

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2026年9月11日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 佐野 径
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	川根 浩志 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2030
【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2030

(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也没有ありません。

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(5)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(6)【申込単位】

1円以上1円単位

(7)【申込期間】

2026年9月12日から2027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。
一般社団法人資産運用業協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型投信	国 内	株 式
	海 外	債 券
追加型投信	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 ()	年12回 (毎月)	中南米		
不動産投信		アフリカ		
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 資産配分変型) (株式、債券、不動産投信))	日々	中近東 (中東)	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
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 分固定型	資産配	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 分変更型	資産配	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、一般社団法人資産運用業協会のホームページ
（アドレス<https://www.imaj.or.jp/>）をご参照下さい。

< 信託金の限度額 >

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

< ファンドの目的・特色 >

ファンドの目的

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

ファンドの特色

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

- 当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、2030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。
- 2030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。

< 2026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2030	13%	9%	5%	5%	48%	20%

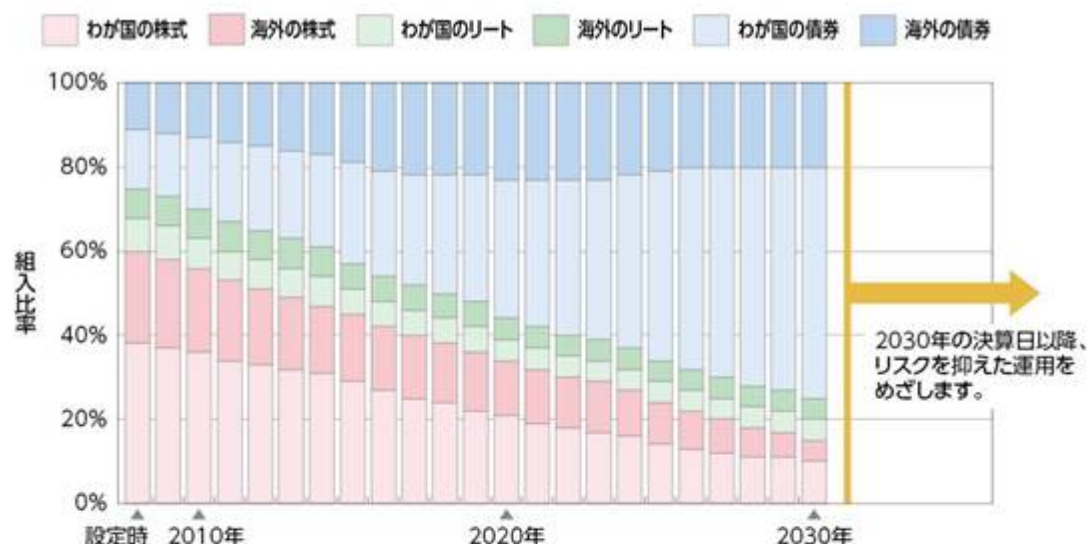
< 当初設定時の基本配分比率 >

	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2030	38%	22%	8%	7%	14%	11%

※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) 2026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。2025年以前は過去の基本配分比率を示しています。
- (注2) 解約資金対応等のためファンドにおいて現金等を保有する必要があるため、実際の資産別実質組入比率の推移は、上記の資産配分とは異なることがあります。
- (注3) 組入有価証券等の価格変動により、ファンドの実際の資産別実質組入比率が、その時点での基本配分比率から乖離することがあります。なお、こうした乖離が一定水準以上となった場合には、基本配分比率の変更計画に基づく定期的なポートフォリオの見直し以外のタイミングであっても、その時点でポートフォリオの調整(リバランス)を行なう場合があります。
- (注4) 投資環境によっては、「わが国の債券」への投資に代えて「わが国の短期債券および短期金融資産」へ投資する場合があります。

2

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

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

運用プロセス



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

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

東証株価指数(TOPIX)とは

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

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

3

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

運用プロセス



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

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

MSCIコクサイ指数とは

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

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

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

4

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

運用プロセス



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

東証REIT指数とは

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

配当込み東証REIT指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、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。

5

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

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

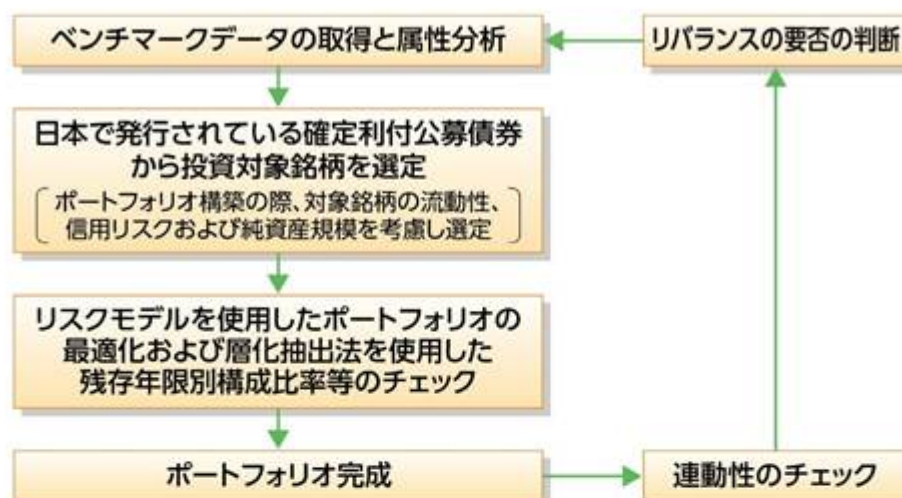
S&P先進国REIT指数は、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS&Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。

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

6

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

運用プロセス



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

(注1)リスクモデルとは…

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

(注2)層化抽出法とは…

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

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

NOMURA-BPI総合指数とは

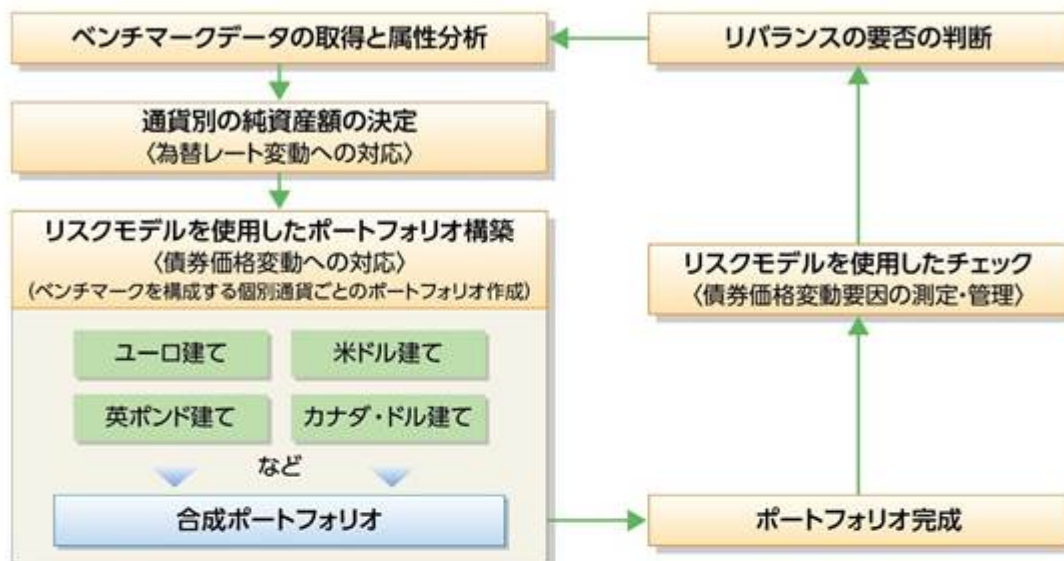
NOMURA-BPIは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表わすために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

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

7

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

運用プロセス



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

① 為替レート変動への対応

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

② 債券価格変動への対応

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

③ 債券価格変動要因の測定・管理

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

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

FTSE世界国債インデックスとは

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

FTSE世界国債インデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

8

2030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。

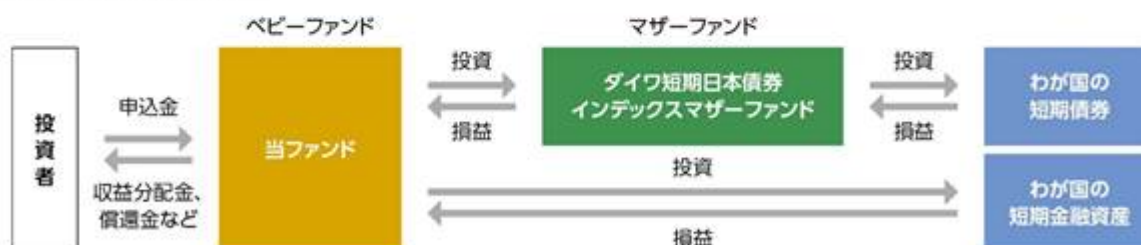
ファミリーファンド方式とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をまとめてベビーファンド(当ファンド)とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

〈2030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。

〈2030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、分配を行わないことがあります。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

●株式への直接投資は、行ないません。

●外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

(2) 【ファンドの沿革】

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	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。 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 など
↑ ↓ 1 収益分配金、償還金など ↑ ↓ お申込金（３）		
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（２）の委託者であり、次の業務を行ないます。 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収受します。また、販売会社には、委託会社から業務に対する代行手数料が支払われます。

< 委託会社の概況（2026年6月末日現在） >

・ 資本金の額 414億2,454万1,896円

・沿革

1959年12月12日	大和証券投資信託委託株式会社として設立
1960年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1960年 4月 1日	営業開始
1985年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
1995年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
1995年 9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
2007年 9月30日	「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。 (金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号）
2020年 4月 1日	大和アセットマネジメント株式会社に商号変更
2024年10月 1日	株式会社かんぽ生命保険と資本業務提携
2025年 7月 1日	大和かんぽオルタナティブインベストメンツ株式会社（旧商号：三井物産オルタナティブインベストメンツ株式会社）を子会社化

・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

主要投資対象

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

1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
2. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
3. ダイワJ - 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（ＲＥＩＴ）に投資するとともに、短期金融資産に投資を行ない、中長期的に安定した信託財産の成長をめざして運用を行ないます。

ロ．マザーファンドの受益証券への投資を通じて、当初設定時の基本配分比率を参考にポートフォリオを構築し、2030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38%

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22%

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの受益証券 ……信託財産の純資産総額の 8%

ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの受益証券
……信託財産の純資産総額の 7%

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券
……信託財産の純資産総額の14%

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11%

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．2030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。）

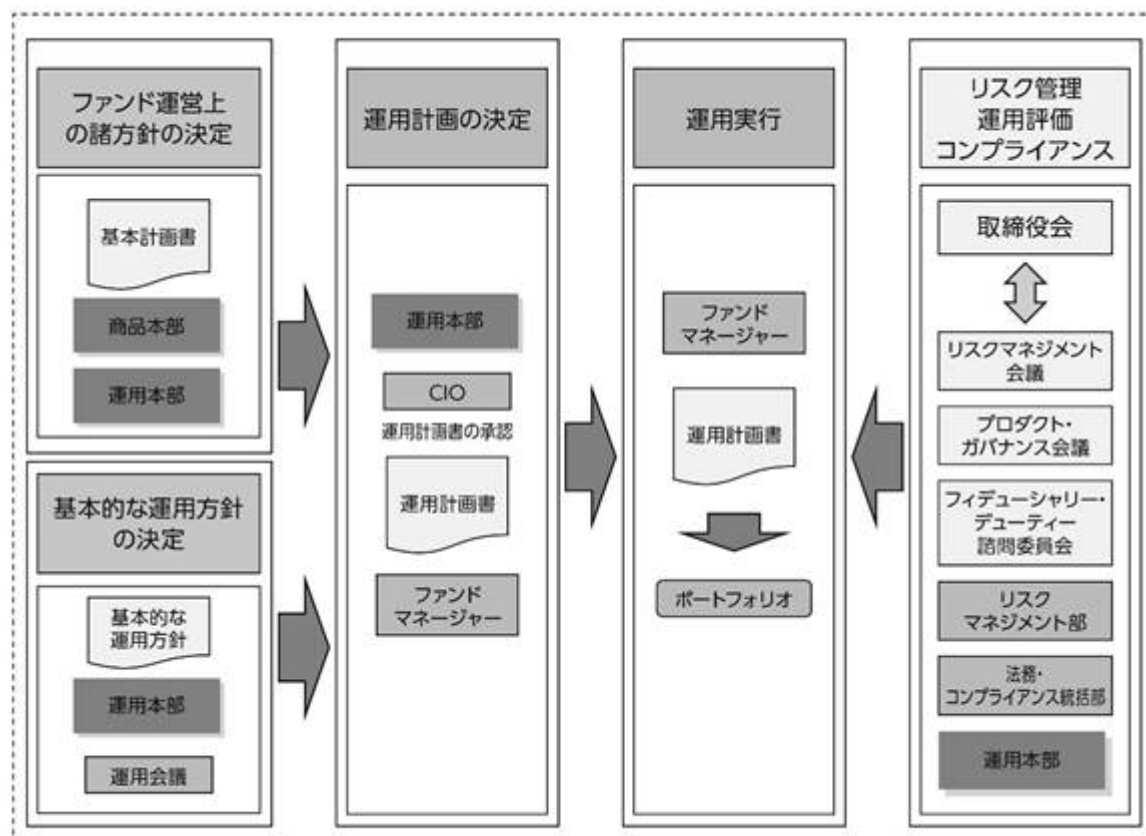
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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本部長の決裁により決定します。

ロ．基本的な運用方針の承認

運用担当チームは、基本的な運用方針を作成し、運用会議にて承認を受けます。

ハ．運用計画書の作成・承認

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で承認された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成し、CIOの承認を受けます。

職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・運用チームまたは運用チームの戦略毎の基本的な運用方針の承認
- ・運用チームリーダーまたは運用チームメンバーが策定する各信託財産等の運用計画書および変更運用計画書の承認
- ・その他信託財産等の運用に関する事項の決定

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

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

ホ．運用チームリーダー

次の職務を遂行します。

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

ヘ．ファンドマネージャー

次の職務を遂行します。

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

リスクマネジメント会議、プロダクト・ガバナンス会議およびフィデューシャリー・デューティー諮問委員会

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

イ．リスクマネジメント会議

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

ロ．プロダクト・ガバナンス会議

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

ハ．フィデューシャリー・デューティー諮問委員会

取締役会の諮問委員会として、当社の取り組みの適切性や妥当性に関する事項、その他フィデューシャリー・デューティー遂行の観点で検討が必要な内容として取締役会から諮問された事項について、取締役会に意見を述べます。

受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は2026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)【配分方針】

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）

一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業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券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. 預託証券（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。）
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
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 - R E I T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す。
- 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。

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。

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

- 1．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します。）

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します。

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

金利先渡取引

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

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

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

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

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

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。）

八．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

金利先渡取引

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

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

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

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

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

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します。

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、リーートの価格や配当に影響を受けることが考えられます。
 - ・ 金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。
- ニ．組入リー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ことがあります。

その他

- イ．解約申込みがあった場合には、解約資金を手当てするため組入証券を売却しなければならないことがあります。その際、市場規模や市場動向によっては市場実勢を押下げ、当初期待される価格で売却できないこともあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。
- ロ．ファンド資産をコール・ローン、譲渡性預金証書等の短期金融資産で運用する場合、債務不履行により損失が発生することがあります（信用リスク）。この場合、基準価額が下落する要因となります。

