100	459.00	4,635,900	貸付株式数	500株
プロネクサス	5,700	951.00	5,420,700	貸付株式数	2,300株
ホクシン	5,400	157.00	847,800	貸付株式数	2,000株
ウッドワン	2,300	895.00	2,058,500	貸付株式数	600株
大建工業	4,200	2,144.00	9,004,800		
きもと	10,200	228.00	2,325,600		
凸版印刷	92,600	2,076.00	192,237,600		
大日本印刷	84,000	2,751.00	231,084,000		
共同印刷	2,000	2,756.00	5,512,000	貸付株式数	500株
N I S S H A	13,500	1,867.00	25,204,500		
光村印刷	600	1,173.00	703,800	貸付株式数	200株
藤森工業	5,600	3,160.00	17,696,000		
ヴィア・ホールディングス	10,200	98.00	999,600	貸付株式数	3,800株
TAKARA & COMPANY	4,800	2,137.00	10,257,600	貸付株式数	1,700株
前澤化成工業	4,400	1,377.00	6,058,800	貸付株式数	1,700株
未来工業	2,500	1,449.00	3,622,500		
アシックス	65,300	2,986.00	194,985,800		
ツツミ	1,600	1,919.00	3,070,400	貸付株式数	700株
ウェーブロックHLDGS	3,200	646.00	2,067,200	貸付株式数	1,200株
ジェイエスピー	4,900	1,484.00	7,271,600	貸付株式数	1,400株
ニチハ	8,900	2,710.00	24,119,000		
ローランド	5,200	3,900.00	20,280,000		
エフピコ	13,400	3,575.00	47,905,000		
小松ウオール工業	2,500	1,826.00	4,565,000		
ヤマハ	44,700	5,190.00	231,993,000		
河合楽器	1,900	2,579.00	4,900,100	貸付株式数	400株
クリナップ	7,800	664.00	5,179,200		
ビジョン	45,100	2,144.00	96,694,400	貸付株式数	300株
天馬	6,300	2,070.00	13,041,000		
兼松サステック	500	1,576.00	788,000	貸付株式数	100株
キングジム	6,100	882.00	5,380,200	貸付株式数	2,200株
象印マホービン	20,900	1,667.00	34,840,300		
リンテック	14,900	2,224.00	33,137,600		
信越ポリマー	13,100	1,204.00	15,772,400		
東リ	15,800	224.00	3,539,200		
イトーキ	14,100	563.00	7,938,300		
任天堂	446,900	5,592.00	2,499,064,800	貸付株式数	175,600株

三菱鉛筆	10,000	1,399.00	13,990,000	
松 風	3,200	2,354.00	7,532,800	貸付株式数 1,200株
タカラスタンダ - ド	13,500	1,350.00	18,225,000	貸付株式数 100株
コ ク ヨ	34,100	1,861.00	63,460,100	
ナカバヤシ	7,300	488.00	3,562,400	貸付株式数 1,000株
ニ フ コ	25,400	3,370.00	85,598,000	
立川ブラインド	3,200	1,160.00	3,712,000	貸付株式数 1,200株
グロープライド	5,700	2,661.00	15,167,700	
オカムラ	21,300	1,380.00	29,394,000	
バルカー	6,400	2,673.00	17,107,200	
MUTOHホールディングス	900	1,761.00	1,584,900	貸付株式数 300株
伊 藤 忠	461,600	4,236.00	1,955,337,600	
丸 紅	591,000	1,549.50	915,754,500	
スクロール	11,100	716.00	7,947,600	
高 島	1,300	2,860.00	3,718,000	
ヨンドシーホールディングス	6,400	1,720.00	11,008,000	貸付株式数 2,400株
三陽商会	2,600	1,223.00	3,179,800	貸付株式数 700株
長瀬産業	34,900	2,022.00	70,567,800	
ナイガイ	2,300	259.00	595,700	貸付株式数 900株
蝶 理	4,200	2,076.00	8,719,200	
豊田通商	65,600	5,200.00	341,120,000	
オンワ - ドホールディングス	45,900	315.00	14,458,500	
三共生興	10,500	469.00	4,924,500	
兼 松	29,000	1,509.00	43,761,000	
美 津 濃	7,000	2,857.00	19,999,000	
ツカモトコーポレーション	1,000	1,394.00	1,394,000	貸付株式数 400株
ルックホールディングス	2,000	2,617.00	5,234,000	貸付株式数 800株
三井物産	548,000	3,973.00	2,177,204,000	
日本紙パルプ	4,000	4,935.00	19,740,000	
東京エレクトロン	49,900	43,110.00	2,151,189,000	
カメイ	7,800	1,206.00	9,406,800	貸付株式数 100株
東都水産	400	5,220.00	2,088,000	貸付株式数 100株
OUGホールディングス	1,100	2,382.00	2,620,200	貸付株式数 400株
スターゼン	5,600	2,077.00	11,631,200	
セイコーグループ	11,000	3,025.00	33,275,000	
山 善	20,000	1,006.00	20,120,000	貸付株式数 11,600株
椿本興業	1,300	3,900.00	5,070,000	貸付株式数 400株

住友商事	463,800	2,233.50	1,035,897,300	
B I P R O G Y	26,100	3,385.00	88,348,500	
内田洋行	3,300	4,480.00	14,784,000	
三菱商事	468,300	4,374.00	2,048,344,200	
第一実業	2,600	4,300.00	11,180,000	
キャノンマーケティングJ P N	17,300	3,050.00	52,765,000	
西華産業	2,800	1,582.00	4,429,600	
佐藤商事	5,000	1,206.00	6,030,000	
菱洋エレクトロ	6,300	2,384.00	15,019,200	貸付株式数 2,500株 (800株)
東京産業	6,700	766.00	5,132,200	貸付株式数 200株
ユアサ商事	6,700	3,585.00	24,019,500	
神鋼商事	1,900	4,610.00	8,759,000	
トルク	7,100	214.00	1,519,400	貸付株式数 1,100株
阪和興業	13,500	3,680.00	49,680,000	
正栄食品	5,000	3,770.00	18,850,000	貸付株式数 1,900株
カナデン	5,900	1,132.00	6,678,800	貸付株式数 2,200株
菱電商事	5,900	1,683.00	9,929,700	貸付株式数 2,300株
ニプロ	58,800	1,028.00	60,446,400	
岩谷産業	17,000	5,860.00	99,620,000	
ナイス	2,500	1,410.00	3,525,000	
ニチモウ	800	2,747.00	2,197,600	
極東貿易	4,400	1,366.00	6,010,400	貸付株式数 400株
アステナホールディングス	13,200	438.00	5,781,600	貸付株式数 5,100株
兼松エレクトロニクス	4,600	4,350.00	20,010,000	
三愛オブリ	20,600	1,228.00	25,296,800	貸付株式数 1,000株
稲畑産業	15,100	2,356.00	35,575,600	
G S I クレオス	4,300	1,444.00	6,209,200	貸付株式数 1,400株
明和産業	9,900	672.00	6,652,800	貸付株式数 3,900株
クワザワホールディングス	2,400	411.00	986,400	貸付株式数 1,000株
ゴ - ルドウイン	12,600	9,590.00	120,834,000	
ユニ・チャ - ム	147,900	5,220.00	772,038,000	
デサント	12,200	3,120.00	38,064,000	
キ ン グ	2,900	488.00	1,415,200	貸付株式数 1,400株
ワ キ タ	13,700	1,191.00	16,316,700	
ヤマトインタ - ナショナル	4,800	245.00	1,176,000	貸付株式数 2,300株
東邦ホールディングス	18,400	2,128.00	39,155,200	
サンゲツ	18,800	2,155.00	40,514,000	
ミツウロコグループ	9,500	1,141.00	10,839,500	

シナネンホールディングス	2,400	3,710.00	8,904,000	
伊藤忠エネクス	18,400	1,012.00	18,620,800	
サンリオ	21,200	4,510.00	95,612,000	貸付株式数 500株
サンワ テクノス	3,800	1,522.00	5,783,600	
リョーサン	7,900	2,926.00	23,115,400	
新光商事	9,900	1,234.00	12,216,600	
トーホー	3,200	1,725.00	5,520,000	貸付株式数 1,200株
三信電気	3,000	2,386.00	7,158,000	
東陽テクニカ	8,700	1,358.00	11,814,600	
モスフード サービス	11,000	3,090.00	33,990,000	貸付株式数 3,600株
加賀電子	6,100	4,165.00	25,406,500	
三益半導体	6,600	2,535.00	16,731,000	
都築電気	3,700	1,270.00	4,699,000	
ソーダニツカ	5,900	629.00	3,711,100	
立花エレテック	5,300	1,784.00	9,455,200	貸付株式数 1,800株
木曽路	11,300	2,087.00	23,583,100	貸付株式数 1,200株
S R S ホールディングス	12,400	862.00	10,688,800	貸付株式数 4,300株 (1,100株)
千 趣 会	13,800	398.00	5,492,400	貸付株式数 5,300株
タカキュー	6,100	78.00	475,800	貸付株式数 2,200株
リテールパートナーズ	11,100	1,272.00	14,119,200	貸付株式数 3,700株
ケーヨー	12,000	893.00	10,716,000	
上新電機	6,600	1,911.00	12,612,600	貸付株式数 2,000株
日本瓦斯	40,100	2,088.00	83,728,800	
ロイヤルホールディングス	14,500	2,420.00	35,090,000	貸付株式数 5,600株
東 天 紅	600	792.00	475,200	貸付株式数 100株
いなげや	7,200	1,170.00	8,424,000	貸付株式数 2,900株
チヨダ	7,300	759.00	5,540,700	貸付株式数 2,500株
ライフコーポレーション	6,500	2,575.00	16,737,500	
リンガーハット	9,700	2,214.00	21,475,800	貸付株式数 3,500株
M r M a x H D	10,600	661.00	7,006,600	
テンアライド	7,800	258.00	2,012,400	貸付株式数 3,100株
A O K I ホールディングス	13,800	671.00	9,259,800	貸付株式数 2,400株
オークワ	11,600	917.00	10,637,200	
コメリ	11,500	2,627.00	30,210,500	
青山商事	15,900	857.00	13,626,300	貸付株式数 100株
しまむら	8,800	12,630.00	111,144,000	
はせがわ	3,700	344.00	1,272,800	
高 島 屋	56,500	1,729.00	97,688,500	
松 屋	12,700	1,007.00	12,788,900	貸付株式数 1,700株

エイチ・ツー・オーリテイ リング	36,500	1,194.00	43,581,000	貸付株式数	12,100株
近鉄百貨店	2,400	2,492.00	5,980,800	貸付株式数	900株
丸井グループ	55,300	2,243.00	124,037,900		
クレディセゾン	44,100	1,705.00	75,190,500		
アクシアル リテイリング	5,100	3,315.00	16,906,500	貸付株式数	1,700株
井筒屋	3,500	418.00	1,463,000	貸付株式数	1,300株
イオン	253,800	2,804.00	711,655,200		
イズミ	11,400	2,934.00	33,447,600	貸付株式数	1,300株
フォーバル	2,800	976.00	2,732,800	貸付株式数	1,000株
平和堂	12,400	2,082.00	25,816,800	貸付株式数	5,200株
フジ	11,500	1,821.00	20,941,500	貸付株式数	6,500株
ヤオコー	8,500	6,810.00	57,885,000	貸付株式数	3,300株
ゼビオホールディングス	10,100	921.00	9,302,100		
ケーズホールディングス	59,500	1,114.00	66,283,000		
PALTA C	11,800	4,425.00	52,215,000	貸付株式数	100株
三谷産業	12,700	311.00	3,949,700	貸付株式数	4,500株
OLYMPICグループ	2,400	514.00	1,233,600	貸付株式数	900株
日産東京販売HD	8,900	296.00	2,634,400		
新生銀行	20,600	2,183.00	44,969,800		
あおぞら銀行	44,000	2,570.00	113,080,000		
三菱UFJフィナンシャル G	4,570,500	772.20	3,529,340,100	貸付株式数	1,740,200株
りそなホールディングス	889,600	650.90	579,040,640		
三井住友トラストHD	129,200	4,278.00	552,717,600		
三井住友フィナンシャルG	509,400	4,721.00	2,404,877,400		
千葉銀行	194,700	866.00	168,610,200		
群馬銀行	135,300	449.00	60,749,700		
武蔵野銀行	8,900	1,895.00	16,865,500		
千葉興業銀行	16,100	407.00	6,552,700	貸付株式数	2,000株
筑波銀行	30,500	200.00	6,100,000		
七十七銀行	22,300	1,933.00	43,105,900		
秋田銀行	4,600	1,774.00	8,160,400		
山形銀行	7,600	1,150.00	8,740,000	貸付株式数	300株
岩手銀行	4,700	1,899.00	8,925,300	貸付株式数	300株
東邦銀行	54,500	208.00	11,336,000	貸付株式数	800株
東北銀行	3,300	980.00	3,234,000		
ふくおかフィナンシャルG	55,700	2,742.00	152,729,400		
スルガ銀行	63,000	411.00	25,893,000		

八十二銀行	142,600	506.00	72,155,600		
山梨中央銀行	7,100	1,056.00	7,497,600	貸付株式数	800株
大垣共立銀行	13,200	1,728.00	22,809,600		
福井銀行	6,200	1,417.00	8,785,400		
清水銀行	2,600	1,479.00	3,845,400		
富山銀行	1,000	1,650.00	1,650,000	貸付株式数	400株
滋賀銀行	11,600	2,534.00	29,394,400	貸付株式数	1,200株
南都銀行	10,400	2,313.00	24,055,200	貸付株式数	100株
百五銀行	66,000	341.00	22,506,000		
京都銀行	22,100	5,420.00	119,782,000		
紀陽銀行	25,000	1,426.00	35,650,000	貸付株式数	9,200株
ほくほくフィナンシャルG	44,200	880.00	38,896,000		
山陰合同銀行	43,600	723.00	31,522,800	貸付株式数	900株
鳥取銀行	2,200	1,095.00	2,409,000		
百十四銀行	6,300	1,749.00	11,018,700		
四国銀行	10,900	894.00	9,744,600	貸付株式数	3,800株
阿波銀行	10,300	1,972.00	20,311,600		
大分銀行	4,100	1,870.00	7,667,000		
宮崎銀行	4,600	2,271.00	10,446,600		
佐賀銀行	4,000	1,568.00	6,272,000	貸付株式数	200株
琉球銀行	15,800	822.00	12,987,600		
セブン銀行	251,100	259.00	65,034,900		
みずほフィナンシャルG	1,008,200	1,698.50	1,712,427,700		
高知銀行	2,100	662.00	1,390,200	貸付株式数	100株
山口フィナンシャルG	77,000	787.00	60,599,000		
芙蓉総合リース	6,400	8,570.00	54,848,000		
みずほリース	10,400	3,295.00	34,268,000	貸付株式数	4,000株
東京センチュリー	13,000	4,550.00	59,150,000	貸付株式数	4,800株
SBIホールディングス	100,900	2,594.00	261,734,600		
日本証券金融	27,800	1,089.00	30,274,200		
アイフル	115,600	408.00	47,164,800		
日本アジア投資	5,700	231.00	1,316,700	貸付株式数	2,200株
長野銀行	2,100	1,224.00	2,570,400	貸付株式数	700株
名古屋銀行	4,600	3,115.00	14,329,000		
北洋銀行	105,900	233.00	24,674,700		
大光銀行	2,000	1,137.00	2,274,000	貸付株式数	300株
愛媛銀行	9,300	855.00	7,951,500		
トマト銀行	2,100	994.00	2,087,400		
京葉銀行	32,500	537.00	17,452,500		
栃木銀行	31,800	294.00	9,349,200		

北日本銀行	2,300	1,898.00	4,365,400	貸付株式数	300株
東和銀行	12,700	527.00	6,692,900		
福島銀行	6,900	215.00	1,483,500		
大東銀行	2,600	630.00	1,638,000	貸付株式数	200株
リコーリース	6,600	3,660.00	24,156,000		
イオンフィナンシャルサー ビス	40,000	1,418.00	56,720,000	貸付株式数	15,400株
アコム	124,100	315.00	39,091,500		
ジャックス	7,400	4,160.00	30,784,000		
オリコ	18,200	1,152.00	20,966,400		
オリックス	466,400	2,157.50	1,006,258,000		
三菱HCキャピタル	271,500	642.00	174,303,000		
ジャフコグループ	23,300	2,335.00	54,405,500		
九州リースサービス	3,500	677.00	2,369,500	貸付株式数	1,300株
トモニホールディングス	56,600	339.00	19,187,400		
大和証券G本社	490,800	573.00	281,228,400		
野村ホールディングス	1,283,600	477.30	612,662,280		
岡三証券グループ	61,400	381.00	23,393,400	貸付株式数	20,900株
丸三証券	23,200	401.00	9,303,200	貸付株式数	1,600株
東洋証券	23,100	275.00	6,352,500		
東海東京HD	75,900	348.00	26,413,200		
光世証券	2,100	375.00	787,500	貸付株式数	500株
水戸証券	19,200	214.00	4,108,800		
いちよし証券	12,800	620.00	7,936,000	貸付株式数	100株
松井証券	41,100	771.00	31,688,100		
SOMPOホールディング ス	119,700	5,656.00	677,023,200		
日本取引所グループ	196,000	1,888.50	370,146,000		
マネックスG	77,900	411.00	32,016,900	貸付株式数	30,600株
極東証券	8,900	584.00	5,197,600	貸付株式数	3,000株
岩井コスモホールディング	8,000	1,268.00	10,144,000		
アイザワ証券グループ	10,000	695.00	6,950,000		
フィデアホール	7,200	1,327.00	9,554,400		
池田泉州HD	88,500	228.00	20,178,000		
アニコムホールディング ス	23,600	607.00	14,325,200	貸付株式数	400株
MS&AD	157,200	4,001.00	628,957,200		
マネーパートナーズGP	7,400	274.00	2,027,600		
スパークス・グループ	7,800	1,730.00	13,494,000		
小林洋行	3,700	223.00	825,100	貸付株式数	700株

第一生命HLDGS	355,000	2,637.00	936,135,000		
東京海上HD	702,000	2,814.00	1,975,428,000		
アドバンテッジリスクマネ	3,400	396.00	1,346,400		
イー・ギャランティ	11,300	2,252.00	25,447,600	貸付株式数	4,400株
アサックス	3,400	626.00	2,128,400	貸付株式数	1,500株
NECキャピタルソリューション	3,500	2,065.00	7,227,500		
T&Dホールディングス	187,100	1,637.00	306,282,700		
アドバンスクリエイト	4,100	1,077.00	4,415,700	貸付株式数	1,100株
三井不動産	303,000	2,591.50	785,224,500		
三菱地所	442,100	1,797.50	794,674,750		
平和不動産	11,300	3,965.00	44,804,500		
東京建物	66,500	1,834.00	121,961,000		
京阪神ビルディング	8,800	1,279.00	11,255,200		
住友不動産	126,100	3,372.00	425,209,200		
太平洋興発	2,600	807.00	2,098,200		
テーオーシー	12,700	680.00	8,636,000	貸付株式数	3,400株
東京楽天地	1,200	4,185.00	5,022,000	貸付株式数	400株
スターツコーポレーション	10,000	2,690.00	26,900,000		
フジ住宅	9,500	655.00	6,222,500		
空港施設	8,200	522.00	4,280,400		
明和地所	3,400	709.00	2,410,600		
ゴールドクレスト	6,500	1,733.00	11,264,500		
リログループ	40,500	2,178.00	88,209,000	貸付株式数	200株
エスリード	3,200	1,870.00	5,984,000		
日神グループHLDGS	11,000	442.00	4,862,000	貸付株式数	4,400株
日本エスコ	15,700	830.00	13,031,000	貸付株式数	4,900株
MIRARTHホールディング	34,800	381.00	13,258,800		
AVANTIA	3,400	789.00	2,682,600	貸付株式数	600株
イオンモール	36,100	1,725.00	62,272,500		
毎日コムネット	2,500	702.00	1,755,000	貸付株式数	900株
ファースト住建	2,700	1,013.00	2,735,100	貸付株式数	1,100株
ランド	417,700	10.00	4,177,000	貸付株式数	133,800株
カチタス	18,800	3,025.00	56,870,000		
東祥	5,100	1,161.00	5,921,100	貸付株式数	1,500株
トーセイ	11,500	1,436.00	16,514,000	貸付株式数	3,600株
穴吹興産	1,600	1,990.00	3,184,000	貸付株式数	600株
サンフロンティア不動産	11,600	1,140.00	13,224,000		
インテリックス	1,700	522.00	887,400	貸付株式数	600株

ランドビジネス	2,400	225.00	540,000	貸付株式数	1,000株
サンネクスタグループ	2,200	967.00	2,127,400	貸付株式数	900株
グランディハウス	5,700	562.00	3,203,400		
東武鉄道	77,800	3,175.00	247,015,000		
相鉄ホールディングス	23,300	2,177.00	50,724,100		
東急	198,500	1,679.00	333,281,500		
京浜急行	80,300	1,363.00	109,448,900	貸付株式数	9,700株
小田急電鉄	107,300	1,745.00	187,238,500		
京王電鉄	37,400	4,980.00	186,252,000		
京成電鉄	45,700	3,795.00	173,431,500		
富士急行	8,700	4,905.00	42,673,500	貸付株式数	3,400株
東日本旅客鉄道	120,000	7,639.00	916,680,000		
西日本旅客鉄道	90,400	5,745.00	519,348,000		
東海旅客鉄道	54,500	16,445.00	896,252,500		
西武ホールディングス	85,600	1,410.00	120,696,000		
鴻池運輸	12,000	1,572.00	18,864,000		
西日本鉄道	18,900	2,601.00	49,158,900		
ハマキョウレックス	5,500	3,295.00	18,122,500		
サカイ引越センター	3,400	4,510.00	15,334,000	貸付株式数	1,200株
近鉄グループHLDGS	70,700	4,480.00	316,736,000		
阪急阪神HLDGS	94,200	4,060.00	382,452,000		
南海電鉄	33,700	2,871.00	96,752,700	貸付株式数	11,500株
京阪ホールディングス	29,200	3,500.00	102,200,000		
神戸電鉄	2,000	3,185.00	6,370,000	貸付株式数	700株
名古屋鉄道	78,100	2,219.00	173,303,900		
山陽電鉄	5,300	2,112.00	11,193,600	貸付株式数	600株
アルプス物流	5,600	1,147.00	6,423,200		
トランコム	2,100	7,700.00	16,170,000	貸付株式数	500株
ヤマトホールディングス	90,500	2,270.00	205,435,000		
山 九	18,000	4,910.00	88,380,000		
日 新	5,300	2,049.00	10,859,700		
丸 運	3,600	215.00	774,000	貸付株式数	1,400株
丸全昭和運輸	4,300	3,075.00	13,222,500	貸付株式数	1,500株
センコーグループHLDGS	37,400	979.00	36,614,600	貸付株式数	3,500株
トナミホールディングス	1,500	3,705.00	5,557,500		
ニッコンホールディングス	22,600	2,392.00	54,059,200		
日石輸送	700	2,200.00	1,540,000	貸付株式数	200株
福山通運	5,900	3,305.00	19,499,500		
セイノーホールディングス	43,900	1,196.00	52,504,400	貸付株式数	6,500株

エスライン	2,000	837.00	1,674,000	貸付株式数	700株
神奈川中央交通	2,000	3,275.00	6,550,000	貸付株式数	100株
A Z - C O M丸和ホール ディ	17,100	1,553.00	26,556,300	貸付株式数	2,600株
C & F ロジホールディング ス	6,800	1,182.00	8,037,600	貸付株式数	800株
日本郵船	189,100	3,142.00	594,152,200	貸付株式数	24,200株
商船三井	124,600	3,345.00	416,787,000	貸付株式数	48,900株
川崎汽船	60,200	2,685.00	161,637,000	貸付株式数	23,600株
N S ユナイテッド海運	3,800	3,820.00	14,516,000		
明治海運	6,900	719.00	4,961,100	貸付株式数	3,000株
飯野海運	25,900	922.00	23,879,800		
共栄タンカー	1,300	936.00	1,216,800	貸付株式数	500株
九州旅客鉄道	49,900	2,924.00	145,907,600		
S G ホールディングス	135,700	2,022.00	274,385,400		
N I P P O N E X P R E S S	26,400	7,900.00	208,560,000		
日本航空	173,600	2,712.00	470,803,200		
A N A ホールディングス	192,300	2,883.00	554,400,900		
ビーウィズ	2,100	1,114.00	2,339,400	貸付株式数	800株 (300株)
パスコ	1,400	1,350.00	1,890,000	貸付株式数	400株
T R E ホールディングス	15,300	1,501.00	22,965,300	貸付株式数	4,600株
人・夢・技術グループ	3,200	1,869.00	5,980,800	貸付株式数	100株
西本W I S M E T T A C H D	1,900	3,605.00	6,849,500	貸付株式数	700株
シルバーライフ	1,700	1,869.00	3,177,300	貸付株式数	600株
ヤマシタヘルスケアH L D G S	800	1,603.00	1,282,400	貸付株式数	200株
G E N K Y D R U G S T O R E S	3,700	3,435.00	12,709,500	貸付株式数	1,400株
コア商事H L D G S	5,200	606.00	3,151,200		
K P P グループホールディ ン	17,400	831.00	14,459,400	貸付株式数	5,500株
ナルミヤ・インターナショ ナル	1,200	871.00	1,045,200	貸付株式数	600株
ブックオフG H D	4,500	1,350.00	6,075,000	貸付株式数	1,800株
ギフトホールディングス	1,600	4,060.00	6,496,000	貸付株式数	400株
三菱倉庫	15,200	3,210.00	48,792,000		
三井倉庫H O L D	6,600	3,680.00	24,288,000		

