

iFree 8資産バランス

追加型投信／内外／資産複合
※課税上は株式投資信託として取扱われます。

投資信託説明書(請求目論見書)

2024年6月1日

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

本文書にかかる「iFree 8資産バランス」の募集については、委託会社は、金融商品取引法第5条の規定により、有価証券届出書を2024年5月31日に関東財務局長に提出しており、2024年6月1日にその届出の効力が生じております。

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

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

i F r e e 8資産バランス

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行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。「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(6)【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

(7)【申込期間】

2024年6月1日から2024年12月2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、値動きの異なる8つの資産クラスに分散投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

(注1) 商品分類の定義

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

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

(注2) 属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
		大型株	目論見書等において、主として大型株に投資する旨の記載があるもの
		中小型株	目論見書等において、主として中小型株に投資する旨の記載があるもの
	債券	一般	公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのもの
		公債	目論見書等において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。）に主として投資する旨の記載があるもの
		社債	目論見書等において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるもの
		その他債券	目論見書等において、公債または社債以外の債券に主として投

		資する旨の記載があるもの
	格付等クレジットによる属性	目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載があるもの
	不動産投信	目論見書等において、主として不動産投信（リート）に投資する旨の記載があるもの
	その他資産	目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信（リート）以外に投資する旨の記載があるもの
	資産複合	目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの
	資産複合 資産配 分固定型	目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの
	資産複合 資産配 分変更型	目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの
決算頻度	年1回	目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
	年2回	目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの
	年4回	目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの
	年6回（隔月）	目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの
	年12回（毎月）	目論見書等において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるもの
	日々	目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの
	その他	上記属性にあてはまらないすべてのもの
投資対象地域	グローバル	目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	日本	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	北米	目論見書等において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	欧州	目論見書等において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アジア	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	オセアニア	目論見書等において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中南米	目論見書等において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アフリカ	目論見書等において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中近東（中東）	目論見書等において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	エマージング	目論見書等において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるもの
投資形態	ファミリーファンド	目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの
	ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズ

為替ヘッジ	あり	目論見書等において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるもの
	なし	目論見書等において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの
対象インデックス	日経 225	目論見書等において、日経 225 に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	TOPIX	目論見書等において、TOPIX に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	その他の指数	目論見書等において、上記以外の指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
特殊型	ブル・ベア型	目論見書等において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行なうとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）をめざす旨の記載があるもの
	条件付運用型	目論見書等において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるもの
	ロング・ショート型 ／絶対収益追求型	目論見書等において、ロング・ショート戦略により収益の追求をめざす旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求をめざす旨の記載があるもの
	その他型	目論見書等において、特殊型のうち上記に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

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

<信託金の限度額>

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、3,000 億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。



SIMPLE & EASY

インデックスってなに?

FREE & LOW

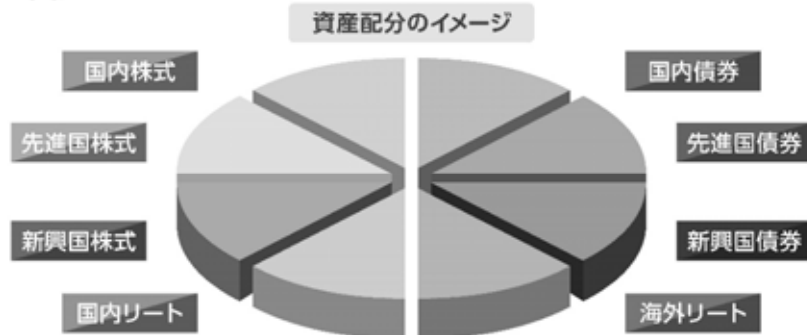
費用はどれくらいかかるのかな?

これらの質問については、以降でご説明します。

ファンドの目的・特色

値動きの異なる8つの資産クラスに均等分散投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。

■ 8つの資産クラスについて



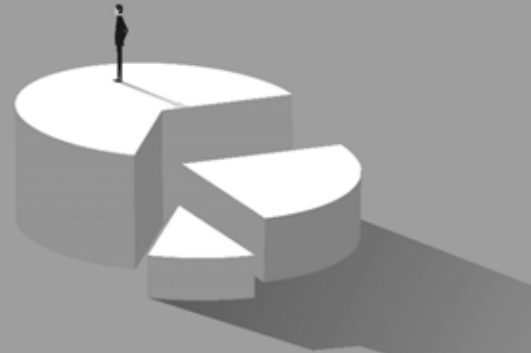
- 内外の株式、債券およびリート(不動産投資信託)に投資します。
- 各資産クラスにおける投資にあたっては、投資成果をそれぞれの対象インデックスに連動させることをめざして運用を行ないます。

※先進国株式・債券の資産クラスには、日本の株式・債券を含みません。
※対象インデックスについては、後掲の「対象インデックスについて」をご参照下さい。





インデックス ってなに？



「インデックス」とは


いうなれば「市場のモノサシ」です。

マーケット（市場）を構成する個々の価格データからマーケット全体の動向がわかるように情報会社等が計算したもので、「〇〇指数」「〇〇インデックス」などと呼ばれます。

インデックスの動きを確認することにより、マーケットのおおよその動きを読み取ることができます。

インデックス	マーケット

一般に
インデックスの上昇時はマーケットは好調
インデックスの下落時はマーケットは低調
と考えられます。



当ファンドの各資産クラスにおける対象インデックスは以下のとおりです。

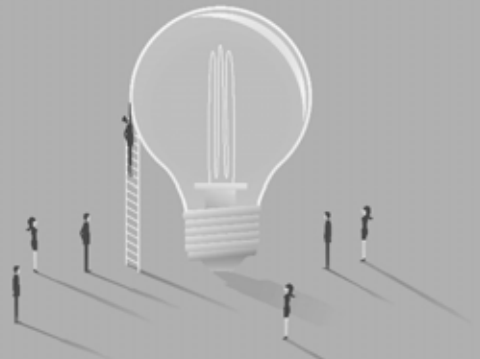
■ 対象インデックスについて

資産クラス	対象インデックス	資産クラス	対象インデックス
国内株式	東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)	先進国債券	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)
先進国株式	MSCIコクサイ指数 (配当込み、円ベース)	新興国債券	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 (円換算)
新興国株式	FTSE RAFI エマージングインデックス (円換算)	国内リート	東証REIT指数 (配当込み)
国内債券	NOMURA-BPI総合指数	海外リート	S&P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)

※対象インデックスの内容については、後掲の「インデックスの概要について」をご参照下さい。



費用はどれくらいかかるのかな？



ファンドへの投資にかかる主な費用は



当ファンドは、費用を低く抑えたファンドです。

※上記は主な費用であり、他にも費用・税金がかかります。

— Aさんの場合 —

運用管理費用っていくらくらい？

Aさんは当ファンドを10万円分保有しています。
当ファンドの運用管理費用の料率は年率0.242%(税込)です。
1年間ファンドの値段(基準価額)が変わらなかったと仮定した場合の1年間にかかる費用はおおよそ…

Aさんの保有残高	×	運用管理費用の料率	÷	1年間にかかる運用管理費用
10万円		0.242%		242円(税込)

※上記の運用管理費用は簡便に計算した概算値です。

■ インデックスの概要について

● 東証株価指数(TOPIX)

東証株価指数(TOPIX)は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。

配当込みTOPIXの指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社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。