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

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

(3)その他の留意点

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

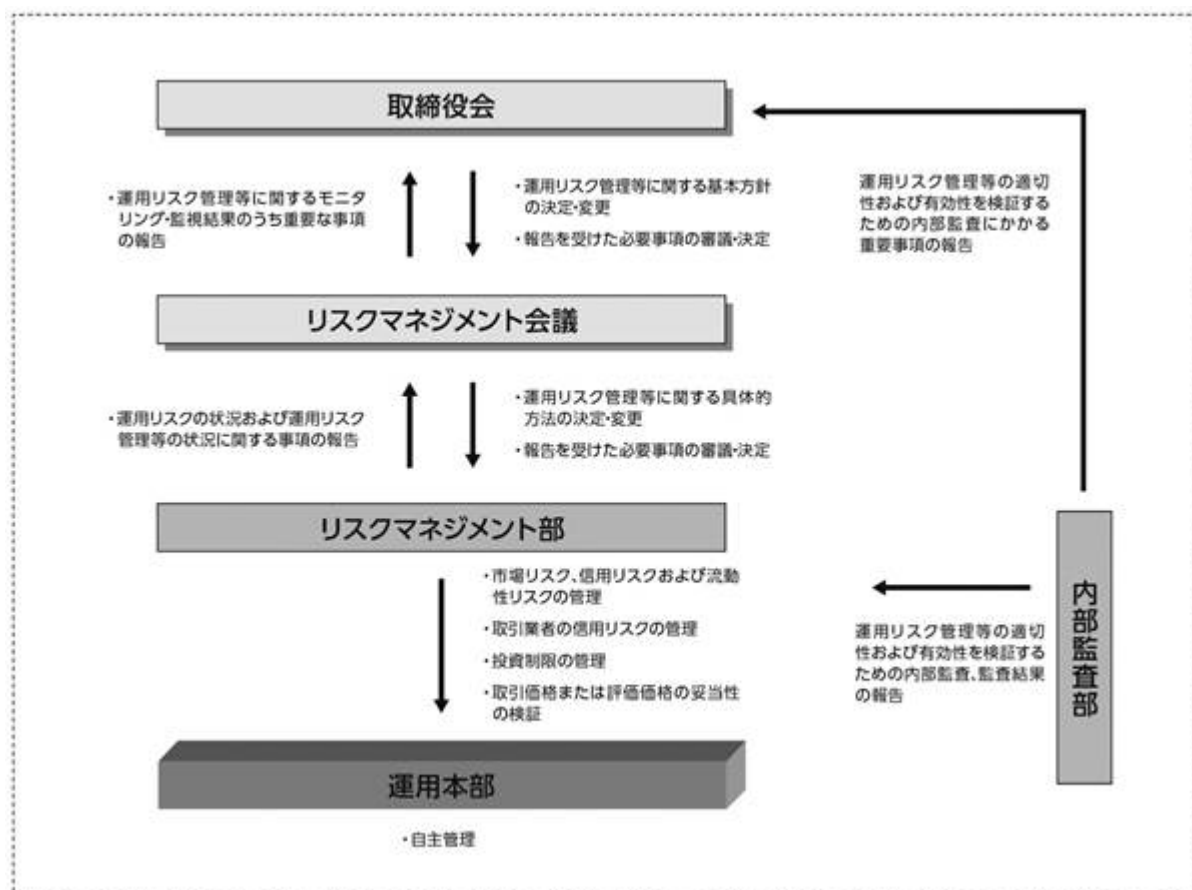
流動性リスクに関する事項

- ・ 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性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

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

(4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



流動性リスクに対する管理体制

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

参考情報

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

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

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



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

資産クラスの指数について

日本株 配当込みTOPIX	配当込みTOPIXの指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
先進国株 MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc. (「MSCI」) が開発した指数です。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。 (https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html)
新興国株 MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	
日本国債 NOMURA-BPI国債	NOMURA-BPI国債は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する国内で発行された公算利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は同社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債 JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円ベース)	JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス 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0.374%（税抜0.34%）
第19計算期間から第23計算期間まで	年率0.308%（税抜0.28%）
第24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0.155% （税抜）	年率0.155% （税抜）	年率0.03% （税抜）

< 第19計算期間から第23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24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、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用され

ます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。

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、20.315%（所得税15.315%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。

ハ．損益通算について

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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」について

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

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

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

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

<注1> 個別元本について

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、2026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】（2026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		715,701,954	99.80
	内 日本	715,701,954	99.80
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,401,137	0.20
純資産総額		717,103,091	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】（2026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	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	329,131,902	1.0368 341,258,872	1.0387 341,869,306	47.67
2	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	33,881,202	4.0471 137,122,919	4.2359 143,517,383	20.01
3	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	30,285,171	2.5645 77,666,624	3.0463 92,257,716	12.87
4	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	6,704,257	8.4278 56,502,243	9.6416 64,639,764	9.01
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	7,177,300	4.3206 31,010,781	5.1572 37,014,771	5.16
6	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	9,945,907	3.8947 38,737,259	3.6601 36,403,014	5.08

(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	99.80%
合計	99.80%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(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9計算期間末 (2016年12月19日)	202,443,979	202,443,979	1.3306	1.3306
第10計算期間末 (2017年12月18日)	229,901,968	229,901,968	1.4390	1.4390
第11計算期間末 (2018年12月18日)	228,565,144	228,565,144	1.3825	1.3825
第12計算期間末 (2019年12月18日)	283,602,330	283,602,330	1.5154	1.5154
第13計算期間末 (2020年12月18日)	266,061,502	266,061,502	1.5414	1.5414
第14計算期間末 (2021年12月20日)	404,356,667	404,356,667	1.6902	1.6902
第15計算期間末 (2022年12月19日)	437,915,846	437,915,846	1.6918	1.6918
第16計算期間末 (2023年12月18日)	553,083,926	553,083,926	1.8448	1.8448
第17計算期間末 (2024年12月18日)	614,313,871	614,313,871	2.0122	2.0122
2025年6月末日	575,658,414	-	2.0342	-

7月末日	612,186,230	-	2.0698	-
8月末日	629,942,553	-	2.0877	-
9月末日	643,700,843	-	2.1135	-
10月末日	660,151,896	-	2.1672	-
11月末日	673,293,815	-	2.1910	-
第18計算期間末 (2025年12月18日)	671,815,960	671,815,960	2.1785	2.1785
12月末日	684,951,193	-	2.1971	-
2026年1月末日	659,396,667	-	2.2049	-
2月末日	652,633,236	-	2.2620	-
3月末日	642,063,634	-	2.1962	-
4月末日	652,124,779	-	2.2548	-
5月末日	659,423,269	-	2.2822	-
6月末日	717,103,091	-	2.3008	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
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
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
2025年12月19日～ 2026年6月18日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第9計算期間	1.3
第10計算期間	8.1
第11計算期間	3.9
第12計算期間	9.6
第13計算期間	1.7
第14計算期間	9.7
第15計算期間	0.1

第16計算期間	9.0
第17計算期間	9.1
第18計算期間	8.3
2025年12月19日～ 2026年6月18日	5.1

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第9計算期間	51,030,255	23,832,682
第10計算期間	51,008,648	43,394,758
第11計算期間	37,107,015	31,539,565
第12計算期間	41,417,826	19,595,592
第13計算期間	62,234,725	76,774,144
第14計算期間	114,918,718	48,290,467
第15計算期間	78,856,220	59,246,003
第16計算期間	88,434,290	47,479,105
第17計算期間	78,911,508	73,415,573
第18計算期間	72,908,303	69,823,458
2025年12月19日～ 2026年6月18日	51,115,830	51,077,495

(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 (2026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		711,691,668,910	96.56
	内 日本	711,691,668,910	96.56
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		25,354,556,920	3.44
純資産総額		737,046,225,830	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)		25,338,990,000	3.44
	内 日本	25,338,990,000	3.44

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

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

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

(2) 投資資産（2026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	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	7,927,600	2,387.21 18,924,871,803	3,207.00 25,423,813,200	3.45
2	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	268,000	27,395.55 7,342,008,878	77,150.00 20,676,200,000	2.81
3	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	6,782,700	2,962.33 20,092,616,465	2,725.00 18,482,857,500	2.51
4	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	2,739,400	4,278.67 11,720,997,407	6,346.00 17,384,232,400	2.36
5	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	2,452,800	4,623.78 11,341,214,256	5,963.00 14,626,046,400	1.98
6	日立	日本	株式	電気機器	3,246,100	3,997.78 12,977,209,993	4,471.00 14,513,313,100	1.97
7	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	4,269,400	3,474.10 14,832,323,122	3,280.00 14,003,632,000	1.90
8	村田製作所	日本	株式	電気機器	1,217,600	2,839.05 3,456,836,005	11,395.00 13,874,552,000	1.88
9	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,748,400	5,037.31 8,807,234,752	7,743.00 13,537,861,200	1.84
10	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	384,200	15,989.75 6,143,265,610	32,340.00 12,425,028,000	1.69
11	三菱商事	日本	株式	卸売業	2,478,600	3,687.06 9,138,769,774	4,347.00 10,774,474,200	1.46
12	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	913,400	7,935.83 7,248,587,247	11,330.00 10,348,822,000	1.40
13	キーエンス	日本	株式	電気機器	127,600	56,258.74 7,178,615,326	81,060.00 10,343,256,000	1.40
14	東京海上HD	日本	株式	保険業	1,291,900	6,303.60 8,143,629,032	7,202.00 9,304,263,800	1.26
15	三菱重工業	日本	株式	機械	2,414,500	3,826.97 9,240,222,486	3,666.00 8,851,557,000	1.20

16	三井物産	日本	株式	卸売業	1,913,600	3,875.81 7,416,758,302	4,497.00 8,605,459,200	1.17
17	伊 藤 忠	日本	株式	卸売業	4,537,300	1,765.02 8,008,458,641	1,854.00 8,412,154,200	1.14
18	三菱電機	日本	株式	電気機器	1,411,600	3,979.17 5,617,000,205	5,876.00 8,294,561,600	1.13
19	信越化学	日本	株式	化学	1,136,500	4,757.93 5,407,390,631	7,008.00 7,964,592,000	1.08
20	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	91,100	47,857.79 4,359,845,309	82,810.00 7,543,991,000	1.02
21	キオクシアホールディングス	日本	株式	電気機器	78,300	7,374.22 577,402,117	89,680.00 7,021,944,000	0.95
22	パナソニック ホールディング	日本	株式	電気機器	1,522,600	1,671.11 2,544,438,847	4,502.00 6,854,745,200	0.93
23	フジクラ	日本	株式	非鉄金属	1,016,400	2,691.60 2,735,742,747	6,238.00 6,340,303,200	0.86
24	HOYA	日本	株式	精密機器	239,600	21,156.46 5,069,088,739	25,950.00 6,217,620,000	0.84
25	ルネサスエレクトロニクス	日本	株式	電気機器	1,249,600	1,877.04 2,345,549,457	4,807.00 6,006,827,200	0.81
26	武田薬品	日本	株式	医薬品	1,138,900	4,549.82 5,181,799,342	5,155.00 5,871,029,500	0.80
27	任 天 堂	日本	株式	その他製 品	798,500	12,471.35 9,958,376,937	6,815.00 5,441,777,500	0.74
28	住友電工	日本	株式	非鉄金属	1,818,400	1,173.58 2,134,054,646	2,927.00 5,322,456,800	0.72
29	NTT	日本	株式	情報・通信 業	35,136,600	157.39 5,530,454,289	145.00 5,094,807,000	0.69
30	ディスコ	日本	株式	機械	62,100	49,177.33 3,053,912,656	81,260.00 5,046,246,000	0.68

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	96.56%
合計	96.56%

(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	0.07%
鉱業	0.31%
建設業	2.09%
食料品	2.60%
繊維製品	0.29%
パルプ・紙	0.11%
化学	4.60%
医薬品	3.06%
石油・石炭製品	0.42%
ゴム製品	0.51%
ガラス・土石製品	0.87%
鉄鋼	0.60%
非鉄金属	2.76%
金属製品	0.48%
機械	5.98%
電気機器	22.32%
輸送用機器	4.69%
精密機器	1.78%
その他製品	1.74%
電気・ガス業	1.13%
陸運業	1.72%
海運業	0.46%
空運業	0.25%
倉庫・運輸関連業	0.12%
情報・通信業	5.93%
卸売業	6.70%
小売業	3.78%
銀行業	11.09%
証券、商品先物取引業	0.86%
保険業	3.19%
その他金融業	1.16%
不動産業	1.58%
サービス業	3.31%
合計	96.56%

(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 0809月	買建	633	25,309,441,150	25,338,990,000	3.44%

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

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

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2026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		1,044,144,137,678	94.87
	内 香港	4,907,456,170	0.45
	内 シンガポール	4,705,589,934	0.43
	内 イスラエル	3,309,045,611	0.30
	内 ノルウェー	1,697,834,797	0.15
	内 スウェーデン	9,980,830,306	0.91
	内 デンマーク	4,978,801,885	0.45
	内 イギリス	37,858,957,908	3.44
	内 アイルランド	1,051,222,696	0.10
	内 オランダ	16,391,324,612	1.49
	内 ベルギー	3,036,141,667	0.28
	内 フランス	25,728,911,187	2.34
	内 ドイツ	22,786,233,567	2.07
	内 スイス	24,298,086,376	2.21
	内 ポルトガル	538,663,101	0.05
	内 スペイン	10,457,463,122	0.95
	内 イタリア	8,991,419,375	0.82
	内 フィンランド	3,168,965,745	0.29
	内 オーストリア	936,984,786	0.09

	内 カナダ	34,624,804,603	3.15
	内 アメリカ	808,710,098,690	73.48
	内 オーストラリア	15,463,688,179	1.40
	内 ニュージーランド	521,613,361	0.05
投資証券		16,999,452,568	1.54
	内 香港	238,565,946	0.02
	内 シンガポール	265,029,291	0.02
	内 イギリス	256,117,912	0.02
	内 フランス	351,915,380	0.03
	内 アメリカ	14,528,461,086	1.32
	内 オーストラリア	1,359,362,953	0.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		39,497,353,906	3.59
純資産総額		1,100,640,944,152	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）	40,704,296,994	3.70
内 イギリス	2,151,967,716	0.20
内 ドイツ	9,319,031,859	0.85
内 カナダ	4,360,395,303	0.40
内 アメリカ	23,445,837,752	2.13
内 オーストラリア	1,427,064,364	0.13
為替予約取引（買建）	17,332,438,400	1.57
内 日本	17,332,438,400	1.57

(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（2026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	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	1,826,400	28,889.18 52,763,427,037	31,661.17 57,825,976,047	5.25

2	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	1,161,440	45,280.17 52,590,384,156	45,751.75 53,137,922,508	4.83
3	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	558,100	78,404.00 43,757,298,813	59,852.08 33,403,447,132	3.03
4	AMAZON COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	765,700	37,759.73 28,912,635,312	38,996.33 29,859,493,403	2.71
5	ALPHABET INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	460,620	52,152.19 24,022,351,726	57,429.22 26,453,048,929	2.40
6	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	355,860	64,682.04 23,017,798,741	60,482.15 21,523,179,856	1.96
7	ALPHABET INC CLASS C	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	365,740	52,014.81 19,023,940,270	57,044.35 20,863,403,934	1.90
8	MICRON TECHNOLOGY INC	アメリカ	株式	情報技術	89,220	47,041.94 4,197,088,484	185,982.01 16,593,315,753	1.51
9	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	173,720	104,565.84 18,165,186,257	91,360.61 15,871,165,864	1.44
10	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	222,630	69,408.08 15,452,345,994	66,878.69 14,889,204,447	1.35
11	ELI LILLY	アメリカ	株式	ヘルスケア	63,525	175,315.91 11,136,951,693	199,728.33 12,687,742,335	1.15
12	JPMORGAN CHASE	アメリカ	株式	金融	212,190	50,881.65 10,796,584,281	53,489.64 11,349,967,157	1.03
13	ADVANCED MICRO DEVICES INC	アメリカ	株式	情報技術	129,027	37,809.75 4,878,480,645	87,607.78 11,303,769,172	1.03
14	BERKSHIRE HATHAWAY INC CLASS B	アメリカ	株式	金融	110,010	83,116.07 9,143,610,927	80,545.44 8,860,803,854	0.81
15	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	29,305	175,188.55 5,133,905,680	298,784.20 8,755,870,981	0.80
16	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	190,600	34,220.93 6,522,525,074	41,979.43 8,001,281,054	0.73
17	INTEL CORPORATION	アメリカ	株式	情報技術	347,600	7,195.82 2,501,296,061	21,390.01 7,435,167,754	0.68