住友倉庫	19,400	1,980.00	38,412,000	貸付株式数	7,600株
渋沢倉庫	2,800	2,074.00	5,807,200	貸付株式数	600株
ヤマタネ	3,300	1,673.00	5,520,900	貸付株式数	1,100株
東陽倉庫	9,200	251.00	2,309,200	貸付株式数	3,200株
乾汽船	9,000	1,959.00	17,631,000	貸付株式数	3,500株
日本トランスシティ	14,200	511.00	7,256,200		
ケイヒン	1,200	1,452.00	1,742,400		
中央倉庫	3,300	943.00	3,111,900	貸付株式数	1,400株
川西倉庫	1,200	991.00	1,189,200	貸付株式数	400株
安田倉庫	4,800	927.00	4,449,600		
ファイズホールディングス	1,300	949.00	1,233,700		
東洋埠頭	2,000	1,313.00	2,626,000		
上組	35,100	2,770.00	97,227,000		
サンリツ	1,500	710.00	1,065,000		
キムラユニティー	3,300	766.00	2,527,800	貸付株式数	400株
キューソー流通システム	4,200	996.00	4,183,200	貸付株式数	1,500株
東海運	4,100	279.00	1,143,900	貸付株式数	1,400株
エーアイテイー	4,400	1,440.00	6,336,000	貸付株式数	1,600株
内外トランスライン	2,600	2,250.00	5,850,000	貸付株式数	1,000株
ショーエイコーポ	2,800	552.00	1,545,600	貸付株式数	900株
日本コンセプト	2,200	1,619.00	3,561,800	貸付株式数	700株
TBSホールディングス	36,300	1,524.00	55,321,200		
日本テレビHLD S	63,000	1,036.00	65,268,000		
朝日放送グループHD	6,700	627.00	4,200,900	貸付株式数	2,600株
テレビ朝日HD	17,200	1,332.00	22,910,400		
スカパーJ S A T H D	63,300	478.00	30,257,400		
テレビ東京HD	5,100	1,814.00	9,251,400		
日本BS放送	2,500	905.00	2,262,500	貸付株式数	900株
ビジョン	9,300	1,305.00	12,136,500	貸付株式数	3,600株
スマートバリュー	1,700	476.00	809,200	貸付株式数	600株
USEN-NEXT H L D G S	6,400	2,118.00	13,555,200	貸付株式数	2,500株
ワイヤレスゲート	3,200	270.00	864,000	貸付株式数	1,200株 (100株)
コネクシオ	4,700	1,223.00	5,748,100		
日本通信	65,300	216.00	14,104,800	貸付株式数	25,800株
クロップス	1,100	1,002.00	1,102,200		
日本電信電話	909,700	3,756.00	3,416,833,200		
KDDI	548,600	4,026.00	2,208,663,600		
ソフトバンク	1,140,300	1,486.00	1,694,485,800		

光通信	8,300	17,530.00	145,499,000	
エムティーアイ	6,400	522.00	3,340,800	貸付株式数 1,400株
GMOインターネットグループ	26,400	2,469.00	65,181,600	
ファイバーゲート	3,800	907.00	3,446,600	貸付株式数 1,400株 (100株)
アйдママーケティングコム	1,600	276.00	441,600	貸付株式数 600株
KADOKAWA	37,600	2,584.00	97,158,400	
学研ホールディングス	11,800	938.00	11,068,400	貸付株式数 2,600株
ゼンリン	12,100	836.00	10,115,600	貸付株式数 100株
昭文社ホールディングス	3,000	290.00	870,000	貸付株式数 1,300株
インプレスホールディングス	6,200	211.00	1,308,200	
東京電力HD	638,000	498.00	317,724,000	
中部電力	260,700	1,295.00	337,606,500	
関西電力	273,200	1,161.00	317,185,200	
中国電力	112,800	638.00	71,966,400	
北陸電力	66,500	535.00	35,577,500	
東北電力	172,900	664.00	114,805,600	
四国電力	60,400	726.00	43,850,400	
九州電力	163,300	699.00	114,146,700	
北海道電力	68,300	442.00	30,188,600	
沖縄電力	16,500	1,012.00	16,698,000	
電源開発	53,300	2,088.00	111,290,400	
エフオン	5,100	511.00	2,606,100	
イーレックス	12,600	2,393.00	30,151,800	貸付株式数 4,000株
レノバ	18,800	2,600.00	48,880,000	貸付株式数 7,200株
東京瓦斯	149,700	2,527.00	378,291,900	
大阪瓦斯	143,500	2,096.00	300,776,000	
東邦瓦斯	27,900	2,509.00	70,001,100	
北海道瓦斯	4,100	1,615.00	6,621,500	貸付株式数 1,400株
広島ガス	14,500	338.00	4,901,000	
西部ガスHLDGS	6,600	1,674.00	11,048,400	貸付株式数 600株
静岡ガス	16,200	1,077.00	17,447,400	貸付株式数 6,200株
メタウォーター	8,900	1,723.00	15,334,700	
アイネット	4,200	1,291.00	5,422,200	
松竹	4,100	11,910.00	48,831,000	
東宝	44,400	5,160.00	229,104,000	
エイチ・アイ・エス	19,100	2,015.00	38,486,500	貸付株式数 7,400株

東映	2,000	18,950.00	37,900,000	
ラックランド	2,300	2,961.00	6,810,300	貸付株式数 800株
NTTデータ	222,800	1,979.00	440,921,200	
共立メンテナンス	12,500	5,820.00	72,750,000	貸付株式数 5,200株
イチネンホールディングス	7,500	1,257.00	9,427,500	
建設技術研究所	3,700	3,335.00	12,339,500	
スペース	5,100	898.00	4,579,800	
アインホールディングス	10,300	6,060.00	62,418,000	貸付株式数 2,200株
燦ホールディングス	3,200	1,777.00	5,686,400	
ピー・シー・エー	4,300	1,290.00	5,547,000	貸付株式数 500株
スバル興業	500	9,210.00	4,605,000	貸付株式数 100株
東京テアトル	2,600	1,121.00	2,914,600	貸付株式数 1,000株
タナベコンサルティンググループ	2,700	670.00	1,809,000	貸付株式数 1,000株
ビジネスB太田昭和	3,000	1,886.00	5,658,000	貸付株式数 600株
ナガワ	2,000	7,240.00	14,480,000	貸付株式数 800株
東京都競馬	6,100	3,815.00	23,271,500	貸付株式数 2,400株
常磐興産	2,500	1,189.00	2,972,500	貸付株式数 1,000株
カナモト	13,300	2,306.00	30,669,800	
DTS	15,300	3,095.00	47,353,500	
スクウェア・エニックス・HD	35,700	6,140.00	219,198,000	
シーイーシー	9,900	1,567.00	15,513,300	
カプコン	70,600	4,250.00	300,050,000	
西尾レントオール	6,700	3,205.00	21,473,500	貸付株式数 1,500株
アイ・エス・ビー	3,600	1,309.00	4,712,400	貸付株式数 1,200株
アゴーラホスピタリティィーG	40,300	22.00	886,600	貸付株式数 15,600株
日本空港ビルデング	24,700	6,320.00	156,104,000	貸付株式数 10,300株
トランス・コスモス	9,000	3,275.00	29,475,000	貸付株式数 3,200株
乃村工藝社	31,800	939.00	29,860,200	
ジャステック	4,200	1,199.00	5,035,800	貸付株式数 1,600株
SCSK	58,000	2,086.00	120,988,000	
藤田観光	3,200	2,860.00	9,152,000	貸付株式数 1,200株
KNT-CTホールディングス	4,300	1,613.00	6,935,900	貸付株式数 1,700株
日本管財	7,700	2,524.00	19,434,800	
トーカイ	6,400	1,917.00	12,268,800	貸付株式数 100株
白洋舎	700	1,830.00	1,281,000	貸付株式数 300株
セコム	74,100	7,945.00	588,724,500	

N S W	2,800	2,134.00	5,975,200		
セントラル警備保障	3,900	2,369.00	9,239,100	貸付株式数	1,500株
アイネス	4,900	1,367.00	6,698,300	貸付株式数	2,300株
丹青社	14,100	700.00	9,870,000		
メイテック	29,100	2,457.00	71,498,700		
T K C	12,800	3,625.00	46,400,000		
富士ソフト	8,000	7,590.00	60,720,000	貸付株式数	400株
応用地質	7,000	2,176.00	15,232,000		
船井総研ホールディング	15,300	2,729.00	41,753,700	貸付株式数	4,800株
N S D	25,400	2,402.00	61,010,800		
進学会ホールディングス	2,600	301.00	782,600	貸付株式数	900株
丸紅建材リース	600	1,729.00	1,037,400	貸付株式数	200株
オ オ バ	4,500	658.00	2,961,000	貸付株式数	1,800株
コナミグループ	30,400	6,030.00	183,312,000		
いであ	1,600	1,733.00	2,772,800	貸付株式数	600株
学 究 社	2,800	1,809.00	5,065,200		
ベネッセホールディングス	27,200	2,008.00	54,617,600		
イオンディライト	8,100	2,990.00	24,219,000		
ナック	3,000	926.00	2,778,000	貸付株式数	1,200株
福井コンピュータH L D S	5,000	2,814.00	14,070,000	貸付株式数	1,400株
ダイセキ	14,900	4,530.00	67,497,000	貸付株式数	5,400株
ステップ	3,000	1,793.00	5,379,000	貸付株式数	200株
日鉄物産	5,100	5,020.00	25,602,000		
泉州電業	3,600	3,265.00	11,754,000	貸付株式数	1,400株
元気寿司	2,300	3,125.00	7,187,500	貸付株式数	900株
トラスコ中山	15,700	2,145.00	33,676,500		
ヤマダホールディングス	306,900	468.00	143,629,200		
オートバックスセブン	25,900	1,421.00	36,803,900	貸付株式数	9,300株
モリト	5,200	749.00	3,894,800		
アークランズ	10,900	1,495.00	16,295,500		
ニトリホールディングス	30,300	15,670.00	474,801,000		
グルメ杵屋	6,100	996.00	6,075,600	貸付株式数	2,400株 (100株)
愛 眼	6,500	172.00	1,118,000	貸付株式数	2,700株
ケーユーホールディングス	4,300	1,311.00	5,637,300		
吉野家ホールディングス	29,300	2,323.00	68,063,900	貸付株式数	11,500株
加藤産業	9,100	3,425.00	31,167,500		
北恵	1,700	643.00	1,093,100	貸付株式数	600株
イノテック	4,600	1,283.00	5,901,800		
イエローハット	13,200	1,745.00	23,034,000	貸付株式数	4,600株

松屋フーズHLDGS	3,500	3,955.00	13,842,500	貸付株式数	1,200株
JBCホールディングス	5,100	1,925.00	9,817,500		
JKホールディングス	5,900	1,014.00	5,982,600	貸付株式数	2,200株
サガミホールディングス	12,000	1,189.00	14,268,000	貸付株式数	300株
日伝	4,900	1,741.00	8,530,900	貸付株式数	1,800株
関西フードマーケット	6,800	1,255.00	8,534,000	貸付株式数	2,500株
ミロク情報サービス	6,500	1,458.00	9,477,000	貸付株式数	700株
北沢産業	4,000	199.00	796,000	貸付株式数	700株
杉本商事	3,300	1,985.00	6,550,500	貸付株式数	1,200株
因幡電機産業	19,200	2,741.00	52,627,200		
王将フードサービス	4,900	6,020.00	29,498,000	貸付株式数	1,700株
プレナス	1,000	2,637.00	2,637,000		
ミニストップ	5,500	1,420.00	7,810,000	貸付株式数	2,000株
アークス	13,700	2,103.00	28,811,100	貸付株式数	5,000株
バローホールディングス	14,300	1,775.00	25,382,500		
東テク	2,500	3,135.00	7,837,500		
ミスミグループ本社	112,900	3,225.00	364,102,500		
アルテック	3,800	306.00	1,162,800		
ベルク	3,700	5,730.00	21,201,000		
大庄	4,100	1,040.00	4,264,000	貸付株式数	1,600株
タキヒヨー	1,700	855.00	1,453,500	貸付株式数	800株
ファーストリテイリング	11,200	80,700.00	903,840,000		
ソフトバンクグループ	410,500	6,018.00	2,470,389,000		
蔵王産業	1,100	1,736.00	1,909,600		
スズケン	26,900	3,650.00	98,185,000		
サンドラッグ	28,400	3,795.00	107,778,000		
サクスパーホールディング	7,100	718.00	5,097,800	貸付株式数	2,400株
ジェコス	4,700	795.00	3,736,500		
ヤマザワ	1,100	1,290.00	1,419,000	貸付株式数	600株
やまや	1,700	2,463.00	4,187,100	貸付株式数	600株
グローセル	8,100	434.00	3,515,400	貸付株式数	3,000株
ベルーナ	18,000	684.00	12,312,000	貸付株式数	100株
合計			197,542,891,460		

(注) 1. 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の有価証券が差し入れられており
ます。

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

2. 貸付株式数のうち（括弧書）の数字は、委託者の利害関係人である大和証券株式会社に対する貸付であります。

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年12月20日現在	2022年12月19日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,253,840,414	852,713,701
コール・ローン	5,197,745,150	9,706,458,321
株式	233,939,162,230	266,686,770,469
投資証券	5,936,676,564	6,559,293,925
派生商品評価勘定	15,064,734	18,399,158
未収入金	2,238,533	2,691,322
未収配当金	175,151,202	267,062,544
差入委託証拠金	5,012,129,733	5,105,362,859
流動資産合計	251,532,008,560	289,198,752,299
資産合計	251,532,008,560	289,198,752,299
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	117,532,109	554,457,124
未払解約金	52,225,700	3,650,800
流動負債合計	169,757,809	558,107,924
負債合計	169,757,809	558,107,924
純資産の部		
元本等		
元本	1 61,674,819,062	69,638,060,038

剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	189,687,431,689	219,002,584,337
元本等合計	251,362,250,751	288,640,644,375
純資産合計	251,362,250,751	288,640,644,375
負債純資産合計	251,532,008,560	289,198,752,299

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2021年12月21日 至 2022年12月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>

	<p>(2)為替予約取引 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 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 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	2021年12月20日現在	2022年12月19日現在
1. 1 期首	2020年12月19日	2021年12月21日
期首元本額	53,363,008,733円	61,674,819,062円
期中追加設定元本額	13,771,213,468円	13,672,424,231円
期中一部解約元本額	5,459,403,139円	5,709,183,255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	371,481,601円	301,093,386円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	4,453,234円	3,459,588円

ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	55,423,826円	36,734,762円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	7,408,815円	6,474,561円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	234,345,757円	179,363,294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)	39,683,312円	69,674,877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)	504,665,975円	523,783,713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)	2,509,703,166円	3,060,018,121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)	510,646,780円	642,031,802円
D-I's 外国株式インデッ クス	15,516,248円	18,445,438円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	33,893,242円	48,152,485円
iFree 外国株式イン デッ クス(為替ヘッジなし)	4,215,042,571円	6,023,455,760円
iFree 8資産バランス	1,121,933,019円	1,382,417,663円
iFree 年金バランス	184,000,246円	256,336,275円
DCダイワ外国株式インデッ クス	38,684,682,327円	43,954,399,858円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	506,389,345円	525,128,068円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	933,195,084円	1,008,584,575円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	757,548,873円	832,693,698円
大和DC海外株式インデッ クス ファンド	1,729,006,952円	1,901,552,608円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	12,891,171円	12,267,820円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	11,150,747円	12,252,667円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	833,306,342円	1,405,540,804円
ダイワつみたてインデックス バランス30	1,690,959円	1,875,196円
ダイワつみたてインデックス バランス50	2,174,143円	2,214,762円
ダイワつみたてインデックス バランス70	3,645,733円	4,705,642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)	- 円	4,349,275円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	107,772,790円	75,082,129円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	208,616,060円	55,630,821円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	1,455,327,992円	1,203,874,057円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	73,750,723円	62,417,353円
ダイワバランスファンド 2020-07(適格機関投資家専 用)	194,296,563円	- 円
ダイワバランスファンド 2021-02(適格機関投資家専 用)	209,089,795円	171,714,594円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国株式	943,001,516円	1,158,534,062円
ダイワ・ノーロード 外国株 式ファンド	333,687,374円	428,235,087円
ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワ SMA専用)	1,912,422,156円	1,278,896,305円
ダイワ投信倶楽部外国株式イ ンデックス	2,851,280,025円	2,899,354,934円
ダイワライフスタイル25	12,394,062円	10,503,837円
ダイワライフスタイル50	49,684,792円	43,488,340円
ダイワライフスタイル75	39,615,746円	33,321,821円

計	61,674,819,062円	69,638,060,038円
2. 期末日における受益権の総数	61,674,819,062口	69,638,060,038口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年12月21日 至 2022年12月19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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年12月19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	2021年12月20日現在	2022年12月19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	1,641,386,529	7,317,666,326
投資証券	139,215,780	162,880,772
合計	1,502,170,749	7,480,547,098

（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（2021年12月1日から2021年12月20日まで、及び2022年12月1日から2022年12月19日まで）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	2021年12月20日 現在				2022年12月19日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	11,789,789,327	-	11,689,355,558	100,433,769	15,921,824,688	-	15,417,025,282	504,799,406
合計	11,789,789,327	-	11,689,355,558	100,433,769	15,921,824,688	-	15,417,025,282	504,799,406

（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	2021年12月20日 現在				2022年12月19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	5,341,793,100	-	5,339,759,494	2,033,606	9,898,107,170	-	9,866,848,610	31,258,560
アメリカ・ドル	3,209,117,795	-	3,214,039,490	4,921,695	6,311,592,350	-	6,287,063,110	24,529,240
イギリス・ポンド	253,116,898	-	252,600,432	516,466	628,979,230	-	628,593,720	385,510
オーストラリア・ドル	282,982,560	-	283,180,450	197,890	388,552,560	-	382,492,740	6,059,820
カナダ・ドル	325,848,643	-	323,516,372	2,332,271	599,086,420	-	586,109,540	12,976,880
スイス・フラン	307,969,224	-	307,656,500	312,724	625,658,000	-	627,512,760	1,854,760
ユーロ	962,757,980	-	958,766,250	3,991,730	1,344,238,610	-	1,355,076,740	10,838,130
合計	5,341,793,100	-	5,339,759,494	2,033,606	9,898,107,170	-	9,866,848,610	31,258,560

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2021年12月20日現在	2022年12月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.0756円 (40,756円)	4.1449円 (41,449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		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	5,000	133.350	666,750.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	12,900	151.000	1,947,900.000	
	FIRST SOLAR INC	4,300	155.080	666,844.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,700	173.850	1,338,645.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,700	103.920	592,344.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,700	157.720	425,844.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	21,100	33.210	700,731.000	
	ABBOTT LABORATORIES	75,366	106.910	8,057,379.060	
	HOWMET AEROSPACE INC	16,083	38.130	613,244.790	
	VERISK ANALYTICS INC	6,800	175.020	1,190,136.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	14,800	47.490	702,852.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	25,600	77.660	1,988,096.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,900	367.030	697,357.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	26,200	69.220	1,813,564.000	
	QORVO INC	4,420	94.590	418,087.800	
	AFLAC INC	25,800	69.020	1,780,716.000	
DARDEN RESTAURANTS INC	5,300	139.900	741,470.000		
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	7,400	69.370	513,338.000		
ADOBE INC	20,120	338.540	6,811,424.800		

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,600	95.070	817,602.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	5,000	321.240	1,606,200.000	
GARMIN LTD	6,600	91.190	601,854.000	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,500	316.420	3,005,990.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	29,000	209.740	6,082,460.000	
WR BERKLEY CORP	9,142	72.050	658,681.100	
AUTOZONE INC	820	2,380.450	1,951,969.000	
DOLLAR TREE INC	9,571	142.650	1,365,303.150	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	51,300	8.690	445,797.000	
CELANESE CORP	4,750	101.530	482,267.500	
DR HORTON INC	14,216	89.380	1,270,626.080	
DENTSPLY SIRONA INC	8,900	30.520	271,628.000	
AUTODESK INC	9,400	192.400	1,808,560.000	
MOODY'S CORP	7,100	281.760	2,000,496.000	
DEVON ENERGY CORP	26,800	60.080	1,610,144.000	
ALBEMARLE CORP	5,000	242.860	1,214,300.000	
ATMOS ENERGY CORP	6,000	114.770	688,620.000	
ALLIANT ENERGY CORP	10,800	54.610	589,788.000	
CITIGROUP INC	83,373	44.350	3,697,592.550	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	17,900	247.050	4,422,195.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	22,100	94.570	2,089,997.000	
DOMINO'S PIZZA INC	1,530	357.230	546,561.900	
HESS CORP	12,000	133.010	1,596,120.000	
DAVITA INC	2,750	72.410	199,127.500	
DANAHER CORP	29,750	262.030	7,795,392.500	
FORTIVE CORP	14,500	63.840	925,680.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	24,000	100.760	2,418,240.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	24,100	92.310	2,224,671.000	
BUNGE LTD	6,500	96.080	624,520.000	
TE CONNECTIVITY LTD	13,795	116.440	1,606,289.800	
APPLE INC	692,000	134.510	93,080,920.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	11,600	96.890	1,123,924.000	
BOEING CO/THE	24,300	184.700	4,488,210.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,515	102.220	665,963.300	
BECTON DICKINSON AND CO	12,299	249.510	3,068,723.490	
LEIDOS HOLDINGS INC	5,600	104.790	586,824.000	
NISOURCE INC	17,500	27.190	475,825.000	

C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,300	94.080	498,624.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	33,071	44.090	1,458,100.390	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	180,804	37.120	6,711,444.480	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	56,150	300.000	16,845,000.000	
ANSYS INC	3,700	242.790	898,323.000	
TRUIST FINANCIAL CORP	57,117	41.300	2,358,932.100	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	30,200	75.390	2,276,778.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	91,900	73.490	6,753,731.000	
JPMORGAN CHASE & CO	126,270	129.290	16,325,448.300	
T ROWE PRICE GROUP INC	9,700	110.520	1,072,044.000	
LKQ CORP	11,100	52.630	584,193.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	13,312	65.860	876,728.320	
CADENCE DESIGN SYS INC	11,800	163.200	1,925,760.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,700	312.180	1,467,246.000	
DOLLAR GENERAL CORP	9,700	248.250	2,408,025.000	
SERVICENOW INC	8,700	394.370	3,431,019.000	
CATERPILLAR INC	22,700	232.720	5,282,744.000	
BROWN & BROWN INC	10,400	55.500	577,200.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	10,700	46.500	497,550.000	
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,200	215.420	473,924.000	
CMS ENERGY CORP	12,500	61.910	773,875.000	
MOSAIC CO/THE	14,900	45.360	675,864.000	
DELTA AIR LINES INC	6,900	33.110	228,459.000	
CORNING INC	34,600	32.300	1,117,580.000	
CISCO SYSTEMS INC	178,350	47.810	8,526,913.500	
MORGAN STANLEY	55,352	86.860	4,807,874.720	
MSCI INC	3,500	471.590	1,650,565.000	
FAIR ISAAC CORP	1,100	590.630	649,693.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,400	246.500	345,100.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	9,900	50.680	501,732.000	
BROADCOM INC	17,412	555.910	9,679,504.920	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,200	236.920	1,231,984.000	
ARAMARK	10,000	41.510	415,100.000	
DTE ENERGY COMPANY	8,400	115.820	972,888.000	
CENTENE CORP	24,607	81.400	2,003,009.800	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,600	124.020	570,492.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	21,400	38.330	820,262.000	
DARLING INGREDIENTS INC	7,200	60.820	437,904.000	

ARTHUR J GALLAGHER & CO	9,100	186.350	1,695,785.000	
GARTNER INC	3,450	338.170	1,166,686.500	
SPLUNK INC	7,000	87.400	611,800.000	
DOMINION ENERGY INC	35,941	58.620	2,106,861.420	
MONSTER BEVERAGE CORP	17,000	100.780	1,713,260.000	
SMITH (A.O.) CORP	5,300	56.050	297,065.000	
DEERE & CO	12,500	431.090	5,388,625.000	
QUANTA SERVICES INC	6,200	143.270	888,274.000	
POOL CORP	1,700	313.020	532,134.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	11,884	94.780	1,126,365.520	
VMWARE INC-CLASS A	9,100	121.760	1,108,016.000	
BURLINGTON STORES INC	2,800	185.800	520,240.000	
NASDAQ INC	14,900	60.620	903,238.000	
VAIL RESORTS INC	1,700	251.210	427,057.000	
TARGA RESOURCES CORP	9,300	70.100	651,930.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,000	132.290	396,870.000	
WESTLAKE CORP	1,600	103.350	165,360.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	15,300	95.170	1,456,101.000	
COGNEX CORP	7,500	47.880	359,100.000	
WEBSTER FINANCIAL CORP	7,600	44.500	338,200.000	
TELEFLEX INC	2,000	247.010	494,020.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,600	178.650	643,140.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,200	226.100	723,520.000	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,000	407.980	407,980.000	
CATALENT INC	7,400	44.260	327,524.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	6,000	168.260	1,009,560.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,500	334.890	837,225.000	
CARLISLE COS INC	2,200	238.990	525,778.000	
IDEX CORP	3,300	227.990	752,367.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	34,100	77.760	2,651,616.000	
ROLLINS INC	9,207	36.760	338,449.320	
AMETEK INC	9,900	136.770	1,354,023.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,500	80.110	841,155.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,450	54.340	350,493.000	
HEICO CORP	1,900	151.850	288,515.000	
GENERAC HOLDINGS INC	2,800	94.680	265,104.000	

FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,600	428.380	685,408.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	11,200	80.580	902,496.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,800	320.300	576,540.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	19,060	461.450	8,795,237.000	
EPAM SYSTEMS INC	2,500	333.300	833,250.000	
RPM INTERNATIONAL INC	5,600	99.440	556,864.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,200	1,462.110	1,754,532.000	
UGI CORP	9,000	36.690	330,210.000	
CUMMINS INC	6,100	235.600	1,437,160.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	33,700	76.080	2,563,896.000	
CDW CORP/DE	5,800	181.280	1,051,424.000	
SIGNATURE BANK	2,650	113.870	301,755.500	
COSTAR GROUP INC	17,000	77.980	1,325,660.000	
SVB FINANCIAL GROUP	2,500	213.400	533,500.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,100	294.880	1,209,008.000	
MERCADOLIBRE INC	1,890	843.980	1,595,122.200	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,100	177.550	550,405.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	11,816	130.990	1,547,777.840	
DEXCOM INC	16,900	114.630	1,937,247.000	
NORDSON CORP	2,190	236.820	518,635.800	
COPART INC	18,400	60.390	1,111,176.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,300	134.320	980,536.000	
SEAGEN INC	6,000	129.610	777,660.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,200	198.210	634,272.000	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,400	206.940	703,596.000	
TRANSDIGM GROUP INC	2,190	605.730	1,326,548.700	
BIO-TECHNE CORP	6,720	82.380	553,593.600	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,100	117.190	480,479.000	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	9,400	112.880	1,061,072.000	
KINDER MORGAN INC	87,681	17.690	1,551,076.890	
HCA HEALTHCARE INC	9,900	239.050	2,366,595.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,600	278.590	445,744.000	
COTERRA ENERGY INC	34,200	24.740	846,108.000	
T-MOBILE US INC	27,027	142.360	3,847,563.720	
ZILLOW GROUP INC - C	6,750	36.050	243,337.500	
COCA-COLA CO/THE	176,950	62.750	11,103,612.500	

COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	9,500	54.080	513,760.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,950	108.540	754,353.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	12,400	25.740	319,176.000	
CSX CORP	92,100	31.650	2,914,965.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,900	226.990	885,261.000	
EXPEDIA GROUP INC	6,525	88.170	575,309.250	
AMAZON.COM INC	394,800	87.860	34,687,128.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	26,700	73.010	1,949,367.000	
EXXON MOBIL CORP	179,305	104.700	18,773,233.500	
AES CORP	28,800	28.340	816,192.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,700	323.110	549,287.000	
EOG RESOURCES INC	25,200	125.770	3,169,404.000	
EQT CORP	14,100	37.240	525,084.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,800	84.980	577,864.000	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	500	729.680	364,840.000	
ABIOMED INC	2,000	381.000	762,000.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	6,700	166.790	1,117,493.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	12,700	149.300	1,896,110.000	
FORD MOTOR CO	170,023	12.120	2,060,678.760	
EXACT SCIENCES CORP	7,600	51.920	394,592.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,137	18.700	133,461.900	
ENTEGRIS INC	6,400	66.320	424,448.000	
AERCAP HOLDINGS NV	6,200	57.250	354,950.000	
FORTINET INC	28,800	51.920	1,495,296.000	
MARKEL CORP	580	1,253.440	726,995.200	
NEXTERA ENERGY INC	84,580	84.140	7,116,561.200	
MASIMO CORP	2,200	142.590	313,698.000	
FREEMPORT-MCMORAN INC	61,508	38.360	2,359,446.880	
INSULET CORP	3,000	298.990	896,970.000	
US BANCORP	60,800	42.150	2,562,720.000	
UNITED RENTALS INC	3,000	353.510	1,060,530.000	
F5 NETWORKS INC	2,600	144.170	374,842.000	
FASTENAL CO	24,700	47.870	1,182,389.000	
FISERV INC	26,133	98.580	2,576,191.140	
GENERAL ELECTRIC CO	47,206	77.650	3,665,545.900	
PAYLOCITY HOLDING CORP	1,800	199.440	358,992.000	
GENERAL MOTORS CO	59,600	36.150	2,154,540.000	

GENERAL DYNAMICS CORP	10,000	246.140	2,461,400.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	14,750	346.350	5,108,662.500	
FIRST HORIZON CORP	23,900	24.410	583,399.000	
ALPHABET INC-CL A	258,100	90.260	23,296,106.000	
ALPHABET INC-CL C	238,540	90.860	21,673,744.400	
OWENS CORNING	4,100	91.130	373,633.000	
GENERAL MILLS INC	25,600	86.930	2,225,408.000	
FIRSTENERGY CORP	23,418	40.930	958,498.740	
GENUINE PARTS CO	6,150	176.810	1,087,381.500	
FIFTH THIRD BANCORP	29,500	31.600	932,200.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	8,250	213.270	1,759,477.500	
HALLIBURTON CO	39,100	35.850	1,401,735.000	
REPLIGEN CORP	2,400	164.840	395,616.000	
HOME DEPOT INC	44,150	323.340	14,275,461.000	
ASSURANT INC	2,250	123.620	278,145.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	62,100	13.650	847,665.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,710	231.270	395,471.700	
HERSHEY CO/THE	6,300	235.000	1,480,500.000	
HUMANA INC	5,500	503.530	2,769,415.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	11,300	163.720	1,850,036.000	
HENRY SCHEIN INC	5,900	80.660	475,894.000	
HP INC	47,300	26.720	1,263,856.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	55,900	15.640	874,276.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	6,828	38.880	265,472.640	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	8,500	58.070	493,595.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,950	39.030	115,138.500	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	15,900	61.030	970,377.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	31,703	39.920	1,265,583.760	
ENPHASE ENERGY INC	5,800	303.390	1,759,662.000	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	38,900	140.160	5,452,224.000	
HUBBELL INC	2,400	232.680	558,432.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	14,800	35.610	527,028.000	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	5,600	57.130	319,928.000	
ZOETIS INC	20,100	144.460	2,903,646.000	

TRANE TECHNOLOGIES PLC	9,999	170.360	1,703,429.640	
CHENIERE ENERGY INC	9,700	157.610	1,528,817.000	
ALLEGION PLC	3,850	103.860	399,861.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	12,973	19.010	246,616.730	
WASTE CONNECTIONS INC	11,137	134.500	1,497,926.500	
JUNIPER NETWORKS INC	13,900	31.780	441,742.000	
JM SMUCKER CO/THE	4,600	155.330	714,518.000	
JOHNSON & JOHNSON	113,200	175.670	19,885,844.000	
PLUG POWER INC	22,500	14.020	315,450.000	
ABBVIE INC	76,072	160.480	12,208,034.560	
HOLOGIC INC	10,800	73.730	796,284.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	14,500	135.320	1,962,140.000	
KROGER CO	29,200	44.320	1,294,144.000	
KLA CORP	6,200	385.540	2,390,348.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	10,300	481.790	4,962,437.000	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,100	181.250	561,875.000	
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	10,500	40.310	423,255.000	
LOWE'S COS INC	27,200	206.140	5,607,008.000	
ELI LILLY & CO	34,785	359.870	12,518,077.950	
LAM RESEARCH CORP	5,880	443.920	2,610,249.600	
LOEWS CORP	8,600	55.800	479,880.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	7,049	29.170	205,619.330	
MCDONALD'S CORP	31,750	266.120	8,449,310.000	
3M CO	23,790	121.690	2,895,005.100	
META PLATFORMS INC CLASS A	98,200	119.430	11,728,026.000	
S&P GLOBAL INC	14,639	339.600	4,971,404.400	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,700	348.220	940,194.000	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	2,420	320.530	775,682.600	
ALCOA CORP	7,700	42.720	328,944.000	
PHILLIPS 66	20,700	100.640	2,083,248.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	16,050	35.660	572,343.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,800	83.410	900,828.000	
METLIFE INC	29,200	71.470	2,086,924.000	
MARVELL TECHNOLOGY INC	36,700	38.990	1,430,933.000	
ARISTA NETWORKS INC	10,500	123.660	1,298,430.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,198	252.440	1,817,063.120	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,000	1,428.190	1,428,190.000	

BAKER HUGHES CO	43,623	28.370	1,237,584.510	
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,000	253.070	1,265,350.000	
MERCK & CO. INC.	109,121	109.200	11,916,013.200	
DUPONT DE NEMOURS INC	21,551	67.910	1,463,528.410	
MASCO CORP	9,800	47.420	464,716.000	
M & T BANK CORP	7,599	140.050	1,064,239.950	
MARSH & MCLENNAN COS	21,470	165.190	3,546,629.300	
BLACK KNIGHT INC	6,750	58.630	395,752.500	
HEICO CORP-CLASS A	3,220	118.250	380,765.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	11,902	153.790	1,830,408.580	
WORKDAY INC-CLASS A	8,700	175.220	1,524,414.000	
BLOCK INC CLASS A	22,812	62.510	1,425,978.120	
TRANSUNION	8,300	57.280	475,424.000	
VISTRA CORP	17,600	24.070	423,632.000	
NOVOCURE LTD	4,150	74.780	310,337.000	
NETAPP INC	9,500	60.320	573,040.000	
NIKE INC -CL B	54,400	105.950	5,763,680.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	10,100	250.600	2,531,060.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	23,800	72.670	1,729,546.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,405	106.750	897,233.750	
ALLY FINANCIAL INC	14,200	24.550	348,610.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,300	529.870	3,338,181.000	
APTIV PLC	11,700	93.480	1,093,716.000	
NEWMONT CORP	34,211	46.140	1,578,495.540	
MCKESSON CORP	6,200	372.640	2,310,368.000	
XYLEM INC	7,800	109.910	857,298.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	66,700	100.280	6,688,676.000	
NUCOR CORP	11,300	133.600	1,509,680.000	
WESTERN UNION CO	16,746	13.280	222,386.880	
GODADDY INC - CLASS A	6,800	74.170	504,356.000	
NEWELL BRANDS INC	16,442	13.070	214,896.940	
EVERGY INC	9,950	61.910	616,004.500	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	40,124	62.530	2,508,953.720	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,150	269.450	309,867.500	
OKTA INC	6,500	67.920	441,480.000	
LIBERTY BROADBAND-C	5,600	69.620	389,872.000	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	17,305	12.020	208,006.100	
LINDE PLC	21,446	329.630	7,069,244.980	

WIX.COM LTD	2,610	80.890	211,122.900	
EQUITABLE HOLDINGS INC	15,800	28.810	455,198.000	
KKR & CO INC	24,000	46.580	1,117,920.000	
PAYCHEX INC	13,900	115.960	1,611,844.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,700	811.770	2,191,779.000	
ALTRIA GROUP INC	77,500	46.560	3,608,400.000	
P G & E CORP	64,200	16.080	1,032,336.000	
PFIZER INC	241,613	51.400	12,418,908.200	
CIGNA CORP	13,100	327.290	4,287,499.000	
DELL TECHNOLOGIES -C	11,801	39.250	463,189.250	
XCEL ENERGY INC	23,600	69.920	1,650,112.000	
STERIS PLC	4,300	183.030	787,029.000	
SEA LTD-ADR	16,700	53.690	896,623.000	
FOX CORP - CLASS B	6,033	28.680	173,026.440	
FOX CORP - CLASS A	12,799	30.740	393,441.260	
STRYKER CORP	14,680	239.840	3,520,851.200	
DOW INC	30,918	49.800	1,539,716.400	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,500	62.890	283,005.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	9,700	69.860	677,642.000	
PARKER HANNIFIN CORP	5,500	285.750	1,571,625.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	64,000	25.970	1,662,080.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	9,800	218.920	2,145,416.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	102,667	150.440	15,445,223.480	
EXELON CORP	42,722	41.930	1,791,333.460	
INGERSOLL-RAND INC	17,308	51.800	896,554.400	
NVR INC	130	4,815.880	626,064.400	
CONOCOPHILLIPS	54,702	110.440	6,041,288.880	
TWILIO INC - A	7,500	47.920	359,400.000	
DOCUSIGN INC	8,300	56.270	467,041.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,200	311.400	685,080.000	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,700	63.890	364,173.000	
PEPSICO INC	59,400	180.340	10,712,196.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,920	131.950	253,344.000	
DROPBOX INC-CLASS A	12,100	23.200	280,720.000	
MONGODB INC	2,900	203.100	588,990.000	
SNAP INC - A	48,100	8.470	407,407.000	

CORTEVA INC	30,868	59.780	1,845,289.040	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	16,000	97.870	1,565,920.000	
AMCOR PLC	64,100	12.080	774,328.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	8,700	111.500	970,050.000	
ROKU INC	5,200	45.850	238,420.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,800	152.400	1,188,720.000	
ACCENTURE PLC-CL A	27,200	264.480	7,193,856.000	
PENTAIR PLC	7,075	43.440	307,338.000	
QUALCOMM INC	48,400	114.530	5,543,252.000	
INVESCO LTD	14,100	18.390	259,299.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,650	140.160	371,424.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,600	84.920	900,152.000	
DATADOG INC - CLASS A	10,700	77.830	832,781.000	
PINTEREST INC- CLASS A	25,100	24.800	622,480.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,600	723.170	3,326,582.000	
REPUBLIC SERVICES INC	9,500	131.550	1,249,725.000	
BOOKING HOLDINGS INC	1,700	1,938.550	3,295,535.000	
ROSS STORES INC	15,100	113.950	1,720,645.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,030	130.580	526,237.400	
RESMED INC	6,300	209.800	1,321,740.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	5,030	149.240	750,677.200	
ROBERT HALF INTL INC	4,700	73.090	343,523.000	
MODERNA INC	14,300	193.290	2,764,047.000	
HUBSPOT INC	1,980	295.480	585,050.400	
PERKINELMER INC	5,400	137.660	743,364.000	
CARRIER GLOBAL CORP	36,187	41.750	1,510,807.250	
OTIS WORLDWIDE CORP	18,138	78.600	1,425,646.800	
BILL.COM HOLDINGS INC	4,100	111.210	455,961.000	
AVANTOR INC	29,300	20.700	606,510.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	8,600	29.490	253,614.000	
DYNATRACE INC	8,700	38.700	336,690.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	19,100	46.150	881,465.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	40,185	20.580	827,007.300	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	11,000	29.800	327,800.000	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	15,100	40.210	607,171.000	
MATCH GROUP INC	12,200	41.940	511,668.000	
CHEVRON CORP	80,018	168.720	13,500,636.960	
ZSCALER INC	3,700	114.210	422,577.000	

EDISON INTERNATIONAL	16,400	65.100	1,067,640.000	
ETSY INC	5,500	126.320	694,760.000	
TESLA INC	114,850	150.230	17,253,915.500	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	9,600	142.450	1,367,520.000	
GEN DIGITAL INC	25,900	21.610	559,699.000	
UNITY SOFTWARE INC	10,800	28.990	313,092.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,602	76.310	503,798.620	
SYNOPSYS INC	6,600	329.120	2,172,192.000	
CHEWY INC - CLASS A	3,950	42.410	167,519.500	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	11,000	47.540	522,940.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4,905	304.960	1,495,828.800	
VIATRIS INC	52,321	10.960	573,438.160	
DOORDASH INC - A	10,250	52.520	538,330.000	
ROBLOX CORP -CLASS A	15,300	27.620	422,586.000	
AIRBNB INC-CLASS A	16,300	89.570	1,459,991.000	
CBRE GROUP INC - A	13,800	75.800	1,046,040.000	
SOUTHERN CO/THE	46,900	69.430	3,256,267.000	
SYSCO CORP	21,800	78.680	1,715,224.000	
TRAVELERS COS INC/THE	10,203	182.800	1,865,108.400	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,500	66.470	166,175.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,000	58.260	291,300.000	
STEEL DYNAMICS INC	7,850	101.020	793,007.000	
SCHLUMBERGER LTD	60,852	49.380	3,004,871.760	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,700	40.950	274,365.000	
AFFIRM HOLDINGS INC	7,700	10.120	77,924.000	
AT&T INC	306,691	18.490	5,670,716.590	
APA CORP	14,400	43.790	630,576.000	
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,450	37.280	240,456.000	
ON SEMICONDUCTOR CORP	18,600	65.380	1,216,068.000	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	9,200	47.260	434,792.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10,600	240.470	2,548,982.000	
SEMPRA ENERGY	13,500	157.320	2,123,820.000	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	8,400	37.330	313,572.000	
CLARIVATE PLC	13,400	8.320	111,488.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	71,900	6.900	496,110.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	8,450	52.130	440,498.500	

COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	5,300	36.600	193,980.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	39,300	169.550	6,663,315.000	
SALESFORCE.COM INC	43,066	128.270	5,524,075.820	
WESTROCK CO	10,700	35.070	375,249.000	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	17,209	62.510	1,075,734.590	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	29,634	63.350	1,877,313.900	
TERADYNE INC	6,600	89.020	587,532.000	
UNION PACIFIC CORP	26,880	210.210	5,650,444.800	
MARATHON OIL CORP	29,900	27.330	817,167.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	21,388	109.750	2,347,333.000	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	63,479	98.340	6,242,524.860	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	31,500	178.200	5,613,300.000	
IQVIA HOLDINGS INC	8,004	203.780	1,631,055.120	
AMEREN CORPORATION	11,100	87.730	973,803.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	40,266	523.700	21,087,304.200	
TOAST INC CLASS A	11,000	18.760	206,360.000	
VERISIGN INC	4,100	200.650	822,665.000	
LUCID GROUP INC	16,800	7.370	123,816.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	13,700	22.480	307,976.000	
VALERO ENERGY CORP	16,942	119.370	2,022,366.540	
ULTA BEAUTY INC	2,200	451.120	992,464.000	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	11,288	36.890	416,414.320	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,830	135.770	384,229.100	
ELEVANCE HEALTH INC	10,300	502.050	5,171,115.000	
WALT DISNEY CO/THE	78,462	90.080	7,067,856.960	
WELLS FARGO & CO	163,322	41.190	6,727,233.180	
WASTE MANAGEMENT INC	17,800	161.790	2,879,862.000	
WILLIAMS COS INC	52,500	32.350	1,698,375.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,800	210.510	1,010,448.000	
WHIRLPOOL CORP	2,400	141.490	339,576.000	
WALMART INC	64,900	142.750	9,264,475.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	9,000	125.580	1,130,220.000	
WYNN RESORTS LTD	4,500	86.010	387,045.000	
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	55,900	3.190	178,321.000	
WABTEC CORP	7,411	99.250	735,541.750	

TJX COMPANIES INC	50,000	77.650	3,882,500.000	
WATERS CORP	2,600	338.480	880,048.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,200	248.920	547,624.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	31,600	39.050	1,233,980.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,863	240.560	1,169,843.280	
WESTERN DIGITAL CORP	13,600	31.940	434,384.000	
WEC ENERGY GROUP INC	13,600	95.130	1,293,768.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	21,500	59.240	1,273,660.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	70,450	206.890	14,575,400.500	
PPL CORP	31,700	29.130	923,421.000	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	14,124	88.200	1,245,736.800	
PULTEGROUP INC	9,850	46.300	456,055.000	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	99,253	9.910	983,597.230	
PPG INDUSTRIES INC	10,100	126.170	1,274,317.000	
NORTHERN TRUST CORP	8,500	86.950	739,075.000	
FERGUSON PLC	9,300	124.330	1,156,269.000	
NVIDIA CORP	107,180	165.710	17,760,797.800	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	17,613	150.390	2,648,819.070	
ASPEN TECHNOLOGY CORP	1,300	201.110	261,443.000	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES L	3,500	17.550	61,425.000	
TYSON FOODS INC-CL A	12,500	61.840	773,000.000	
NETFLIX INC	19,090	290.710	5,549,653.900	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	16,900	536.440	9,065,836.000	
NRG ENERGY INC	9,850	31.050	305,842.500	
GLOBE LIFE INC	3,855	116.500	449,107.500	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,900	121.050	956,295.000	
TEXTRON INC	8,900	70.000	623,000.000	
NEWS CORP - CLASS A	16,687	17.830	297,529.210	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	250	2,516.990	629,247.500	
OMNICOM GROUP	8,800	77.130	678,744.000	
JACOBS SOLUTIONS INC	5,520	119.070	657,266.400	
ORACLE CORP	68,833	79.580	5,477,730.140	

MASTERCARD INC - A	37,100	345.840	12,830,664.000	
ONEOK INC	19,200	64.490	1,238,208.000	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	40,152	5.410	217,222.320	
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,600	424.360	1,952,056.000	
AMERCO NON VOTING SERIES N	3,600	53.060	191,016.000	
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	6,900	68.140	470,166.000	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	4,600	97.650	449,190.000	
HF SINCLAIR CORP	7,300	50.760	370,548.000	
OVINTIV INC	11,300	50.170	566,921.000	
YUM! BRANDS INC	12,300	129.370	1,591,251.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	7,200	100.760	725,472.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	8,200	51.180	419,676.000	
BANK OF AMERICA CORP	311,301	31.700	9,868,241.700	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,000	396.460	792,920.000	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,000	108.630	869,040.000	
AMERICAN EXPRESS CO	27,400	146.300	4,008,620.000	
MASTERBRAND INC	5,600	9.300	52,080.000	
ANALOG DEVICES INC	22,091	166.820	3,685,220.620	
ADVANCED MICRO DEVICES	69,527	65.410	4,547,761.070	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	32,972	62.570	2,063,058.040	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,900	93.010	641,769.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,900	53.410	528,759.000	
AVERY DENNISON CORP	3,530	179.290	632,893.700	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	22,300	55.560	1,238,988.000	
EMERSON ELECTRIC CO	25,400	94.960	2,411,984.000	
AON PLC-CLASS A	9,100	298.760	2,718,716.000	
AMGEN INC	23,000	267.410	6,150,430.000	
EATON CORP PLC	17,136	154.500	2,647,512.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,900	231.360	1,596,384.000	
APPLIED MATERIALS INC	37,000	104.730	3,875,010.000	
CME GROUP INC	15,500	171.120	2,652,360.000	
ECOLAB INC	11,000	144.050	1,584,550.000	
EQUIFAX INC	5,300	191.900	1,017,070.000	
GILEAD SCIENCES INC	54,000	86.760	4,685,040.000	
KEURIG DR PEPPER INC	33,500	36.070	1,208,345.000	

HORMEL FOODS CORP	12,900	45.660	589,014.000	
STATE STREET CORP	15,813	77.700	1,228,670.100	
SCHWAB (CHARLES) CORP	62,640	78.190	4,897,821.600	
BAXTER INTERNATIONAL INC	21,700	49.710	1,078,707.000	
CAMPBELL SOUP CO	9,100	57.060	519,246.000	
CROWN HOLDINGS INC	5,180	80.500	416,990.000	
CARDINAL HEALTH INC	11,700	79.280	927,576.000	
FEDEX CORP	10,600	171.720	1,820,232.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	16,754	90.100	1,509,535.400	
FMC CORP	5,450	124.300	677,435.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11,013	103.110	1,135,550.430	
INTEL CORP	176,800	26.920	4,759,456.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	16,800	32.460	545,328.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	13,950	74.210	1,035,229.500	
WOLFSPEED INC	5,500	77.060	423,830.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	13,300	216.790	2,883,307.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	38,600	5.960	230,056.000	
ILLUMINA INC	6,800	199.540	1,356,872.000	
SEALED AIR CORP	6,300	50.370	317,331.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	15,400	264.680	4,076,072.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,650	129.050	600,082.500	
SNAP-ON INC	2,300	225.720	519,156.000	
CARMAX INC	6,900	61.440	423,936.000	
DUKE ENERGY CORP	33,228	100.340	3,334,097.520	
TARGET CORP	19,800	146.450	2,899,710.000	
DOVER CORP	6,200	133.480	827,576.000	
WW GRAINGER INC	2,000	558.650	1,117,300.000	
CINTAS CORP	3,900	445.280	1,736,592.000	
CONAGRA BRANDS INC	20,700	38.010	786,807.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	6,400	86.990	556,736.000	
CLOROX COMPANY	5,300	144.600	766,380.000	
ENTERGY CORP	8,800	114.450	1,007,160.000	
MICROSOFT CORP	305,000	244.690	74,630,450.000	
INCYTE CORP	8,200	82.030	672,646.000	
CVS HEALTH CORP	56,469	95.450	5,389,966.050	
MEDTRONIC PLC	57,298	76.720	4,395,902.560	
MICRON TECHNOLOGY INC	47,500	52.070	2,473,325.000	
BLACKROCK INC	6,500	700.220	4,551,430.000	

CENTERPOINT ENERGY INC	27,100	30.010	813,271.000	
HASBRO INC	5,700	57.860	329,802.000	
KELLOGG CO	11,000	71.290	784,190.000	
KEYCORP	40,200	16.620	668,124.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	59,011	66.160	3,904,167.760	
COOPER COS INC/THE	2,100	317.860	667,506.000	
CHUBB LTD	17,999	211.680	3,810,028.320	
ARROW ELECTRONICS INC	2,700	105.120	283,824.000	
ALLSTATE CORP	11,600	131.190	1,521,804.000	
EBAY INC	24,900	41.000	1,020,900.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	47,350	69.260	3,279,461.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	5,200	82.330	428,116.000	
DISH NETWORK CORP-A	10,700	14.410	154,187.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	10,000	240.940	2,409,400.000	
TRIMBLE INC	10,700	49.830	533,181.000	
LENNAR CORP-A	11,000	92.200	1,014,200.000	
LEAR CORP	2,600	124.700	324,220.000	
PROGRESSIVE CORP	25,200	126.450	3,186,540.000	
PACCAR INC	15,037	98.230	1,477,084.510	
BIOGEN INC	6,200	284.980	1,766,876.000	
IDEXX LABORATORIES INC	3,600	407.710	1,467,756.000	
STARBUCKS CORP	49,400	98.830	4,882,202.000	
PTC INC	4,800	123.510	592,848.000	
EVERSOURCE ENERGY	14,900	82.780	1,233,422.000	
INTUIT INC	11,480	384.980	4,419,570.400	
BORGWARNER INC	10,200	40.540	413,508.000	
BEST BUY CO INC	8,850	79.480	703,398.000	
BALL CORP	13,504	51.320	693,025.280	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	61,597	45.810	2,821,758.570	
ELECTRONIC ARTS INC	12,000	121.740	1,460,880.000	
VULCAN MATERIALS CO	5,700	177.170	1,009,869.000	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,000	304.800	3,352,800.000	
VF CORP	14,200	26.370	374,454.000	
PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	26,225	17.310	453,954.750	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,200	97.500	214,500.000	
CARNIVAL CORP	42,500	8.450	359,125.000	
CLEVELAND-CLIFFS INC	21,800	15.130	329,834.000	
COMCAST CORP-CLASS A	189,390	34.490	6,532,061.100	