● MSCIコクサイ指数

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

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

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

● FTSE RAFI エマージング インデックス

FTSE RAFI エマージング インデックスとは、FTSE社(FTSE International Limited)の流動性基準、時価総額基準、浮動株調整をクリアした新興国の上場株式の中から、4つのファンダメンタル指標(株主資本、キャッシュフロー、売上、配当)に着目し、リサーチ・アフィリエイツ社(Research Affiliates LLC)独自のインデックス構成手法により、銘柄の選定およびウェイト付けを行なう指数です。なお、FTSE RAFI エマージング インデックス(円換算)は、FTSE RAFI エマージング インデックス(米ドルベース)をもとに、FTSE International Limitedの承諾を得て委託会社が計算したものです。

「iFree 8資産バランス」は、いかなる形式においてもFTSE International Limited(以下「FTSE」)、ロンドン証券取引所グループ会社(以下「LSEG」)、またはResearch Affiliates LLC(以下「RA」)(以下、総称して「ライセンサ各社」)によって出資、保証、販売、または販売促進されることはございません。また、ライセンサ各社はいずれも、明示的にも黙示的にも当該インデックスの使用から得られる結果や特定の日時における指数値について何ら保証や表明を行うことはございません。当該指数はまたRAと共同しFTSEによってルールに基づき計算されます。いずれのライセンサ各社も、指数における瑕疵については(過失の有無に関わらず)何人に対しても責任を負わず、またそれについて通知する義務も負いません。

FTSE®はLSEGの商標です。Fundamental Index®およびRAFI®はResearch Affiliates, LLCの登録商標です。

The iFree Balanced Fund 8 is not in any way sponsored, endorsed, sold or promoted by FTSE International Limited ("FTSE"), by the London Stock Exchange Group companies ("LSEG"), or by Research Affiliates LLC ("RA") (collectively the "Licensor Parties"), and none of the Licensor Parties make any warranty or representation whatsoever, expressly or impliedly, either as to the results to be obtained from the use of the FTSE RAFI Emerging Index (the "Index") and/or the figure at which the said Index stands at any particular time on any particular day or otherwise. The Index is compiled and calculated by FTSE in conjunction with RA. None of the Licensor Parties shall be liable (whether in negligence or otherwise) to any person for any error in the Index and none of the Licensor Parties shall be under any obligation to advise any person of any error therein.

FTSE® is a trade mark of LSEG. The trade names Fundamental Index® and RAFI® are registered trademarks of Research Affiliates, LLC.

● NOMURA-BPI総合指数

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。

● FTSE世界国債インデックス

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

● 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(円換算)

JPモルガン社が算出し公表している債券指数で、新興国の政府が現地通貨建てで発行する債券で構成されています。米ドルベースの指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。外国人投資家に対して著しい不利益を与える制度等がある国は除外されています。国別構成比率に、1か国当たりの上限を設けており、分散が図られています。

JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P.Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P.Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016,J.P.Morgan Chase & Co. All rights reserved.

● 東証REIT指数(配当込み)

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

● S&P先進国REIT指数

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

ファンドの
仕組みなど

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



- 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
- 各資産クラスの配分比率の合計は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- 安定した収益の確保および効率的な運用を行なうためのものとして定める次の目的により投資する場合を除き、法人税法第61条の5第1項に規定するデリバティブ取引にかかる権利に対する投資として運用を行ないません。
 - (a) 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的
 - (b) 信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスク(為替相場の変動、市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいいます。)を減じる目的
 - (c) 法人税法施行規則第27条の7第1項第6号に規定する先物外国為替取引により、信託財産の資産または負債について為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的
- 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想される時、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、「ファンドの特色」の運用が行なわれないことがあります。

分配方針

毎年9月7日(休業日の場合翌営業日)に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

[分配方針]

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

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

(2) 【ファンドの沿革】

2016年9月8日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金（※3）	
お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行いません。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など
↑↓※1	収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※3）	
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（※2）の委託者であり、次の業務を行いません。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成 など
↓運用指図 ↑↓※2	損益↑↓信託金（※3）	
受託会社	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行	信託契約（※2）の受託者であり、次の業務を行いません。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算 など
	損益↑↓投資	
投資対象	内外の株式・債券およびリート（不動産投資信託） など （ファミリーファンド方式で運用を行いません。）	

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は、自動的に再投資されます。

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

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

<委託会社の概況（2024年3月末日現在）>

- ・資本金の額 151億7,427万2,500円
- ・沿革
 - 1959年12月12日 大和証券投資信託委託株式会社として設立
 - 1960年 2月17日 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
 - 1960年 4月 1日 営業開始
 - 1985年11月 8日 投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
 - 1995年 5月31日 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
 - 1995年 9月14日 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
 - 2007年 9月30日 「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。
(金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号)
 - 2020年 4月 1日 大和アセットマネジメント株式会社に商号変更
- ・大株主の状況

名 称	住 所	所有 株式数	比率
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	株 2,608,525	% 100.00

2【投資方針】

(1)【投資方針】

① 主要投資対象

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

※ 各マザーファンドは、それぞれかつこ内に掲げる指数に採用されている資産に投資を行ない、投資成果を当該指数の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券（東証株価指数（配当込み））
2. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券（MSCIコクサイ指数（配当込み、円ベース））
3. ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの受益証券（FTSE RAFI エマージング インデックス（円換算））
4. 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（NOMURA-BPI総合指数）
5. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券（FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））
6. ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券（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（円換算））
7. ダイワJ-REITマザーファンドの受益証券（東証REIT指数（配当込み））
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（S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース））

② 投資態度

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

1. 国内株式
 2. 先進国株式
 3. 新興国株式
 4. 国内債券
 5. 先進国債券
 6. 新興国債券
 7. 国内リート
 8. 海外リート
- ロ. 各資産クラスの配分比率については、均等とすることを目標とします。
- ハ. 各資産クラスの配分比率の合計は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ニ. 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
- ホ. 安定した収益の確保および効率的な運用を行なうためのものとして定める次の目的により投資する場合を除き、法人税法第61条の5第1項に規定するデリバティブ取引にかかる権利に対する投資として運用を行ないません。
- (a) 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的
 - (b) 信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスク（為替相場の変動、市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいいます。）を減じる目的
 - (c) 法人税法施行規則第27条の7第1項第6号に規定する先物外国為替取引により、信託財産の資産または負債について為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的
- ヘ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 【投資対象】