18	VISA INC CLASS A	アメリカ	株式	金融	132,990	54,241.34 7,213,566,982	55,480.54 7,378,357,480	0.67
19	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	328,809	19,147.40 6,295,857,195	22,094.78 7,264,963,635	0.66
20	APPLIED MATERIAL INC	アメリカ	株式	情報技術	62,820	44,347.08 2,785,891,811	112,802.58 7,086,258,679	0.64
21	LAM RESEARCH CORP	アメリカ	株式	情報技術	98,800	27,435.30 2,710,622,649	66,727.67 6,592,694,280	0.60
22	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需品	346,900	18,138.15 6,292,165,440	18,609.89 6,455,772,229	0.59
23	CATERPILLAR INC	アメリカ	株式	資本財・サービス	36,800	97,713.63 3,595,863,218	167,779.72 6,174,293,847	0.56
24	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	312,550	12,808.83 4,003,419,832	19,113.30 5,973,862,853	0.54
25	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	139,872	37,127.06 5,193,041,944	41,297.40 5,776,350,059	0.52
26	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	35,080	149,346.99 5,239,095,163	153,731.36 5,392,896,291	0.49
27	MASTERCARD INC CLASS A	アメリカ	株式	金融	64,820	88,896.34 5,762,267,760	82,760.43 5,364,531,695	0.49
28	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	537,001	8,732.52 4,689,426,424	9,399.13 5,047,343,928	0.46
29	GE AEROSPACE	アメリカ	株式	資本財・サービス	82,666	49,074.58 4,056,801,793	60,686.76 5,016,732,273	0.46
30	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	71,786	53,986.06 3,875,449,500	68,174.56 4,893,979,668	0.44

(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	94.87%
投資証券	1.54%
合計	96.41%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	3.62%
素材	3.07%

資本財・サービス	10.42%
一般消費財・サービス	8.35%
生活必需品	4.99%
ヘルスケア	9.12%
金融	15.15%
情報技術	29.35%
コミュニケーション・サービス	8.00%
公益事業	2.62%
不動産	0.18%
合計	94.87%

(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 26	買建	385	23,558,394,077	23,445,837,752	2.13%
	イギリス	FTSE 100 INDEX SEP 26	買建	95	2,147,511,074	2,151,967,716	0.20%
	オーストラリア	SPI 200 SEP 26	買建	58	1,435,404,701	1,427,064,364	0.13%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX SEP 26	買建	93	4,363,565,077	4,360,395,303	0.40%
	ドイツ	SWISS MKT IX SEP 26	買建	97	2,687,724,185	2,770,809,123	0.25%
		EURO STOXX 50 SEP 26	買建	564	6,595,271,795	6,548,222,736	0.59%
為替予約取引	日本	スイス・フラン買/円売 2026年7月	買建	8,400,000	1,698,451,590	1,688,293,320	0.15%
		カナダ・ドル買/円売 2026年7月	買建	20,800,000	2,387,978,850	2,373,737,600	0.22%
		米ドル買/円売 2026年7 月	買建	53,000,000	8,562,504,300	8,601,847,000	0.78%
		豪ドル買/円売 2026年7 月	買建	6,800,000	769,245,490	758,068,760	0.07%
		英ポンド買/円売 2026年 7月	買建	4,400,000	941,024,280	945,675,720	0.09%

	ユーロ買/円売 2026年7月	買建	16,000,000	2,956,247,610	2,964,816,000	0.27%
--	-----------------	----	------------	---------------	---------------	-------

(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) 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（2026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		217,865,333,200	97.58
	内 日本	217,865,333,200	97.58
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,401,854,849	2.42
純資産総額		223,267,188,049	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）		5,323,175,000	2.38
	内 日本	5,323,175,000	2.38

(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（2026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	123,806	144,203.35 17,853,240,652	125,900.00 15,587,175,400	6.98

2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	107,653	127,926.61 13,771,683,708	115,800.00 12,466,217,400	5.58
3	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	106,429	120,424.33 12,816,641,526	112,100.00 11,930,690,900	5.34
4	野村不動産マスターフ	日本	投資証券	65,313	162,820.68 10,634,307,153	151,800.00 9,914,513,400	4.44
5	GLP投資法人	日本	投資証券	67,440	137,512.66 9,273,854,087	137,400.00 9,266,256,000	4.15
6	KDX不動産投資法人	日本	投資証券	59,766	168,584.29 10,075,608,729	154,900.00 9,257,753,400	4.15
7	日本プロロジスリート	日本	投資証券	105,510	92,158.62 9,723,656,706	86,800.00 9,158,268,000	4.10
8	オリックス不動産投資	日本	投資証券	81,677	102,366.97 8,361,027,557	97,500.00 7,963,507,500	3.57
9	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	63,815	130,233.75 8,310,867,237	120,500.00 7,689,707,500	3.44
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	47,254	180,282.77 8,519,082,356	162,100.00 7,659,873,400	3.43
11	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	87,359	78,085.29 6,821,453,158	79,300.00 6,927,568,700	3.10
12	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	113,141	61,885.51 7,001,789,009	59,800.00 6,765,831,800	3.03
13	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	42,204	168,999.06 7,132,436,434	150,400.00 6,347,481,600	2.84
14	産業ファンド	日本	投資証券	37,412	149,063.03 5,576,746,100	141,900.00 5,308,762,800	2.38
15	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	56,833	103,620.08 5,889,040,028	93,300.00 5,302,518,900	2.37
16	三井不ロジパーク	日本	投資証券	45,258	119,270.19 5,397,930,366	107,800.00 4,878,812,400	2.19
17	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	60,500	91,527.24 5,537,398,171	76,600.00 4,634,300,000	2.08
18	API投資法人	日本	投資証券	31,645	146,092.65 4,623,102,110	137,100.00 4,338,529,500	1.94
19	三井不動産アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	35,386	136,301.73 4,823,173,222	121,900.00 4,313,553,400	1.93
20	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	40,634	103,186.07 4,192,862,838	94,900.00 3,856,166,600	1.73
21	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	25,699	156,817.83 4,030,061,662	146,000.00 3,752,054,000	1.68

22	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	31,052	111,390.14 3,458,886,687	103,300.00 3,207,671,600	1.44
23	イオンリート投資	日本	投資証券	24,889	134,831.61 3,355,824,148	123,000.00 3,061,347,000	1.37
24	森ヒルズリート	日本	投資証券	23,723	143,871.45 3,413,062,623	128,600.00 3,050,777,800	1.37
25	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	30,009	114,630.05 3,439,933,375	99,500.00 2,985,895,500	1.34
26	森トラストリート投資法人	日本	投資証券	39,507	76,527.19 3,023,359,870	74,300.00 2,935,370,100	1.31
27	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	36,022	89,263.30 3,215,442,950	80,400.00 2,896,168,800	1.30
28	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	18,111	170,019.59 3,079,224,820	155,300.00 2,812,638,300	1.26
29	NTT都市開発リート投資法人	日本	投資証券	20,639	146,632.81 3,026,354,656	136,200.00 2,811,031,800	1.26
30	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	8,299	352,371.68 2,924,332,649	327,000.00 2,713,773,000	1.22

(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	97.58%
合計	97.58%

(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 0809月	買建	2,978	5,176,687,180	5,323,175,000	2.38%

(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（2026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(%)
投資信託受益証券		754,372,920	0.97
	内 アメリカ	754,372,920	0.97
投資証券		74,980,400,587	96.76
	内 ガーンジー	166,226,474	0.21
	内 韓国	115,698,835	0.15
	内 香港	599,480,424	0.77
	内 シンガポール	2,417,628,982	3.12
	内 イスラエル	123,084,343	0.16
	内 イギリス	2,907,189,574	3.75
	内 アイルランド	28,129,050	0.04
	内 オランダ	101,959,258	0.13
	内 ベルギー	700,208,583	0.90
	内 フランス	1,425,547,810	1.84
	内 ドイツ	14,795,230	0.02
	内 スペイン	396,366,820	0.51
	内 イタリア	10,397,334	0.01
	内 カナダ	878,599,986	1.13
	内 アメリカ	59,883,331,832	77.28
	内 オーストラリア	5,131,452,209	6.62
	内 ニュージーランド	80,303,843	0.10
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,754,498,676	2.26
純資産総額		77,489,272,183	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引（買建）		1,824,345,040	2.35
	内 ドイツ	426,712,770	0.55
	内 アメリカ	1,397,632,270	1.80

為替予約取引(買建)		367,505,336	0.47
内 日本		367,505,336	0.47

(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（2026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	WELLTOWER INC (REIT)	アメリカ	投資証券	187,623	33,532.23 6,291,433,869	36,981.07 6,938,500,178	8.95
2	PROLOGIS REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	247,804	21,007.90 5,205,848,883	22,554.34 5,589,057,429	7.21
3	EQUINIX REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	26,213	125,715.68 3,295,385,759	176,220.75 4,619,274,685	5.96
4	SIMON PROPERTY GROUP REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	86,190	30,420.35 2,621,933,128	36,953.46 3,185,019,441	4.11
5	DIGITAL REALTY TRUST REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	87,795	26,332.83 2,311,892,755	30,948.28 2,717,104,787	3.51
6	REALTY INCOME REIT CORP (REIT)	アメリカ	投資証券	247,845	9,428.03 2,336,705,126	10,237.06 2,537,205,524	3.27
7	PUBLIC STORAGE REIT (REIT)	アメリカ	投資証券	41,992	44,824.83 1,882,289,443	52,687.43 2,212,450,792	2.86
8	GOODMAN GROUP UNITS	オーストラリア	投資証券	566,203	3,298.15 1,867,442,781	3,581.07 2,027,615,974	2.62
9	VENTAS REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	129,218	13,120.30 1,695,378,958	14,501.42 1,873,845,394	2.42
10	IRON MOUNTAIN INC (REIT)	アメリカ	投資証券	79,078	14,390.35 1,137,967,063	21,105.82 1,669,006,690	2.15
11	EXTRA SPACE STORAGE REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	56,151	21,737.36 1,220,575,208	24,075.94 1,351,888,186	1.74
12	VICI PPTYS INC (REIT)	アメリカ	投資証券	290,464	4,664.81 1,355,000,474	4,413.76 1,282,038,443	1.65
13	AVALONBAY COMMUNITIES REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	36,924	29,453.32 1,087,537,920	31,282.80 1,155,086,462	1.49
14	EQUITY RESIDENTIAL REIT (REIT)	アメリカ	投資証券	90,621	10,045.44 910,338,647	11,097.73 1,005,687,626	1.30

15	ESSEX PROPERTY TRUST REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	17,080	42,725.78 729,758,629	48,056.07 820,797,722	1.06
16	VANGUARD REAL ESTATE INDEX FUND;ET (ETF)	アメリカ	投資信託 受益証券	47,330	15,605.19 738,597,852	15,938.57 754,372,920	0.97
17	KIMCO REALTY REIT CORP (REIT)	アメリカ	投資証券	179,245	3,385.99 606,931,264	4,194.53 751,849,193	0.97
18	INVITATION HOMES INC (REIT)	アメリカ	投資証券	145,258	4,555.52 661,728,493	4,967.51 721,570,582	0.93
19	W. P. CAREY REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	59,201	11,003.38 651,414,528	11,935.66 706,603,304	0.91
20	MID AMERICA APARTMENT COMMUNITIES (REIT)	アメリカ	投資証券	30,934	21,999.46 680,534,551	22,840.15 706,537,308	0.91
21	HOST HOTELS & RESORTS REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	169,290	2,907.91 492,285,538	4,046.75 685,075,797	0.88
22	SEGRO REIT PLC (REIT)	イギリス	投資証券	361,871	1,545.13 559,169,483	1,888.56 683,418,388	0.88
23	HEALTHPEAK PROPERTIES INC (REIT)	アメリカ	投資証券	183,239	2,953.22 541,162,757	3,551.46 650,767,683	0.84
24	SCENTRE GROUP UNIT (REIT)	オーストラ リア	投資証券	1,446,241	452.59 654,576,704	437.31 632,463,172	0.82
25	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS REIT IN (REIT)	アメリカ	投資証券	79,152	7,446.71 589,434,026	7,812.58 618,381,562	0.80
26	SUN COMMUNITIES REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	30,788	20,915.02 643,931,761	19,686.53 606,109,184	0.78
27	LAMAR ADVERTISING COMPANY CLASS A (REIT)	アメリカ	投資証券	23,138	21,557.92 498,810,752	25,394.54 587,579,056	0.76
28	REGENCY CENTERS REIT CORP (REIT)	アメリカ	投資証券	43,798	11,620.62 508,967,306	13,202.30 578,234,642	0.75
29	UNIBAIL RODAMCO WE STAPLED UNITS	フランス	投資証券	30,247	16,311.54 493,377,249	19,063.24 576,606,047	0.74
30	GAMING AND LEISURE PROPERTIES REIT (REIT)	アメリカ	投資証券	75,277	7,119.17 535,922,266	7,455.32 561,214,492	0.72

(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
投資信託受益証券	0.97%
投資証券	96.76%
合計	97.74%

(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

(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 26	買建	218	1,398,456,529	1,397,632,270	1.80%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE SEP 26	買建	360	417,863,568	426,712,770	0.55%
為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2026年7月	買建	1,490,000	276,240,338	276,098,490	0.36%
		米ドル買/円売 2026年7月	買建	563,000	90,921,740	91,406,846	0.12%

(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（2026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		783,228,380	98.95
	内 日本	783,228,380	98.95
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		8,332,377	1.05
純資産総額		791,560,757	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（2026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	355 10年国債	日本	国債証券	85,000,000	95.72 81,366,350	95.89 81,511,600	0.100000 2029/06/20	10.30
2	108 20年国債	日本	国債証券	77,000,000	102.10 78,619,470	101.09 77,844,690	1.900000 2028/12/20	9.83
3	100 20年国債	日本	国債証券	73,000,000	102.41 74,763,570	101.49 74,091,350	2.200000 2028/03/20	9.36
4	169 5年国債	日本	国債証券	73,000,000	97.41 71,115,740	97.38 71,093,240	0.500000 2029/03/20	8.98
5	155 5年国債	日本	国債証券	72,000,000	98.52 70,940,160	98.58 70,980,480	0.300000 2027/12/20	8.97
6	163 5年国債	日本	国債証券	61,000,000	98.01 59,786,380	97.79 59,653,120	0.400000 2028/09/20	7.54
7	154 5年国債	日本	国債証券	60,000,000	98.41 59,050,820	98.67 59,205,000	0.100000 2027/09/20	7.48
8	161 5年国債	日本	国債証券	57,000,000	97.96 55,840,410	97.91 55,813,830	0.300000 2028/06/20	7.05
9	481 2年国債	日本	国債証券	27,000,000	100.10 27,027,060	99.98 26,995,680	1.300000 2028/02/01	3.41
10	479 2年国債	日本	国債証券	27,000,000	99.64 26,902,880	99.62 26,898,210	1.000000 2027/12/01	3.40
11	483 2年国債	日本	国債証券	21,000,000	100.03 21,008,260	100.11 21,023,310	1.400000 2028/04/01	2.66
12	101 20年国債	日本	国債証券	18,000,000	102.83 18,510,680	101.83 18,329,580	2.400000 2028/03/20	2.32
13	98 20年国債	日本	国債証券	18,000,000	101.83 18,329,990	101.09 18,197,280	2.100000 2027/09/20	2.30
14	156 5年国債	日本	国債証券	16,000,000	98.33 15,733,120	98.44 15,750,400	0.200000 2027/12/20	1.99
15	165 5年国債	日本	国債証券	15,000,000	97.13 14,570,500	97.22 14,583,150	0.300000 2028/12/20	1.84
16	106 20年国債	日本	国債証券	14,000,000	102.91 14,407,680	101.71 14,239,680	2.200000 2028/09/20	1.80
17	97 20年国債	日本	国債証券	14,000,000	101.39 14,195,950	101.21 14,170,240	2.200000 2027/09/20	1.79