	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,700	50.220	436,914.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	48,600	4.490	218,214.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 1,432,373,909.060 (195,117,973,892)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	SHELL PLC	305,297	22.430	6,847,811.710	
	HALEON PLC	213,986	3.127	669,241.210	
	BP PLC	788,177	4.554	3,589,358.050	
	UNILEVER PLC	107,054	41.410	4,433,106.140	
	BARCLAYS PLC	683,263	1.544	1,055,094.720	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	352,535	0.873	307,868.810	
	PRUDENTIAL PLC	115,661	10.565	1,221,958.460	
	NATWEST GROUP PLC	223,426	2.590	578,673.340	
	JOHNSON MATTHEY PLC	7,745	20.830	161,328.350	
	BAE SYSTEMS PLC	131,582	8.408	1,106,341.450	
	AVIVA PLC	115,648	4.361	504,340.920	
	AVEVA GROUP PLC	4,948	32.080	158,731.840	
	GSK	171,111	14.280	2,443,465.080	
	INFORMA PLC	60,095	6.076	365,137.220	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	178,792	1.240	221,791.470	
	AUTO TRADER GROUP PLC	38,002	5.344	203,082.680	
	DCC PLC	3,964	40.680	161,255.520	
	OCADO GROUP PLC	23,827	6.296	150,014.790	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,107	108.550	337,264.850	
	HALMA PLC	15,995	20.670	330,616.650	
	ENTAIN PLC	24,059	13.235	318,420.860	
	JD SPORTS FASHION PLC	99,700	1.181	117,745.700	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	30,168	5.966	179,982.280	
	M&G PLC	104,504	1.801	188,211.700	
	RELX PLC	80,735	23.060	1,861,749.100	
	DIAGEO PLC	95,756	36.240	3,470,197.440	
	RIO TINTO PLC	47,305	56.120	2,654,756.600	
	STANDARD CHARTERED PLC	104,659	6.168	645,536.710	
	TESCO PLC	313,857	2.223	697,704.110	
	SMITH & NEPHEW PLC	36,648	10.800	395,798.400	
	GLENCORE PLC	410,631	5.311	2,180,861.240	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	15,095	8.540	128,911.300	

SMITHS GROUP PLC	15,383	15.705	241,590.010
PEARSON PLC	28,363	9.194	260,769.420
SAINSBURY (J) PLC	71,864	2.179	156,591.650
NEXT PLC	5,311	56.260	298,796.860
TAYLOR WIMPEY PLC	146,673	1.005	147,406.360
WHITBREAD PLC	8,127	26.020	211,464.540
BUNZL PLC	14,223	28.530	405,782.190
VODAFONE GROUP PLC	1,110,726	0.837	930,344.090
CRODA INTERNATIONAL PLC	5,884	67.120	394,934.080
KINGFISHER PLC	78,711	2.287	180,012.050
WPP PLC	45,847	7.982	365,950.750
UNITED UTILITIES GROUP PLC	27,881	10.200	284,386.200
SEVERN TRENT PLC	10,232	26.940	275,650.080
RENTOKIL INITIAL PLC	108,366	5.178	561,119.140
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	30,107	57.360	1,726,937.520
ST JAMES'S PLACE PLC	22,937	10.940	250,930.780
SCHRODERS PLC	31,016	4.388	136,098.200
SSE PLC	44,916	16.885	758,406.660
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	43,245	3.997	172,850.260
ASTRAZENECA PLC	65,186	111.560	7,272,150.160
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	251,679	2.469	621,395.450
3I GROUP PLC	41,010	12.765	523,492.650
ASHTED GROUP PLC	18,552	47.580	882,704.160
SAGE GROUP PLC/THE	43,009	7.708	331,513.370
NATIONAL GRID PLC	154,032	9.958	1,533,850.650
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,850,013	0.451	1,287,635.870
IMPERIAL BRANDS PLC	38,161	20.500	782,300.500
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	4,618	37.980	175,391.640
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	89,852	32.935	2,959,275.620
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	15,062	15.530	233,912.860
HSBC HOLDINGS PLC	839,526	4.922	4,132,566.730
ANGLO AMERICAN PLC	53,457	31.000	1,657,167.000
MONDI PLC	19,853	14.180	281,515.540
COMPASS GROUP PLC	74,218	19.010	1,410,884.180
PERSIMMON PLC	12,832	12.130	155,652.160
BT GROUP PLC	345,300	1.129	390,016.350

	COCA-COLA HBC AG-DI	8,521	19.360	164,966.560	
	BURBERRY GROUP PLC	16,061	20.400	327,644.400	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	7,523	48.070	361,630.610	
	INTERTEK GROUP PLC	6,800	39.430	268,124.000	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	13,843	73.400	1,016,076.200	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	6,600	15.035	99,231.000	
	ADMIRAL GROUP PLC	7,500	20.150	151,125.000	
	ANTOFAGASTA PLC	16,670	14.580	243,048.600	
	ABRDN PLC	90,862	1.851	168,185.560	
	EXPERIAN PLC	38,728	28.590	1,107,233.520	
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 73,985,069.880 (12,268,204,289)	
イスラエル・ シュケル		株	イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	57,175	18.800	1,074,890.000	
	AZRIELI GROUP LTD	1,826	242.900	443,535.400	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	5,051	158.200	799,068.200	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	89,000	6.050	538,450.000	
	ICL GROUP LTD	32,721	25.500	834,385.500	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,230	580.000	713,400.000	
	BANK HAPOALIM BM	58,700	30.350	1,781,545.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	71,355	29.210	2,084,279.550	
	NICE LTD	2,936	689.400	2,024,078.400	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	7,128	113.600	809,740.800	
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル 11,103,372.850 (437,100,927)	
オーストラリ ア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	THE LOTTERY CORPORATION LTD	90,336	4.570	412,835.520	
	TELSTRA GROUP LTD	163,832	4.050	663,519.600	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	105,094	2.940	308,976.360	
	BHP GROUP LTD	205,018	45.670	9,363,172.060	
	SOUTH32 LTD	187,789	4.100	769,934.900	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	76,829	35.600	2,735,112.400	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	68,528	20.130	1,379,468.640	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	127,924	30.400	3,888,889.600	

WESTPAC BANKING CORP	141,707	23.300	3,301,773.100	
SANTOS LTD	128,823	7.220	930,102.060	
AUST AND NZ BANKING GROUP	120,941	23.620	2,856,626.420	
RIO TINTO LTD	15,022	114.550	1,720,770.100	
ORIGIN ENERGY LTD	68,887	7.240	498,741.880	
AURIZON HOLDINGS LTD	75,100	3.870	290,637.000	
PILBARA MINERALS LTD	113,184	4.100	464,054.400	
XERO LTD	5,484	73.520	403,183.680	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	8,844	27.480	243,033.120	
COLES GROUP LTD	54,076	17.140	926,862.640	
WISETECH GLOBAL LTD	5,992	54.500	326,564.000	
IDP EDUCATION LTD	7,900	27.830	219,857.000	
IGO LTD	30,405	13.920	423,237.600	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	47,271	10.660	503,908.860	
REECE LTD	10,500	14.480	152,040.000	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	54,518	6.590	359,273.620	
SEEK LTD	12,845	21.570	277,066.650	
TREASURY WINE ESTATES LTD	29,301	13.320	390,289.320	
NEWCREST MINING LTD	36,247	20.660	748,863.020	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	68,827	105.980	7,294,285.460	
AMPOL LTD	9,715	28.580	277,654.700	
ORICA LTD	17,751	15.390	273,187.890	
QBE INSURANCE GROUP LTD	60,251	13.150	792,300.650	
WOOLWORTHS GROUP LTD	49,120	34.310	1,685,307.200	
QANTAS AIRWAYS LTD	35,469	6.230	220,971.870	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	17,415	29.480	513,394.200	
MACQUARIE GROUP LTD	14,874	169.900	2,527,092.600	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	24,284	32.950	800,157.800	
CSL LTD	19,493	291.680	5,685,718.240	
WESFARMERS LTD	45,895	46.970	2,155,688.150	
COCHLEAR LTD	2,670	206.800	552,156.000	
BLUESCOPE STEEL LTD	19,124	17.280	330,462.720	
SUNCORP GROUP LTD	51,271	11.820	606,023.220	
ASX LTD	7,861	68.270	536,670.470	
COMPUTERSHARE LTD	22,060	26.610	587,016.600	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	96,410	4.690	452,162.900	

	SONIC HEALTHCARE LTD	18,523	30.380	562,728.740	
	BRAMBLES LTD	56,158	12.430	698,043.940	
	MINERAL RESOURCES LTD	6,666	81.220	541,412.520	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,434	65.000	483,210.000	
	REA GROUP LTD	2,023	119.210	241,161.830	
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル 62,375,601.250 (5,693,021,126)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	34,100	61.250	2,088,625.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	14,681	37.120	544,958.720	
	IMPERIAL OIL LTD	9,500	63.860	606,670.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	800	2,118.260	1,694,608.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	12,087	90.430	1,093,027.410	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	18,900	53.350	1,008,315.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	7,350	198.100	1,456,035.000	
	BCE INC	4,930	60.390	297,722.700	
	FRANCO-NEVADA CORP	8,000	181.380	1,451,040.000	
	SUNCOR ENERGY INC	58,230	40.970	2,385,683.100	
	METRO INC/CN	10,000	76.690	766,900.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	14,100	92.400	1,302,840.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	50,000	65.240	3,262,000.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	37,800	55.440	2,095,632.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	76,000	86.630	6,583,880.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	11,400	30.120	343,368.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	58,050	127.960	7,428,078.000	
	TOURMALINE OIL CORP	13,300	71.150	946,295.000	
	TC ENERGY CORP	42,450	55.170	2,341,966.500	
	PEMBINA PIPELINE CORP	23,229	44.790	1,040,426.910	
	BARRICK GOLD CORP	73,900	23.140	1,710,046.000	
	CAE INC	13,300	26.570	353,381.000	
	THOMSON REUTERS CORP	7,112	155.750	1,107,694.000	
	EMPIRE CO LTD 'A'	6,500	35.750	232,375.000	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,500	98.960	346,360.000	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	6,150	59.210	364,141.500	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	17,600	18.980	334,048.000	

HYDRO ONE LTD	13,800	37.020	510,876.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	6,760	122.140	825,666.400	
NORTHLAND POWER INC	9,400	38.940	366,036.000	
WSP GLOBAL INC	5,200	162.550	845,260.000	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,300	100.450	331,485.000	
PARKLAND CORP	6,600	29.680	195,888.000	
QUEBECOR INC -CL B	6,000	27.860	167,160.000	
EMERA INC	11,100	52.540	583,194.000	
TFI INTERNATIONAL INC	3,300	144.370	476,421.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	5,400	37.470	202,338.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	14,800	60.910	901,468.000	
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,600	103.930	166,288.000	
IVANHOE MINES LTD-CL A	24,600	11.480	282,408.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	19,117	69.950	1,337,234.150	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	26,700	9.410	251,247.000	
AIR CANADA	6,500	18.950	123,175.000	
KINROSS GOLD CORP	53,000	5.620	297,860.000	
BANK OF MONTREAL	28,000	120.630	3,377,640.000	
POWER CORP OF CANADA	23,100	32.610	753,291.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	49,800	49.400	2,460,120.000	
NUTRIEN LTD	22,519	100.850	2,271,041.150	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,300	41.750	221,275.000	
CAMECO CORP	18,300	29.720	543,876.000	
FIRSTSERVICE CORP	1,700	166.460	282,982.000	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	7,100	38.760	275,196.000	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,600	36.070	93,782.000	
TELUS CORP	10,800	27.030	291,924.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	20,000	51.100	1,022,000.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,200	143.290	315,238.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	46,600	71.800	3,345,880.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,000	796.350	796,350.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	11,300	78.250	884,225.000	
WESTON (GEORGE) LTD	2,937	173.370	509,187.690	
PAN AMERICAN SILVER CORP	8,900	21.880	194,732.000	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	3,800	94.210	357,998.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	24,500	62.500	1,531,250.000	
ENBRIDGE INC	84,600	52.540	4,444,884.000	
BROOKFIELD CORP	58,725	44.400	2,607,390.000	

	MANULIFE FINANCIAL CORP	79,600	23.970	1,908,012.000	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	38,820	103.200	4,006,224.000	
	IA FINANCIAL CORP INC	4,400	76.690	337,436.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,500	37.510	281,325.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	24,550	166.460	4,086,593.000	
	CGI INC - CLASS A	8,900	117.080	1,042,012.000	
	ONEX CORPORATION	2,900	65.240	189,196.000	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	20,000	36.350	727,000.000	
	IGM FINANCIAL INC	3,100	37.280	115,568.000	
	TMX GROUP LTD	2,300	136.460	313,858.000	
	OPEN TEXT CORP	11,000	39.400	433,400.000	
	SAPUTO INC	10,200	34.120	348,024.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	24,600	27.300	671,580.000	
	FORTIS INC	20,000	55.060	1,101,200.000	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	4,400	75.470	332,068.000	
	LUNDIN MINING CORP	27,800	8.720	242,416.000	
	CENOVUS ENERGY INC	58,000	24.240	1,405,920.000	
	DOLLARAMA INC	11,500	81.000	931,500.000	
	ALTAGAS LTD	11,100	23.130	256,743.000	
	KEYERA CORP	8,800	28.660	252,208.000	
	ARC RESOURCES LTD	28,600	17.630	504,218.000	
	カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 97,116,884.230 (9,675,755,175)	
シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD	120,200	3.620	435,124.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	54,500	30.720	1,674,240.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	83,700	33.840	2,832,408.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	61,875	5.560	344,025.000	
	KEPPEL CORP LTD	67,300	7.330	493,309.000	
	UOL GROUP LTD	20,000	6.720	134,400.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	18,900	8.170	154,413.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,400	28.070	123,508.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	156,500	12.190	1,907,735.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	279,500	0.935	261,332.500	
	VENTURE CORP LTD	12,800	17.070	218,496.000	

	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	381,750	2.540	969,645.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	72,200	3.380	244,036.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	39,600	8.930	353,628.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	88,800	4.120	365,856.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 10,512,155.500 (1,055,840,898)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	UBS GROUP AG-REG	140,483	16.515	2,320,076.740	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,180	369.800	436,364.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	280	628.000	175,840.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	6,360	29.950	190,482.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	28,985	301.350	8,734,629.750	
	SIKA AG-REG	6,025	226.100	1,362,252.500	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	4	94,000.000	376,000.000	
	ABB LTD-REG	65,605	28.120	1,844,812.600	
	SWISS RE AG	12,444	84.160	1,047,287.040	
	NESTLE SA-REG	113,134	107.160	12,123,439.440	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	937	828.000	775,836.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,683	171.750	289,055.250	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	109,588	2.825	309,586.100	
	JULIUS BAER GROUP LTD	8,708	52.940	461,001.520	
	SGS SA-REG	263	2,139.000	562,557.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	934	163.000	152,242.000	
	TEMENOS AG - REG	2,500	51.100	127,750.000	
	VAT GROUP AG	1,117	265.400	296,451.800	
	BKW AG	942	126.600	119,257.200	
	ALCON INC	20,616	62.260	1,283,552.160	
	SIG GROUP N AG	13,000	20.800	270,400.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,159	253.800	294,154.200	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,207	438.500	2,721,769.500	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,800	138.900	250,020.000	
	CLARIANT AG-REG	8,678	14.830	128,694.740	
	NOVARTIS AG-REG	89,263	84.240	7,519,515.120	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	141	1,815.000	255,915.000	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,250	84.150	105,187.500	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	21,536	118.200	2,545,555.200	

	SWISSCOM AG-REG	1,068	500.400	534,427.200	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,344	89.550	120,355.200	
	GEBERIT AG-REG	1,480	436.200	645,576.000	
	GIVAUDAN-REG	381	2,884.000	1,098,804.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	4,614	104.450	481,932.300	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,220	219.100	486,402.000	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,929	54.660	378,739.140	
	LONZA GROUP AG-REG	3,072	450.000	1,382,400.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,900	46.560	88,464.000	
	HOLCIM LTD	22,909	46.940	1,075,348.460	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,271	473.800	602,199.800	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,246	212.200	476,601.200	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,025	78.700	238,067.500	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	42	9,420.000	395,640.000	
スイス・フラン 小計				スイス・フラン 55,084,641.160 (8,042,357,609)	
スウェーデン・ クローナ		株	スウェーデン・クロー ナ	スウェーデン・クロー ナ	
	SAGAX CLASS B	8,813	233.900	2,061,360.700	
	INVESTOR CLASS A	23,050	195.900	4,515,495.000	
	VOLVO CAR CLASS B	24,808	47.125	1,169,077.000	
	ERICSSON LM-B SHS	130,588	59.760	7,803,938.880	
	VOLVO AB-B SHS	67,930	189.880	12,898,548.400	
	SKF AB-B SHARES	17,719	159.500	2,826,180.500	
	ELECTROLUX AB-SER B	10,164	140.000	1,422,960.000	
	TELE2 AB-B SHS	26,333	86.500	2,277,804.500	
	GETINGE AB-B SHS	10,572	216.800	2,292,009.600	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN- A	73,028	117.500	8,580,790.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	65,759	103.100	6,779,752.900	
	SWEDBANK AB - A SHARES	40,966	171.100	7,009,282.600	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	33,756	111.440	3,761,768.640	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	28,004	134.000	3,752,536.000	
	SKANSKA AB-B SHS	15,724	164.350	2,584,239.400	
	SANDVIK AB	47,700	187.550	8,946,135.000	
	INVESTOR AB-B SHS	81,394	189.220	15,401,372.680	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	120,575	126.540	15,257,560.500	
	VOLVO AB-A SHS	9,255	200.000	1,851,000.000	

	HOLMEN AB-B SHARES	4,336	414.200	1,795,971.200	
	SECURITAS AB-B SHS	22,743	83.140	1,890,853.020	
	TELIA CO AB	122,866	26.730	3,284,208.180	
	ALFA LAVAL AB	13,391	299.500	4,010,604.500	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	70,161	114.320	8,020,805.520	
	ASSA ABLOY AB-B	45,126	229.000	10,333,854.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	6,027	252.300	1,520,612.100	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	26,268	49.600	1,302,892.800	
	INDUTRADE AB	12,629	213.500	2,696,291.500	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	7,807	219.700	1,715,197.900	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,513	444.300	1,560,825.900	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,843	199.300	1,363,809.900	
	LIFCO AB-B SHS	10,774	173.950	1,874,137.300	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	68,208	99.100	6,759,412.800	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	27,204	272.900	7,423,971.600	
	EMBRACER GROUP AB	30,041	50.720	1,523,679.520	
	BOLIDEN AB	12,642	392.350	4,960,088.700	
	EPIROC AB-A	30,436	189.000	5,752,404.000	
	EPIROC AB-B	18,025	165.800	2,988,545.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	19,395	73.340	1,422,429.300	
	NORDEA BANK ABP	151,748	107.180	16,264,350.640	
	EQT AB	13,781	221.500	3,052,491.500	
	EVOLUTION AB	8,167	1,004.400	8,202,934.800	
	KINNEVIK AB - B	10,431	143.450	1,496,326.950	
	HEXAGON AB-B SHS	87,750	113.350	9,946,462.500	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	7,118	252.500	1,797,295.000	
	スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 224,152,268.430 (2,940,877,761)	
デンマーク・クローネ		株	デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	NOVO NORDISK A/S-B	74,105	927.700	68,747,208.500	
	DANSKE BANK A/S	31,880	130.050	4,145,994.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	143	14,480.000	2,070,640.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	46,042	193.620	8,914,652.040	
	CARLSBERG AS-B	4,499	907.000	4,080,593.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	9,453	352.500	3,332,182.500	
	COLOPLAST-B	5,491	836.000	4,590,476.000	
	DSV PANALPINA A/S	8,480	1,084.000	9,192,320.000	

	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	370	1,524.500	564,065.000	
	DEMANT A/S	4,275	181.300	775,057.500	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	230	14,760.000	3,394,800.000	
	TRYG A/S	16,642	161.550	2,688,515.100	
	PANDORA A/S	4,000	490.000	1,960,000.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,875	508.600	2,479,425.000	
	GENMAB A/S	3,029	3,053.000	9,247,537.000	
	ORSTED A/S	8,744	619.300	5,415,159.200	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 131,598,624.840 (2,553,013,322)	
ニュージーランド・ドル		株	ニュージーランド・ドル	ニュージーランド・ドル	
	MERIDIAN ENERGY LTD	59,568	5.095	303,498.960	
	MERCURY NZ LTD	30,000	5.730	171,900.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	86,506	5.340	461,942.040	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	57,858	8.110	469,228.380	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	26,686	22.060	588,693.160	
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 1,995,262.540 (173,587,841)	
ノルウェー・クローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	DNB BANK	42,995	185.550	7,977,722.250	
	NORSK HYDRO ASA	62,159	69.100	4,295,186.900	
	ORKLA ASA	34,715	70.540	2,448,796.100	
	TELENOR ASA	32,342	88.560	2,864,207.520	
	EQUINOR ASA	44,031	357.450	15,738,880.950	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,653	424.700	3,250,229.100	
	MOWI ASA	19,121	157.950	3,020,161.950	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	9,244	191.700	1,772,074.800	
	AKER BP ASA	14,606	301.500	4,403,709.000	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	4,098	408.000	1,671,984.000	
	SALMAR ASA	3,020	357.200	1,078,744.000	
	ADEVINTA ASA	12,000	68.250	819,000.000	
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 49,340,696.570 (680,408,206)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	

UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	30,189	22.250	671,705.250	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	18,873	29.955	565,340.710	
EXOR NV	4,500	69.200	311,400.000	
DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	4,737	93.640	443,572.680	
CORPORACION ACCIONA ENERGIAS RENOV	2,938	36.800	108,118.400	
BAYER AG-REG	40,896	48.560	1,985,909.760	
EVONIK INDUSTRIES AG	8,777	17.730	155,616.210	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	86,224	9.905	854,048.720	
COMMERZBANK AG	44,394	8.144	361,544.730	
VOLKSWAGEN AG	1,200	170.100	204,120.000	
VOLKSWAGEN AG-PREF	7,725	136.540	1,054,771.500	
SIEMENS AG-REG	31,842	127.080	4,046,481.360	
E.ON SE	93,460	8.928	834,410.880	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,783	82.620	1,138,751.460	
GEA GROUP AG	6,337	38.560	244,354.720	
CONTINENTAL AG	4,588	56.480	259,130.240	
BASF SE	38,234	45.790	1,750,734.860	
ALLIANZ SE-REG	17,002	197.860	3,364,015.720	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	7,415	65.660	486,868.900	
RHEINMETALL AG	1,813	201.400	365,138.200	
RWE AG	26,742	41.490	1,109,525.580	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	25,117	8.028	201,639.270	
BRENNTAG SE	6,444	56.320	362,926.080	
FRESENIUS SE & CO KGAA	17,639	25.580	451,205.620	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,839	18.140	69,639.460	
SAP SE	43,465	99.450	4,322,594.250	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,832	296.600	1,729,771.200	
ZALANDO SE	9,346	31.850	297,670.100	
HEIDELBERGCEMENT AG	6,041	51.720	312,440.520	
COVESTRO AG	8,095	35.660	288,667.700	
RATIONAL AG	215	552.000	118,680.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,210	341.600	413,336.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	6,387	51.960	331,868.520	
DELIVERY HERO SE	7,122	40.390	287,657.580	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,592	116.950	186,184.400	
BECHTLE AG	3,238	33.420	108,213.960	

NEMETSCHKE SE	2,284	47.730	109,015.320	
SCOUT24 AG	3,600	49.560	178,416.000	
AROUNDTOWN SA	38,000	2.380	90,440.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	11,765	48.100	565,896.500	
KNORR-BREMSE AG	2,800	51.180	143,304.000	
HELLOFRESH SE	6,516	20.880	136,054.080	
SIEMENS ENERGY AG	18,174	16.575	301,234.050	
BEIERSDORF AG	4,204	106.650	448,356.600	
MERCK KGAA	5,380	181.200	974,856.000	
ADIDAS AG	7,200	121.100	871,920.000	
PUMA SE	4,163	52.340	217,891.420	
HENKEL AG & CO KGAA	4,334	61.100	264,807.400	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	134,925	18.850	2,543,336.250	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	8,570	29.370	251,700.900	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	33,369	62.030	2,069,879.070	
QIAGEN N.V.	9,482	46.130	437,404.660	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	54,363	29.660	1,612,406.580	
HANNOVER RUECK SE	2,515	181.900	457,478.500	
DEUTSCHE POST AG-REG	41,264	36.010	1,485,916.640	
DEUTSCHE BOERSE AG	7,909	165.850	1,311,707.650	
MTU AERO ENGINES AG	2,229	202.600	451,595.400	
SYMRISE AG	5,539	104.400	578,271.600	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	41,312	2.235	92,332.320	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	2,494	78.950	196,901.300	
VONOVIA SE	29,815	21.500	641,022.500	
LEG IMMOBILIEN SE	3,105	60.660	188,349.300	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	37,112	12.846	476,740.750	
NN GROUP NV	11,292	40.910	461,955.720	
ARCELORMITTAL	25,700	24.060	618,342.000	
HEINEKEN NV	10,790	88.240	952,109.600	
AEGON NV	72,059	4.561	328,661.090	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	43,531	27.150	1,181,866.650	
AKZO NOBEL N.V.	7,582	63.760	483,428.320	
KONINKLIJKE DSM NV	7,276	118.850	864,752.600	
WOLTERS KLUWER	10,928	101.300	1,107,006.400	
ING GROEP NV	156,862	11.268	1,767,521.010	