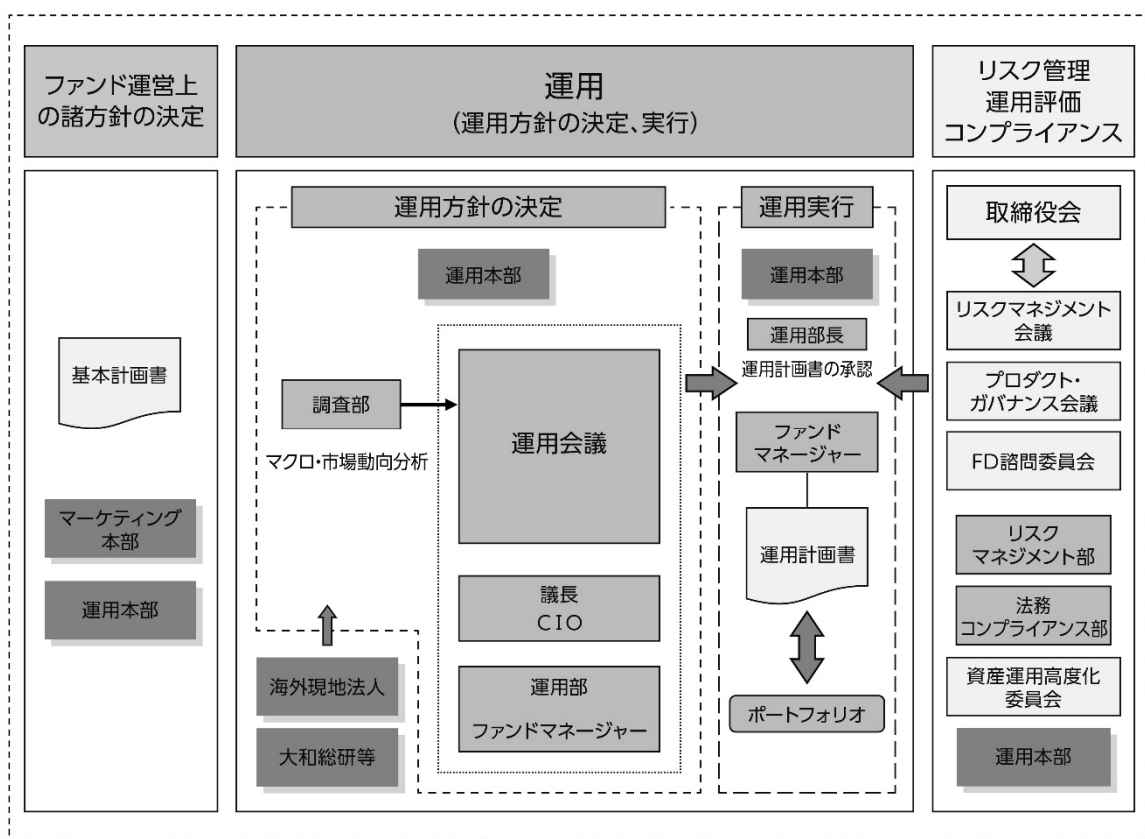
- ① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
 1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. 約束手形
 - ハ. 金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの
 2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形
- ② 委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の 1. から 8. までの掲げる親投資信託（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券、ならびに次の 9. から 12. までの掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。
 1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
 2. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
 3. ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの受益証券
 4. 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
 5. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
 6. ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券
 7. ダイワJ-REITマザーファンドの受益証券
 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
 9. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
 10. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前9.の証券の性質を有するもの
 11. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

12. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- ③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 【運用体制】

① 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ. 基本計画書の策定

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

ロ. 基本的な運用方針の決定

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

ハ. 運用計画書の作成・承認

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

項との整合性等を確認し、承認します。

③ 職務権限

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

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

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

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

ロ. Deputy-CIO (0~5名程度)

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ. インベストメント・オフィサー (0~5名程度)

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

ニ. 運用部長 (各運用部に1名)

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ. 運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ. ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

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

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

イ. リスクマネジメント会議

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

ロ. プロダクト・ガバナンス会議

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

ハ. FD諮問委員会

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

ニ. 資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

⑤ 受託会社に対する管理体制

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

※ 上記の運用体制は2024年3月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。

② 原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

③ 留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

- ① 株式（信託約款）
株式への直接投資は、行ないません。
- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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取引の指図をすることができます。
- ⑤ 信用リスク集中回避（信託約款）
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ 100 分の 10、合計で 100 分の 20 を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
- ⑥ 資金の借入れ（信託約款）
 - イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとし、
 - ロ. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が 5 営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の 10% を超えないこととします。
 - ハ. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ニ. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

<参考>マザーファンドの概要

1. トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

- ① 投資対象
東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。
- ② 投資態度
投資成果を東証株価指数（配当込み）の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。

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

(2) 投資対象

- ① 委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）で市場性のあるものに投資することを指図します。
 - 1. 株券または新株引受権証書
 - 2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
 - 3. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 - 4. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
なお、前 1. の証券または証書を以下「株式」といいます。
- ② 委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
 - 1. 預金
 - 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3. コール・ローン
 - 4. 手形割引市場において売買される手形
 - 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 2 項第 1 号で定めるもの

(3) 主な投資制限

① 株式

株式への投資には、制限を設けません。

② 先物取引等

イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第 28 条第 8 項第 3 号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

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

③ スワップ取引

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

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

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

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

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

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

2. 外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

外国の株式（預託証券を含みます。）を主要投資対象とします。

② 投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

- めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 16. 預託証券（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書
 18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 19. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの
 なお、前1.の証券または証書、前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前13.の証券および前14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。
- ② 委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの
- (3) 主な投資制限
- ① 株式
 株式への投資割合には、制限を設けません。
 - ② 投資信託証券
 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
 - ③ 外貨建資産
 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

3. ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

- (1) 投資方針
- ① 主要投資対象
 次の有価証券を主要投資対象とします。
 イ. 新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。）
 ロ. 新興国の企業のDR（預託証券）
 ハ. FTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすETF（上場投資信託証券）
 - ② 投資態度
 イ. 主として、新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）（※）に投資し、投資成果をFTSE RAFI エマージング インデックス（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

※ 効率性の観点から FTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざす E T F (上場投資信託証券) に投資する場合があります。

ロ. 株式および E T F (上場投資信託証券) の組入比率の合計は、通常の状態では信託財産の純資産総額の 80% 程度以上に維持することを基本とします。

ハ. 運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、株式の組入総額ならびに株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産の組入総額ならびに外国為替予約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。

ニ. 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

(2) 投資対象

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

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

1. 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せん。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. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。）
 17. 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。）
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
 20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 21. 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
 22. 外国の者に対する権利で前21.の有価証券の性質を有するもの
 なお、前1.の証券または証書ならびに前12.および前17.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券ならびに前14.の証券のうち投資法人債券ならびに前12.および前17.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（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。
- ③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの
- (3) 主な投資制限
- ① 株式
 株式への投資割合には、制限を設けません。
 - ② 投資信託証券
 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
 - ③ 外貨建資産
 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
 - ④ 先物取引等
 - イ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
 - ロ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
 - ハ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

⑤ スワップ取引

- イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。
- ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、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、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ホ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

⑥ 金利先渡取引および為替先渡取引

- 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、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ロ. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.に掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。）の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ. 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産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、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産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為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ホ. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ヘ. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

4. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）

(1) 投資方針

① 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。

② 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

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

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

② 委託会社は、信託金を、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
- ③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 2 項第 1 号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前 5. の権利の性質を有するもの
- (3) 主な投資制限
- ① 株式
- 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限り、株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以下とします。
- ② 投資信託証券
- 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。
- ③ 外貨建資産
- 外貨建資産への投資は、行ないません。
- ④ 先物取引等
- イ. 委託会社は、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。
- ⑤ スワップ取引
- イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。
- ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ. スワップ取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ホ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。
- ⑥ 金利先渡取引
- イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

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

5. 外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

② 投資態度

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

(2) 投資対象

- ① 委託会社は、信託金を、主として、次の有価証券（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。
1. 転換社債の転換、新株予約権（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券
 2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 4 号で定めるものをいいます。）
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 6 号で定めるものをいいます。）
 8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 7 号で定めるものをいいます。）
 9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 8 号で定めるものをいいます。）
 10. コマーシャル・ペーパー

11. 外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前 1. から前 11. までの証券または証書の性質を有するもの
 13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 10 号で定めるものをいいます。）
 14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号で定めるものをいいます。）
 15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 18 号で定めるものをいいます。）
 16. 預託証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 20 号で定めるものをいいます。）
 17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 19. 抵当証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 16 号で定めるものをいいます。）
 20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 21. 外国の者に対する権利で前 20. の有価証券の性質を有するもの
- ② 委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 14 号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 2 条第 2 項第 1 号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前 5. の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