18	104 20年国債	日本	国債証券	13,000,000	102.39 13,311,850	101.40 13,183,170	2.100000 2028/06/20	1.67
19	352 10年国債	日本	国債証券	13,000,000	97.15 12,629,650	97.15 12,630,280	0.100000 2028/09/20	1.60
20	484 2年国債	日本	国債証券	12,000,000	100.06 12,007,440	100.09 12,011,760	1.400000 2028/05/01	1.52
21	482 2年国債	日本	国債証券	9,000,000	99.90 8,991,720	99.96 8,997,030	1.300000 2028/03/01	1.14
22	480 2年国債	日本	国債証券	9,000,000	99.69 8,972,180	99.71 8,974,080	1.100000 2028/01/01	1.13
23	99 20年国債	日本	国債証券	6,000,000	102.08 6,125,340	101.19 6,071,880	2.100000 2027/12/20	0.77
24	350 10年国債	日本	国債証券	1,000,000	97.84 978,400	97.93 979,340	0.100000 2028/03/20	0.12

(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	98.95%
合計	98.95%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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（2026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	417,691,175,741	98.16

内 ユーロ	120,384,952,029	28.29
内 韓国	2,917,922,778	0.69
内 中国	53,154,292,615	12.49
内 シンガポール	1,372,168,735	0.32
内 マレーシア	2,088,543,353	0.49
内 イスラエル	1,711,290,041	0.40
内 ノルウェー	644,857,151	0.15
内 スウェーデン	636,044,950	0.15
内 デンマーク	812,580,647	0.19
内 イギリス	23,532,107,949	5.53
内 ポーランド	2,998,385,630	0.70
内 カナダ	8,621,191,671	2.03
内 アメリカ	188,633,629,062	44.33
内 メキシコ	3,783,884,176	0.89
内 オーストラリア	5,330,535,037	1.25
内 ニュージーランド	1,068,789,917	0.25
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,828,516,761	1.84
純資産総額	425,519,692,502	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）	3,336,164,895	0.78
内 日本	3,336,164,895	0.78
為替予約取引（売建）	104,532,240	0.02
内 日本	104,532,240	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（2026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	11,700,000	100.19 1,903,616,338	99.05 1,882,065,348	3.500000 2028/01/31	0.44
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	11,500,000	98.56 1,840,667,915	97.79 1,826,288,280	2.875000 2028/05/15	0.43

3	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,800,000	104.82 1,838,385,980	102.15 1,791,659,262	4.625000 2035/02/15	0.42
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,500,000	99.61 1,698,462,180	97.10 1,655,664,295	3.875000 2034/08/15	0.39
5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,200,000	102.07 1,690,698,152	99.53 1,648,708,969	4.125000 2032/11/15	0.39
6	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	104.38 1,695,156,732	101.48 1,647,998,676	4.500000 2033/11/15	0.39
7	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	98.31 1,644,420,457	98.15 1,641,773,942	4.125000 2036/02/15	0.39
8	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,200,000	100.81 1,669,860,916	98.19 1,626,414,121	4.000000 2034/02/15	0.38
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	102.26 1,660,713,813	99.54 1,616,559,972	4.250000 2034/11/15	0.38
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,800,000	98.97 1,575,156,124	97.29 1,548,389,949	4.000000 2035/11/15	0.36
11	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	102.08 1,574,870,399	99.37 1,533,032,239	4.250000 2035/05/15	0.36
12	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	63,000,000	100.11 1,504,100,428	100.09 1,503,900,269	1.290000 2028/03/15	0.35
13	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	87.58 1,465,028,504	86.73 1,450,727,628	1.250000 2031/08/15	0.34
14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,000,000	100.21 1,464,608,401	97.70 1,427,997,575	3.875000 2033/08/15	0.34
15	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	58,000,000	102.77 1,421,557,574	102.84 1,422,539,647	2.370000 2029/01/15	0.33
16	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,800,000	99.98 1,428,750,000	99.20 1,417,699,776	3.500000 2027/10/31	0.33
17	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	87.63 1,423,121,004	86.68 1,407,612,759	1.375000 2031/11/15	0.33
18	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,700,000	101.72 1,437,164,273	99.61 1,407,353,746	4.000000 2030/02/28	0.33
19	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,700,000	101.67 1,436,493,411	99.29 1,402,790,425	4.250000 2035/08/15	0.33
20	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,500,000	103.40 1,427,356,135	100.57 1,388,182,795	4.375000 2034/05/15	0.33
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	87.72 1,396,027,206	87.09 1,386,112,647	0.875000 2030/11/15	0.33
22	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,500,000	101.45 1,400,398,583	99.72 1,376,505,330	4.000000 2029/01/31	0.32

23	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,800,000	96.47 1,378,623,149	94.88 1,355,979,884	3.375000 2033/05/15	0.32
24	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,800,000	94.28 1,347,424,388	93.20 1,331,972,146	2.875000 2032/05/15	0.31
25	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	55,000,000	99.51 1,305,342,233	100.31 1,315,775,101	1.430000 2030/01/25	0.31
26	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	54,000,000	101.76 1,310,576,648	102.14 1,315,470,320	2.050000 2029/04/15	0.31
27	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	100.01 1,299,262,903	98.66 1,281,763,756	3.500000 2028/10/15	0.30
28	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	52,000,000	100.57 1,247,267,043	101.64 1,260,511,435	1.790000 2032/03/25	0.30
29	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	50,000,000	104.50 1,246,097,523	104.96 1,251,642,253	2.540000 2030/12/25	0.29
30	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	98.05 1,273,891,089	95.83 1,245,011,652	3.500000 2033/02/15	0.29

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.16%
合計	98.16%

(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	ユーロ買/円売 2026年 7月	買建	3,288,000	607,102,230	609,351,084	0.14%
		豪ドル買/円売 2026年 7月	買建	678,000	76,065,205	75,599,173	0.02%

韓国ウォン買/円売 2026年7月	買建	8,798,414,000	921,281,929	921,581,076	0.22%
米ドル買/円売 2026年 7月	買建	4,176,000	673,420,085	677,996,587	0.16%
カナダ・ドル買/円売 2026年7月	買建	657,000	75,024,095	74,984,142	0.02%
イスラエル・シェケル 買/円売 2026年7月	買建	740,000	41,834,494	40,183,406	0.01%
スウェーデン・クロー ネ買/円売 2026年7月	買建	5,290,000	91,102,264	88,385,320	0.02%
オフショア人民元買/ 円売 2026年7月	買建	18,919,000	447,236,975	451,158,846	0.11%
ニュージーランド・ド ル買/円売 2026年7月	買建	40,000	3,805,656	3,664,480	0.00%
英ポンド買/円売 2026 年7月	買建	1,628,000	348,232,845	349,956,381	0.08%
シンガポール・ドル 買/円売 2026年7月	買建	345,000	43,042,511	43,304,400	0.01%
マレーシア・リングッ ト売/円買 2026年7月	売建	2,612,000	104,192,680	104,532,240	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2030

2026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	23,008円
純資産総額	7.1億円



基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.8%
3カ月間	4.8%
6カ月間	4.7%
1年間	13.1%
3年間	26.4%
5年間	38.4%
設定来	130.1%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、

「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。

※基準価額の計算において運用管理費用(信託報酬)は控除しています。

分配の推移 (10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第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	第16期	第17期	第18期
	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	23年12月	24年12月	25年12月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	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
国内債券	24	47.2%	日本円	65.8%	直接利回り(%)	1.6	NVIDIA CORP	アメリカ	0.5%
外国債券	1,127	19.6%	米ドル	20.1%	最終利回り(%)	2.0	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.4%
国内株式・先物	1,634	12.9%	ユーロ	6.8%	修正デュレーション	3.2	TOPIX 先物 0809月	日本	0.4%
外国株式・先物	1,080	8.9%	オフショア人民元	2.5%	残存年数	3.8	APPLE INC	アメリカ	0.4%
外国リート・先物	286	5.2%	英ポンド	1.7%	債券格付別構成	比率	東京エレクトロン	日本	0.4%
国内リート・先物	59	5.1%	カナダ・ドル	0.8%	AAA	91.5%	WELLTOWER INC (REIT)	アメリカ	0.5%
外国投資信託等	5	0.1%	豪ドル	0.8%	AA	5.7%	PROLOGIS REIT INC (REIT)	アメリカ	0.4%
			シンガポール・ドル	0.3%	A	2.7%	日本ビルファンド	日本	0.4%
			スイス・フラン	0.2%	BBB	-	EQUINIX REIT INC (REIT)	アメリカ	0.3%
コール・ローン、その他		2.1%	その他	1.1%	BB	-	ジャパンリアルエステイト	日本	0.3%
合計	4,215	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計		4.0%

※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。

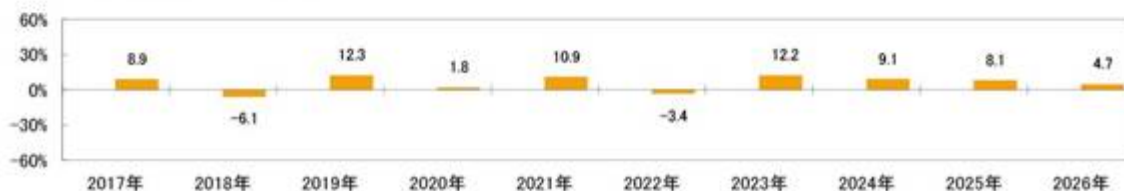
※格付別構成については、当社所定の基準で採用した格付けを基準に算出しています。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額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。

・2026年は6月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

〈参考情報〉ファンドの総経費率

	総経費率(①+②)	運用管理費用の比率 ①	その他費用の比率 ②
DCダイワ・ ターゲットイヤー2030	0.39%	0.37%	0.01%

※対象期間は2024年12月19日～2025年12月18日です。

※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。)

を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当り)を乗じた数で除した値(年率)です。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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】

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

<一部解約>

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

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

委託会社は、一部解約金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。委託会社は、委託会社の指定する預金口座等の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資産運用業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24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ます。
2. 委託会社は、前1. の事項（前1. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1. の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前2. から前5. までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1. から前6. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1. から前7. までの規定にしたがいます。

反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

運用報告書

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

公告

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

関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

< 収益分配金にかかる請求権 >

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

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

< 償還金にかかる請求権 >

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

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

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

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18期計算期間(2024年12月19日から2025年12月18日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

D C ダイワ・ターゲットイヤー2030

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第17期 2024年12月18日現在	第18期 2025年12月18日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,320,894	2,748,429
親投資信託受益証券	613,120,316	670,504,066
未収入金	-	630,000
流動資産合計	615,441,210	673,882,495
資産合計	615,441,210	673,882,495
負債の部		
流動負債		
未払解約金	155	852,761
未払受託者報酬	97,284	104,744
未払委託者報酬	1,005,665	1,082,917
その他未払費用	24,235	26,113
流動負債合計	1,127,339	2,066,535
負債合計	1,127,339	2,066,535
純資産の部		
元本等		
元本	1 305,301,992	1 308,386,837
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	309,011,879	363,429,123
（分配準備積立金）	98,840,713	126,874,030
元本等合計	614,313,871	671,815,960
純資産合計	614,313,871	671,815,960
負債純資産合計	615,441,210	673,882,495

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第17期 自 2023年12月19日 至 2024年12月18日	第18期 自 2024年12月19日 至 2025年12月18日
営業収益		
受取利息	2,158	9,088
有価証券売買等損益	51,413,717	51,409,750
営業収益合計	51,415,875	51,418,838
営業費用		
支払利息	16	-
受託者報酬	191,440	203,258
委託者報酬	1,979,046	2,101,260
その他費用	47,701	50,665
営業費用合計	2,218,203	2,355,183
営業利益又は営業損失（ ）	49,197,672	49,063,655
経常利益又は経常損失（ ）	49,197,672	49,063,655
当期純利益又は当期純損失（ ）	49,197,672	49,063,655
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（ ）	7,015,224	421,851
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	253,277,869	309,011,879
剰余金増加額又は欠損金減少額	76,280,946	76,452,416
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	76,280,946	76,452,416
剰余金減少額又は欠損金増加額	62,729,384	70,676,976
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	62,729,384	70,676,976
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	309,011,879	363,429,123

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	第17期	第18期
	2024年12月18日現在	2025年12月18日現在
1. 1 期首元本額	299,806,057円	305,301,992円
期中追加設定元本額	78,911,508円	72,908,303円
期中一部解約元本額	73,415,573円	69,823,458円
2. 計算期間末日における受益権の 総数	305,301,992口	308,386,837口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第17期	第18期
	自2023年12月19日 至2024年12月18日	自2024年12月19日 至2025年12月18日
1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う 当期純利益金額分配後の配当等 収益から費用を控除した額 (2,075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 (42,180,113円)、投資信託約 款に規定される収益調整金 (238,204,249円)及び分配準備 積立金(56,658,525円)より分 配対象額は337,044,962円(1万 口当たり11,039.72円)であり、 分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う 当期純利益金額分配後の配当等 収益から費用を控除した額 (8,617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 (48,633,187円)、投資信託約 款に規定される収益調整金 (262,218,401円)及び分配準備 積立金(78,232,226円)より分 配対象額は389,092,431円(1万 口当たり12,617.02円)であり、 分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第17期 2024年12月18日現在	第18期 2025年12月18日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	41,321,176	50,323,010
合計	41,321,176	50,323,010

（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17期 2024年12月18日現在	第18期 2025年12月18日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

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

（1口当たり情報）

	第17期 2024年12月18日現在	第18期 2025年12月18日現在
1口当たり純資産額	2.0122円	2.1785円
（1万口当たり純資産額）	（20,122円）	（21,785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	37,305,727	94,279,033	

外国株式インデックスマザーファンド	7,992,598	66,715,014	
外国債券インデックスマザーファンド	34,970,586	140,966,432	
ダイワJ - R E I Tマザーファンド	8,549,687	33,773,828	
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	7,817,949	33,341,988	
ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	290,700,908	301,427,771	
親投資信託受益証券 合計		670,504,066	
合計		670,504,066	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

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

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年12月18日現在	2025年12月18日現在
1. 1 期首	2023年12月19日	2024年12月19日
期首元本額	167,363,042,675円	202,918,715,077円
期中追加設定元本額	54,208,209,542円	53,198,902,810円
期中一部解約元本額	18,652,537,140円	30,571,051,002円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
トピックス・インデックスファンド	2,749,376,688円	2,731,605,500円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A	3,722,637,732円	3,383,151,818円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドV A 2	904,647円	898,339円
ダイワ国内重視バランスファンド30 V A (一般投資家私募)	8,959,470円	6,314,008円
ダイワ国内重視バランスファンド50 V A (一般投資家私募)	127,893,647円	81,223,299円
ダイワ国際分散バランスファンド30 V A (一般投資家私募)	11,283,120円	8,264,060円

ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	302,620,796円	205,657,242円
国内株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,171,311,234円	1,419,979,170円
日本株式インデックスファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	862,207,445円	922,419,969円
アセット・アロケーションファンド（リスク判断付き）2023-07（適格機関投資家専用）	963,731,047円	156,533,865円
D - I ' s T O P I X インデックス	11,679,154円	9,973,569円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2050	246,515,707円	232,867,249円
i F r e e T O P I X インデックス	9,959,603,282円	11,717,086,512円
i F r e e 8資産バランス	5,200,333,681円	5,526,666,419円
i F r e e 年金バランス	1,228,550,661円	1,245,644,827円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2060	4,364,951円	6,079,864円
D Cダイワ日本株式インデックス	72,963,753,872円	70,964,159,641円
ダイワ・ライフ・バランス30	2,973,734,629円	2,625,742,895円
ダイワ・ライフ・バランス50	5,197,844,995円	5,127,917,409円
ダイワ・ライフ・バランス70	6,247,921,235円	6,163,501,893円
年金ダイワ日本株式インデックス	10,598,144,797円	10,504,216,260円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2030	48,865,163円	37,305,727円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2040	76,595,831円	75,475,909円
ダイワつみたてインデックス日本株式	6,604,969,865円	8,110,537,056円
ダイワつみたてインデックスバランス30	12,474,384円	11,518,163円
ダイワつみたてインデックスバランス50	14,025,228円	15,557,473円
ダイワつみたてインデックスバランス70	83,687,341円	295,812,368円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	24,141,805,204円	33,566,457,270円

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

	ダイワライフスタイル 2 5	92,382,825円	72,022,380円
	ダイワライフスタイル 5 0	431,876,444円	363,352,487円
	ダイワライフスタイル 7 5	379,440,247円	335,370,055円
	D C ・ダイワ ・トピックス ・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）	7,641,606,691円	7,031,856,337円
計		202,918,715,077円	225,546,566,885円
2.	期末日における受益権の総数	202,918,715,077口	225,546,566,885口
3.	2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 12,125,038,290円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 9,783,411,200円
4.	3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 1,018,970,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 1,114,135,000円
5.	4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

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

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

金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

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

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種類	2024年12月18日現在				2025年12月18日現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(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	5,510,405,000	-	5,476,245,000	34,160,000	9,020,510,000	-	8,949,570,000	70,940,000
合計	5,510,405,000	-	5,476,245,000	34,160,000	9,020,510,000	-	8,949,570,000	70,940,000

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

（1口当たり情報）

	2024年12月18日現在	2025年12月18日現在
1口当たり純資産額	1.9977円	2.5272円
（1万口当たり純資産額）	(19,977円)	(25,272円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極 洋	6,900	4,740.00	32,706,000	貸付株式数 2,700株
ニッスイ	151,400	1,200.00	181,680,000	
マルハニチロ	26,700	3,825.00	102,127,500	
ユキグニファクトリー	14,100	1,042.00	14,692,200	貸付株式数 5,400株
カネコ種苗	4,700	1,551.00	7,289,700	
サカタのタネ	20,000	4,190.00	83,800,000	貸付株式数 100株
ホクト	14,700	2,063.00	30,326,100	

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

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

昭和産業	9,800	2,873.00	28,155,400	貸付株式数	3,800株
中部飼料	14,700	1,763.00	25,916,100		
フィード・ワン	15,300	1,050.00	16,065,000		
日本甜菜糖	6,100	3,635.00	22,173,500	貸付株式数	2,200株
DM三井製糖	9,700	3,265.00	31,670,500	貸付株式数	2,500株
ウェルネオシュガー	6,500	2,832.00	18,408,000		
L I F U L L	35,500	173.00	6,141,500	貸付株式数	13,900株
M I X I	22,000	2,716.00	59,752,000		
ジェイエシーリクルートメント	43,800	1,095.00	47,961,000		
日本M&Aセンターホールデ	192,900	716.60	138,232,140	貸付株式数	75,800株
フィットイージー	2,700	2,528.00	6,825,600	貸付株式数	1,000株
メンバーズ	4,100	1,241.00	5,088,100		
U T グループ	15,800	2,868.00	45,314,400		
アイティメディア	6,500	1,495.00	9,717,500	貸付株式数	2,500株
E・Jホールディングス	8,000	1,701.00	13,608,000		
オープンアップグループ	40,400	1,870.00	75,548,000		
コシダカホールディングス	33,200	1,202.00	39,906,400	貸付株式数	13,000株
パソナグループ	14,200	1,876.00	26,639,200	貸付株式数	5,500株
リンクアンドモチベーション	28,800	507.00	14,601,600	貸付株式数	11,300株
エス・エム・エス	46,300	1,344.00	62,227,200		
パーソルホールディングス	1,103,900	290.00	320,131,000		
クックパッド	23,700	147.00	3,483,900	貸付株式数	12,100株
森永製菓	45,500	2,636.00	119,938,000		
中 村 屋	2,900	3,065.00	8,888,500		
江崎グリコ	33,200	5,418.00	179,877,600		
m e i t o	5,100	2,355.00	12,010,500	貸付株式数	1,900株
井村屋グループ	6,300	2,516.00	15,850,800		
不 二 家	7,900	2,639.00	20,848,100	貸付株式数	3,100株
山崎製パン	77,600	3,385.00	262,676,000		
モロゾフ	11,200	1,515.00	16,968,000	貸付株式数	4,100株
亀田製菓	7,400	3,925.00	29,045,000	貸付株式数	2,800株
寿スピリッツ	61,700	1,824.00	112,540,800	貸付株式数	26,300株
カルビー	53,100	2,964.00	157,388,400		
森永乳業	43,100	3,746.00	161,452,600	貸付株式数	1,000株
六甲バター	9,500	1,245.00	11,827,500	貸付株式数	3,600株
ヤクルト	160,900	2,438.50	392,354,650	貸付株式数	63,200株
明治ホールディングス	161,600	3,410.00	551,056,000		
雪印メグミルク	31,200	3,275.00	102,180,000	貸付株式数	1,300株

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

栗田工業	71,700	6,218.00	445,830,600	貸付株式数	800株
椿本チエイン	51,500	2,217.00	114,175,500		
日 機 装	27,400	1,582.00	43,346,800		
木村化工機	9,100	1,205.00	10,965,500		
レイズネクスト	16,700	2,344.00	39,144,800		
アネスト岩田	22,100	1,592.00	35,183,200		
ダイフク	200,800	4,805.00	964,844,000		
サムコ	3,200	3,830.00	12,256,000	貸付株式数	1,200株
タダノ	62,700	1,067.00	66,900,900		
フジテック	34,100	5,670.00	193,347,000		
C K D	35,900	2,754.00	98,868,600		
平和	35,200	1,958.00	68,921,600	貸付株式数	4,700株
理想科学工業	19,000	1,235.00	23,465,000	貸付株式数	7,400株
S A N K Y O	126,000	2,513.00	316,638,000		
日本金銭機械	14,400	1,001.00	14,414,400	貸付株式数	5,600株
マースグループHLDGS	10,000	3,110.00	31,100,000	貸付株式数	3,700株
ガリレイ	17,500	3,740.00	65,450,000		
ダイコク電機	5,900	2,885.00	17,021,500	貸付株式数	2,300株
竹内製作所	21,600	6,670.00	144,072,000		
ア マ ノ	31,300	4,213.00	131,866,900		
J U K I	18,400	486.00	8,942,400		
ジャノメ	8,800	1,145.00	10,076,000		
ブラザー工業	147,600	3,118.00	460,216,800		
マックス	16,400	6,560.00	107,584,000		
モリタホールディングス	18,600	2,714.00	50,480,400		
グローリー	31,200	3,956.00	123,427,200		
新晃工業	34,100	1,407.00	47,978,700		
大和冷機工業	18,200	1,598.00	29,083,600	貸付株式数	5,000株
セガサミーホールディングス	97,400	2,497.00	243,207,800		
T P R	27,200	1,286.00	34,979,200		
ツバキ・ナカシマ	27,500	349.00	9,597,500		
ホシザキ	76,600	5,262.00	403,069,200		
大豊工業	9,000	801.00	7,209,000		
日本精工	220,200	938.10	206,569,620		
N T N	281,400	354.90	99,868,860		
ジェイテクト	112,300	1,715.50	192,650,650		
不 二 越	8,800	4,175.00	36,740,000		
ミネベアミツミ	206,900	3,101.00	641,596,900		
日本トムソン	32,400	774.00	25,077,600	貸付株式数	5,500株

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

神戸電鉄	3,200	2,453.00	7,849,600	貸付株式数	1,200株
名古屋鉄道	130,000	1,629.50	211,835,000	貸付株式数	51,000株
山陽電鉄	8,900	2,084.00	18,547,600	貸付株式数	3,100株
ヤマトホールディングス	142,900	2,170.50	310,164,450		
山 九	26,900	8,498.00	228,596,200	貸付株式数	10,300株
丸全昭和運輸	7,300	7,950.00	58,035,000	貸付株式数	2,000株
センコーグループHLDGS	85,100	1,922.00	163,562,200		
ニッコンホールディングス	50,100	3,465.00	173,596,500	貸付株式数	25,600株
福山通運	12,600	4,275.00	53,865,000		
セイノーホールディングス	57,900	2,362.50	136,788,750	貸付株式数	10,700株
神奈川中央交通	3,300	3,740.00	12,342,000	貸付株式数	1,300株
AZ-COM丸和ホールディ	36,500	1,005.00	36,682,500	貸付株式数	9,800株
日本郵船	248,600	4,926.00	1,224,603,600		
商船三井	223,800	4,523.00	1,012,247,400	貸付株式数	70,800株
川崎汽船	253,400	2,144.50	543,416,300		
NSユニテッド海運	7,400	6,020.00	44,548,000	貸付株式数	1,200株
飯野海運	43,200	1,381.00	59,659,200		
九州旅客鉄道	88,600	4,101.00	363,348,600		
SGホールディングス	197,500	1,487.00	293,682,500		
NIPPON EXPRESS	126,500	3,330.00	421,245,000		
日本航空	269,600	2,961.50	798,420,400		
ANAホールディングス	320,000	3,022.00	967,040,000		
ビーウィズ	3,100	1,567.00	4,857,700	貸付株式数	1,200株
サンウェルズ	9,300	341.00	3,171,300	貸付株式数	3,600株
TREホールディングス	27,800	1,600.00	44,480,000	貸付株式数	9,800株
人・夢・技術グループ	5,000	1,601.00	8,005,000		
シルバーライフ	3,300	791.00	2,610,300	貸付株式数	1,200株
GENKY DRUGSTORES	10,900	5,120.00	55,808,000		
コア商事HLDGS	11,100	814.00	9,035,400	貸付株式数	4,100株
KPPグループホールディン	32,600	776.00	25,297,600	貸付株式数	12,800株
ブックオフGHD	9,100	1,405.00	12,785,500	貸付株式数	3,500株
ギフトホールディングス	7,100	3,265.00	23,181,500	貸付株式数	2,700株
三菱倉庫	133,500	1,182.00	157,797,000		
三井倉庫HOLD	36,300	3,825.00	138,847,500		
住友倉庫	34,200	3,510.00	120,042,000		
渋沢倉庫	18,800	1,249.00	23,481,200	貸付株式数	7,600株
ヤマタネ	10,000	2,338.00	23,380,000	貸付株式数	3,900株
乾汽船	14,900	1,346.00	20,055,400	貸付株式数	5,700株
日本トランスシティ	29,600	1,141.00	33,773,600	貸付株式数	5,500株

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

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

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

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

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

リクルートホールディングス	35,000株
日 立	80,000株
トヨタ自動車	60,000株
三菱商事	60,000株

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年12月18日現在 金 額（円）	2025年12月18日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,666,500,509	2,793,512,730
コール・ローン	16,316,826,115	22,551,019,792
株式	656,595,315,530	836,211,564,442
投資証券	12,506,235,965	13,666,321,110
派生商品評価勘定	336,584,772	96,273,805
未収入金	4,596,994	5,734,980
未収配当金	523,072,149	636,323,607
差入委託証拠金	9,094,372,389	14,076,445,624
流動資産合計	697,043,504,423	890,037,196,090
資産合計	697,043,504,423	890,037,196,090
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	91,801,958	471,286,031
未払解約金	345,686,100	975,579,000
流動負債合計	437,488,058	1,446,865,031
負債合計	437,488,058	1,446,865,031
純資産の部		
元本等		
元本	1 97,471,314,337	106,454,857,152
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	599,134,702,028	782,135,473,907
元本等合計	696,606,016,365	888,590,331,059
純資産合計	696,606,016,365	888,590,331,059
負債純資産合計	697,043,504,423	890,037,196,090

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2024年12月19日 至2025年12月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(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 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 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引

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

(貸借対照表に関する注記)

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

ダイワ国際分散バランスファンド50VA（一般投資家私募）	85,662,411円	62,418,221円
外国株式インデックスファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	114,845,246円	129,546,343円
ダイワバランスファンド2023-01（適格機関投資家専用）	77,052,001円	-円
外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	8,670,747,397円	10,013,254,143円
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	763,141,440円	813,719,731円
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	6,049,980,216円	7,917,157,677円
ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	570,811,387円	606,592,478円
D - I ' s 外国株式インデックス	15,964,093円	15,387,205円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	45,602,828円	44,912,318円
i F r e e 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	9,804,220,171円	11,890,719,277円
i F r e e 8資産バランス	1,523,216,776円	1,651,161,722円
i F r e e 年金バランス	347,680,301円	374,685,403円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	18,710,984円	31,611,079円
DCダイワ外国株式インデックス	51,367,234,653円	50,786,746,140円
ダイワ・ライフ・バランス30	433,707,038円	396,086,901円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,018,865,470円	1,028,521,487円
ダイワ・ライフ・バランス70	997,600,353円	1,026,479,439円
大和DC海外株式インデックスファンド	1,098,357,050円	986,445,757円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	9,588,199円	7,992,598円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	11,192,828円	12,502,210円
ダイワつみたてインデックス外国株式	2,863,091,211円	3,443,295,255円

ダイワつみたてインデックスバ ランス 3 0	1,774,665円	1,743,294円
ダイワつみたてインデックスバ ランス 5 0	2,615,264円	3,116,189円
ダイワつみたてインデックスバ ランス 7 0	13,195,933円	49,244,389円
ダイワ先進国株式インデックス （為替ヘッジなし）（投資一任 専用）	16,128,054円	1,214,413,934円
ダイワ世界バランスファンド 4 0 V A	40,010,033円	33,216,199円
ダイワ世界バランスファンド 6 0 V A	28,225,334円	23,760,596円
ダイワ・バランスファンド 3 5 V A	629,488,881円	491,938,959円
ダイワ・バランスファンド 2 5 V A（適格機関投資家専用）	33,701,276円	26,206,283円
ダイワバランスファンド2021-02 （適格機関投資家専用）	122,278,441円	100,431,384円
スタイル9（4資産分散・保守 型）	330,995円	637,673円
スタイル9（4資産分散・ balan ス型）	2,357,489円	4,529,983円
スタイル9（4資産分散・積極 型）	3,464,255円	7,373,476円
スタイル9（6資産分散・保守 型）	136,863円	252,497円
スタイル9（6資産分散・ balan ス型）	4,334,111円	8,230,509円
スタイル9（6資産分散・積極 型）	5,039,343円	10,075,144円
スタイル9（8資産分散・保守 型）	192,325円	347,811円
スタイル9（8資産分散・ balan ス型）	3,078,619円	6,629,482円
スタイル9（8資産分散・積極 型）	9,781,176円	19,239,582円
全世界株式インデックス・ファ ンド（オール・カントリー）	-円	1,542,801,634円
i F r e e 全世界株式インデッ クス（オール・カントリー）	-円	19,608,763円

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

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

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

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

金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

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

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

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

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2. 通貨関連

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

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

（注） 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2024年12月18日現在	2025年12月18日現在
1口当たり純資産額	7.1468円	8.3471円
（1万口当たり純資産額）	(71,468円)	(83,471円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	8,400	228.770	1,921,668.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	48,500	183.440	8,896,840.000	
	FIRST SOLAR INC	7,300	254.030	1,854,419.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	12,300	198.530	2,441,919.000	