KONINKLIJKE KPN NV	132,781	2.903	385,463.240	
ASML HOLDING NV	16,921	540.500	9,145,800.500	
ABN AMRO BANK NV-CVA	16,700	12.510	208,917.000	
IMCD NV	2,377	137.350	326,480.950	
ADYEN NV	903	1,371.800	1,238,735.400	
JUST EAT TAKEAWAY	7,220	19.816	143,071.520	
PROSUS NV	35,480	63.800	2,263,624.000	
JDE PEET'S NV	4,224	27.520	116,244.480	
ASM INTERNATIONAL NV	1,949	254.300	495,630.700	
RANDSTAD NV	4,987	55.920	278,873.040	
HEINEKEN HOLDING NV	4,250	72.350	307,487.500	
OCI NV	4,386	34.740	152,369.640	
TOTALENERGIES SE	103,618	55.660	5,767,377.880	
MICHELIN (CGDE)	28,298	25.840	731,220.320	
AIR LIQUIDE SA	21,786	132.760	2,892,309.360	
KERING	3,117	491.050	1,530,602.850	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	22,584	130.820	2,954,438.880	
BOUYGUES SA	9,572	28.260	270,504.720	
BNP PARIBAS	46,244	52.540	2,429,659.760	
THALES SA	4,441	119.500	530,699.500	
DANONE	26,733	48.625	1,299,892.120	
CARREFOUR SA	24,454	15.575	380,871.050	
VIVENDI	29,591	8.670	256,553.970	
L'OREAL	10,055	335.750	3,375,966.250	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	20,549	44.610	916,690.890	
LEGRAND SA	11,104	76.660	851,232.640	
PERNOD RICARD SA	8,576	182.950	1,568,979.200	
EURAZEO SE	1,724	58.000	99,992.000	
SOCIETE GENERALE SA	33,661	22.405	754,174.700	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	11,518	693.800	7,991,188.400	
ACCOR SA	6,717	23.940	160,804.980	
CAPGEMINI SE	6,818	159.450	1,087,130.100	
VALEO SA	8,400	17.405	146,202.000	
PUBLICIS GROUPE	9,510	59.440	565,274.400	
BUREAU VERITAS SA	12,262	24.380	298,947.560	
EIFFAGE	3,474	91.800	318,913.200	
SODEXO SA	3,690	91.620	338,077.800	
IPSEN	1,583	97.300	154,025.900	

AMUNDI SA	2,569	51.800	133,074.200	
TELEPERFORMANCE	2,468	213.600	527,164.800	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,600	25.480	91,728.000	
EURONEXT NV	3,583	69.160	247,800.280	
EUROFINS SCIENTIFIC	5,621	62.740	352,661.540	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,152	303.900	350,092.800	
SEB SA	997	76.650	76,420.050	
ESSILORLUXOTTICA	12,121	170.950	2,072,084.950	
DASSAULT AVIATION SA	1,000	157.700	157,700.000	
WORLDLINE SA	9,957	37.070	369,105.990	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	4,163	38.140	158,776.820	
AXA SA	77,674	26.030	2,021,854.220	
EDENRED	10,387	50.840	528,075.080	
RENAULT SA	7,755	32.695	253,549.720	
HERMES INTERNATIONAL	1,318	1,486.500	1,959,207.000	
STMICROELECTRONICS NV	28,451	34.940	994,077.940	
REMY COINTREAU	900	158.600	142,740.000	
DASSAULT SYSTEMES SE	27,747	34.165	947,976.250	
WENDEL	1,124	86.100	96,776.400	
ORANGE	83,049	9.180	762,389.820	
ALSTOM	13,348	22.820	304,601.360	
SANOFI	47,495	87.620	4,161,511.900	
VINCI SA	22,407	92.390	2,070,182.730	
AIRBUS SE	24,606	109.980	2,706,167.880	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	27,767	24.230	672,794.410	
CREDIT AGRICOLE SA	49,128	9.384	461,017.150	
BIOMERIEUX	1,691	95.160	160,915.560	
ENGIE	76,032	13.892	1,056,236.540	
EDF	24,416	12.000	292,992.000	
SAFRAN SA	14,228	115.820	1,647,886.960	
ARKEMA	2,395	84.940	203,431.300	
ADP	1,245	123.350	153,570.750	
GETLINK SE	18,353	14.940	274,193.820	
BOLLORE	35,675	5.125	182,834.370	
UCB SA	5,274	73.120	385,634.880	
KBC GROUP NV	10,435	56.800	592,708.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,200	74.120	311,304.000	
SOLVAY SA	2,984	93.320	278,466.880	
UMICORE	8,735	34.060	297,514.100	

ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	36,158	55.990	2,024,486.420
AGEAS	6,735	40.920	275,596.200
D' IETEREN GROUP	1,036	174.900	181,196.400
ELIA GROUP SA/NV	1,333	134.400	179,155.200
SOFINA	600	206.800	124,080.000
ARGENX SE	2,290	365.500	836,995.000
PRYSMIAN SPA	10,626	34.990	371,803.740
ASSICURAZIONI GENERALI	46,239	16.500	762,943.500
MEDIOBANCA SPA	24,407	8.908	217,417.550
TENARIS SA	19,697	15.370	302,742.890
UNICREDIT SPA	83,217	12.788	1,064,178.990
TELECOM ITALIA SPA	378,782	0.203	76,930.620
INTESA SANPAOLO	696,328	2.058	1,433,043.020
POSTE ITALIANE SPA	21,074	9.048	190,677.550
MONCLER SPA	8,261	49.190	406,358.590
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	4,217	39.600	166,993.200
ENI SPA	103,962	12.900	1,341,109.800
DAVIDE CAMPARI -MILANO NV	21,064	9.814	206,722.090
DIASORIN SPA	1,000	129.500	129,500.000
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	12,800	9.312	119,193.600
NEXI SPA	25,005	7.360	184,036.800
AMPLIFON SPA	5,217	26.940	140,545.980
ENEL SPA	338,574	5.050	1,709,798.700
SNAM SPA	84,127	4.663	392,284.200
TERNA SPA	58,687	7.184	421,607.400
CNH INDUSTRIAL NV	42,691	14.945	638,016.990
FINECOBANK SPA	25,546	15.120	386,255.520
STELLANTIS NV	91,611	13.354	1,223,373.290
FERRARI NV	5,247	206.500	1,083,505.500
TELEFONICA SA	216,164	3.246	701,668.340
ENDESA SA	13,297	17.495	232,631.010
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	267,700	5.398	1,445,044.600
IBERDROLA SA	251,955	10.715	2,699,697.820
REPSOL SA	57,201	13.990	800,241.990
GRIFOLS SA	11,830	10.395	122,972.850
BANCO SANTANDER SA	698,191	2.723	1,901,523.180
AMADEUS IT GROUP SA	18,753	50.500	947,026.500

NATURGY ENERGY GROUP SA	10,300	25.150	259,045.000
CAIXABANK SA	184,901	3.546	655,658.940
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,876	26.120	231,841.120
AENA SME SA	3,135	121.100	379,648.500
CELLNEX TELECOM SA	22,664	31.160	706,210.240
ACCIONA SA	1,028	174.800	179,694.400
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	45,409	24.320	1,104,346.880
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	9,414	18.010	169,546.140
ENAGAS SA	9,884	16.575	163,827.300
RED ELECTRICA CORPORACION SA	16,961	16.665	282,655.060
FERROVIAL SA	20,379	24.410	497,451.390
UPM-KYMMENE OYJ	22,218	34.860	774,519.480
NOKIA OYJ	225,267	4.360	982,164.120
WARTSILA OYJ ABP	19,124	8.132	155,516.360
STORA ENSO OYJ-R SHS	23,026	13.140	302,561.640
ELISA OYJ	5,725	49.770	284,933.250
SAMPO OYJ-A SHS	19,930	48.190	960,426.700
FORTUM OYJ	18,595	14.330	266,466.350
KESKO OYJ-B SHS	11,435	20.360	232,816.600
KONE OYJ-B	14,180	47.540	674,117.200
NESTE OYJ	17,611	44.610	785,626.710
ORION OYJ-CLASS B	4,472	51.520	230,397.440
VERBUND AG	2,740	79.750	218,515.000
OMV AG	6,161	46.000	283,406.000
ERSTE GROUP BANK AG	14,343	28.290	405,763.470
VOESTALPINE AG	4,878	24.000	117,072.000
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	9,948	34.980	347,981.040
AIB GROUP PLC	47,708	3.338	159,249.300
BANK OF IRELAND GROUP PLC	47,750	8.408	401,482.000
KINGSPAN GROUP PLC	6,443	50.400	324,727.200
JERONIMO MARTINS	11,416	20.080	229,233.280
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	115,792	4.624	535,422.200
GALP ENERGIA SGPS SA	20,196	11.720	236,697.120
EDP RENOVAVEIS SA	11,594	21.430	248,459.420
KERRY GROUP PLC-A	6,643	86.080	571,829.440
CRH PLC	31,392	36.290	1,139,215.680
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,954	130.900	910,278.600

ユーロ 小計			ユーロ	177,702,739.170 (25,651,390,399)
香港・ドル	株	香港・ドル	香港・ドル	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	64,000	41.500	2,656,000.000	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	101,000	52.500	5,302,500.000	
MTR CORP	71,500	40.300	2,881,450.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	67,000	105.100	7,041,700.000	
SINO LAND CO	160,000	9.810	1,569,600.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	124,169	45.450	5,643,481.050	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	21,500	65.800	1,414,700.000	
CLP HOLDINGS LTD	76,000	54.550	4,145,800.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	66,507	26.900	1,789,038.300	
HONG KONG & CHINA GAS	517,475	7.440	3,850,014.000	
HANG SENG BANK LTD	35,300	129.000	4,553,700.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	63,500	22.000	1,397,000.000	
WH GROUP LTD	361,000	4.630	1,671,430.000	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	54,100	332.800	18,004,480.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	87,000	14.900	1,296,300.000	
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	78,000	14.740	1,149,720.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	54,000	19.300	1,042,200.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	91,169	45.850	4,180,098.650	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	26,500	39.450	1,045,425.000	
AIA GROUP LTD	535,600	84.600	45,311,760.000	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	54,000	21.900	1,182,600.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	77,000	45.600	3,511,200.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	74,100	24.450	1,811,745.000	
ESR CAYMAN LTD	86,200	16.860	1,453,332.000	
SANDS CHINA LTD	112,400	25.900	2,911,160.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	63,500	90.950	5,775,325.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	171,000	26.150	4,471,650.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 137,063,409.000 (2,397,239,024)	
合計			266,686,770,469	

(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			アメリカ・ドル	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,037	996,105.000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	14,107	1,640,926.240	
		BOSTON PROPERTIES INC	6,200	417,136.000	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,600	1,289,334.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	15,400	936,782.000	
		EQUINIX INC	3,908	2,609,918.720	
		AMERICAN TOWER CORP	20,100	4,290,345.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	30,843	524,331.000	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	13,500	416,205.000	
		KIMCO REALTY CORP	26,700	566,841.000	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	16,400	310,616.000	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	11,000	575,520.000	
		INVITATION HOMES INC	26,300	798,994.000	
		VICI PROPERTIES INC	41,500	1,383,610.000	
		VENTAS INC	17,200	767,980.000	
		WEYERHAEUSER CO	31,914	998,908.200	
		CROWN CASTLE INTL CORP	18,600	2,506,722.000	
		IRON MOUNTAIN INC	12,500	645,125.000	
		SUN COMMUNITIES INC	5,300	754,508.000	
		PROLOGIS INC	39,654	4,450,764.960	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6,700	970,830.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,400	493,680.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,800	593,936.000	
		WELLTOWER INC	20,000	1,286,400.000	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	23,300	585,995.000	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,000	788,000.000	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	7,600	496,052.000	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	20,300	434,217.000	
		REALTY INCOME CORP	26,595	1,688,250.600	
PUBLIC STORAGE	6,800	1,947,996.000			
REGENCY CENTERS CORP	6,600	414,018.000			
UDR INC	14,000	547,680.000			
WP CAREY INC	8,300	662,174.000			

	DIGITAL REALTY TRUST INC	12,400	1,259,096.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,800	865,940.000	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	25,800	293,862.000	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 40,208,798.720 (5,477,242,562)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	28,317	173,413.300	
	SEGREO PLC	50,974	387,300.450	
	BRITISH LAND CO PLC	35,395	137,332.600	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 698,046.350 (115,750,046)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	DEXUS/AU	40,978	336,429.380	
	LENDLEASE GROUP	28,107	208,272.870	
	TRANSURBAN GROUP	124,442	1,732,232.640	
	APA GROUP	47,887	515,264.120	
	SCENTRE GROUP	203,007	590,750.370	
	GPT GROUP	73,031	318,415.160	
	MIRVAC GROUP	160,990	357,397.800	
	STOCKLAND	96,885	375,913.800	
	GOODMAN GROUP	68,550	1,248,981.000	
	VICINITY CENTRES	151,865	302,211.350	
オーストラリア・ドル	小計		オーストラリア・ドル 5,985,868.490 (546,330,217)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,400	143,616.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5,800	120,698.000	
カナダ・ドル	小計		カナダ・ドル 264,314.000 (26,333,604)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	155,300	420,863.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	245,170	495,243.400	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	155,400	248,640.000	

	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	101,300	169,171.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 1,333,917.400 (133,978,663)	
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,925	243,393.500	ユーロ
	GECINA SA	1,817	170,888.850	
	KLEPIERRE	8,527	184,609.550	
	COVIVIO	2,000	108,900.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	6,757	178,384.800	
ユーロ 小計			ユーロ 886,176.700 (127,919,606)	
香港・ドル	LINK REIT	97,600	5,431,440.000	香港・ドル
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	107,000	539,280.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	163,000	1,561,540.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 7,532,260.000 (131,739,227)	
投資証券 合計			6,559,293,925 [6,559,293,925]	
合計			6,559,293,925 [6,559,293,925]	

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 602銘柄	97.3%	2.7%	73.5%
	投資証券 36銘柄			
イギリス・ポンド	株式 78銘柄	99.1%	0.9%	4.5%
	投資証券 3銘柄			
イスラエル・シケル	株式 10銘柄	100%	-%	0.2%
オーストラリア・ドル	株式 49銘柄	91.2%	8.8%	2.3%
	投資証券 10銘柄			

カナダ・ドル	株式	86銘柄	99.7%	0.3%	3.6%
	投資証券	2銘柄			
シンガポール・ドル	株式	15銘柄	88.7%	11.3%	0.4%
	投資証券	4銘柄			
スイス・フラン	株式	43銘柄	100%	-%	2.9%
スウェーデン・クローナ	株式	45銘柄	100%	-%	1.1%
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄	100%	-%	0.9%
ニュージーランド・ドル	株式	5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	223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%	0.9%
	投資証券	3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。

「ダイワ」-REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年12月20日現在	2022年12月19日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	9,771,002,648	9,223,851,917
投資証券	2 434,362,900,300	479,641,458,200
派生商品評価勘定	-	48,944,000
未収入金	670,746,903	213,366,356
未収配当金	1,815,317,726	2,161,912,970
流動資産合計	446,619,967,577	491,289,533,443
資産合計	446,619,967,577	491,289,533,443
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	20,216,000	-
前受金	260,400,000	253,960,000
未払金	-	233,215,145

未払解約金		786,411,000	428,260,000
流動負債合計		1,067,027,000	915,435,145
負債合計		1,067,027,000	915,435,145
純資産の部			
元本等			
元本	1	133,202,288,962	147,074,195,757
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		312,350,651,615	343,299,902,541
元本等合計		445,552,940,577	490,374,098,298
純資産合計		445,552,940,577	490,374,098,298
負債純資産合計		446,619,967,577	491,289,533,443

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2021年12月21日 至 2022年12月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年12月20日現在	2022年12月19日現在
1. 1 期首	2020年12月19日	2021年12月21日
期首元本額	134,624,414,134円	133,202,288,962円
期中追加設定元本額	26,273,264,912円	36,700,219,266円
期中一部解約元本額	27,695,390,084円	22,828,312,471円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ-REITオープン	4,801,166,661円	4,480,203,081円
ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	116,999,358,707円	130,146,228,171円
ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	334,201,598円	367,869,269円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	9,585,118円	14,451,855円
iFree J-REITイ ンデックス	579,105,948円	622,837,560円
iFree 8資産バランス	1,364,256,461円	1,777,811,911円
DC・ダイワJ-REIT オープン	5,294,129,212円	5,512,669,093円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	6,014,642円	6,605,564円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	4,982,317円	6,178,591円
ダイワ国内REITインデッ クス(投資一任専用)	- 円	931,559円
ダイワ・ノーロード J-R EITファンド	97,243,674円	96,504,584円
ダイワファンドラップ J- REITインデックス	1,875,255,140円	2,251,400,882円
ダイワJ-REITインデッ クス(ダイワSMA専用)	369,231,583円	366,001,320円
ダイワファンドラップオンラ イン J-REITインデッ クス	515,120,244円	498,776,889円
ダイワ・インデックスセレク ト J-REIT	952,637,657円	925,725,428円
計	133,202,288,962円	147,074,195,757円
2. 期末日における受益権の総数	133,202,288,962口	147,074,195,757口

3. 2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 5,586,350,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 5,134,300,000円
--------------------	---	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年12月21日 至 2022年12月19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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年12月19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。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	2021年12月20日現在	2022年12月19日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資証券	19,941,072,010	17,040,737,891
合計	19,941,072,010	17,040,737,891

（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（2021年9月16日から2021年12月20日まで、及び2022年9月16日から2022年12月19日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

種 類	2021年12月20日 現在				2022年12月19日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	11,208,400,000	-	11,188,800,000	19,600,000	10,682,840,000	-	10,732,400,000	49,560,000
合計	11,208,400,000	-	11,188,800,000	19,600,000	10,682,840,000	-	10,732,400,000	49,560,000

（注） 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2021年12月20日現在	2022年12月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3,3449円 (33,449円)	3,3342円 (33,342円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	8,968	1,067,192,000	
	サンケイリアルエステート	14,132	1,284,598,800	
	SOSILA物流リート投	21,945	3,054,744,000	
	東海道リート投資法	5,349	652,578,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	15,233	9,322,596,000	
	森ヒルズリート	51,877	8,367,760,100	
	産業ファンド	65,926	10,251,493,000	
	アドバンス・レジデンス	44,110	15,063,565,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	32,351	6,806,650,400	
	A P I 投資法人	23,291	9,677,410,500	
	G L P 投資法人	142,390	22,027,733,000	
	コンフォリア・レジデンシャル	20,522	6,259,210,000	
	日本プロロジスリート	74,362	24,465,098,000	
	星野リゾート・リート	7,716	5,493,792,000	
	ONE リート投資法人	7,695	1,925,289,000	
	イオンリート投資	48,834	7,691,355,000	
	ヒューリックリート投資法	41,275	7,053,897,500	
	日本リート投資法人	14,329	5,201,427,000	
	積水ハウス・リート投資	132,565	10,419,609,000	
	トーセイ・リート投資法人	9,786	1,312,302,600	
	ケネディクス商業リート	19,178	4,995,869,000	
	ヘルスケア&メディカル投資	10,877	1,967,649,300	
	サムティ・レジデンシャル	11,467	1,370,306,500	
野村不動産マスターF	142,662	23,781,755,400		

いちごホテルリート投資	7,308	793,648,800	
ラサールロジポート投資	54,007	8,803,141,000	
スターアジア不動産投	55,082	3,024,001,800	
マリモ地方創生リート	5,510	755,421,000	
三井不ロジパーク	17,427	8,713,500,000	
大江戸温泉リート	7,121	457,880,300	
投資法人みらい	53,596	2,486,854,400	
森トラスト・ホテルリート投	10,351	1,412,911,500	
三菱地所物流REIT	15,156	6,539,814,000	
CREロジスティクスファンド	17,085	3,413,583,000	
ザイマックス・リート	7,156	870,169,600	
タカラレーベン不動産投	19,321	1,935,964,200	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	19,230	2,780,658,000	
日本ビルファンド	51,465	31,908,300,000	
ジャパンリアルエステイト	44,116	26,513,716,000	
日本都市ファンド投資法人	222,590	23,639,058,000	
オリックス不動産投資	87,901	16,595,708,800	
日本プライムリアルティ	30,170	11,494,770,000	
NTT都市開発リート投資法人	42,408	5,975,287,200	
東急リアル・エステート	29,578	6,285,325,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	32,464	3,480,140,800	
ユナイテッド・アーバン投資法人	98,685	14,970,514,500	
森トラスト総合リート	31,530	4,644,369,000	
インヴィンシブル投資法人	194,174	9,941,708,800	
フロンティア不動産投資	16,368	8,593,200,000	
平和不動産リート	30,150	4,688,325,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	29,746	9,607,958,000	
福岡リート投資法人	22,816	3,960,857,600	
ケネディクス・オフィス投資法人	25,670	8,368,420,000	
いちごオフィスリート投資法人	36,149	3,159,422,600	
大和証券オフィス投資法人	9,221	6,039,755,000	
阪急阪神リート投資法人	19,927	3,048,831,000	
スターツプロシード投資法人	7,647	1,779,456,900	
大和ハウスリート投資法人	66,499	19,683,704,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	142,266	11,196,334,200	
大和証券リビング投資法人	61,133	7,073,088,100	
ジャパンエクセレント投資法人	40,470	5,491,779,000	
投資証券 合計		479,641,458,200	
合計		479,641,458,200	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

日本プロロジスリート	3,500口	野村不動産マスターF	5,000口
日本ビルファンド	2,850口	ジャパンリアルエステイト	2,300口

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年12月20日現在	2022年12月19日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	77,178,682	127,175,029
コール・ローン	561,581,827	420,501,713
株式	-	6,907,662
投資信託受益証券	634,794,940	1,361,968,562
投資証券	48,297,799,583	25,349,124,046
派生商品評価勘定	1,705,031	1,041,012
未収入金	319,970,945	72,539,746
未収配当金	118,771,009	80,146,993
差入委託証拠金	415,715,725	193,896,290
流動資産合計	50,427,517,742	27,613,301,053
資産合計	50,427,517,742	27,613,301,053
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,435,561	27,041,488
未払金	271,117,852	98,336,823
未払解約金	21,376,000	17,352,000
流動負債合計	296,929,413	142,730,311
負債合計	296,929,413	142,730,311
純資産の部		
元本等		

元本	1	15,690,434,259	9,133,427,619
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		34,440,154,070	18,337,143,123
元本等合計		50,130,588,329	27,470,570,742
純資産合計		50,130,588,329	27,470,570,742
負債純資産合計		50,427,517,742	27,613,301,053

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年12月21日 至 2022年12月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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>(3) 投資証券</p>

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年12月20日現在	2022年12月19日現在
1. 1 期首	2020年12月19日	2021年12月21日
期首元本額	13,140,962,393円	15,690,434,259円
期中追加設定元本額	5,773,494,898円	2,653,731,706円
期中一部解約元本額	3,224,023,032円	9,210,738,346円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス(為替 ヘッジあり)	6,295,948,752円	- 円
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス(為替 ヘッジなし)	1,143,714,741円	1,258,414,610円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジあり)	336,507,070円	- 円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス(為替ヘッジなし)	287,027,419円	256,019,682円
D-I's グローバルREI Tインデックス	1,920,281円	1,857,810円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	8,727,395円	13,283,048円
iFree 外国REITイ ンデックス	650,467,941円	754,901,479円
iFree 8資産バランス グローバル・リート・イン デックスファンド(資産形成 型)	1,462,383,857円	1,906,089,257円
グローバル・リート・イン デックスファンド(毎月決算 型)	251,617,852円	334,906,115円
DCダイワ・グローバルRE ITインデックスファンド	116,348,191円	183,911,672円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	3,355,252,225円	3,935,780,669円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	6,384,178円	7,070,511円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	5,332,616円	6,626,997円

ダイワ海外REITインデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	- 円	835,597円
ダイワバランスファンド 2020-07（適格機関投資家専用）	168,184,947円	- 円
ダイワバランスファンド 2021-02（適格機関投資家専用）	181,663,633円	148,041,885円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	243,525,692円	250,341,989円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	61,679,527円	71,408,491円
ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）	1,109,755,007円	- 円
ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）	3,992,935円	3,937,807円
計	15,690,434,259円	9,133,427,619円
2. 期末日における受益権の総数	15,690,434,259口	9,133,427,619口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自 2021年12月21日 至 2022年12月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用してまいります。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まいります。</p>

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年12月19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	2021年12月20日現在	2022年12月19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	-	36,787
投資信託受益証券	10,735,011	32,198,689
投資証券	678,764,407	622,040,103
合計	689,499,418	654,275,579

(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（2021年12月1日から2021年12月20日まで、及び2022年12月1日から2022年12月19日まで）を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 不動産投信関連

種 類	2021年12月20日 現在				2022年12月19日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	1,155,924,678	-	1,152,061,055	3,863,623	790,150,708	-	764,752,654	25,398,054
合計	1,155,924,678	-	1,152,061,055	3,863,623	790,150,708	-	764,752,654	25,398,054