① 株式

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

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

② 投資信託証券

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の 5%以下とします。

③ 同一銘柄の株式

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

④ 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

6. ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

新興国通貨建ての債券を主要投資対象とします。

② 投資態度

- イ. 主として、新興国通貨建ての債券に投資し、投資成果を 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(円換算)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
- ロ. 運用の効率化をはかるため、債券先物取引等や外国為替予約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、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産の組入総額ならびに外国為替予約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. 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. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

- ① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
 - 1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)④、⑤および⑥に定めるものに限りません。）
 - ハ. 約束手形
 - ニ. 金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの
 - 2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形
- ② 委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。
 - 1. 転換社債の転換、新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証券
 - 2. 国債証券
 - 3. 地方債証券
 - 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
 - 6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 7. コマーシャル・ペーパー
 - 8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
 - 9. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 - 10. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 - 11. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 - 12. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。）

13. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 14. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 15. 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。）
 16. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 17. 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
 18. 外国の者に対する権利で前17.の有価証券の性質を有するもの
 なお、前1.の証券または証書ならびに前8.および前13.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券ならびに前10.の証券のうち投資法人債券ならびに前8.および前13.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前9.の証券および前10.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。
- ③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形
 5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの
- (3) 主な投資制限
- ① 株式
 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限り、株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
 - ② 投資信託証券
 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
 - ③ 外貨建資産
 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
 - ④ 先物取引等
 イ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
 ロ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
 ハ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
 - ⑤ スワップ取引
 イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以

- 下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。
- ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、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、市場実勢金利等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。
- ⑥ 金利先渡取引および為替先渡取引
- 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、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ロ. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.に掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。）の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ. 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産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、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産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為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ホ. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ヘ. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、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. ダイワJ-REITマザーファンド

(1) 投資方針

① 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。以下同じ。

② 投資態度

イ。「東証 REIT 指数」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

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

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

② 委託会社は、信託金を、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。）

なお、前 2. の証券および前 3. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

① 株式

株式への直接投資は、行ないません。

② 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。

③ 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。

④ 外貨建資産

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

⑤ 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 号ロ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。

8. 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

① 主要投資対象

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

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

② 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せん。

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

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

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

② 委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第 2 条第 2 項の規定により有価証

券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができます。

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
 2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの
 3. 外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 4. 外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 5. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 6. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- ③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 3. コール・ローン
 4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

- ① 株式への直接投資は、行ないません。
- ② 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- ③ 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。
- ④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- ⑤ 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号ロ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。

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。

① 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

新興国の証券市場は、先進国の証券市場に比べ、一般に市場規模や取引量が小さく、流動

性が低いことにより本来想定される投資価値とは乖離した価格水準で取引される場合もあるなど、価格の変動性が大きくなる傾向が考えられます。

② 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

新興国の公社債は、先進国の公社債と比較して価格変動が大きく、債務不履行が生じるリスクがより高いものになると考えられます。組入公社債の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

③ 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、リーートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

- ・リーートの収益は、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。

④ 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。

特に、新興国の為替レートは短期間に大幅に変動することがあり、先進国と比較して、相対的に高い為替変動リスクがあります。

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み入れた部分は、為替レートの変動の影響を直接受けます。

ロ. カントリー・リスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落したり、方針に沿った運用が困難となることがあります。新興国への投資には、先進国と比べて大きなカントリー・リスクが伴います。

新興国の経済状況は、先進国経済に比較して脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化、また、政治不安や社会不安あるいは他国との外交関係の悪化などが市場に及ぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制など数々の規制が緊急に導入されたり、あるいは政策の変更等により証券市場が著しい悪影響を被る可能性もあります。

新興国においては、先進国と比較して、証券の決済、保管等にかかる制度やインフラストラクチャーが未発達であったり、証券の売買を行なう当該国の仲介業者等の固有の事由等により、決済の遅延、不能等が発生する可能性も想定されます。そのような場合、ファンドの基準価額に悪影響が生じる可能性があります。

実質的な投資対象である証券が上場または取引されている新興国の税制は先進国と異なる面がある場合があります。また、税制が変更されたり、あるいは新たな税制が適用されることにより、基準価額に影響を受ける可能性があります。

⑤ その他

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

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

(2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

- ① 金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生した場合には、お買付け、ご換金の申込みの受け付けを中止すること、すでに受け付けたお買付けの申込みを取消すことがあります。
- ② ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受け付けたものとして取扱います。

(3) その他の留意点

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

※ 流動性リスクに関する事項

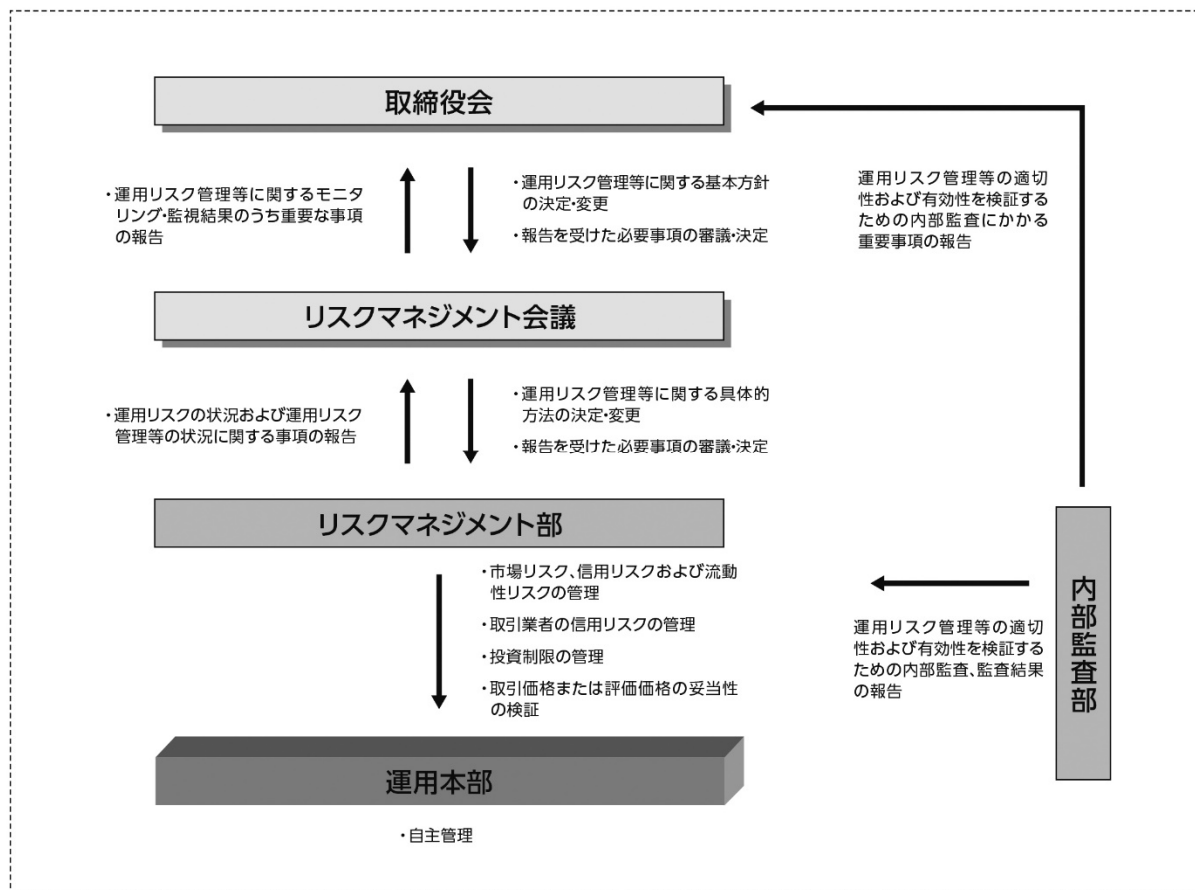
- ・ 当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合