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	----	------	-----	----

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

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

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

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 526銘柄 投資証券 32銘柄	98.2%	1.8%	77.1%
イギリス・ポンド	株式 71銘柄 投資証券 2銘柄	99.4%	0.6%	3.8%
イスラエル・シェケル	株式 10銘柄	100%	-%	0.2%
オーストラリア・ドル	株式 40銘柄 投資証券 6銘柄	91.6%	8.4%	1.6%
カナダ・ドル	株式 83銘柄	100%	-%	3.3%
シンガポール・ドル	株式 12銘柄 投資証券 2銘柄	93.2%	6.8%	0.4%
スイス・フラン	株式 40銘柄	100%	-%	2.4%
スウェーデン・クローナ	株式 40銘柄	100%	-%	0.9%
デンマーク・クローネ	株式 15銘柄	100%	-%	0.5%
ニュージーランド・ドル	株式 5銘柄	100%	-%	0.0%
ノルウェー・クローネ	株式 11銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式 216銘柄 投資証券 4銘柄	99.6%	0.4%	9.1%
香港・ドル	株式 22銘柄 投資証券 2銘柄	95.5%	4.5%	0.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

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

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

(貸借対照表に関する注記)

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

ファンド名		
ダイワ外国債券インデックスV A	324,211,441円	247,762,561円
ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	4,781,204円	3,871,011円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	30,065,328円	21,389,429円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	14,033,041円	12,269,783円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	165,405,939円	128,585,190円
外国債券インデックスファンド (F0Fs用)(適格機関投資家専 用)	862,368,326円	1,068,874,178円
外国債券インデックスファンド VA(適格機関投資家専用)	626,597,140円	697,540,586円
ダイワファンドラップ 外国債券 インデックス エマージングプラ ス(為替ヘッジなし)	981,378,486円	1,055,877,362円
ダイワファンドラップ 外国債券 インデックス(為替ヘッジな し)	6,255,603,498円	8,990,949,850円
ダイワファンドラップオンライ ン 外国債券インデックス エ マージングプラス(為替ヘッジ なし)	1,141,672,928円	1,108,770,873円
D-I's 外国債券インデック ス	1,854,652円	1,207,634円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	21,957,522円	28,034,880円
iFree 外国債券インデック ス	1,366,095,940円	1,250,435,277円
iFree 8資産バランス	2,814,766,620円	3,417,582,606円
iFree 年金バランス	671,427,825円	790,545,183円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2060	2,389,602円	4,416,493円
DCダイワ外国債券インデック ス	51,472,893,222円	50,684,294,827円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,196,484,774円	1,225,140,614円
ダイワ・ライフ・バランス50	934,115,462円	1,010,850,139円
ダイワ・ライフ・バランス70	750,649,313円	849,032,107円

D Cダイワ・ワールドアセット （六つの羽 / 安定コース）	742,484,165円	803,421,268円
D Cダイワ・ワールドアセット （六つの羽 / 6 分散コース）	609,463,845円	665,045,291円
D Cダイワ・ワールドアセット （六つの羽 / 成長コース）	292,026,114円	324,214,241円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2030	36,746,467円	34,970,586円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2040	22,755,567円	31,253,447円
ダイワつみたてインデックス外 国債券	2,478,042,791円	2,946,240,617円
ダイワつみたてインデックスバ ランス3 0	5,041,201円	5,339,628円
ダイワつみたてインデックスバ ランス5 0	2,514,030円	3,213,774円
ダイワつみたてインデックスバ ランス7 0	10,205,784円	41,493,736円
ダイワ先進国債券インデックス （為替ヘッジなし）（ラップ専 用）	2,584,397,859円	3,410,440,718円
ダイワ世界バランスファンド4 0 V A	89,069,708円	80,675,074円
ダイワ世界バランスファンド6 0 V A	26,929,432円	24,732,473円
ダイワ・バランスファンド3 5 V A	2,415,693,402円	2,044,376,496円
ダイワ・バランスファンド2 5 V A（適格機関投資家専用）	150,818,032円	128,123,750円
スタイル9（4資産分散・保守 型）	237,164円	402,700円
スタイル9（4資産分散・ balan ス型）	2,681,759円	5,038,174円
スタイル9（4資産分散・積極 型）	2,477,850円	5,755,951円
スタイル9（6資産分散・保守 型）	52,155円	159,844円
スタイル9（6資産分散・ balan ス型）	1,827,207円	4,730,681円
スタイル9（6資産分散・積極 型）	641,559円	2,337,929円

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

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

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

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

金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

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

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

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

（注） 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2024年12月18日現在	2025年12月18日現在
1口当たり純資産額	3.6992円	4.0310円
(1万口当たり純資産額)	(36,992円)	(40,310円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	743,670.100	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	772,966.440	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	788,770.080	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,575,346.100	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	2,576,000.000	2,665,850.880	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	907,840.010	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	553,945.800	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	529,296.960	

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

（注）1. 各種通貨毎の小計の欄における（ ）内の金額は、邦貨換算額であります。

2. 合計欄における[]内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 288銘柄	100%	46.1%
イギリス・ポンド	国債証券 66銘柄	100%	5.9%
イスラエル・シェケル	国債証券 13銘柄	100%	0.4%
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	100%	1.2%
オフショア・人民元	国債証券 84銘柄	100%	11.6%
カナダ・ドル	国債証券 43銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券 22銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	100%	0.2%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.2%
ニュージーランド・ドル	国債証券 14銘柄	100%	0.2%
ノルウェー・クローネ	国債証券 11銘柄	100%	0.1%
ポーランド・ズロチ	国債証券 17銘柄	100%	0.7%
マレーシア・リンギット	国債証券 30銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 18銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券 410銘柄	100%	29.7%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ」-REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年12月18日現在 金 額（円）	2025年12月18日現在 金 額（円）
--	-------------------------	-------------------------

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

(貸借対照表に関する注記)

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

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

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年12月19日 至2025年12月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における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	2025年12月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

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

（注） 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

（1口当たり情報）

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

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

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

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

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

野村不動産マスターF

5,000口

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

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

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

(貸借対照表に関する注記)

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

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

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

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

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

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

金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

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

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 不動産投信関連

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

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

（注） 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

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

（注） 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2024年12月18日現在	2025年12月18日現在
1口当たり純資産額	4.1013円	4.2648円
(1万口当たり純資産額)	(41,013円)	(42,648円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年12月18日現在 金 額（円）	2025年12月18日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

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

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

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

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

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

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

(1口当たり情報)

	2024年12月18日現在	2025年12月18日現在
1口当たり純資産額	1.0366円	1.0369円
（1万口当たり純資産額）	(10,366円)	(10,369円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
国債証券	468 2年国債	3,000,000	2,992,290	
	469 2年国債	4,000,000	3,992,880	
	470 2年国債	32,000,000	31,975,040	
	473 2年国債	19,000,000	18,957,820	
	152 5年国債	61,000,000	60,408,300	
	153 5年国債	61,000,000	60,141,730	
	154 5年国債	60,000,000	59,049,000	
	155 5年国債	72,000,000	70,940,160	
	156 5年国債	16,000,000	15,733,120	
	161 5年国債	49,000,000	48,039,600	
	163 5年国債	58,000,000	56,869,000	
	350 10年国債	5,000,000	4,892,350	
	352 10年国債	5,000,000	4,862,450	
	97 20年国債	14,000,000	14,287,000	
	98 20年国債	17,000,000	17,319,090	
	99 20年国債	6,000,000	6,125,340	
	100 20年国債	60,000,000	61,502,400	
	101 20年国債	16,000,000	16,470,880	
	104 20年国債	13,000,000	13,321,230	
	106 20年国債	14,000,000	14,407,680	
	108 20年国債	69,000,000	70,501,440	
国債証券 合計			652,788,800	
合計			652,788,800	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第284条及び第307条の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2025年12月19日から2026年6月18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】

D C ダイワ・ターゲットイヤー2030

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	当中間計算期間末 2026年6月18日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,648,801
親投資信託受益証券	704,974,585
流動資産合計	707,623,386
資産合計	707,623,386
負債の部	
流動負債	
未払解約金	209,700
未払受託者報酬	108,752
未払委託者報酬	906,638
その他未払費用	27,109
流動負債合計	1,252,199
負債合計	1,252,199
純資産の部	
元本等	
元本	308,425,172
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	397,946,015
（分配準備積立金）	106,773,289
元本等合計	706,371,187
純資産合計	706,371,187
負債純資産合計	707,623,386

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2025年12月19日 至 2026年6月18日
営業収益	
受取利息	7,556
有価証券売買等損益	34,388,519
営業収益合計	34,396,075
営業費用	
受託者報酬	108,752
委託者報酬	906,638
その他費用	27,109
営業費用合計	1,042,499
営業利益又は営業損失（ ）	33,353,576
経常利益又は経常損失（ ）	33,353,576
中間純利益又は中間純損失（ ）	33,353,576
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（ ）	2,502,006
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	363,429,123
剰余金増加額又は欠損金減少額	63,942,681
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	63,942,681
剰余金減少額又は欠損金増加額	60,277,359
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	60,277,359
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	397,946,015

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2025年12月19日 至2026年6月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2026年6月18日現在
1. 1 期首元本額	308,386,837円
期中追加設定元本額	51,115,830円
期中一部解約元本額	51,077,495円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	308,425,172口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2025年12月19日 至2026年6月18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 2026年6月18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 2026年6月18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 2026年6月18日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.2903円 (22,903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

	2026年6月18日現在 金 額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	22,121,793,242
株式 2 3	724,877,706,420
派生商品評価勘定	511,213,750
未収配当金	3,961,725,117

その他未収収益	4	94,202,501
差入委託証拠金		163,904,794
流動資産合計		751,730,545,824
資産合計		751,730,545,824
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		11,100
前受金		353,551,000
未払解約金		394,805,800
未払利息		4,637,142
受入担保金		14,123,927,442
流動負債合計		14,876,932,484
負債合計		14,876,932,484
純資産の部		
元本等		
元本	1	237,748,201,880
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		499,105,411,460
元本等合計		736,853,613,340
純資産合計		736,853,613,340
負債純資産合計		751,730,545,824

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2025年12月19日 至2026年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2026年6月18日現在
1. 1 期首	2025年12月19日
期首元本額	225,546,566,885円
期中追加設定元本額	31,106,879,025円
期中一部解約元本額	18,905,244,030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	2,919,263,733円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A	3,220,332,005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	895,206円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	4,931,706円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	43,641,769円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	7,963,392円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	169,279,238円
国内株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,418,788,782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)	893,754,025円
D-I's TOPIXインデックス	9,608,592円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	219,832,506円
iFree TOPIXインデックス	12,024,795,056円
iFree 8資産バランス	5,469,977,721円
iFree 年金バランス	1,226,454,410円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	7,309,090円
DCダイワ日本株式インデックス	70,360,588,926円

ダイワ・ライフ・バランス 3 0	2,390,387,124円
ダイワ・ライフ・バランス 5 0	4,673,963,716円
ダイワ・ライフ・バランス 7 0	5,946,070,461円
年金ダイワ日本株式インデックス	10,654,833,005円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2030	30,050,666円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2040	68,514,245円
ダイワつみたてインデックス日本株式	9,676,565,673円
ダイワつみたてインデックスバランス 3 0	10,707,270円
ダイワつみたてインデックスバランス 5 0	16,443,401円
ダイワつみたてインデックスバランス 7 0	299,219,703円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	35,603,213,107円
ダイワ世界バランスファンド 4 0 V A	19,722,327円
ダイワ世界バランスファンド 6 0 V A	14,120,598円
ダイワ・バランスファンド 3 5 V A	1,793,225,160円
ダイワ・バランスファンド 2 5 V A（適格機関投資家専用）	180,713,985円
ダイワ国内バランスファンド 2 5 V A（適格機関投資家専用）	20,253,930円
ダイワ国内バランスファンド 3 0 V A（適格機関投資家専用）	28,678,487円
ダイワ・ノーロード T O P I X ファンド	230,557,382円
ダイワファンドラップ T O P I X インデックス	24,981,636,717円
ダイワ T O P I X インデックス（ダイワ S M A 専用）	22,365,234,969円
ダイワファンドラップオンライン T O P I X インデックス	3,196,222,411円
スタイル9（4資産分散・保守型）	1,651,131円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	13,107,382円
スタイル9（4資産分散・積極型）	21,652,237円
スタイル9（6資産分散・保守型）	705,435円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	24,987,700円
スタイル9（6資産分散・積極型）	29,527,464円
スタイル9（8資産分散・保守型）	1,114,268円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	22,369,174円
スタイル9（8資産分散・積極型）	62,576,174円
ダイワ国内株式インデックス（投資一任専用）	8,981,250,778円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル1（安定）	371,554円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル2（やや安定）	576,146円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル3（バランス）	722,126円

	BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル4（やや積極）	723,240円
	BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル5（積極）	513,858円
	ダイワ・インデックスセレクト T O P I X	792,484,704円
	ダイワライフスタイル2 5	58,537,805円
	ダイワライフスタイル5 0	331,198,820円
	ダイワライフスタイル7 5	314,605,842円
	D C ・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）	6,891,775,548円
	計	237,748,201,880円
2.	期末日における受益権の総数	237,748,201,880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 13,555,718,930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 1,216,585,000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	2026年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（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	2026年6月18日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1 年超		
市場取引				
株価指数				
先物取引				
買建	11,594,354,000	-	12,105,720,000	511,366,000
合計	11,594,354,000	-	12,105,720,000	511,366,000

（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）

	2026年6月18日現在
1 口当たり純資産額	3.0993円
（1万口当たり純資産額）	（30,993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

	2026年6月18日現在 金 額（円）
--	------------------------

資産の部	
流動資産	
預金	7,477,191,523
コール・ローン	30,974,190,077
株式	992,050,932,633
投資証券	15,815,701,884
派生商品評価勘定	309,587,485
未収入金	36,512,699
未収配当金	904,392,608
差入委託証拠金	18,588,436,594
流動資産合計	1,066,156,945,503
資産合計	1,066,156,945,503
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	111,367,137
未払解約金	744,474,200
その他未払費用	366,991
流動負債合計	856,208,328
負債合計	856,208,328
純資産の部	
元本等	
元本	1 111,527,908,592
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	953,772,828,583
元本等合計	1,065,300,737,175
純資産合計	1,065,300,737,175
負債純資産合計	1,066,156,945,503

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2025年12月19日 至2026年6月18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 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 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2026年6月18日現在
1. 1 期首	2025年12月19日
期首元本額	106,454,857,152円
期中追加設定元本額	12,492,809,284円
期中一部解約元本額	7,419,757,844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	156,349,072円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	772,238円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	5,884,210円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	2,441,474円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	53,075,189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)	132,533,690円
外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	11,008,438,565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)	847,720,048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)	9,767,076,522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）	659,234,491円
D - I ' s 外国株式インデックス	13,092,251円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2050	42,435,076円
i F r e e 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	12,754,672,308円
i F r e e 8資産バランス	1,714,652,100円
i F r e e 年金バランス	390,136,909円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2060	35,124,330円
D Cダイワ外国株式インデックス	47,959,506,581円
ダイワ・ライフ・バランス30	375,540,345円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,002,857,495円
ダイワ・ライフ・バランス70	1,067,341,906円
大和D C海外株式インデックスファンド	957,903,289円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2030	6,658,703円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2040	12,151,959円
ダイワつみたてインデックス外国株式	3,942,110,387円
ダイワつみたてインデックスバランス30	1,728,871円
ダイワつみたてインデックスバランス50	3,408,715円
ダイワつみたてインデックスバランス70	52,108,023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）	3,418,255,769円
ダイワ世界バランスファンド40VA	18,632,408円
ダイワ世界バランスファンド60VA	22,231,307円
ダイワ・バランスファンド35VA	424,267,006円
ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	24,582,580円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	89,423,932円
スタイル9（4資産分散・保守型）	663,715円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	5,323,015円
スタイル9（4資産分散・積極型）	8,909,710円
スタイル9（6資産分散・保守型）	281,924円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	10,225,537円
スタイル9（6資産分散・積極型）	12,114,302円
スタイル9（8資産分散・保守型）	427,166円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	8,267,607円
スタイル9（8資産分散・積極型）	23,833,528円
全世界株式インデックス・ファンド（オール・カンントリー）	3,119,560,294円

i F r e e 全世界株式インデックス（オール・カントリー）	158,110,398円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル1（安定）	87,627円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル2（やや安定）	155,074円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル3（バランス）	233,435円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル4（やや積極）	400,165円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル5（積極）	615,021円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	943,999,830円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	393,999,424円
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）	6,247,546,921円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,467,255,415円
ダイワライフスタイル25	4,575,692円
ダイワライフスタイル50	25,996,171円
ダイワライフスタイル75	24,606,083円
ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	54,476,491円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	53,896,298円
計	111,527,908,592円
2. 期末日における受益権の総数	111,527,908,592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	2026年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