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

種 類	2021年12月20日 現在				2022年12月19日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売 建	47,975,647	-	48,038,172	62,525	-	-	-	-
アメリカ・ドル	36,319,680	-	36,356,960	37,280	-	-	-	-
ユーロ	11,655,967	-	11,681,212	25,245	-	-	-	-
買 建	564,008,057	-	565,203,675	1,195,618	406,481,533	-	405,879,111	602,422
アメリカ・ドル	430,232,799	-	431,794,280	1,561,481	246,253,254	-	244,828,829	1,424,425

イギリス・ポンド	2,102,094	-	2,105,573	3,479	8,655,177	-	8,654,895	282
オーストラリア・ドル	17,776,847	-	17,796,287	19,440	22,880,160	-	22,879,207	953
カナダ・ドル	2,078,046	-	2,081,017	2,971	-	-	-	-
シンガポール・ドル	-	-	-	-	13,478,779	-	13,477,397	1,382
ユーロ	109,054,568	-	108,660,175	394,393	112,770,922	-	113,595,794	824,872
香港・ドル	2,763,703	-	2,766,343	2,640	2,443,241	-	2,442,989	252
合計	611,983,704	-	613,241,847	1,133,093	406,481,533	-	405,879,111	602,422

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2021年12月20日現在	2022年12月19日現在
1口当たり純資産額	3.1950円	3.0077円
(1万口当たり純資産額)	(31,950円)	(30,077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	

イギリス・ポンド	CLS HOLDINGS PLC	株 28,300	イギリス・ポンド 1.472	イギリス・ポンド 41,657.600	
イギリス・ポンド	小計			イギリス・ポンド 41,657.600 (6,907,662)	
合計				6,907,662 [6,907,662]	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REAL ESTATE ETF	118,900.000	アメリカ・ドル 9,998,301.000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 9,998,301.000 (1,361,968,562)	
投資信託受益証券 合計				1,361,968,562 [1,361,968,562]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	19,596	290,020.800	
		URBAN EDGE PROPERTIES	17,277	247,924.950	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	16,400	225,992.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	20,571	3,394,215.000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	48,158	5,601,738.560	
		BOSTON PROPERTIES INC	20,983	1,411,736.240	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	22,688	174,697.600	
		VORNADO REALTY TRUST	23,721	513,559.650	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	13,078	184,269.020	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	12,500	457,000.000	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	3,326	145,179.900	
		EQUITY RESIDENTIAL	49,799	3,029,273.170	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	31,700	514,174.000	
		EPR PROPERTIES	11,184	449,820.480	
		CITY OFFICE REIT INC	6,000	54,300.000	
		GLOBAL NET LEASE INC	14,833	195,202.280	
		EQUINIX INC	13,498	9,014,504.320	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11,929	311,108.320	
CHATHAM LODGING TRUST	6,665	85,645.250			
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8,114	706,404.840			

RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	18,500	278,055.000	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,500	119,385.000	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	7,800	31,590.000	
HOST HOTELS & RESORTS INC	105,170	1,787,890.000	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	44,506	1,372,119.980	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	18,964	188,691.800	
RLJ LODGING TRUST	23,943	264,570.150	
FARMLAND PARTNERS INC	7,101	85,851.090	
PHYSICIANS REALTY TRUST	33,500	499,150.000	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	9,961	117,340.580	
KIMCO REALTY CORP	90,987	1,931,654.010	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9,060	88,788.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	56,003	1,060,696.820	
WHITESTONE REIT	6,400	60,928.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	37,584	1,966,394.880	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	17,700	157,176.000	
PARK HOTELS & RESORTS INC	33,077	397,916.310	
INVITATION HOMES INC	85,302	2,591,474.760	
JBG SMITH PROPERTIES	14,641	283,596.170	
ALEXANDER & BALDWIN INC	10,400	200,096.000	
CLIPPER REALTY INC	1,890	13,570.200	
GLADSTONE LAND CORP	4,680	87,094.800	
AMERICOLD REALTY TRUST	39,627	1,117,877.670	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	9,000	33,030.000	
VICI PROPERTIES INC	140,284	4,677,068.560	
BRT APARTMENTS CORP	1,600	32,624.000	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4,189	470,005.800	
SAFEHOLD INC	3,523	104,280.800	
NECESSITY RETAIL REIT INC CLASS A	19,143	117,155.160	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	20,776	470,368.640	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	5,372	105,882.120	
STORE CAPITAL CORP	39,092	1,252,898.600	
BROADSTONE NET LEASE INC	25,200	424,116.000	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	15,726	119,517.600	
LIFE STORAGE INC	12,414	1,255,427.820	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,574	202,831.720	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	32,919	574,436.550	

PARAMOUNT GROUP INC	24,493	147,202.930	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	19,500	131,820.000	
NETSTREIT CORP	7,406	142,121.140	
APARTMENT INCOME REIT CO	22,683	799,348.920	
CTO REALTY GROWTH INC	2,580	47,162.400	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	26,766	1,438,940.160	
STAG INDUSTRIAL INC	26,365	856,862.500	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	1,500	28,095.000	
INDUS REALTY TRUST INC	861	54,785.430	
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2,300	34,109.000	
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	16,969	543,517.070	
ORION OFFICE REIT INC	7,823	69,468.240	
DIGITAL CORE REIT UNITS	49,400	29,393.000	
VENTAS INC	58,803	2,625,553.950	
CARETRUST REIT INC	14,404	278,861.440	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	9,920	231,334.400	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	44,085	976,041.900	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,128	98,223.840	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	34,343	422,762.330	
UMH PROPERTIES INC	7,244	119,526.000	
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	3,600	88,488.000	
BLUEROCK HOMES TRUST INC CLASS A	487	10,743.220	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C	4,800	58,752.000	
IRON MOUNTAIN INC	42,755	2,206,585.550	
TERRENO REALTY CORP	9,780	548,169.000	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	19,993	813,315.240	
SUN COMMUNITIES INC	18,143	2,582,837.480	
ACADIA REALTY TRUST	13,611	194,365.080	
ALEXANDER'S INC	300	68,388.000	
PROLOGIS INC	134,422	15,087,525.280	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	21,844	3,165,195.600	
BRANDYWINE REALTY TRUST	24,642	151,794.720	
SAUL CENTERS INC	1,800	72,360.000	
VERIS RESIDENTIAL INC	11,900	192,899.000	

CAMDEN PROPERTY TRUST	15,672	1,758,398.400	
COUSINS PROPERTIES INC	22,155	552,988.800	
SITE CENTERS CORP	27,078	354,721.800	
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,409	944,686.600	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,581	2,032,321.720	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	19,429	941,140.760	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,710	1,098,096.300	
GETTY REALTY CORP	6,256	214,768.480	
WELLTOWER INC	68,868	4,429,589.760	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	79,379	1,996,381.850	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	15,700	436,931.000	
SERVICE PROPERTIES TRUST	24,600	182,778.000	
EQUITY COMMONWEALTH	16,365	413,543.550	
KILROY REALTY CORP	15,609	613,277.610	
LTC PROPERTIES INC	5,959	220,840.540	
LXP INDUSTRIAL TRUST	41,176	424,936.320	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	16,983	2,676,520.800	
MACERICH CO/THE	31,979	374,793.880	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	25,715	1,678,418.050	
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,569	363,922.600	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	26,056	1,182,160.720	
REALTY INCOME CORP	91,354	5,799,151.920	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	16,710	427,776.000	
PUBLIC STORAGE	23,242	6,658,135.740	
REGENCY CENTERS CORP	22,656	1,421,210.880	
RPT REALTY	12,530	129,936.100	
ISTAR INC	12,560	96,335.200	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,016	272,690.560	
SL GREEN REALTY CORP	9,538	325,531.940	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	32,900	23,372.160	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	4,100	75,563.000	
UDR INC	44,932	1,757,739.840	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,800	85,284.000	
WP CAREY INC	30,533	2,435,922.740	
ELME	12,600	228,186.000	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4,700	24,675.000	
AGREE REALTY CORP	12,944	914,623.040	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	34,441	986,390.240	
CUBESMART	33,020	1,335,328.800	

	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	31,234	313,901.700	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	42,282	4,293,314.280	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	19,700	2,941,210.000	
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	4,575	43,462.500	
	CENTERSPACE	2,261	139,616.750	
	KITE REALTY GROUP TRUST	32,569	686,228.830	
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,200	51,128.000	
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,521	104,788.580	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	31,030	267,788.900	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	88,121	1,003,698.190	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	13,105	36,431.900	
	DOUGLAS EMMETT INC	26,186	414,262.520	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	265,962	86,437.650	
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	110,200	52,896.000	
	EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	0.000	
	PRIME US REIT	92,200	41,951.000	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 142,231,052.290 (19,374,713,943)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	WAREHOUSE REIT PLC	63,302	67,479.930	
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT COMPAN	31,488	18,577.920	
	ASSURA PLC	456,627	247,948.460	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	83,320	67,489.200	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	56,200	31,415.800	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	118,460	68,588.340	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	75,640	60,209.440	
	REGIONAL REIT LTD	59,840	34,527.680	
	NEWRIVER REIT PLC	42,860	34,030.840	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	132,590	136,965.470	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	85,980	49,524.480	
	CUSTODIAN REIT PLC	60,900	54,931.800	
	PRS REIT PLC/THE	75,872	65,477.530	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	53,280	53,599.680	
	LXI REIT PLC	255,448	287,123.550	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	51,240	32,896.080	
	AEW UK REIT PLC	21,930	21,447.540	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	128,420	115,192.740	

	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	194,253	197,166.790	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	70,322	96,341.140	
	HOME REIT PLC	117,587	42,213.730	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	115,934	709,979.810	
	SEGRO PLC	186,572	1,417,574.050	
	HAMMERSON PLC	545,564	123,952.140	
	UNITE GROUP PLC/THE	61,739	551,329.270	
	BRITISH LAND CO PLC	144,736	561,575.680	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	36,781	187,215.290	
	DERWENT LONDON PLC	17,327	403,719.100	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	205,675	222,951.700	
	WORKSPACE GROUP PLC	20,759	88,059.670	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	32,544	298,753.920	
	SHAFTESBURY PLC	41,750	149,882.500	
	BIG YELLOW GROUP PLC	26,760	303,190.800	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	149,787	257,633.640	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	78,138	33,599.340	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	286,510	398,248.900	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 7,490,813.950 (1,242,126,769)	
イスラエル・ シュケル			イスラエル・シュケル	
	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	105,526	182,876.550	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	31,070	259,651.990	
	REIT 1 LTD	26,100	465,102.000	
	イスラエル・シュケル 小計		イスラエル・シュケル 907,630.540 (35,730,238)	
オーストラリ ア・ドル			オーストラリア・ドル	
	DEXUS/AU	171,638	1,409,147.980	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	38,400	65,088.000	
	HMC CAPITAL LTD	31,078	136,432.420	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY UN	53,900	40,425.000	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	53,565	185,334.900	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	226,751	150,789.410	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	88,000	284,240.000	

RURAL FUNDS GROUP	61,515	155,017.800	
WAYPOINT REIT	113,781	328,827.090	
CHARTER HALL LONG WALE REIT	104,327	481,990.740	
CENTURIA OFFICE REIT	68,959	114,127.140	
CENTURIA CAPITAL GROUP	105,967	182,263.240	
HOMECO DAILY NEEDS REIT	248,840	325,980.400	
REGION GROUP	178,136	498,780.800	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	46,669	146,073.970	
NATIONAL STORAGE REIT	173,066	413,627.740	
DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	31,510	95,160.200	
GDI PROPERTY GROUP	71,460	53,952.300	
SCENTRE GROUP	832,224	2,421,771.840	
ARENA REIT	56,810	219,286.600	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	31,154	114,335.180	
BWP TRUST	77,951	321,937.630	
GPT GROUP	305,687	1,332,795.320	
CHARTER HALL RETAIL REIT	83,410	338,644.600	
MIRVAC GROUP	629,679	1,397,887.380	
STOCKLAND	380,944	1,478,062.720	
ABACUS PROPERTY GROUP	65,960	182,709.200	
GOODMAN GROUP	274,378	4,999,167.160	
VICINITY CENTRES	617,483	1,228,791.170	
CHARTER HALL GROUP	75,840	979,852.800	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	59,590	258,620.600	
オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 20,341,121.330 (1,856,534,144)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	2,300	9,453.000	
BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	5,100	18,615.000	
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	6,200	18,910.000	
NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	4,300	42,398.000	
PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	7,841	112,675.170	
PRO REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	4,400	26,180.000	

BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST U	2,758	50,250.760	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	8,400	77,700.000	
SLATE GROCERY REIT	4,000	62,440.000	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	9,100	149,604.000	
SLATE OFFICE REIT	5,100	22,491.000	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,800	40,684.000	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	18,700	181,951.000	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	15,000	338,100.000	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	6,100	34,465.000	
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2,700	30,483.000	
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5,100	374,493.000	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	19,900	237,606.000	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,000	138,710.000	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	16,700	280,226.000	
CHOICE PROPERTIES REIT	25,300	379,247.000	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	2,700	43,470.000	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	8,400	129,528.000	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11,300	304,987.000	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	13,500	570,240.000	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	20,866	254,565.200	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	23,700	493,197.000	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,300	49,170.000	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,600	177,444.000	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	8,200	129,970.000	
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	10,100	266,539.000	
カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 5,045,792.130 (502,712,270)	
シンガポール・ドル		シンガポール・ドル	
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	84,700	55,055.000	
KEPPEL DC REIT	212,183	392,538.550	
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	170,976	44,453.760	
AIMS APAC REIT	81,100	99,753.000	
FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	460,090	533,704.400	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	73,800	56,457.000	
LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	291,140	206,709.400	
EC WORLD REIT	36,500	16,790.000	

	CAPITALAND ASCENDAS REIT	536,277	1,453,310.670	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	803,522	1,623,114.440	
	SUNTEC REIT	357,600	497,064.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	516,700	826,720.000	
	KEPPEL REIT	317,600	292,192.000	
	CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	331,456	348,028.800	
	ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T	894,402	344,344.770	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	127,700	155,794.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	172,076	359,638.840	
	STARHILL GLOBAL REIT	227,100	122,634.000	
	CAPITALAND CHINA TRUST	187,842	214,139.880	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	62,600	234,750.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	320,869	712,329.180	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	367,484	613,698.280	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	169,000	108,160.000	
	SPH REIT	163,000	148,330.000	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	337,763	113,150.600	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 9,572,860.570 (961,498,116)	
ニュージーランド・ドル			ニュージーランド・ドル	
	STRIDE PROPERTY GROUP	82,638	119,825.100	
	ARGOSY PROPERTY LTD	119,250	143,100.000	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	261,440	245,753.600	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	71,483	169,414.710	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	172,800	357,696.000	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	213,350	288,022.500	
	ニュージーランド・ドル 小計		ニュージーランド・ドル 1,323,811.910 (115,171,637)	
ユーロ			ユーロ	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	5,854	128,553.840	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1,820	13,104.000	
	HAMBORNER REIT AG	9,070	61,403.900	
	WERELDHAVE NV	5,160	65,016.000	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	14,478	715,502.760	

	NSI NV	2,271	50,643.300	
	VASTNED RETAIL NV	2,320	48,720.000	
	ICADE	4,098	163,100.400	
	CARMILA	7,789	104,839.940	
	ALTAREA	550	70,070.000	
	GECINA SA	7,453	700,954.650	
	KLEPIERRE	26,957	583,619.050	
	COVIVIO	6,222	338,787.900	
	MERCIALYS	10,432	101,242.560	
	AEDIFICA	5,376	404,275.200	
	COFINIMMO	4,064	330,606.400	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	3,030	57,509.400	
	RETAIL ESTATES	1,457	87,711.400	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	19,268	508,675.200	
	CARE PROPERTY INVEST	3,450	50,646.000	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	2,670	74,226.000	
	MONTEA NV	1,669	106,982.900	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,930	21,552.300	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	7,500	32,850.000	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	40,217	239,090.060	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	45,751	403,523.820	
	CROMWELL REIT EUR	43,520	67,020.800	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	54,940	57,687.000	
	ユーロ 小計		ユーロ 5,587,914.780 (806,615,499)	
韓国・ウォン			韓国・ウォン	
	SK REITS LTD	11,423	61,569,970.000	
	D&D PLATFORM REIT LTD	8,000	27,680,000.000	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT LTD	3,930	14,776,800.000	
	NH ALL ONE REIT LTD	6,454	21,685,440.000	
	E KOCREF CR	3,584	18,959,360.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8,260	55,176,800.000	
	LOTTE REIT CO LTD	17,135	69,568,100.000	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	13,090	54,258,050.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	5,600	26,208,000.000	
	JR REIT XXVII	22,640	99,616,000.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	5,990	30,369,300.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	24,442	97,523,580.000	
韓国・ウォン 小計			韓国・ウォン	

			577,391,400.000	
			(60,452,879)	
香港・ドル			香港・ドル	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	362,000	720,380.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	160,000	529,600.000	
	FORTUNE REIT	233,000	1,393,340.000	
	PROSPERITY REIT	174,000	330,600.000	
	LINK REIT	337,000	18,754,050.000	
	CHAMPION REIT	268,000	774,520.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル	
			22,502,490.000	
			(393,568,551)	
投資証券 合計			25,349,124,046	
			[25,349,124,046]	
合計			26,711,092,608	
			[26,711,092,608]	

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

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託 1銘柄 受益証券 投資証券 146銘柄	-%	6.6%	93.4%	77.7%
イギリス・ポンド	株式 1銘柄 投資証券 36銘柄	0.6%	-%	99.4%	4.7%
イスラエル・シケル	投資証券 3銘柄	-%	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券 31銘柄	-%	-%	100%	6.9%
カナダ・ドル	投資証券 31銘柄	-%	-%	100%	1.9%
シンガポール・ドル	投資証券 25銘柄	-%	-%	100%	3.6%
ニュージーランド・ドル	投資証券 6銘柄	-%	-%	100%	0.4%
ユーロ	投資証券 28銘柄	-%	-%	100%	3.0%
韓国・ウォン	投資証券 12銘柄	-%	-%	100%	0.2%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	-%	-%	100%	1.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年12月20日現在	2022年12月19日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,499,641	4,588,647
国債証券	323,942,760	357,729,980
未収利息	122,984	330,109
前払費用	14,011	18,035
流動資産合計	328,579,396	362,666,771
資産合計	328,579,396	362,666,771
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	129,000
流動負債合計	-	129,000
負債合計	-	129,000
純資産の部		
元本等		
元本	1 314,356,530	347,622,118
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	14,222,866	14,915,653
元本等合計	328,579,396	362,537,771
純資産合計	328,579,396	362,537,771
負債純資産合計	328,579,396	362,666,771

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2021年12月21日 至 2022年12月19日
-----	--------------------------------

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年12月20日現在	2022年12月19日現在
1. 1 期首	2020年12月19日	2021年12月21日
期首元本額	6,513,195円	314,356,530円
期中追加設定元本額	347,115,400円	89,833,929円
期中一部解約元本額	39,272,065円	56,568,341円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
DCダイワ・ターゲットイ	26,486,360円	39,658,917円
ヤー2050		
DCダイワ・ターゲットイ	108,542,159円	93,976,772円
ヤー2020		
DCダイワ・ターゲットイ	135,752,811円	157,189,025円
ヤー2030		
DCダイワ・ターゲットイ	43,575,200円	56,797,404円
ヤー2040		
計	314,356,530円	347,622,118円
2. 期末日における受益権の総数	314,356,530口	347,622,118口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年12月21日 至 2022年12月19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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年12月19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	2021年12月20日現在	2022年12月19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	829,940	1,474,210
合計	829,940	1,474,210

（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（2020年12月19日から2021年12月20日まで、及び2021年12月21日から2022年12月19日まで）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

2021年12月20日現在	2022年12月19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）

	2021年12月20日現在	2022年12月19日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1,0452円 (10,452円)	1,0429円 (10,429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 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	4 3 3 2年国債	57,000,000	57,044,460	
	1 4 2 5年国債	29,000,000	29,063,800	
	1 4 3 5年国債	9,000,000	9,022,230	
	1 4 4 5年国債	112,000,000	112,306,880	
	1 4 6 5年国債	9,000,000	9,027,000	
	3 3 3 10年国債	35,000,000	35,283,500	
	3 3 4 10年国債	52,000,000	52,495,040	
	3 3 5 10年国債	53,000,000	53,487,070	
国債証券 合計			357,729,980	
合計			357,729,980	

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

	2021年12月20日現在	2022年12月19日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		

預金		432,520,132	1,226,900,795
コール・ローン		1,168,153,193	1,310,485,939
国債証券		231,782,934,708	236,458,977,725
派生商品評価勘定		318,574	2,654,404
未収入金		16,245	193,503
未収利息		1,239,129,219	1,461,653,232
前払費用		26,729,836	64,484,887
流動資産合計		234,649,801,907	240,525,350,485
資産合計		234,649,801,907	240,525,350,485
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,247,272	15,219,744
未払金		390,208	390,580,231
未払解約金		56,147,554	37,084,509
流動負債合計		58,785,034	442,884,484
負債合計		58,785,034	442,884,484
純資産の部			
元本等			
元本	1	74,672,925,593	76,482,606,084
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		159,918,091,280	163,599,859,917
元本等合計		234,591,016,873	240,082,466,001
純資産合計		234,591,016,873	240,082,466,001
負債純資産合計		234,649,801,907	240,525,350,485

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2021年12月21日 至 2022年12月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	<p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、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。</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. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<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>	<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	2021年12月20日現在	2022年12月19日現在
1. 1 期首	2020年12月19日	2021年12月21日
期首元本額	70,392,881,865円	74,672,925,593円
期中追加設定元本額	9,932,425,637円	9,112,372,426円
期中一部解約元本額	5,652,381,909円	7,302,691,935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	498,028,337円	444,538,723円
VA		

ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	10,756,510円	9,071,985円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	72,334,081円	50,091,127円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	22,023,940円	19,793,735円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	308,654,670円	244,218,374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)	217,667,139円	357,104,321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)	509,869,721円	597,663,829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)	2,330,554,085円	2,724,660,501円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国債券インデックス エマージングプラス(為替 ヘッジなし)	846,032,534円	613,268,261円
D-I's 外国債券インデッ クス	765,768円	1,270,054円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	7,328,602円	13,099,307円
iFree 外国債券イン デックス	1,758,964,643円	2,023,525,041円
iFree 8資産バランス	1,461,523,347円	1,882,858,890円
iFree 年金バランス	238,716,164円	349,171,161円
DCダイワ外国債券インデッ クス	49,656,604,656円	50,572,540,564円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	976,846,606円	1,069,355,051円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	610,161,427円	684,799,685円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	396,812,649円	453,688,230円

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	582,032,544円	642,739,139円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	444,325,582円	505,372,368円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	162,174,994円	193,737,548円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	29,622,344円	32,191,219円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	10,683,059円	14,065,842円
ダイワつみたてインデックス外国債券	630,063,162円	1,391,446,743円
ダイワつみたてインデックスバランス30	3,395,429円	3,873,500円
ダイワつみたてインデックスバランス50	1,440,219円	1,503,887円
ダイワつみたてインデックスバランス70	1,897,080円	2,563,794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)	317,987円	185,919,347円
ダイワ世界バランスファンド40VA	164,717,681円	119,575,140円
ダイワ世界バランスファンド60VA	136,633,533円	37,971,006円
ダイワ・バランスファンド35VA	3,856,062,322円	3,276,156,835円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	229,414,922円	199,538,920円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	143,499,097円	150,870,402円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	43,853,527円	49,160,892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)	2,364,084,706円	1,744,667,921円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,829,571,725円	5,718,090,934円
ダイワライフスタイル25	33,009,183円	28,515,260円
ダイワライフスタイル50	65,126,638円	58,847,063円

ダイワライフスタイル75	17,354,980円	15,079,485円
計	74,672,925,593円	76,482,606,084円
2. 期末日における受益権の総数	74,672,925,593口	76,482,606,084口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年12月21日 至 2022年12月19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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年12月19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	2021年12月20日現在	2022年12月19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	817,393,215	196,650,391
合計	817,393,215	196,650,391

(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(2021年12月1日から2021年12月20日まで、及び2022年12月1日から2022年12月19日まで)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	2021年12月20日 現在				2022年12月19日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買 建	1,081,771,778	-	1,079,843,080	1,928,698	1,538,661,456	-	1,526,096,116	12,565,340
アメリカ・ドル	580,843,321	-	580,629,135	214,186	521,851,632	-	517,168,624	4,683,008
イギリス・ポ ンド	76,845,564	-	76,386,486	459,078	40,192,377	-	39,771,407	420,970
オーストラ リア・ドル	-	-	-	-	15,676,295	-	15,514,421	161,874
オフショア 人民元	-	-	-	-	95,757,698	-	94,927,509	830,189
カナダ・ドル	-	-	-	-	105,772,518	-	102,875,476	2,897,042
シンガポ ール・ドル	31,361,148	-	31,419,964	58,816	55,212,696	-	54,592,813	619,883

メキシコ・ペ ソ	-	-	-	-	67,791,720	-	65,102,918	2,688,802
ユーロ	392,721,745	-	391,407,495	1,314,250	636,406,520	-	636,142,948	263,572
合計	1,081,771,778	-	1,079,843,080	1,928,698	1,538,661,456	-	1,526,096,116	12,565,340

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2021年12月20日現在	2022年12月19日現在
1口当たり純資産額	3.1416円	3.1390円
(1万口当たり純資産額)	(31,416円)	(31,390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	2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	アメリカ・ドル 5,229,000.000	アメリカ・ドル 5,121,962.370	

2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	4,778,442.720	
6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	908,403.300	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	786,018.670	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	797,984.640	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	835,708.440	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,697,239.280	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,312,745.280	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	991,913.230	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	604,060.400	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	579,816.420	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	1,040,261.830	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,216,363.470	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,184,094.200	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,331,000.000	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,143,744.200	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	1,841,403.640	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,123,217.230	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,584,213.670	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,438,375.620	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,494,183.600	