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

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

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※ 流動性リスクに対する管理体制

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

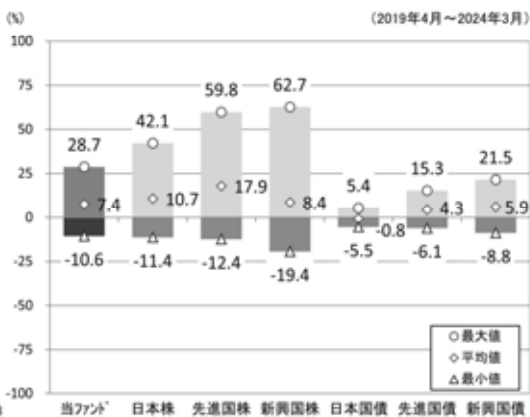
参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

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

※指数について

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

(2)【換金（解約）手数料】

- ① 換金手数料
ありません。
- ② 信託財産留保額
ありません。

(3)【信託報酬等】

- ① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率 0.242%（税抜 0.22%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の 6 か月終了日（6 か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。
- ② 信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。
- ③ 信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分については、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率 0.10%（税抜）	年率 0.10%（税抜）	年率 0.02%（税抜）

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

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

する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

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

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

① 個人の投資者に対する課税

イ. 収益分配金に対する課税

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

ロ. 解約金および償還金に対する課税

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

ハ. 損益通算について

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

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「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」および「つみたて投資枠（特定累積投資勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

② 法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として課税され、15%（所得税15%）の税率で源泉徴収（※）され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）となります。なお、益金不算入制度の適用はありません。

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

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

<注1>個別元本について

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

<注2>収益分配金の課税について

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

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

（※）上記は、2024年3月末日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】 (2024年3月29日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	70,598,005,058	99.01
内 日本	70,598,005,058	99.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	708,387,712	0.99
純資産総額	71,306,392,770	100.00

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

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

(2) 【投資資産】 (2024年3月29日現在)

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	4,577,867,025	1.6930 7,750,730,994	2.0084 9,194,188,133	12.89
2	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,466,987,993	5.1785 7,596,849,442	6.2238 9,130,239,870	12.80
3	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,710,082,379	3.3601 9,106,355,217	3.2712 8,865,221,478	12.43
4	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	2,379,300,410	3.3125 7,881,500,361	3.7250 8,862,894,027	12.43
5	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	3,532,638,837	2.2603 7,985,125,959	2.4872 8,786,379,315	12.32
6	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	2,415,350,218	3.3587 8,112,557,214	3.5847 8,658,305,926	12.14
7	ダイワ新興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	4,656,836,631	1.7141 7,982,593,248	1.8435 8,584,878,329	12.04
8	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	日本	親投資信託受益証券	6,971,672,518	1.2252 8,541,744,351	1.2215 8,515,897,980	11.94

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.01%
合計	99.01%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1 計算期間末 (2017年9月7日)	4,423,564,263	4,423,564,263	1.1184	1.1184
第2 計算期間末 (2018年9月7日)	9,247,296,645	9,247,296,645	1.1443	1.1443
第3 計算期間末 (2019年9月9日)	15,633,295,158	15,633,295,158	1.2108	1.2108
第4 計算期間末 (2020年9月7日)	22,486,955,149	22,486,955,149	1.1937	1.1937
第5 計算期間末 (2021年9月7日)	34,554,535,822	34,554,535,822	1.4651	1.4651
第6 計算期間末 (2022年9月7日)	45,579,049,607	45,579,049,607	1.5066	1.5066
2023年3月末日	50,817,540,179	—	1.4697	—
4月末日	52,570,236,389	—	1.4973	—
5月末日	54,441,837,595	—	1.5324	—
6月末日	57,857,667,360	—	1.6084	—
7月末日	58,987,594,904	—	1.6163	—
8月末日	60,450,563,447	—	1.6297	—
第7 計算期間末 (2023年9月7日)	60,624,212,803	60,624,212,803	1.6324	1.6324
9月末日	60,237,226,313	—	1.6003	—
10月末日	59,725,641,813	—	1.5638	—
11月末日	63,411,685,267	—	1.6434	—
12月末日	64,532,588,289	—	1.6605	—
2024年1月末日	66,517,163,252	—	1.6976	—
2月末日	68,608,510,666	—	1.7294	—
3月末日	71,306,392,770	—	1.7744	—

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1 計算期間	0.0000
第2 計算期間	0.0000
第3 計算期間	0.0000
第4 計算期間	0.0000
第5 計算期間	0.0000
第6 計算期間	0.0000
第7 計算期間	0.0000
2023年9月8日～ 2024年3月7日	—

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1 計算期間	11.8
第2 計算期間	2.3
第3 計算期間	5.8
第4 計算期間	△1.4
第5 計算期間	22.7
第6 計算期間	2.8
第7 計算期間	8.3
2023年9月8日～ 2024年3月7日	6.1

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1 計算期間	5,119,041,794	1,173,761,616
第2 計算期間	5,936,562,291	1,810,640,911
第3 計算期間	6,888,328,647	2,057,961,207
第4 計算期間	9,224,765,978	3,298,328,374
第5 計算期間	8,347,815,842	3,601,501,893
第6 計算期間	9,073,700,420	2,405,303,826
第7 計算期間	9,706,776,681	2,820,662,222
2023年9月8日～ 2024年3月7日	5,194,761,200	2,604,701,866

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

(参考) マザーファンド
トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2024年3月29日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		336,050,229,900	97.37
	内 日本	336,050,229,900	97.37
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		9,077,446,723	2.63
純資産総額		345,127,676,623	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)		8,919,400,000	2.58
	内 日本	8,919,400,000	2.58

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

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

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

(2) 投資資産 (2024年3月29日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	4,711,400	2,885.28 13,593,718,967	3,792.00 17,865,628,800	5.18
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	5,145,600	1,325.80 6,822,046,393	1,557.00 8,011,699,200	2.32
3	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	606,900	12,825.30 7,783,676,956	12,985.00 7,880,596,500	2.28
4	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	181,600	21,153.50 3,841,476,729	39,570.00 7,185,912,000	2.08
5	三菱商事	日本	株式	卸売業	1,770,600	2,531.42 4,482,147,706	3,487.00 6,174,082,200	1.79
6	キーエンス	日本	株式	電気機器	85,800	58,023.71 4,978,434,474	69,540.00 5,966,532,000	1.73
7	日立	日本	株式	電気機器	416,400	9,994.81 4,161,841,280	13,905.00 5,790,042,000	1.68
8	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	600,700	7,599.97 4,565,306,427	8,909.00 5,351,636,300	1.55