(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	2026年6月18日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引				
株価指数				
先物取引				
買建	57,345,760,703	-	57,421,443,581	75,682,878
合計	57,345,760,703	-	57,421,443,581	75,682,878

(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	2026年6月18日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	30,529,088,010	-	30,651,625,480	122,537,470

アメリカ・ドル	21,953,026,550	-	22,142,354,780	189,328,230
イギリス・ポンド	256,798,860	-	256,387,320	411,540
オーストラリア・ドル	1,003,593,140	-	992,085,600	11,507,540
カナダ・ドル	2,650,671,810	-	2,621,756,200	28,915,610
スイス・フラン	1,792,118,740	-	1,771,823,680	20,295,060
ユーロ	2,872,878,910	-	2,867,217,900	5,661,010
合計	30,529,088,010	-	30,651,625,480	122,537,470

（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）

	2026年6月18日現在
1口当たり純資産額	9.5519円
（1万口当たり純資産額）	（95,519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

	2026年6月18日現在 金 額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,408,321,651
コール・ローン	1,688,002,301
国債証券	412,062,470,753
派生商品評価勘定	23,664,642
未収入金	7,413,967,323
未収利息	3,425,319,810
前払費用	257,263,351
流動資産合計	426,279,009,831
資産合計	426,279,009,831
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,243,438
未払金	2,369,316
未払解約金	8,053,062,602
流動負債合計	8,067,675,356
負債合計	8,067,675,356
純資産の部	
元本等	
元本	1 99,776,780,717
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	318,434,553,758
元本等合計	418,211,334,475
純資産合計	418,211,334,475
負債純資産合計	426,279,009,831

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2025年12月19日 至2026年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価 方法	国債証券

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2026年6月18日現在
1. 1 期首	2025年12月19日
期首元本額	96,342,155,305円
期中追加設定元本額	10,408,176,604円
期中一部解約元本額	6,973,551,192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	241,938,489円

ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	3,485,112円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	13,607,695円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	12,142,433円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	120,114,302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）	1,118,400,607円
外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	732,032,530円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	1,139,533,275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）	11,100,108,924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）	939,318,492円
D - I ' s 外国債券インデックス	1,452,517円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	34,743,055円
i F r e e 外国債券インデックス	1,158,005,349円
i F r e e 8資産バランス	3,678,781,815円
i F r e e 年金バランス	866,968,735円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	5,314,929円
DCダイワ外国債券インデックス	49,228,202,448円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,209,160,822円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,060,412,460円
ダイワ・ライフ・バランス70	925,711,192円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	805,971,523円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	684,369,232円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	334,986,435円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	33,671,073円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	38,704,512円
ダイワつみたてインデックス外国債券	3,354,595,710円
ダイワつみたてインデックスバランス30	5,627,377円
ダイワつみたてインデックスバランス50	3,872,395円
ダイワつみたてインデックスバランス70	47,365,951円

ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ラップ専用）	3,418,612,598円
ダイワ世界バランスファンド40VA	49,931,831円
ダイワ世界バランスファンド60VA	25,533,527円
ダイワ・バランスファンド35VA	1,903,870,184円
ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	123,553,372円
スタイル9（4資産分散・保守型）	215,483円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	5,137,572円
スタイル9（4資産分散・積極型）	6,224,915円
スタイル9（6資産分散・保守型）	81,631円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	3,761,853円
スタイル9（6資産分散・積極型）	1,200,905円
スタイル9（8資産分散・保守型）	236,778円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	3,371,837円
スタイル9（8資産分散・積極型）	3,298,444円
ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	896,244,794円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル1（安定）	494,982円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル2（やや安定）	372,398円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル3（バランス）	255,752円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル4（やや積極）	133,135円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル5（積極）	47,910円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	99,588,360円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	66,597,697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）	8,002,165,278円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	6,170,487,514円
ダイワライフスタイル25	20,903,597円
ダイワライフスタイル50	57,469,496円
ダイワライフスタイル75	18,389,485円
計	99,776,780,717円
2. 期末日における受益権の総数	99,776,780,717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	2026年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(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	2026年6月18日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1 年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	7,615,635,969	-	7,602,741,593	12,894,376
アメリカ・ドル	3,443,571,780	-	3,451,337,117	7,765,337
イギリス・ポンド	484,631,550	-	481,319,325	3,312,225
オーストラリア・ドル	136,024,080	-	135,486,240	537,840
オフショア・人民元	968,917,667	-	968,211,810	705,857
カナダ・ドル	153,040,395	-	152,260,755	779,640
デンマーク・クローネ	14,656,135	-	14,557,468	98,667
ノルウェー・クローネ	12,140,100	-	11,998,206	141,894

ポーランド・ズロチ	52,837,323	-	52,416,634	420,689
メキシコ・ペソ	68,348,170	-	68,148,740	199,430
ユーロ	2,237,511,276	-	2,223,311,890	14,199,386
韓国・ウォン	43,957,493	-	43,693,408	264,085
買建	1,362,703,520	-	1,361,230,348	1,473,172
アメリカ・ドル	250,404,177	-	251,309,107	904,930
イギリス・ポンド	281,630,081	-	281,194,457	435,624
イスラエル・シュケル	41,834,494	-	40,408,810	1,425,684
オーストラリア・ドル	40,591,008	-	40,589,352	1,656
オフショア・人民元	287,877,734	-	289,794,248	1,916,514
カナダ・ドル	17,432,361	-	17,213,033	219,328
シンガポール・ドル	43,042,511	-	43,065,418	22,907
スウェーデン・クローナ	91,102,264	-	89,449,139	1,653,125
ニュージーランド・ドル	3,805,656	-	3,714,728	90,928
ユーロ	304,983,234	-	304,492,056	491,178
合計	8,978,339,489	-	8,963,971,941	11,421,204

（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)

	2026年6月18日現在
1口当たり純資産額	4.1915円
(1万口当たり純資産額)	(41,915円)

「ダイワ」- R E I T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

	2026年6月18日現在 金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,329,502,680
投資証券	2 212,773,466,400
派生商品評価勘定	16,944,820
未収配当金	1,396,615,795
差入委託証拠金	231,484,793
流動資産合計	218,748,014,488
資産合計	218,748,014,488
負債の部	
流動負債	
前受金	30,673,400
未払解約金	700,848,000
流動負債合計	731,521,400
負債合計	731,521,400
純資産の部	
元本等	
元本	1 61,079,389,848
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金 ()	156,937,103,240
元本等合計	218,016,493,088

純資産合計	218,016,493,088
負債純資産合計	218,748,014,488

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2025年12月19日 至2026年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2026年6月18日現在
1. 1 期首	2025年12月19日
期首元本額	64,556,516,313円
期中追加設定元本額	4,273,668,447円
期中一部解約元本額	7,750,794,912円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ世界REITインデックスV A	4,567,676円
ダイワJ - REITオープン	2,450,786,823円
ダイワJ - REITオープン（毎月分配型）	36,506,025,055円

ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（年1回決算型）	767,715,924円	
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	35,698,571円	
ｉＦｒｅｅＪ－ＲＥＩＴインデックス	476,021,147円	
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	4,066,262,775円	
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（奇数月決算型）	140,876,007円	
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	732,239円	
ＤＣ・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン	5,230,985,217円	
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	9,644,959円	
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	12,675,916円	
ダイワ国内ＲＥＩＴインデックス（投資一任専用）	1,206,158,879円	
ダイワ・ノーロードＪ－ＲＥＩＴファンド	61,148,844円	
ダイワファンドラップＪ－ＲＥＩＴインデックス	7,367,954,620円	
ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	1,335,207,705円	
ダイワファンドラップオンラインＪ－ＲＥＩＴインデックス	869,922,307円	
スタイル9（6資産分散・保守型）	149,174円	
スタイル9（6資産分散・バランス型）	5,723,266円	
スタイル9（6資産分散・積極型）	5,109,624円	
スタイル9（8資産分散・保守型）	169,442円	
スタイル9（8資産分散・バランス型）	4,332,775円	
スタイル9（8資産分散・積極型）	8,184,138円	
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル1（安定）	74,389円	
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル2（やや安定）	133,728円	
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル3（バランス）	112,175円	
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル4（やや積極）	105,419円	
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル5（積極）	27,565円	
ダイワ・インデックスセレクトＪ－ＲＥＩＴ	512,883,489円	
計	61,079,389,848円	
2. 期末日における受益権の総数	61,079,389,848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 743,000,000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	2026年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(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	2026年6月18日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引				
不動産投信				
指数先物取引				
買建	5,176,359,600	-	5,193,632,000	17,272,400
合計	5,176,359,600	-	5,193,632,000	17,272,400

(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）

	2026年6月18日現在
1口当たり純資産額	3,5694円
（1万口当たり純資産額）	(35,694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

	2026年6月18日現在 金 額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	696,450,908
コール・ローン	358,409,201
投資信託受益証券	2,018,743,291
投資証券	70,722,006,374
派生商品評価勘定	231,230
未収入金	3,558,087
未収配当金	220,143,521
差入委託証拠金	580,547,686
流動資産合計	74,600,090,298
資産合計	74,600,090,298
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	45,955,787
未払金	72,270,265
未払解約金	58,854,000
流動負債合計	177,080,052
負債合計	177,080,052
純資産の部	
元本等	
元本	15,117,639,795

剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	59,305,370,451
元本等合計	74,423,010,246
純資産合計	74,423,010,246
負債純資産合計	74,600,090,298

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2025年12月19日 至2026年6月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)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。 (2)投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的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 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2026年6月18日現在
1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額 期末元本額の内訳 ファンド名 ダイワ世界REITインデックスV A	2025年12月19日 13,900,892,178円 1,858,687,880円 641,940,263円 59,849,129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）	4,011,748,674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）	176,610,107円
D - I ' s グローバルREITインデックス	1,192,562円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	22,890,971円
i F r e e 外国REITインデックス	542,472,407円
i F r e e 8資産バランス	3,250,719,964円
グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成型）	432,836,044円
グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）	189,216,975円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	8,388,025円
DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド	4,723,876,294円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	7,004,724円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	9,233,598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）	845,033,051円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	113,891,128円
スタイル9（6資産分散・保守型）	30,052円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	1,295,614円
スタイル9（6資産分散・積極型）	3,080,261円
スタイル9（8資産分散・保守型）	49,274円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	1,732,439円
スタイル9（8資産分散・積極型）	4,312,522円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル1（安定）	83,950円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル2（やや安定）	95,271円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル3（バランス）	108,523円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル4（やや積極）	133,360円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル5（積極）	154,238円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	141,368,202円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	52,183,995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）	380,023,021円
ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	69,382,012円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	68,643,408円
計	15,117,639,795円
2. 期末日における受益権の総数	15,117,639,795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	2026年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（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	2026年6月18日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買建	1,801,927,774	-	1,756,590,685	45,337,089

合計	1,801,927,774	-	1,756,590,685	45,337,089

（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	2026年6月18日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	373,434,606	-	373,047,138	387,468
アメリカ・ドル	97,194,268	-	97,424,256	229,988
ユーロ	276,240,338	-	275,622,882	617,456
合計	373,434,606	-	373,047,138	387,468

（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)

	2026年6月18日現在
1口当たり純資産額	4.9229円
(1万口当たり純資産額)	(49,229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

	2026年6月18日現在 金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	27,309,588
国債証券	757,090,020
未収利息	2,097,290
前払費用	237,636
流動資産合計	786,734,534
資産合計	786,734,534
負債の部	
流動負債	
未払金	5,746,500
流動負債合計	5,746,500
負債合計	5,746,500
純資産の部	
元本等	
元本	1 752,463,488
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金 ()	28,524,546

元本等合計	780,988,034
純資産合計	780,988,034
負債純資産合計	786,734,534

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2025年12月19日 至2026年6月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2026年6月18日現在
1. 1 期首	2025年12月19日
期首元本額	635,968,648円
期中追加設定元本額	162,256,001円
期中一部解約元本額	45,761,161円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
D C ダイワ・ターゲットイヤー2050	155,288,478円
D C ダイワ・ターゲットイヤー2060	21,414,086円
D C ダイワ・ターゲットイヤー2020	64,170,767円
D C ダイワ・ターゲットイヤー2030	325,843,259円
D C ダイワ・ターゲットイヤー2040	185,746,898円
計	752,463,488円
2. 期末日における受益権の総数	752,463,488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	2026年6月18日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（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

2026年6月18日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2026年6月18日現在
1 口当たり純資産額	1.0379円
（1万口当たり純資産額）	(10,379円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2026年6月30日

資産総額	717,263,495円
負債総額	160,404円
純資産総額（ - ）	717,103,091円
発行済数量	311,680,025口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.3008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

2026年6月30日

資産総額	752,334,181,317円
負債総額	15,287,955,487円
純資産総額（ - ）	737,046,225,830円
発行済数量	241,951,849,275口
1単位当たり純資産額（ / ）	3.0463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

2026年6月30日

資産総額	1,111,350,564,516円
負債総額	10,709,620,364円
純資産総額（ - ）	1,100,640,944,152円
発行済数量	114,155,277,214口
1単位当たり純資産額（ / ）	9.6416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

2026年6月30日

資産総額	223,722,973,449円
負債総額	455,785,400円
純資産総額（ - ）	223,267,188,049円
発行済数量	61,000,794,812口
1単位当たり純資産額（ / ）	3.6601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

2026年6月30日

資産総額	77,975,661,941円
負債総額	486,389,758円
純資産総額（ - ）	77,489,272,183円
発行済数量	15,025,340,138口
1単位当たり純資産額（ / ）	5.1572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

2026年6月30日

資産総額	791,628,757円
負債総額	68,000円
純資産総額（ - ）	791,560,757円
発行済数量	762,043,873口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0387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

2026年6月30日

資産総額	425,699,698,581円
負債総額	180,006,079円
純資産総額（ - ）	425,519,692,502円
発行済数量	100,455,950,799口

1 単位当たり純資産額（ / ）

4.2359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たときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

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

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

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2026年6月末日現在

資本金の額 414億2,454万1,896円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 326万657株

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

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. 商品会議

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

ロ. 商品本部長

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

ハ. 運用会議

運用チームまたは運用チームの戦略における基本的な運用方針を審議・決定します。

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ. リスクマネジメント会議

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2026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	68	391,445
追加型株式投資信託	765	45,091,288
株式投資信託 合計	833	45,482,733
単位型公社債投資信託	66	130,695
追加型公社債投資信託	14	1,503,746
公社債投資信託 合計	80	1,634,441
総合計	913	47,117,174

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(2025年4月1日から2026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 (2025年3月31日)	当事業年度 (2026年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	13,153	7,798
有価証券	1,194	652
前払費用	513	717
未収委託者報酬	19,097	23,971
未収収益	110	230
関係会社短期貸付金	70,000	52,400
金銭の信託	-	18,993
その他	94	404
流動資産計	104,164	105,168
固定資産		
有形固定資産	1	55
建物	0	0
器具備品	59	52
建設仮勘定	0	2
無形固定資産	1,160	1,262
ソフトウェア	1,062	1,167
ソフトウェア仮勘定	97	94
その他	0	1
投資その他の資産	14,856	21,090
投資有価証券	9,348	13,401
関係会社株式	3,414	5,586
出資金	34	34
長期差入保証金	1,049	1,050
繰延税金資産	995	1,007