3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,523,507.930	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,326,634.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,482,496.890	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,207,971.930	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	4,470,621.840	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,390,145.500	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,378,867.140	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,996,387.500	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	3,138,535.280	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	2,069,700.170	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	3,228,326.470	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	3,121,125.240	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	5,965,308.960	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,736,987.340	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	5,709,797.930	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,421,065.820	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,490,595.150	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	2,067,597.730	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,531,823.120	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	1,835,000.000	1,615,864.300	

2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,455,390.560	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,612,896.490	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,571,944.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	580,328.580	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,543,238.220	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	2,527,969.920	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,181,013.900	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	2,263,453.170	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	4,978,314.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	2,119,305.200	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	4,959,899.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	860,310.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,433,003.900	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,441,425.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,432,374.400	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,418,000.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	2,061,114.300	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,235,301.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	4,550,000.000	4,414,546.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,051,456.000	

3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,758,120.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	2,900,250.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240531	5,300,000.000	5,116,726.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,314,296.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,541,339.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	2,893,920.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	1,450,000.000	1,218,957.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	1,919,140.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,408,000.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,151,795.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	2,103,125.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,375,715.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,077,248.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,696,288.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	6,077,966.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,513,446.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,623,725.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,647,260.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	2,810,506.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	3,434,440.000	

2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,251,375.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	1,848,776.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,452,907.500	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	2,911,260.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,433,407.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,847,671.400	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,431,925.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,486,780.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,436,600.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,434,950.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,597,362.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,865,617.600	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	2,911,260.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,000,000.000	1,968,980.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,500,000.000	1,446,315.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,450,700.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,234,624.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	3,910,440.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,409,550.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	4,178,018.000	

2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,396,725.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,217,368.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,378,450.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	4,041,315.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,625,323.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,394,720.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,670,584.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,835,210.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,362,660.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,622,676.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	5,500,000.000	5,273,730.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,338,075.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,172,801.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	3,511,410.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,567,572.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	3,799,040.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,313,325.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	2,858,820.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	951,540.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,771,010.000	

1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	2,850,000.000	2,548,669.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	3,531,600.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,845,620.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	2,849,760.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,316,500.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,383,825.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,700,000.000	1,605,565.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,369,900.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	5,947,240.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	3,883,950.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	270,234.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	4,878,640.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	1,500,000.000	1,385,145.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,405,312.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,533,500.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,478,303.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,094,000.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	3,304,952.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	3,328,900.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,043,355.000	

0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,738,310.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	6,500,000.000	5,924,880.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,037,475.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,087,064.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,475,280.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,305,650.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,700,000.000	4,086,062.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	5,000,000.000	3,303,700.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,023,370.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	4,000,000.000	3,619,840.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,426,840.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,168,865.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	8,064,616.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,605,760.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,440,440.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	4,433,940.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,521,142.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,599,129.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,318,150.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20231215	3,000,000.000	2,871,690.000	

0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,310,150.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,000,000.000	901,170.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20240115	4,000,000.000	3,814,400.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,061,230.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	4,098,730.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	8,979,975.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,000,000.000	4,752,500.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,487,850.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,408,200.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,525,893.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,697,180.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240315	2,000,000.000	1,897,560.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,542,800.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,620,760.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20240415	3,000,000.000	2,841,540.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	7,539,072.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240515	5,100,000.000	4,806,138.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,061,250.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,305,980.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	4,998,592.000	

2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	3,025,864.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	4,000,000.000	3,530,440.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	3,962,904.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240615	2,000,000.000	1,880,000.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,406,400.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,516,400.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240715	5,500,000.000	5,165,435.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240815	3,000,000.000	2,810,130.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,607,710.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	6,900,000.000	4,935,363.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	3,700,000.000	2,687,051.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,359,200.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,334,050.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,357,200.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,477,500.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240915	7,500,000.000	7,010,100.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,381,800.000	
0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,143,840.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241015	2,000,000.000	1,874,280.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241115	4,500,000.000	4,215,195.000	

1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	9,000,000.000	7,559,640.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,600,000.000	4,570,962.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	3,025,760.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,289,360.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	7,000,000.000	6,336,050.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,633,400.000	
0.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20231130	5,000,000.000	4,809,400.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	4,966,248.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241215	2,200,000.000	2,067,472.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20231231	2,500,000.000	2,403,925.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	4,000,000.000	3,521,680.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,628,400.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250115	1,000,000.000	940,070.000	
0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240131	3,000,000.000	2,880,630.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	10,400,000.000	9,097,504.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250215	3,700,000.000	3,499,645.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,860,067.000	
2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	3,900,000.000	2,958,969.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	2,016,725.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,522,650.000	

1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240229	4,000,000.000	3,858,640.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	1,000,000.000	928,320.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250315	5,000,000.000	4,751,150.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,789,760.000	
2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,759,950.000	
2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240331	2,000,000.000	1,943,340.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250415	2,000,000.000	1,935,840.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	9,300,000.000	8,845,137.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250515	3,000,000.000	2,911,170.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	4,352,300.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,392,180.000	
2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240430	4,500,000.000	4,379,400.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,872,440.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,884,080.000	
2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240531	4,500,000.000	4,375,170.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	6,000,000.000	5,701,380.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,912,880.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250615	2,000,000.000	1,946,080.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,913,880.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,944,560.000	

3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250715	3,000,000.000	2,926,170.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	3,909,397.800	
3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240630	1,000,000.000	978,940.000	
3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250815	2,500,000.000	2,445,500.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	7,500,000.000	7,051,125.000	
3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	5,200,000.000	4,658,056.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	1,000,000.000	945,000.000	
3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240731	3,970,000.000	3,884,684.700	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,167,505.600	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240831	3,890,000.000	3,821,536.000	
3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,442,575.000	
3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,400,110.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250915	2,300,000.000	2,272,584.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240930	3,500,000.000	3,496,850.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,540,625.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	1,500,000.000	1,529,640.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251015	3,400,000.000	3,425,228.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241031	1,000,000.000	1,002,100.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031	3,000,000.000	3,061,050.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	3,000,000.000	3,159,360.000	

	4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251115	1,500,000.000	1,522,500.000	
	4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	1,300,000.000	1,408,160.000	
	4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	3,073,800.000	
	4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241130	3,000,000.000	3,016,980.000	
	3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	2,500,000.000	2,543,925.000	
	3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	3,000,000.000	3,033,510.000	
	4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20421115	1,000,000.000	1,036,250.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 887,147,312.690 (120,847,206,934)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	2% United Kingdom Gilt 20250907	921,000.000	888,746.580	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,282,000.000	1,006,177.700	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,374,550.900	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	1,126,980.800	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,134,842.500	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	1,162,327.700	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,410,000.000	1,287,118.500	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,372,275.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,040,000.000	610,480.000	
	1% United Kingdom Gilt 20240422	1,800,000.000	1,742,238.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	813,688.700	

1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	528,700.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,500,000.000	1,282,260.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20250607	1,900,000.000	1,779,882.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	792,052.100	
0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,300,000.000	1,039,415.000	
0.5% United Kingdom Gilt 20611022	1,700,000.000	646,544.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,363,290.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,362,320.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	520,718.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,700,000.000	1,190,714.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20240131	1,300,000.000	1,252,433.000	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	1,921,000.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20460131	500,000.000	279,060.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20261022	500,000.000	446,895.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20510731	800,000.000	457,008.000	
0.25% UNITED KINGDOM GILT 20250131	1,100,000.000	1,024,441.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	900,000.000	619,065.000	
0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	700,000.000	590,303.000	
0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	300,000.000	231,096.000	
1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	300,000.000	181,230.000	

1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	2,100,000.000	1,705,956.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	820,000.000	380,676.800	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	2,000,000.000	2,043,800.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	1,000,000.000	1,004,090.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,081,869.490	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	2,240,000.000	2,404,124.800	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,521,753.600	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,362,000.000	1,456,468.320	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	1,526,774.270	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	1,904,676.200	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,464,638.860	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,283,017.120	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	2,331,091.400	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,600,000.000	1,764,240.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,452,709.670	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	1,534,466.280	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,707,622.800	
4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	1,278,415.560	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,674,222.050	
3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,563,903.840	

	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,866,000.000	1,720,638.600	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	1,388,079.000	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,077,028.680	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,524,000.000	1,457,614.560	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 66,755,730.380 (11,069,435,211)	
イスラエル・ シュケル		イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	1,984,500.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,600,000.000	2,058,336.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20240331	2,000,000.000	2,006,780.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,202,066.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,702,530.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,502,600.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,132,332.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20231130	1,500,000.000	1,474,905.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,049,696.000	
	0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	1,600,000.000	1,493,312.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,339,532.000	
	0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	182,518.000	
	0.4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20241031	900,000.000	851,220.000	

	1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	300,000.000	253,269.000	
イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 21,233,596.000 (835,892,357)	
オーストラリア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,112,397.560	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	573,000.000	569,968.830	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,349,545.340	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,798,000.000	1,803,447.940	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,371,370.960	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,748,000.000	1,807,309.640	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,120,345.800	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,195,447.550	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	742,341.600	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,635,817.920	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,119,524.080	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,087,837.760	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,457,490.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,830,954.000	
2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,707,127.500		
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,196,039.400		

	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,439,957.600	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	1,700,000.000	1,402,534.000	
	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,272,032.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,664,920.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	906,122.000	
	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,600,000.000	1,472,144.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,035,350.000	
	0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,086,576.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,600,000.000	1,372,640.000	
	3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,300,000.000	1,242,943.000	
	3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	1,200,000.000	1,226,436.000	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 40,228,620.480 (3,671,666,192)	
オフショア・人民元		オフショア・人民元	オフショア・人民元	
	3.22% China Government Bond 20251206	5,200,000.000	5,308,472.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,152,900.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,174,500.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,115,700.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,210,360.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	8,000,000.000	8,173,920.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,066,430.000	

2.68% China Government Bond 20300521	6,500,000.000	6,419,660.000	
3.02% China Government Bond 20251022	18,000,000.000	18,224,100.000	
3.28% China Government Bond 20271203	9,000,000.000	9,258,120.000	
3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	12,909,875.000	
3.03% China Government Bond 20260311	7,000,000.000	7,109,340.000	
3.81% China Government Bond 20500914	7,300,000.000	7,875,313.000	
3.01% China Government Bond 20280513	7,000,000.000	7,085,330.000	
3.72% China Government Bond 20510412	8,000,000.000	8,643,440.000	
3.02% China Government Bond 20310527	15,800,000.000	15,980,910.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,503,105.000	
2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,041,300.000	
3.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20240622	11,000,000.000	11,225,940.000	
3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,746,015.000	
3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20240921	15,000,000.000	15,381,150.000	
3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,286,350.000	
3.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20250607	17,000,000.000	17,520,370.000	
3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,738,950.000	
4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	4,500,000.000	5,091,615.000	
3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	6,300,000.000	6,896,862.000	
3.77% CHINA GOVERNMENT BOND 20250308	11,000,000.000	11,359,920.000	

3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	12,000,000.000	12,099,000.000	
2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,539,435.000	
3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	3,500,000.000	3,647,175.000	
2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	6,000,000.000	5,998,980.000	
2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	17,000,000.000	16,780,700.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	7,200,000.000	7,101,936.000	
2.26% CHINA GOVERNMENT BOND 20250224	10,000,000.000	9,940,500.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	14,966,850.000	
3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	5,556,650.000	
2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	4,944,650.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	4,000,000.000	3,985,920.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	4,000,000.000	3,925,440.000	
2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20250825	25,000,000.000	24,756,750.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	12,000,000.000	11,692,200.000	
1.99% CHINA GOVERNMENT BOND 20240915	22,000,000.000	21,842,700.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	9,375,170.000	
2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	17,200,000.000	17,001,684.000	
3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	4,000,000.000	3,885,280.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	5,500,000.000	5,465,240.000	
オフショア・人民元 小計		オフショア・人民元 429,006,207.000 (8,374,973,372)	

カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	2.75% Canada Government International Bond 20641201	605,000.000	588,429.050	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,156,008.000	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,408,291.260	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,253,665.600	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	1,047,402.730	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	1,053,236.780	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,379,948.850	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,303,107.050	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,125,886.200	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	919,232.160	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,146,094.800	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	625,924.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	3,075,293.200	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,186,096.200	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,176,720.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,350,636.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,101,274.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	700,000.000	666,785.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,676,660.200	

0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,677,920.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	1,911,189.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240401	1,200,000.000	1,146,432.000	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	278,229.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	3,071,866.000	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241001	1,000,000.000	950,560.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	2,050,000.000	1,584,732.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	200,000.000	186,478.000	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240201	3,000,000.000	2,894,850.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,100,000.000	1,885,884.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250401	200,000.000	191,212.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240501	400,000.000	387,492.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,400,805.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	97,117.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	400,000.000	397,396.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240801	200,000.000	196,838.000	
3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20251001	1,000,000.000	990,020.000	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	770,000.000	749,548.800	
3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241101	360,000.000	355,798.800	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	200,000.000	206,092.000	

	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250201	300,000.000	300,924.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 47,102,074.680 (4,692,779,700)	
シンガポール・ ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	792,226.400	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	923,000.000	920,849.410	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	803,741.500	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	399,100.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	590,436.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	621,562.500	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	517,292.800	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	703,824.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	439,335.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	691,852.500	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	541,970.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	490,000.000	483,336.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	327,425.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	462,240.000	
	0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	750,000.000	701,100.000	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	542,862.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	200,000.000	170,744.000	

	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	188,460.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	234,489.600	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	220,000.000	241,410.400	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	100,000.000	100,231.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 10,474,488.110 (1,052,057,585)	
スウェーデン・ クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	3,655,000.000	4,489,582.700	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	7,582,696.100	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	6,825,667.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,690,036.000	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,380,388.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	5,859,008.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,266,300.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 37,093,677.800 (486,669,053)	
デンマーク・ク ローネ		デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	17,909,242.560	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	5,894,604.030	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,656,402.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	8,590,000.000	7,568,992.600	

	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	2,145,955.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	404,440.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20241115	1,000,000.000	953,770.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 39,533,406.190 (766,948,080)	
ニュージーランド・ドル		ニュージーランド・ドル	ニュージーランド・ドル	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	600,000.000	601,038.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	400,000.000	374,376.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	403,162.200	
	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	600,000.000	556,446.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	530,000.000	427,344.300	
	1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	230,510.000	
	0.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20240515	700,000.000	656,957.000	
	0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	400,000.000	321,916.000	
	0.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20260515	500,000.000	436,205.000	
	2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	440,000.000	363,695.200	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	279,991.600	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20250415	640,000.000	610,944.000	
	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20340515	200,000.000	198,928.000	
ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 5,461,513.300 (475,151,657)	

ノルウェー・クローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,088,161.350	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,245,288.750	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,146,132.200	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,246,635.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,339,700.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,577,343.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	6,800,000.000	6,076,616.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	3,051,650.000	
2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	1,700,000.000	1,587,970.000		
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 35,359,496.300 (487,607,453)	
ポーランド・ズロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	3,773,849.400	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	2,644,414.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,870,000.000	2,719,325.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	3,827,714.000	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	3,400,000.000	3,137,554.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	2,000,000.000	1,742,900.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,039,100.000	
0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	1,716,220.000		

	POLAND GOVERNMENT BOND 20240725	1,000,000.000	895,640.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,800,000.000	1,198,890.000	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	500,000.000	442,350.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	791,025.500	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,016,542.500	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	4,205,447.820	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 32,150,972.220 (990,401,054)	
マレーシア・リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,347,727.550	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,218,605.660	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,547,762.200	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,324,375.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	735,137.460	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,402,669.650	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,871,402.360	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,387,633.000	
	4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,067,686.270	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,752,355.080	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,230,528.600	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	963,461.400	

3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,560,121.500	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	1,550,000.000	1,563,392.000	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,195,723.900	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,059,258.500	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,205,352.000	
4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,257,756.000	
4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	641,046.000	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	654,472.000	
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,302,839.000	
4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,269,996.000	
3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	399,812.000	
3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,266,408.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,628,427.500	
4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,447,566.500	
2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,631,826.000	
3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	500,000.000	482,920.000	
4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	400,000.000	416,064.000	
4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	514,860.000	
マレーシア・リングット 小計		マレーシア・リングット 39,347,185.130 (1,211,322,768)	
メキシコ・ペソ 5.75% Mexican Bonos 20260305	メキシコ・ペソ 37,290,000.000	メキシコ・ペソ 34,127,062.200	

	8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	19,347,855.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	23,800,000.000	23,085,762.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	6,210,470.000	
	5% MEXICAN BONOS 20250306	1,000,000.000	912,300.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	3,000,000.000	2,725,170.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	28,033,000.000	27,341,145.560	
	10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	24,071,364.030	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	26,738,526.720	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,611,429.400	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	29,180,313.360	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	18,114,055.680	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	32,515,000.000	30,544,591.000	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	21,654,000.000	19,136,939.040	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	7,258,830.000	
	メキシコ・ペソ 小計		メキシコ・ペソ 278,405,813.990 (1,917,241,638)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	311,383.800	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	267,494.040	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	761,488.450	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	285,771.600	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	727,280.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	395,721.200	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	444,295.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	434,675.000	
	Finland Government Bond 20240915	200,000.000	191,846.000	
	0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	219,219.600	
	0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	259,432.000	

Finland Government Bond 20300915	500,000.000	406,770.000	
0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	208,916.000	
0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	481,536.000	
FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	182,168.000	
0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	297,589.500	
1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	300,000.000	268,320.000	
1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	256,656.600	
1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,328,707.020	
0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,059,689.860	
1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	624,197.280	
1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	162,722.400	
0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,177,318.400	
2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	441,234.000	
0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,098,000.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,127,078.400	
Austria Government Bond 20240715	800,000.000	769,776.000	
Austria Government Bond 20300220	980,000.000	810,048.400	
0.75% Austria Government Bond 20510320	700,000.000	440,440.000	
Austria Government Bond 20401020	400,000.000	245,632.000	
0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	163,037.000	

Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	963,900.000	
Austria Government Bond 20250420	480,000.000	452,832.000	
0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	427,764.000	
0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	151,362.000	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	300,000.000	257,958.000	
0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	500,000.000	424,645.000	
1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	300,000.000	254,262.000	
2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	300,000.000	294,999.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,634,200.140	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,550,067.980	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	916,693.520	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,463,000.000	1,395,584.960	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	959,148.880	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	639,744.800	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,022,461.000	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,013,827.500	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	506,937.400	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	493,728.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,365,123.100	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	562,620.500	

0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,354,785.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	539,028.000	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,013,283.200	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	557,323.000	
Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,063,848.000	
Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,260,112.000	
0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	256,440.500	
0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	400,000.000	319,020.000	
1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	558,928.000	
2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	400,000.000	386,040.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,014,654.760	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,381,926.390	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,510,752.220	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,074,763.500	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,465,751.840	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,779,184.720	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	2,906,605.000	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,271,000.000	3,979,400.470	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	1,699,365.500	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,383,438.620	

3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,974,000.000	2,330,563.620	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	3,020,144.400	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,552,586.210	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	2,925,226.890	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,577,294.880	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	4,042,000.000	3,958,451.860	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,111,571.420	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,064,196.860	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,368,000.000	2,245,148.160	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,235,765.400	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	4,200,000.000	3,878,910.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,056,097.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	2,770,000.000	2,378,405.100	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,745,074.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,685,859.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,200,000.000	1,961,608.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,602,440.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,850,000.000	1,687,143.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,503,687.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,100,000.000	1,598,247.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,797,720.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,532,052.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,021,440.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	900,000.000	756,999.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	1,400,000.000	1,043,084.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,763,080.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	652,355.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	3,600,000.000	2,996,208.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	583,058.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	1,800,000.000	1,481,544.000	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	400,000.000	337,232.000	
1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,591,244.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,200,000.000	1,150,092.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	200,000.000	198,962.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	1,200,000.000	685,344.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231215	4,200,000.000	4,110,414.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240315	100,000.000	97,227.000	
0.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240614	100,000.000	96,927.000	
0.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240913	530,000.000	512,308.600	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20241212	500,000.000	497,750.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	1,920,000.000	1,865,414.400	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,629,790.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,277,336.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,160,206.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	94,216.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,045,736.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	1,300,000.000	1,195,038.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	100,000.000	90,909.000	
1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,873,460.000	
1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	412,456.000	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,314,855.500	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,904,491.770	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	3,227,000.000	4,081,219.170	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,174,925.770	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	2,177,005.320	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,698,881.900	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,870,995.800	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,217,000.000	1,551,906.230	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	3,764,750.220	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,899,000.000	5,973,681.340	

3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	3,088,000.000	3,272,291.840	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	6,086,000.000	6,064,577.280	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	5,089,136.540	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	4,899,000.000	4,827,082.680	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,331,263.240	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	4,895,327.680	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,731,443.200	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	4,387,000.000	4,107,372.620	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	3,416,912.400	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	1,070,334.030	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	3,720,613.500	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	2,208,144.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,195,456.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	2,157,606.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	4,924,800.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	3,344,939.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,484,502.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	3,400,000.000	3,295,076.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,850,000.000	2,134,308.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	4,350,000.000	3,839,136.000	

FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	4,330,000.000	4,092,412.900	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,537,828.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,654,050.100	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	2,775,420.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,482,118.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	4,000,000.000	3,278,480.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	1,480,000.000	654,071.200	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240225	100,000.000	97,217.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	1,500,000.000	943,530.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,659,668.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	3,100,000.000	2,801,377.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,100,000.000	1,224,804.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	2,100,000.000	1,641,150.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250225	2,100,000.000	1,987,755.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	200,000.000	159,282.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	300,000.000	274,551.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	2,800,000.000	2,634,128.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	934,190.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,305,840.720	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	2,064,143.250	

3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	2,083,911.830	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,469,321.200	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	2,097,671.760	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,504,401.240	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,696,130.730	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,938,000.000	1,816,022.280	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,048,904.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,364,804.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,237,909.500	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,045,116.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	662,157.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,170,736.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	726,720.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,250,000.000	681,987.500	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,060,033.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	623,331.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	778,689.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	100,000.000	92,917.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	600,000.000	500,100.000	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	300,000.000	285,570.000	

7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,265,599.800	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,702,457.680	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,794,771.600	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,280,386.500	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,387,893.050	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,677,606.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	2,891,000.000	2,784,611.200	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,240,633.800	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,243,770.540	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	1,838,469.920	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	981,385.200	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	703,135.840	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,258,110.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,428,550.600	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,279,200.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,250,000.000	1,092,637.500	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,524,392.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,552,928.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,091,259.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	1,937,649.000	

1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,250,353.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,421,301.500	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,517,155.500	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,140,726.700	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,650,000.000	1,536,579.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	1,804,848.000	
1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	2,200,000.000	2,158,090.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,004,891.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,055,187.500	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,588,267.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,226,147.000	
0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,116,762.500	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,109,753.500	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,073,160.000	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	1,500,000.000	1,448,190.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,598,920.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,759,863.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	1,947,330.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,554,072.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,026,225.000	

0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,900,000.000	1,481,430.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240115	1,100,000.000	1,065,130.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	721,872.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	455,917.000	
0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,584,714.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,348,866.000	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	700,000.000	423,052.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	982,289.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240415	1,500,000.000	1,442,445.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	281,809.800	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	668,928.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,451,277.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,000,000.000	951,270.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240130	1,200,000.000	1,161,108.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	3,100,000.000	2,737,641.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,700,000.000	1,279,981.000	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	900,000.000	732,366.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241215	300,000.000	282,477.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	523,248.000	
1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	270,828.000	

1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250815	500,000.000	473,115.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	748,352.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,600,000.000	1,374,560.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	300,000.000	261,066.000	
1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240530	100,000.000	98,091.000	
2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	200,000.000	190,410.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	500,000.000	480,355.000	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260115	300,000.000	300,018.000	
4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	300,000.000	300,174.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	300,000.000	296,691.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	3,254,000.000	3,536,772.600	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,250,794.470	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,016,166.950	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,414,554.560	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,650,018.400	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	2,181,970.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,201,258.580	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,408,533.400	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,137,606.200	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,530,716.900	

4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	1,904,320.810	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,229,257.580	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,225,893.310	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,260,304.980	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	1,963,588.940	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,305,191.840	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	1,874,675.000	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,068,026.960	
4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	856,034.400	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	724,628.850	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,507,573.550	
3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	754,089.030	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,096,159.200	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	615,036.680	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	952,158.800	
2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	798,658.350	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,027,290.200	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	476,597.000	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	737,096.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	653,512.500	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	684,615.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	871,520.500	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	456,912.000	
0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	262,493.000	
0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	454,070.000	
0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	667,240.000	
IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	636,432.000	
0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	268,052.000	

0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	80,397.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	961,933.500	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,587,860.770	
4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	941,412.500	
3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	425,024.860	
3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	768,787.590	
2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	742,480.710	
1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	918,952.000	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	693,359.840	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	392,395.970	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	401,245.020	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	526,296.810	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,110,371.680	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	1,997,392.400	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	1,903,927.680	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,162,517.600	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	2,663,581.800	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,796,894.080	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	1,510,351.000	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,493,555.600	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,800,630.000	

2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,607,970.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	1,920,768.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,222,856.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,200,000.000	1,049,652.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,676,323.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,464,208.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	2,250,000.000	1,902,982.500	
0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	2,300,000.000	2,213,014.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,396,856.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,360,000.000	1,138,469.600	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	2,500,000.000	2,364,550.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	798,756.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,190,432.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,103,336.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	900,419.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	458,910.000	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,722,446.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20240531	300,000.000	288,810.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	337,493.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	500,000.000	431,955.000	