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
9	信越化学	日本	株式	化学	770,600	4,663.23 3,593,491,343	6,584.00 5,073,630,400	1.47
10	三井物産	日本	株式	卸売業	681,900	5,794.83 3,951,499,861	7,106.00 4,845,581,400	1.40
11	日本電信電話	日本	株式	情報・通信 業	25,594,500	180.75 4,626,345,660	179.80 4,601,891,100	1.33
12	任天堂	日本	株式	その他製 品	541,700	6,501.03 3,521,613,330	8,196.00 4,439,773,200	1.29
13	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	652,900	5,092.02 3,324,581,864	6,707.00 4,379,000,300	1.27
14	本田技研	日本	株式	輸送用機 器	2,092,000	1,790.49 3,745,714,726	1,891.00 3,955,972,000	1.15
15	伊藤忠	日本	株式	卸売業	608,000	5,739.71 3,489,748,552	6,466.00 3,931,328,000	1.14
16	東京海上HD	日本	株式	保険業	835,200	3,593.99 3,001,700,784	4,703.00 3,927,945,600	1.14
17	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信 業	424,500	6,524.86 2,769,803,857	8,962.00 3,804,369,000	1.10
18	第一三共	日本	株式	医薬品	749,700	4,070.42 3,051,596,870	4,777.00 3,581,316,900	1.04
19	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,140,500	2,677.94 3,054,193,469	3,046.00 3,473,963,000	1.01
20	武田薬品	日本	株式	医薬品	761,200	4,791.02 3,646,929,290	4,184.00 3,184,860,800	0.92
21	HOYA	日本	株式	精密機器	168,900	16,161.26 2,729,638,001	18,740.00 3,165,186,000	0.92
22	KDDI	日本	株式	情報・通信 業	665,100	4,721.49 3,140,269,520	4,482.00 2,980,978,200	0.86
23	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信 業	1,384,900	1,762.65 2,441,101,035	1,951.00 2,701,939,900	0.78
24	三菱電機	日本	株式	電気機器	964,300	1,923.44 1,854,781,777	2,512.00 2,422,321,600	0.70
25	ディスコ	日本	株式	機械	41,700	26,996.48 1,125,753,317	57,190.00 2,384,823,000	0.69
26	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	466,800	5,110.20 2,385,445,352	4,849.00 2,263,513,200	0.66
27	村田製作所	日本	株式	電気機器	780,600	2,765.81 2,158,996,240	2,824.00 2,204,414,400	0.64
28	SMC	日本	株式	機械	25,900	70,228.14 1,818,909,005	84,830.00 2,197,097,000	0.64
29	三菱重工業	日本	株式	機械	1,515,000	881.19 1,335,013,224	1,448.50 2,194,477,500	0.64
30	ダイキン工業	日本	株式	機械	103,500	24,755.46 2,562,190,969	20,600.00 2,132,100,000	0.62

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.37%
合計	97.37%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.08%
鉱業	0.35%
建設業	2.03%
食料品	2.99%
繊維製品	0.35%
パルプ・紙	0.16%
化学	5.56%
医薬品	4.15%
石油・石炭製品	0.50%
ゴム製品	0.67%
ガラス・土石製品	0.67%
鉄鋼	0.91%
非鉄金属	0.69%
金属製品	0.50%
機械	5.47%
電気機器	16.94%
輸送用機器	9.27%
精密機器	2.16%
その他製品	2.22%
電気・ガス業	1.37%
陸運業	2.43%
海運業	0.68%
空運業	0.39%
倉庫・運輸関連業	0.13%
情報・通信業	7.05%
卸売業	7.23%
小売業	4.12%
銀行業	7.21%
証券、商品先物取引業	0.91%
保険業	2.65%
その他金融業	1.17%
不動産業	2.05%
サービス業	4.31%
合計	97.37%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX 先物 0606 月	買建	322	8,803,829,700	8,919,400,000	2.58%

(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。

ダイワJ-REITマザーファンド

(1) 投資状況 (2024年3月29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	357,470,518,800	97.28
内 日本	357,470,518,800	97.28
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	9,995,672,382	2.72
純資産総額	367,466,191,182	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	10,001,600,000	2.72
内 日本	10,001,600,000	2.72

(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 (2024年3月29日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	40,594	584,010.72 23,707,331,500	598,000.00 24,275,212,000	6.61
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	35,744	533,011.93 19,051,978,492	538,000.00 19,230,272,000	5.23
3	野村不動産マスターF	日本	投資証券	112,528	140,706.34 15,833,403,950	150,300.00 16,912,958,400	4.60
4	日本プロロジスリート	日本	投資証券	60,619	257,308.07 15,597,758,482	269,000.00 16,306,511,000	4.44
5	KDX 不動産投資法人	日本	投資証券	100,140	147,307.56 14,751,379,082	158,700.00 15,892,218,000	4.32
6	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	166,794	90,902.57 15,162,003,698	94,700.00 15,795,391,800	4.30
7	GLP投資法人	日本	投資証券	117,543	122,202.66 14,364,067,624	125,600.00 14,763,400,800	4.02
8	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	52,453	246,210.30 12,914,469,239	258,800.00 13,574,836,400	3.69

	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 (%)
9	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	77,840	146,005.22 11,365,047,092	153,200.00 11,925,088,000	3.25
10	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	168,482	65,701.46 11,069,514,465	68,000.00 11,456,776,000	3.12
11	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	34,141	318,011.21 10,857,220,935	334,000.00 11,403,094,000	3.10
12	オリックス不動産投資	日本	投資証券	69,334	158,504.90 10,989,779,388	164,400.00 11,398,509,600	3.10
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	116,486	77,201.88 8,992,939,232	79,700.00 9,283,934,200	2.53
14	産業ファンド	日本	投資証券	63,383	131,204.92 8,316,161,483	135,600.00 8,594,734,800	2.34
15	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	104,564	76,602.89 8,009,905,040	80,500.00 8,417,402,000	2.29
16	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	23,798	319,509.91 7,603,697,010	332,000.00 7,900,936,000	2.15
17	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	12,015	591,033.47 7,101,267,171	645,000.00 7,749,675,000	2.11
18	API投資法人	日本	投資証券	18,255	380,521.56 6,946,421,201	408,500.00 7,457,167,500	2.03
19	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	44,481	150,603.46 6,698,992,743	154,100.00 6,854,522,100	1.87
20	三井不ロジパーク	日本	投資証券	14,473	443,007.03 6,411,640,853	451,000.00 6,527,323,000	1.78
21	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	22,211	264,809.57 5,881,685,530	274,100.00 6,088,035,100	1.66
22	イオンリート投資	日本	投資証券	42,685	135,303.03 5,775,410,046	139,300.00 5,946,020,500	1.62
23	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	12,911	435,515.69 5,622,943,076	454,500.00 5,868,049,500	1.60
24	森ヒルズリート	日本	投資証券	40,919	134,803.11 5,516,008,625	136,900.00 5,601,811,100	1.52
25	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	17,111	292,520.88 5,005,324,790	325,500.00 5,569,630,500	1.52
26	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	51,243	102,203.35 5,237,206,600	105,400.00 5,401,012,200	1.47
27	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	32,557	145,305.28 4,730,704,240	153,900.00 5,010,522,300	1.36
28	森トラストリート投資法人	日本	投資証券	67,073	70,202.28 4,708,677,942	72,200.00 4,842,670,600	1.32
29	三菱地所物流 REIT	日本	投資証券	12,016	363,015.82 4,361,998,160	383,000.00 4,602,128,000	1.25
30	NTT 都市開発リート投資法人	日本	投資証券	35,279	117,903.60 4,159,521,392	122,700.00 4,328,733,300	1.18

(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	97.28%
合計	97.28%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	日本	TREIT 先物 0606 月	買建	5,600	9,584,400,000	10,001,600,000	2.72%