その他	13	9
固定資産計	16,077	22,408
資産合計	120,241	127,577

(単位:百万円)

	前事業年度 (2025年 3 月31日)	当事業年度 (2026年 3 月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	134	148
未払金	6,757	8,109
未払収益分配金	62	80
未払償還金	12	12
未払手数料	6,660	7,935
その他未払金	22	79
未払費用	5,997	7,290
未払法人税等	4,121	4,925
未払消費税等	763	1,437
賞与引当金	1,456	1,738
その他	0	1
流動負債計	19,233	23,651
固定負債		
退職給付引当金	2,300	2,323
役員退職慰労引当金	58	25
固定負債計	2,358	2,348
負債合計	21,592	25,999
純資産の部		
株主資本		
資本金	41,424	41,424
資本剰余金		
資本準備金	37,745	37,745
資本剰余金合計	37,745	37,745
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	17,743	20,341
利益剰余金合計	18,117	20,715
株主資本合計	97,287	99,886

評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,361	1,691
評価・換算差額等合計	1,361	1,691
純資産合計	98,649	101,577
負債・純資産合計	120,241	127,577

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2024年 4 月 1 日 至 2025年 3 月31日)	当事業年度 (自 2025年 4 月 1 日 至 2026年 3 月31日)
営業収益		
委託者報酬	91,634	104,615
その他営業収益	1,233	3,205
営業収益計	92,868	107,820
営業費用		
支払手数料	37,180	41,200
広告宣伝費	1,124	1,129
調査費	13,135	15,770
調査費	1,954	2,312
委託調査費	11,180	13,457
委託計算費	1,957	2,120
営業雑経費	3,114	4,313
通信費	167	165
印刷費	483	472
協会費	57	61
諸会費	18	20
その他営業雑経費	2,388	3,593
営業費用計	56,512	64,534
一般管理費		
給料	7,599	8,495
役員報酬	453	422
給料・手当	5,116	5,773
賞与	572	561
賞与引当金繰入額	1,456	1,738
福利厚生費	1,070	1,132
交際費	108	116
旅費交通費	247	284
租税公課	1,004	1,061
不動産賃借料	1,298	1,318
退職給付費用	349	393

役員退職慰労引当金繰入額	6	7
固定資産減価償却費	444	452
諸経費	2,164	2,777
一般管理費計	14,293	16,042
営業利益	22,061	27,243

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2024年 4 月 1 日 至 2025年 3 月31日)	当事業年度 (自 2025年 4 月 1 日 至 2026年 3 月31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	387	383
有価証券償還益	183	294
受取利息	95	247
受取配当金	959	23
雑収入	76	157
営業外収益計	1,703	1,106
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	1,006
投資有価証券売却損	176	80
有価証券償還損	4	59
その他	54	24
営業外費用計	235	1,171
経常利益	23,528	27,179
特別利益		
投資有価証券売却益	1 380	-
固定資産売却益	2 110	-
特別利益計	491	-
特別損失		
固定資産売却損	3 101	-
投資有価証券評価損	-	3
特別損失計	101	3
税引前当期純利益	23,918	27,175
法人税、住民税及び事業税	7,763	8,215
法人税等調整額	397	188
法人税等合計	7,366	8,026
当期純利益	16,552	19,149

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2024年 4 月 1 日 至 2025年 3 月31日)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本 合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	13,048	13,422	40,092
当期変動額						
新株の発行	26,250	26,250	-	-	-	52,500
剰余金の配当	-	-	-	△ 11,858	△ 11,858	△ 11,858
当期純利益	-	-	-	16,552	16,552	16,552
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	26,250	26,250	-	4,694	4,694	57,195
当期末残高	41,424	37,745	374	17,743	18,117	97,287

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,530	1,530	41,623
当期変動額			
新株の発行	-	-	52,500
剰余金の配当	-	-	△ 11,858
当期純利益	-	-	16,552
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	△ 168	△ 168	△ 168
当期変動額合計	△ 168	△ 168	57,026
当期末残高	1,361	1,361	98,649

当事業年度(自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本 合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	41,424	37,745	374	17,743	18,117	97,287
当期変動額						
新株の発行	-	-	-	-	-	-
剰余金の配当	-	-	-	△ 16,551	△ 16,551	△ 16,551
当期純利益	-	-	-	19,149	19,149	19,149
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	2,598	2,598	2,598
当期末残高	41,424	37,745	374	20,341	20,715	99,886

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,361	1,361	98,649
当期変動額			
新株の発行	-	-	-
剰余金の配当	-	-	△ 16,551
当期純利益	-	-	19,149
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	329	329	329
当期変動額合計	329	329	2,927
当期末残高	1,691	1,691	101,577

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．金銭の信託

時価法を採用しております。

3．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

（2）無形固定資産

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

4．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

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

（2）退職給付引当金

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

（3）役員退職慰労引当金

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

5．収益及び費用の計上基準

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

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

(重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

(未適用の会計基準等)

リースに関する会計基準等

- ・「リースに関する会計基準」(企業会計基準第34号 2024年9月13日 企業会計基準委員会)等
- ・「リースに関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第33号 2024年9月13日 企業会計基準委員会)等

(1) 概要

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

(2) 適用予定日

2028年3月期の期首から適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

(表示方法の変更)

(損益計算書関係)

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

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」の「その他」に表示していた76百万円は、「雑収入」76百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2025年3月31日)	当事業年度 (2026年3月31日)
建物	40百万円	41百万円
器具備品	269百万円	281百万円

2 保証債務

前事業年度(2025年3月31日)

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

当事業年度(2026年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,598百万円に対して保証を行っております。

(損益計算書関係)

1 投資有価証券売却益の項目

	前事業年度 (自 2024年 4 月 1 日 至 2025年 3 月31日)	当事業年度 (自 2025年 4 月 1 日 至 2026年 3 月31日)
投資有価証券売却益		
非上場株式	380百万円	- 百万円

2 固定資産売却益の項目

	前事業年度 (自 2024年 4 月 1 日 至 2025年 3 月31日)	当事業年度 (自 2025年 4 月 1 日 至 2026年 3 月31日)
固定資産売却益		
美術品	83百万円	- 百万円
ゴルフ会員権	26百万円	- 百万円

3 固定資産売却損の項目

	前事業年度 (自 2024年 4 月 1 日 至 2025年 3 月31日)	当事業年度 (自 2025年 4 月 1 日 至 2026年 3 月31日)
固定資産売却損		
美術品	85百万円	- 百万円
ゴルフ会員権	15百万円	- 百万円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2024年 4 月 1 日 至 2025年 3 月31日)

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

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

2．配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

当事業年度(自 2025年4月1日 至 2026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	3,260	-	-	3,260
合 計	3,260	-	-	3,260

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
2025年6月19日 定時株主総会	普通株式	16,551	5,076	2025年 3月31日	2025年 6月20日

(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

2026年6月17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	19,146百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	5,872円
基準日	2026年3月31日
効力発生日	2026年6月18日

(リース取引関係)

前事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料
1年内 1,037百万円	1年内 1,040百万円
1年超 7,521百万円	1年超 6,511百万円
合計 8,559百万円	合計 7,552百万円

（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。金銭の信託を通じて保有している証券投資信託につきましては、事業推進目的で保有しており、価格変動リスクに晒されております。関係会社短期貸付金は、親会社に対して貸付を行っているものであります。

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

（3）金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

（ ）為替変動リスクの管理

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

（ ）価格変動リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

2．金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

前事業年度(2025年3月31日)

(1)時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

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

当事業年度(2026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	4,710	9,001	-	13,711
金銭の信託	-	18,993	-	18,993
資産合計	4,710	27,995	-	32,705

(2)時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1)時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

金銭の信託

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

(注2)市場価格のない株式等の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	342	342
子会社株式	1,386	3,558
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(2025年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 1,386百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額 2,027百万円)は、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度(2026年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 3,558百万円)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(2025年3月31日)

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

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

当事業年度(2026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	133	55	78
(2)その他	7,886	4,756	3,130
小計	8,020	4,811	3,208
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	5,691	6,430	739
小計	5,691	6,430	739
合計	13,711	11,242	2,469

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

3．売却したその他有価証券

前事業年度(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

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

当事業年度(自 2025年4月1日 至 2026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	2,479	383	80
合計	2,479	383	80

4．減損処理を行った有価証券

当事業年度において、証券投資信託について3百万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 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,227百万円	2,300百万円
勤務費用	149	172
退職給付の支払額	166	246
その他	89	97
退職給付債務の期末残高	2,300	2,323

(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 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,300百万円	2,323百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,300	2,323
退職給付引当金	2,300	2,323

貸借対照表に計上された負債と		
資産の純額	2,300	2,323

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
勤務費用	149百万円	172百万円
その他	8	10
確定給付制度に係る退職給付費用	158	182

(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191百万円、当事業年度211百万円であります。

(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 (2025年3月31日)	当事業年度 (2026年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	724	732
賞与引当金	340	434
未払事業税	260	323
株式報酬費用	150	136
関係会社株式評価損	87	87
投資有価証券評価損	171	31
出資金評価損	14	14
その他	157	395
繰延税金資産小計	1,907	2,155
評価性引当額	277	136
繰延税金資産合計	1,629	2,018
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	633	1,011
繰延税金負債合計	633	1,011
繰延税金資産の純額	995	1,007

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(2025年3月31日)

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

当事業年度(2026年3月31日)

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

この税率変更により、繰延税金資産が27百万円増加、法人税等調整額が27百万円減少しております。

(企業結合等関係)

(取得による企業結合)

当社は、2025年6月19日開催の当社取締役会において、投資商品の開発・運用・助言サービスを提供する三井物産オルタナティブインベストメンツ株式会社を子会社化するための資金拠出を行うことを決議し、2025年7月1日付で同社の株式を取得いたしました。

1. 企業結合の概要

(1) 被取得企業の名称及び事業内容

名称：三井物産オルタナティブインベストメンツ株式会社

事業内容：投資商品開発・運用・助言事業

(2) 企業結合を行った主な理由

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

(3) 企業結合日

2025年7月1日（株式取得日）

2025年6月30日（みなし取得日）

(4) 企業結合の法的形式

現金による株式の取得

(5) 結合後企業の名称

大和かんぼオルタナティブインベストメンツ株式会社

(6) 取得した議決権比率

51%

(7) 取得企業を決定するに至った主な根拠

当社が現金を対価として株式を取得したためです。

2. 被取得企業の取得原価及び対価の種類ごとの内訳

現金 2,142百万円

3. 主要な取得関連費用の内容及び金額

アドバイザー費用等 30百万円

（収益認識関係）

（1）顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が104,615百万円、その他3,205百万円であります。

（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5. 収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

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

〔関連情報〕

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度(自 2024年 4 月 1 日 至 2025年 3 月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2025年 4 月 1 日 至 2026年 3 月31日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア)財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

前事業年度(自 2024年 4 月 1 日 至 2025年 3 月31日)

属性	会社等の 名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権 等の所 有(被所 有)割合 (%)	関係内容		取引の内 容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社	(株)大和証券 グループ 本社	東京都 千代田 区	247,397	証券持株 会社業	被所有 80.0	あり	経営管理	資金の貸 付	63,600	関係会 社 短期貸 付金	70,000
								貸付の回 収	17,000	-	-
								利息の受 取 (注1)	89	-	-
その他 の 関係会 社	(株)かんぽ 生命保険	東京都 千代田 区	500,000	生命保険 業	被所有 20.0	あり	投資顧問 契約の締 結	投資顧問 報酬 (注2)	215	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

なお、担保は受け入れておりません。

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

当事業年度(自 2025年 4 月 1 日 至 2026年 3 月31日)

属性	会社等の 名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権 等の所 有(被所 有)割合 (%)	関係内容		取引の内 容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社	(株)大和証券 グループ 本社	東京都 千代田 区	247,397	証券持株 会社業	被所有 80.0	あり	経営管理	資金の貸 付 貸付の回 収 利息の受 取 (注1)	20,800 38,400 236	関係会 社 短期貸 付金 - -	52,400 - -
その他の 関係会 社	(株)かんぽ 生命保険	東京都 千代田 区	500,000	生命保険 業	被所有 20.0	あり	投資顧問 契約の締 結	投資顧問 報酬 (注2)	1,492	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

なお、担保は受け入れておりません。

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

(イ)財務諸表提出会社の子会社

前事業年度(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度(自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)

属性	会社等の 名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等の 所有(被所 有)割合 (%)	関係内容		取引の内 容	取引金額 (百万円)	科目	期末残 高 (百万 円)
						役員 の 兼任 等	事業上 の関係				
子会 社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商 品取引 業	所有 直接100.0	なし	経営管 理	債務保証 (注)	2,598	-	-

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 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

属性	会社等 の 名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権 等の所 有(被 所有) 割合 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の 兼任 等	事業上 の関係				
同一 の親 会社 をも つ会 社	大和証 券(株)	東京都 千代田 区	100,000	金融商品 取引業	-	なし	証券投資 信託受益 証券の募 集販売	証券投資 信託の代 行手数料 (注2)	15,779	未払手 数料	3,657
							本社ビル の管理	不動産の 賃借料 (注3)	1,038	長期差 入保証 金	1,037
同一 の親 会社 をも つ会 社	(株)大和 総研	東京都 江東区	3,898	情報サー ビス業	-	なし	ソフト ウェアの 開発・保 守	ソフト ウェアの 購入・保 守 (注4)	857	未払費 用	77

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度(自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)

属性	会社等の 名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権 等の所有(被 所有) 割合 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の 兼任 等	事業上 の関係				
同一 の親 会社 をも つ会 社	大和証券(株)	東京都 千代田 区	100,000	金融商品 取引業	-	なし	証券投資 信託受益 証券の募 集販売	証券投資 信託の代 行手数料 (注2)	16,682	未払手 数料	4,134
							本社ビル の管理	不動産の 賃借料 (注3)	1,045	長期差 入保証 金	1,037
同一 の親 会社 をも つ会 社	(株)大和 総研	東京都 江東区	3,898	情報サー ビス業	-	なし	ソフト ウェアの 開発・保 守	ソフト ウェアの 購入・保 守 (注4)	912	未払費 用	82

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2. 親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社(東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

前事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)		当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)	
1株当たり純資産額	30,254.44円	1株当たり純資産額	31,152.40円
1株当たり当期純利益	5,642.31円	1株当たり当期純利益	5,872.86円

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

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

	前事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	当事業年度 (自 2025年4月1日 至 2026年3月31日)
当期純利益(百万円)	16,552	19,149
普通株式の期中平均株式数(株)	2,933,697	3,260,657

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2025年7月1日、株式譲渡取引により大和かんぼオルタナティブインベストメンツ株式会社（旧商号：三井物産オルタナティブインベストメンツ株式会社）を子会社化いたしました。

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

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

(注1) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

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

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

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

(注7) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注8) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注9) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

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

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

(注12) 農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでいます。

(注13) 資産運用業務を行なっています。

(注14) 資産運用業務、投資助言業務および情報提供業務を行なっています。

2【関係業務の概要】

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

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

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

第3【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

2026年 5 月25日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2025年4月1日から2026年3月31日までの第67期事業年度の財務諸表、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2026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（社会的影響度の高い事業体の財務諸表監査に適用される規定を含む。）に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2026年2月13日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030の2024年12月19日から2025年12月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030の2025年12月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2026年8月21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	松田 好弘
--------------------	-------	-------

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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2030の2025年12月19日から2026年6月18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2030の2026年6月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2025年12月19日から2026年6月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) １． 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) ２． XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。