0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	1,900,000.000	1,328,556.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,517,055.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	391,026.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	900,000.000	802,179.000	
0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,681,911.000	
1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	600,000.000	421,374.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20250531	100,000.000	93,562.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	100,000.000	86,849.000	
2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,700,000.000	1,600,057.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,000,000.000	978,830.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,656,288.160	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,914,806.720	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,158,000.000	1,382,339.340	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	1,723,898.620	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,309,771.370	
4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,789,000.000	2,928,143.210	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,178,772.350	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	1,977,196.200	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	1,639,753.680	
3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,001,185.100	

	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,100,166.470	
	ユーロ 小計		ユーロ 551,296,326.090 (79,579,624,671)	
国債証券	合計		236,458,977,725 [236,458,977,725]	
合計			236,458,977,725 [236,458,977,725]	

- (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 268銘柄	100%	51.1%
イギリス・ポンド	国債証券 55銘柄	100%	4.7%
イスラエル・シケル	国債証券 14銘柄	100%	0.4%
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	100%	1.6%
オフショア・人民元	国債証券 46銘柄	100%	3.5%
カナダ・ドル	国債証券 40銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券 21銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	100%	0.2%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.3%
ニュージーランド・ドル	国債証券 13銘柄	100%	0.2%
ノルウェー・クローネ	国債証券 9銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	100%	0.4%
マレーシア・リングgit	国債証券 30銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券 361銘柄	100%	33.7%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

(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(2022年12月20日から2023年6月19日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

DCダイワ・ターゲットイヤー2040

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	当中間計算期間末 2023年6月19日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,310,417
親投資信託受益証券	356,686,054
未収入金	25,000
流動資産合計	358,021,471
資産合計	358,021,471
負債の部	
流動負債	
未払解約金	23,914
未払受託者報酬	51,166
未払委託者報酬	563,195
その他未払費用	12,712
流動負債合計	650,987
負債合計	650,987
純資産の部	
元本等	
元本	1,162,517,987
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	194,852,497
（分配準備積立金）	21,246,994
元本等合計	357,370,484
純資産合計	357,370,484
負債純資産合計	358,021,471

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間
	自 2022年12月20日
	至 2023年6月19日
営業収益	
有価証券売買等損益	34,249,622
営業収益合計	34,249,622
営業費用	
支払利息	90
受託者報酬	51,166
委託者報酬	563,195
その他費用	12,712
営業費用合計	627,163
営業利益	33,622,459
経常利益	33,622,459
中間純利益	33,622,459
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（ ）	335,750
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	144,497,490
剰余金増加額又は欠損金減少額	25,126,509
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	25,126,509
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,058,211
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,058,211
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	194,852,497

(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2022年12月20日 至2023年6月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2023年6月19日現在
1. 1 期首元本額	146,424,862円
期中追加設定元本額	24,251,257円
期中一部解約元本額	8,158,132円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	162,517,987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2022年12月20日 至2023年6月19日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2023年6月19日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2023年6月19日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2023年6月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,1990円 (21,990円)

(参考)

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年6月19日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	9,452,944,090
株式	2 3 246,517,241,000
派生商品評価勘定	154,905,850
未収配当金	1,712,583,298

未収利息		278,788
その他未収収益	4	33,170,835
流動資産合計		257,871,123,861
資産合計		257,871,123,861
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		972,650
前受金		159,545,000
未払解約金		152,444,540
受入担保金		4,860,062,989
流動負債合計		5,173,025,179
負債合計		5,173,025,179
純資産の部		
元本等		
元本	1	155,441,716,919
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		97,256,381,763
元本等合計		252,698,098,682
純資産合計		252,698,098,682
負債純資産合計		257,871,123,861

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20日 至2023年6月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023年6月19日現在
1. 1 期首	2022年12月20日
期首元本額	148,213,575,565円
期中追加設定元本額	14,337,497,441円
期中一部解約元本額	7,109,356,087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	2,757,704,427円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A	4,549,036,179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	914,226円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	15,842,998円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	232,173,822円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	14,489,300円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	458,537,106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)	582,804,567円
D-I's TOPIXインデックス	13,711,470円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	229,349,862円
iFree TOPIXインデックス	6,690,185,148円
iFree 8資産バランス	4,433,279,381円
iFree 年金バランス	853,672,461円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	33,003円
DCダイワ日本株式インデックス	69,986,058,577円
ダイワ・ライフ・バランス30	3,180,763,630円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,808,803,528円
ダイワ・ライフ・バランス70	5,092,334,666円

	年金ダイワ日本株式インデックス	7,113,786,468円
	DCダイワ・ターゲットイヤー2030	52,301,980円
	DCダイワ・ターゲットイヤー2040	71,281,189円
	ダイワつみたてインデックス日本株式	3,628,018,426円
	ダイワつみたてインデックスバランス30	12,632,163円
	ダイワつみたてインデックスバランス50	10,199,775円
	ダイワつみたてインデックスバランス70	30,561,440円
	ダイワ国内株式インデックス(ラップ専用)	5,632,774,993円
	ダイワ世界バランスファンド40VA	68,265,420円
	ダイワ世界バランスファンド60VA	24,867,151円
	ダイワ・バランスファンド35VA	4,326,315,401円
	ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	414,580,439円
	ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	59,675,537円
	ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)	91,079,592円
	ダイワ・ノーロードTOPIXファンド	210,675,257円
	ダイワファンドラップTOPIXインデックス	12,193,381,108円
	ダイワTOPIXインデックス(ダイワSMA専用)	3,459,995,963円
	ダイワファンドラップオンラインTOPIXインデックス	3,528,085,487円
	ダイワ・インデックスセレクトTOPIX	1,174,472,594円
	ダイワライフスタイル25	116,204,199円
	ダイワライフスタイル50	519,385,919円
	ダイワライフスタイル75	418,052,331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)	8,385,429,736円
	計	155,441,716,919円
2.	期末日における受益権の総数	155,441,716,919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 4,659,071,100円
4.	3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 1,132,560,000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。
--------------	--------------------------------

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年6月19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

株式関連

種類	2023年6月19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	6,167,695,000	-	6,321,780,000	154,085,000
合計	6,167,695,000	-	6,321,780,000	154,085,000

（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）

	2023年6月19日現在
1口当たり純資産額	1.6257円
（1万口当たり純資産額）	（16,257円）

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年6月19日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	987,494,006
コール・ローン	7,144,338,720
株式	341,736,971,350
投資証券	7,480,138,290
派生商品評価勘定	438,156,250
未収入金	108,881,124
未収配当金	416,712,468
差入委託証拠金	6,916,357,596
流動資産合計	365,229,049,804
資産合計	365,229,049,804
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	77,371
未払解約金	184,854,900
流動負債合計	184,932,271

負債合計		184,932,271
純資産の部		
元本等		
元本	1	73,588,245,283
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		291,455,872,250
元本等合計		365,044,117,533
純資産合計		365,044,117,533
負債純資産合計		365,229,049,804

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20日 至2023年6月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)投資証券

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

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023年6月19日現在
1. 1 期首	2022年12月20日
期首元本額	69,638,060,038円
期中追加設定元本額	6,449,192,753円
期中一部解約元本額	2,499,007,508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	289,363,340円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	2,653,445円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	32,907,938円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	4,853,233円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	150,057,928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)	88,035,966円
ダイワバランスファンド2023-01(適格機関投資家専用)	105,196,680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)	644,064,199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)	3,698,570,324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)	595,093,261円
D-I's 外国株式インデックス	18,528,770円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	50,273,049円

i F r e e 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)	6,909,581,557円
i F r e e 8資産バランス	1,467,364,616円
i F r e e 年金バランス	284,439,971円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2060	160,733円
D Cダイワ外国株式インデックス	45,298,627,479円
ダイワ・ライフ・バランス30	527,100,683円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,053,632,399円
ダイワ・ライフ・バランス70	925,648,089円
大和D C 海外株式インデックスファンド	1,967,672,458円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2030	12,384,478円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2040	12,656,535円
ダイワつみたてインデックス外国株式	1,770,889,732円
ダイワつみたてインデックスバランス30	2,074,276円
ダイワつみたてインデックスバランス50	2,265,321円
ダイワつみたてインデックスバランス70	5,620,426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)	5,962,982円
ダイワ世界バランスファンド40VA	66,467,884円
ダイワ世界バランスファンド60VA	40,358,122円
ダイワ・バランスファンド35VA	1,075,334,572円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	58,861,714円
ダイワバランスファンド2021-02(適格機関投資家専用)	160,197,575円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,273,057,802円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	416,012,037円
ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	1,535,421,012円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,949,549,162円
ダイワライフスタイル25	9,735,152円
ダイワライフスタイル50	43,069,169円
ダイワライフスタイル75	34,501,214円
計	73,588,245,283円
2. 期末日における受益権の総数	73,588,245,283口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年6月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種類	2023年6月19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				
株価指数 先物取引				
買建	15,452,000,522	-	15,662,362,171	210,361,649
合計	15,452,000,522	-	15,662,362,171	210,361,649

(注)

1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2. 通貨関連

種類	2023年6月19日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	6,874,421,770	-	7,102,139,000	227,717,230
アメリカ・ドル	3,871,800,380	-	3,950,249,400	78,449,020
イギリス・ ポンド	397,116,650	-	417,611,000	20,494,350
オーストラリ ア・ドル	469,082,730	-	505,148,800	36,066,070
カナダ・ドル	695,610,640	-	728,932,800	33,322,160
スイス・フラン	534,308,160	-	555,002,000	20,693,840
ユーロ	906,503,210	-	945,195,000	38,691,790
合計	6,874,421,770	-	7,102,139,000	227,717,230

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2023年6月19日現在
1口当たり純資産額	4.9606円

(1万口当たり純資産額)

(49,606円)

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年6月19日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	2,786,315,472
コール・ローン	1,378,129,165
国債証券	256,103,619,934
派生商品評価勘定	28,669,803
未収入金	798,837
未収利息	1,700,297,324
前払費用	84,706,293
流動資産合計	262,082,536,828
資産合計	262,082,536,828
負債の部	
流動負債	
未払金	116,907
未払解約金	105,619,206
流動負債合計	105,736,113
負債合計	105,736,113
純資産の部	
元本等	
元本	1 79,365,949,731
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	182,610,850,984
元本等合計	261,976,800,715
純資産合計	261,976,800,715
負債純資産合計	262,082,536,828

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20日 至2023年6月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、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。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023年6月19日現在
1. 1 期首	2022年12月20日
期首元本額	76,482,606,084円
期中追加設定元本額	5,524,360,883円
期中一部解約元本額	2,641,017,236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	419,615,070円
ダイワ国内重視バランスファンド30V A(一般投資家私募)	7,806,699円
ダイワ国内重視バランスファンド50V A(一般投資家私募)	47,693,634円
ダイワ国際分散バランスファンド30V A(一般投資家私募)	16,768,247円
ダイワ国際分散バランスファンド50V A(一般投資家私募)	217,000,520円
外国債券インデックスファンド(F0Fs用)(適格機関投資家専用)	470,306,657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)	754,856,518円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス (為替ヘッジなし)	3,166,627,209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)	856,969,643円
D - I ' s 外国債券インデックス	1,585,875円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	17,888,179円
i F r e e 外国債券インデックス	2,200,982,130円
i F r e e 8資産バランス	2,137,642,854円
i F r e e 年金バランス	421,103,447円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	15,487円
DCダイワ外国債券インデックス	50,618,575,880円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,136,510,420円
ダイワ・ライフ・バランス50	750,175,721円
ダイワ・ライフ・バランス70	540,812,518円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安 定コース)	682,257,155円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6 分散コース)	532,620,893円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成 長コース)	209,302,937円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	35,056,061円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	17,108,723円
ダイワつみたてインデックス外国債券	1,624,944,749円
ダイワつみたてインデックスバランス30	4,466,739円
ダイワつみたてインデックスバランス50	1,674,643円

ダイワつみたてインデックスバランス70	3,273,659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）	511,024,245円
ダイワ世界バランスファンド40VA	112,079,398円
ダイワ世界バランスファンド60VA	29,164,889円
ダイワ・バランスファンド35VA	3,120,655,285円
ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	196,547,666円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	157,386,959円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	60,223,624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）	2,429,200,954円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,749,387,068円
ダイワライフスタイル25	28,682,481円
ダイワライフスタイル50	61,332,116円
ダイワライフスタイル75	16,622,779円
計	79,365,949,731円
2. 期末日における受益権の総数	79,365,949,731口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年6月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	2023年6月19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	1,331,701,591	-	1,360,371,394	28,669,803
アメリカ・ドル	234,916,098	-	237,475,439	2,559,341
イギリス・ ポンド	10,810,273	-	11,077,295	267,022
オフショア・ 人民元	723,623,800	-	734,179,900	10,556,100
シンガポ- ル・ドル	27,108,708	-	27,930,144	821,436
メキシコ・ペソ	195,982,580	-	208,380,536	12,397,956
ユーロ	139,260,132	-	141,328,080	2,067,948
合計	1,331,701,591	-	1,360,371,394	28,669,803

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2023年6月19日現在
--	--------------

1口当たり純資産額	3.3009円
(1万口当たり純資産額)	(33,009円)

「ダイワ」-REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年6月19日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	8,157,915,108
投資証券	2 455,082,015,950
未収入金	733,631,790
未収配当金	2,299,667,764
前払金	12,320,000
流動資産合計	466,285,550,612
資産合計	466,285,550,612
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	52,136,000
未払解約金	874,718,000
流動負債合計	926,854,000
負債合計	926,854,000
純資産の部	
元本等	
元本	1 142,520,451,873
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	322,838,244,739
元本等合計	465,358,696,612
純資産合計	465,358,696,612
負債純資産合計	466,285,550,612

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20日 至2023年6月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023年6月19日現在
1. 1 期首	2022年12月20日
期首元本額	147,074,195,757円
期中追加設定元本額	11,482,067,042円
期中一部解約元本額	16,035,810,926円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワJ - REITオープン	4,315,632,399円
ダイワJ - REITオープン（毎月分配型）	125,119,136,564円
ダイワJ - REITオープン（年1回決算型）	388,922,682円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	17,668,307円
iFree J - REITインデックス	633,049,048円
iFree 8資産バランス	2,111,976,663円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	2,397円
DC・ダイワJ - REITオープン	5,496,427,592円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	7,522,259円

DCダイワ・ターゲットイヤー2040	7,382,097円
ダイワ国内REITインデックス(投資一任専用)	1,616,697円
ダイワ・ノーロード J-REITファンド	103,111,548円
ダイワファンドラップ J-REITインデックス	2,551,934,142円
ダイワ J-REITインデックス(ダイワSMA専用)	393,691,288円
ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス	457,776,502円
ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	914,601,688円
計	142,520,451,873円
2. 期末日における受益権の総数	142,520,451,873口
3. 2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 4,670,200,000円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年6月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

種類	2023年6月19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 不動産投信 指数先物取引 買建	10,338,720,000	-	10,287,200,000	51,520,000
合計	10,338,720,000	-	10,287,200,000	51,520,000

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2023年6月19日現在
1口当たり純資産額	3.2652円
(1万口当たり純資産額)	(32,652円)

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年6月19日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	172,225,200
コール・ローン	491,184,399

株式		9,212,520
投資信託受益証券		200,157,257
投資証券		30,964,085,084
派生商品評価勘定		23,507,432
未収入金		1,669,946,657
未収配当金		103,183,571
差入委託証拠金		169,598,119
流動資産合計		33,803,100,239
資産合計		33,803,100,239
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		952
未払金		1,737,849,192
未払解約金		7,068,000
流動負債合計		1,744,918,144
負債合計		1,744,918,144
純資産の部		
元本等		
元本	1	9,860,829,146
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		22,197,352,949
元本等合計		32,058,182,095
純資産合計		32,058,182,095
負債純資産合計		33,803,100,239

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20日 至2023年6月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

(2)投資信託受益証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、市場価格のない有価証券については投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。また、市場価格のある有価証券については、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

(3)投資証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法

(1)先物取引

	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023年6月19日現在
1. 1 期首	2022年12月20日
期首元本額	9,133,427,619円
期中追加設定元本額	1,111,220,709円
期中一部解約元本額	383,819,182円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワバランスファンド2023-01（適格機関投資家専用）	94,248,022円
ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）	1,461,291,483円

ダイワファンドラップオンライン 外国REIT インデックス(為替ヘッジなし)	274,052,627円
D-I's グローバルREITインデックス	1,641,861円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	15,753,367円
iFree 外国REITインデックス	745,152,383円
iFree 8資産バランス	2,202,460,901円
グローバル・リート・インデックスファンド (資産形成型)	371,610,909円
グローバル・リート・インデックスファンド (毎月決算型)	225,492,679円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	30,065円
DCダイワ・グローバルREITインデックス ファンド	3,982,272,748円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	7,792,251円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	7,880,547円
ダイワ海外REITインデックス(為替ヘッジ なし)(投資一任専用)	1,420,445円
ダイワバランスファンド2021-02(適格機関投資 家専用)	145,182,962円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルRE IT	254,176,259円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファン ド	66,565,748円
ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジ なし)(ダイワSMA専用)	3,803,889円
計	9,860,829,146円
2. 期末日における受益権の総数	9,860,829,146口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年6月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額 との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計 上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しておりま す。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 不動産投信関連

種類	2023年6月19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				
不動産投信 指数先物取引				
買建	851,711,975	-	864,055,693	12,343,718
合計	851,711,975	-	864,055,693	12,343,718

(注)

1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2. 通貨関連

種類	2023年6月19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				

売建	56,771,720	-	56,770,920	800
アメリカ・ドル	56,771,720	-	56,770,920	800
買建	526,926,129	-	538,088,091	11,161,962
アメリカ・ドル	414,308,718	-	422,288,980	7,980,262
イギリス・ ポンド	14,559,992	-	14,559,600	392
オーストラリ ア・ドル	9,734,980	-	9,734,800	180
シンガポー ル・ドル	13,778,739	-	13,778,440	299
ユーロ	69,643,848	-	72,826,500	3,182,652
香港・ドル	4,899,852	-	4,899,771	81
合計	583,697,849	-	594,859,011	11,162,762

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2023年6月19日現在
1口当たり純資産額	3.2511円
(1万口当たり純資産額)	(32,511円)

「ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド」の状況
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年6月19日現在 金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		4,030,247
国債証券		409,653,530
未収利息		184,806
前払費用		22,927
流動資産合計		413,891,510
資産合計		413,891,510
負債の部		
流動負債		
流動負債合計		-
負債合計		-
純資産の部		
元本等		
元本	1	396,305,310
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		17,586,200
元本等合計		413,891,510
純資産合計		413,891,510
負債純資産合計		413,891,510

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20日 至2023年6月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023年6月19日現在
1. 1 期首	2022年12月20日
期首元本額	347,622,118円
期中追加設定元本額	64,276,515円
期中一部解約元本額	15,593,323円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	55,183,753円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	47,788円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	93,572,531円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	178,732,981円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	68,768,257円
計	396,305,310円
2. 期末日における受益権の総数	396,305,310口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年6月19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)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等</p>

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2023年6月19日現在

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2023年6月19日現在

1口当たり純資産額	1.0444円
(1万口当たり純資産額)	(10,444円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2023年6月30日

資産総額	357,798,921円
負債総額	99,424円
純資産総額（ - ）	357,699,497円
発行済数量	161,795,807口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.2108円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2023年6月30日

資産総額	259,089,022,360円
負債総額	4,388,279,371円
純資産総額（ - ）	254,700,742,989円
発行済数量	156,615,442,339口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.6263円

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2023年6月30日

資産総額	372,790,043,327円
負債総額	67,787,140円
純資産総額（ - ）	372,722,256,187円
発行済数量	74,202,461,234口
1単位当たり純資産額（ / ）	5.0230円

(参考) ダイワJ - R E I Tマザーファンド

純資産額計算書

2023年6月30日

資産総額	465,200,436,186円
負債総額	753,380,434円
純資産総額（ - ）	464,447,055,752円
発行済数量	141,777,297,512口
1単位当たり純資産額（ / ）	3.2759円

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2023年6月30日

資産総額	32,551,360,092円
負債総額	135,454,920円
純資産総額（ - ）	32,415,905,172円
発行済数量	9,890,894,222口
1単位当たり純資産額（ / ）	3.2773円

(参考) ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2023年6月30日

資産総額	422,817,875円
負債総額	3,013,210円
純資産総額（ - ）	419,804,665円
発行済数量	401,900,926口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0445円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2023年6月30日

資産総額	267,188,756,400円
負債総額	96,355,444円
純資産総額（ - ）	267,092,400,956円
発行済数量	79,700,394,310口

1 単位当たり純資産額 (/)

3.3512円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典
ありません。

(3) 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

(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け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2023年6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

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. 商品会議

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

ロ. 商品担当役員

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ. リスクマネジメント会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年6月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	92	314,869
追加型株式投資信託	777	24,120,844
株式投資信託 合計	869	24,435,714
単位型公社債投資信託	98	177,279
追加型公社債投資信託	14	1,581,751
公社債投資信託 合計	112	1,759,030
総合計	981	26,194,744

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（2022年4月1日から2023年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。
- 3．財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

(1)【貸借対照表】

(単位:百万円)

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

資産合計

61,390

52,959

(単位:百万円)

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

その他有価証券評価差額金	971	534
評価・換算差額等合計	971	534
純資産合計	41,941	39,084
負債・純資産合計	61,390	52,959

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

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

固定資産減価償却費	606	625
諸経費	1,864	2,193
一般管理費計	11,628	11,946
営業利益	18,551	15,310

(単位:百万円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

	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	10,574	10,948	37,618
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 9,388	△ 9,388	△ 9,388
当期純利益	-	-	-	12,738	12,738	12,738
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,350	3,350	3,350
当期末残高	15,174	11,495	374	13,925	14,298	40,969

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	947	947	38,566
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 9,388
当期純利益	-	-	12,738
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	24	24	24
当期変動額合計	24	24	3,374
当期末残高	971	971	41,941

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	13,925	14,299	40,969
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 12,737	△ 12,737	△ 12,737
当期純利益	-	-	-	10,317	10,317	10,317
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△ 2,419	△ 2,419	△ 2,419
当期末残高	15,174	11,495	374	11,505	11,879	38,549

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

注記事項

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物 15～18年

器具備品 4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 収益及び費用の計上基準

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

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

(重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

(会計方針の変更に関する注記)

(時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用)

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

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

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

前事業年度	当事業年度
(2022年3月31日)	(2023年3月31日)

建物	37百万円	38百万円
器具備品	283百万円	296百万円

2 関係会社項目

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

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

3 保証債務

前事業年度(2022年3月31日)

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

当事業年度(2023年3月31日)

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自2021年4月1日至2022年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当 の総額(百万 円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月22日 定時株主総会	普通株式	9,388	3,599	2021年 3月31日	2021年 6月23日

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

2022年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	12,737百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,883円
基準日	2022年3月31日

効力発生日

2022年6月24日

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2．配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

2023年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

（金融商品関係）

1．金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。その他未払金は主にグループ通算制度における通算親法人へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド

運用に係る業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

（ ）為替変動リスクの管理

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

（ ）価格変動リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

前事業年度（2022年3月31日）

（1）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券及び投資有価証券	66	-	-	66
資産合計	66	-	-	66

当事業年度（2023年3月31日）

（1）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

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

(単位：百万円)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（2022年3月31日）

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

当事業年度（2023年3月31日）

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

2. その他有価証券

前事業年度（2022年3月31日）

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	66	55	11
(2) その他	6,755	4,917	1,838
小計	6,822	4,972	1,850

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	3,753	4,208	454
小計	3,753	4,208	454
合計	10,575	9,180	1,395

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

当事業年度(2023年3月31日)

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

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	-	-	-
(2) その他 証券投資信託	1,719	327	59
合計	1,719	327	59

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、証券投資信託について331百万円の減損処理を行っております。

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(注) その他には、臨時に支払った割増退職金等を含んでおります。

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度189百万円、当事業年度184百万円であります。

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

（単位：百万円）

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

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

前事業年度（2022年3月31日）

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

当事業年度（2023年3月31日）

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

3．法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

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

（収益認識関係）

（1）顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

(2) 収益を理解するための基礎となる情報

(重要な会計方針)の4.収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1.サービスごとの情報

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

2.地域ごとの情報

(1)営業収益

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

(2)有形固定資産

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

3.主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取(注)	19,000 0	関係会社短期貸付金 受取利息関係会社	24,900 0

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（イ）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
----	--------	-----	-------------------	-------	-----------------------	-----------	-------	---------------	----	---------------

子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有直接100.0	経営管理	債務保証(注)	1,900	-	-
-----	---	-----------	-----	---------	-----------	------	---------	-------	---	---

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

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

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

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

2. 親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（1株当たり情報）

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,078.50円	1株当たり純資産額	14,983.42円
1株当たり当期純利益	4,883.43円	1株当たり当期純利益	3,955.35円

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

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

	名 称	資本金の額 (2022年03月末日現在)	事業の内容	備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	(注6)	
再信託受託会社	株式会社日本カスト ディ銀行	51,000百万円	(注6)	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	(注1)	
	東海東京証券株式会社	6,000百万円	(注1)	
	第一生命保険株式会社	60,000百万円	(注9)	
	株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円	(注3)	

(注1) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

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

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

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

(注7) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注8) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注9) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

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

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

(注12) 農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでいます。

2【関係業務の概要】

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

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

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

第3【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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

独立監査人の監査報告書

2023年5月26日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第64期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年2月17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 深井 康治指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ターゲットイヤー2040の2021年12月21日から2022年12月19日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DCダイワ・ターゲットイヤー2040の2022年12月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年7月28日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDCダイワ・ターゲットイヤー2040の2022年12月20日から2023年6月19日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DCダイワ・ターゲットイヤー2040の2023年6月19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（2022年12月20日から2023年6月19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、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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。