(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。

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

(1) 投資状況（2024年3月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	78,617,243,000	86.68
内 日本	78,617,243,000	86.68
地方債証券	4,002,693,455	4.41
内 日本	4,002,693,455	4.41
特殊債券	2,451,110,596	2.70
内 日本	2,451,110,596	2.70
社債券	5,064,781,400	5.58
内 日本	5,064,781,400	5.58
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	562,629,588	0.62
純資産総額	90,698,458,039	100.00

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

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

(2) 投資資産（2024年3月29日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	149 5 年国債	日本	国債証券	2,380,000,000	99.64 2,371,510,500	99.55 2,369,456,600	0.005000 2026/09/20	2.61
2	154 5 年国債	日本	国債証券	2,380,000,000	99.58 2,370,220,000	99.55 2,369,337,600	0.100000 2027/09/20	2.61
3	452 2 年国債	日本	国債証券	2,130,000,000	99.83 2,126,584,700	99.88 2,127,571,800	0.005000 2025/09/01	2.35
4	455 2 年国債	日本	国債証券	2,020,000,000	99.75 2,015,132,000	99.77 2,015,455,000	0.005000 2025/12/01	2.22
5	148 5 年国債	日本	国債証券	1,500,000,000	99.69 1,495,448,200	99.61 1,494,195,000	0.005000 2026/06/20	1.65
6	153 5 年国債	日本	国債証券	1,500,000,000	99.30 1,489,521,000	99.32 1,489,920,000	0.005000 2027/06/20	1.64
7	158 5 年国債	日本	国債証券	1,500,000,000	99.30 1,489,531,000	99.31 1,489,695,000	0.100000 2028/03/20	1.64
8	164 5 年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	99.22 1,190,739,600	99.30 1,191,636,000	0.200000 2028/12/20	1.31
9	356 10 年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	98.52 1,182,262,800	98.49 1,181,988,000	0.100000 2029/09/20	1.30

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
10	163 5 年国債	日本	国債証券	1,150,000,000	100.34 1,154,022,600	100.33 1,153,795,000	0.400000 2028/09/20	1.27
11	150 5 年国債	日本	国債証券	1,150,000,000	99.63 1,145,802,000	99.49 1,144,238,500	0.005000 2026/12/20	1.26
12	145 5 年国債	日本	国債証券	1,070,000,000	100.17 1,071,829,700	100.01 1,070,149,800	0.100000 2025/09/20	1.18
13	364 10 年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	97.03 1,067,348,200	96.94 1,066,384,000	0.100000 2031/09/20	1.18
14	369 10 年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	99.05 990,515,000	99.00 990,070,000	0.500000 2032/12/20	1.09
15	370 10 年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	98.83 988,324,500	98.77 987,700,000	0.500000 2033/03/20	1.09
16	357 10 年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	98.44 984,447,800	98.40 984,040,000	0.100000 2029/12/20	1.08
17	359 10 年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	98.07 980,760,000	98.11 981,190,000	0.100000 2030/06/20	1.08
18	360 10 年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	98.00 980,020,000	97.92 979,220,000	0.100000 2030/09/20	1.08
19	371 10 年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	97.56 975,687,600	97.65 976,550,000	0.400000 2033/06/20	1.08
20	366 10 年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	97.13 971,338,000	97.21 972,170,000	0.200000 2032/03/20	1.07
21	363 10 年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	97.14 971,421,800	97.21 972,120,000	0.100000 2031/06/20	1.07
22	368 10 年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	96.57 965,752,000	96.73 967,360,000	0.200000 2032/09/20	1.07
23	153 20 年国債	日本	国債証券	875,000,000	105.07 919,439,250	104.87 917,673,750	1.300000 2035/06/20	1.01
24	367 10 年国債	日本	国債証券	940,000,000	97.03 912,096,300	96.98 911,612,000	0.200000 2032/06/20	1.01
25	361 10 年国債	日本	国債証券	900,000,000	97.77 879,952,640	97.71 879,444,000	0.100000 2030/12/20	0.97
26	372 10 年国債	日本	国債証券	850,000,000	100.96 858,225,900	101.02 858,687,000	0.800000 2033/09/20	0.95
27	365 10 年国債	日本	国債証券	880,000,000	96.70 851,003,900	96.66 850,669,600	0.100000 2031/12/20	0.94
28	144 5 年国債	日本	国債証券	800,000,000	100.16 801,358,500	100.04 800,384,000	0.100000 2025/06/20	0.88
29	147 5 年国債	日本	国債証券	800,000,000	99.91 799,352,000	99.67 797,408,000	0.005000 2026/03/20	0.88
30	16 40 年国債	日本	国債証券	940,000,000	84.98 798,870,100	83.30 783,029,400	1.300000 2063/03/20	0.86

(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	86.68%
地方債証券	4.41%
特殊債証券	2.70%
社債証券	5.58%
合計	99.38%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2024年3月29日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	27,294,970,450	85.73
内 中国	10,340,184,124	32.48
内 台湾	4,930,512,718	15.49
内 タイ	904,220,606	2.84
内 マレーシア	166,645,200	0.52
内 インドネシア	397,906,690	1.25
内 インド	3,327,669,290	10.45
内 サウジアラビア	773,630,652	2.43
内 トルコ	491,272,078	1.54
内 カナダ	22,139,776	0.07
内 メキシコ	798,764,632	2.51
内 チリ	104,497,353	0.33
内 ブラジル	3,981,725,506	12.51
内 南アフリカ	1,055,801,825	3.32
投資証券	2,304,804,578	7.24
内 アメリカ	2,255,498,748	7.08
内 メキシコ	25,121,693	0.08
内 南アフリカ	24,184,137	0.08
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,239,363,535	7.03
純資産総額	31,839,138,563	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)	2,215,665,806	6.96
内 アメリカ	2,215,665,806	6.96
為替予約取引(買建)	195,796,809	0.61
内 日本	195,796,809	0.61
為替予約取引(売建)	2,202,695	△0.01
内 日本	2,202,695	△0.01

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

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

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

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

(2) 投資資産 (2024年3月29日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	アメリカ	投資証券	—	765,500	2,879.36 2,204,211,790	2,946.43 2,255,498,748	7.08
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技術	399,000	2,755.89 1,099,604,294	3,635.44 1,450,543,553	4.56
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	中国	株式	一般消費財・サービス	764,400	1,528.69 1,168,540,726	1,358.63 1,038,540,594	3.26
4	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	ブラジル	株式	エネルギー	645,800	917.18 592,317,718	1,126.94 727,781,546	2.29
5	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	株式	コミュニケーション・サービス	123,400	6,275.13 774,351,950	5,875.49 725,035,713	2.28
6	VALE SA	ブラジル	株式	素材	377,790	1,930.10 729,183,410	1,834.90 693,209,340	2.18
7	IND & COMM BK OF CHINA-H	中国	株式	金融	8,763,000	79.97 700,824,039	76.19 667,737,095	2.10
8	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	株式	金融	6,378,000	97.37 621,193,217	91.28 582,214,454	1.83
9	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	ブラジル	株式	エネルギー	428,900	1,018.05 436,642,449	1,154.69 495,249,569	1.56
10	BANK OF CHINA LTD-H	中国	株式	金融	7,641,000	61.19 467,610,417	62.46 477,319,516	1.50
11	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	株式	金融	745,000	910.73 678,511,375	639.18 476,194,315	1.50
12	JD.COM INC - CL A	中国	株式	一般消費財・サービス	167,395	2,416.53 404,516,525	2,086.78 349,317,542	1.10
13	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	株式	エネルギー	62,132	4,311.55 267,885,911	5,438.21 337,886,926	1.06
14	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国	株式	エネルギー	3,743,800	89.60 335,497,865	85.86 321,478,608	1.01
15	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	415,902	518.93 215,827,848	735.12 305,740,478	0.96
16	MEDIATEK INC	台湾	株式	情報技術	53,003	3,776.04 200,142,116	5,483.90 290,663,152	0.91
17	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	ブラジル	株式	金融	258,836	866.32 224,246,801	1,044.89 270,457,291	0.85

	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 (%)
18	PETROCHINA CO LTD-H	中国	株式	エネルギー	1,846,000	110.37 203,763,159	129.38 238,843,972	0.75
19	HDFC BANK LIMITED	インド	株式	金融	83,336	2,625.63 218,810,022	2,649.65 220,811,816	0.69
20	BANCO BRADESCO SA-PREF	ブラジル	株式	金融	488,059	497.44 242,795,225	430.14 209,936,514	0.66
21	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	中国	株式	金融	3,241,000	59.74 193,681,079	63.82 206,847,102	0.65
22	BAIDU INC-CLASS A	中国	株式	コミュニケ ーション・サ ービス	99,650	2,561.09 255,213,942	1,986.21 197,926,624	0.62
23	PTT PCL-NVDR	タイ	株式	エネルギー	1,336,100	139.69 186,645,246	138.69 185,303,709	0.58
24	INFOSYS LTD	インド	株式	情報技術	63,137	2,470.04 155,951,261	2,741.43 173,085,761	0.54
25	AMERICA MOVIL L	メキシコ	株式	コミュニケ ーション・サ ービス	1,215,200	168.91 205,279,198	142.04 172,610,483	0.54
26	CHINA MERCHANTS BANK-H	中国	株式	金融	288,000	689.97 198,713,025	598.57 172,389,024	0.54
27	XIAOMI CORP-CLASS B	中国	株式	情報技術	591,000	215.58 127,421,207	288.93 170,763,304	0.54
28	EVERGREEN MARINE CORP LTD	台湾	株式	資本財・サ ービス	193,800	627.06 121,526,150	832.04 161,249,352	0.51
29	MEITUAN-CLASS B	中国	株式	一般消費 財・サービ ス	84,290	2,072.02 174,652,633	1,872.11 157,800,320	0.50
30	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	台湾	株式	情報技術	211,000	524.56 110,683,379	732.76 154,612,888	0.49

(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	85.73%
投資証券	7.24%
合計	92.97%

(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	10.98%
素材	9.05%
資本財・サービス	3.94%
一般消費財・サービス	8.53%
生活必需品	3.13%

業種	投資比率
ヘルスケア	0.84%
金融	24.93%
情報技術	14.65%
コミュニケーション・サービス	5.89%
公益事業	2.53%
不動産	1.25%
合計	85.73%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	MSCI EMER MKT INDEX (ICE) JUN 24	買建	279	2,236,343,945	2,215,665,806	6.96%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2024年4 月	買建	1,294,587	193,348,058	195,796,809	0.61%
		トルコ・リラ売/円買 2024年4月	売建	473,311	2,211,546	2,202,695	△0.01%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況 (2024年3月29日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	483,242,346,776	93.44
内 香港	2,461,321,559	0.48
内 シンガポール	1,720,279,589	0.33
内 イスラエル	1,084,858,201	0.21
内 ノルウェー	853,667,369	0.17
内 スウェーデン	4,457,892,400	0.86
内 デンマーク	5,282,654,421	1.02
内 イギリス	19,536,506,766	3.78
内 アイルランド	453,814,036	0.09
内 オランダ	6,768,160,409	1.31
内 ベルギー	1,188,257,469	0.23
内 フランス	15,938,867,104	3.08
内 ドイツ	11,568,751,544	2.24
内 スイス	12,021,977,181	2.32
内 ポルトガル	231,878,612	0.04
内 スペイン	3,544,400,503	0.69
内 イタリア	3,714,059,482	0.72
内 フィンランド	1,282,363,427	0.25
内 オーストリア	238,842,542	0.05
内 カナダ	14,992,602,635	2.90
内 アメリカ	367,192,045,938	71.00
内 オーストラリア	8,440,758,398	1.63
内 ニュージーランド	268,387,191	0.05
投資証券	9,779,623,578	1.89
内 香港	132,913,860	0.03
内 シンガポール	184,065,404	0.04
内 イギリス	164,306,779	0.03
内 ベルギー	38,826,461	0.01
内 フランス	172,707,350	0.03
内 カナダ	34,001,980	0.01
内 アメリカ	8,194,829,015	1.58
内 オーストラリア	857,972,729	0.17

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	24,141,482,571	4.67
純資産総額	517,163,452,925	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	24,565,241,903	4.75
内 イギリス	1,160,873,674	0.22
内 ドイツ	4,983,954,772	0.96
内 カナダ	1,829,779,595	0.35
内 アメリカ	15,512,567,711	3.00
内 オーストラリア	1,078,066,151	0.21
為替予約取引(買建)	10,806,136,960	2.09
内 日本	10,806,136,960	2.09

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

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

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

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

(2) 投資資産 (2024年3月29日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	380,200	57,731.42 21,949,512,217	63,701.21 24,219,202,019	4.68
2	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	790,900	28,608.76 22,626,780,049	25,963.78 20,534,758,980	3.97
3	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	132,980	76,252.34 10,140,056,096	136,808.01 18,192,730,446	3.52
4	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービス	500,800	22,461.82 11,248,932,062	27,311.33 13,677,516,969	2.64
5	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケ ーション・サ ービス	119,500	51,786.15 6,188,463,739	73,521.66 8,785,839,302	1.70
6	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケ ーション・サ ービス	318,600	20,499.24 6,531,105,780	22,852.31 7,280,746,380	1.41
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケ ーション・サ ービス	277,440	20,710.91 5,746,057,951	23,053.68 6,396,014,810	1.24

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
8	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	43,385	91,200.14 3,956,723,051	117,790.92 5,110,359,220	0.99
9	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	23,912	145,726.37 3,484,611,358	200,680.32 4,798,668,006	0.93
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	155,670	23,694.45 3,688,520,419	30,327.42 4,721,069,938	0.91
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	アメリカ	株式	金融	70,650	54,836.61 3,874,207,690	63,670.93 4,498,351,431	0.87
12	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	154,050	36,440.90 5,613,741,963	26,616.36 4,100,250,859	0.79
13	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	215,205	15,549.04 3,346,264,368	17,599.89 3,787,586,135	0.73
14	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	49,766	80,700.16 4,016,131,730	74,902.52 3,727,599,159	0.72
15	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	85,250	38,714.47 3,300,416,329	42,255.50 3,602,281,614	0.70
16	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	株式	ヘルスケア	185,687	15,330.39 2,846,658,292	19,282.84 3,580,573,454	0.69
17	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	45,100	62,666.63 2,826,267,057	72,914.51 3,288,444,568	0.64
18	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	126,867	22,977.22 2,915,063,376	24,566.27 3,116,649,293	0.60
19	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	53,650	47,730.33 2,560,735,403	58,080.87 3,116,038,997	0.60
20	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	129,600	23,116.82 2,995,958,755	23,951.54 3,104,120,608	0.60
21	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	20,953	104,945.85 2,198,933,570	145,642.72 3,051,652,080	0.59
22	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	136,421	15,562.67 2,123,095,205	19,978.54 2,725,493,701	0.53
23	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	23,860	90,483.22 2,158,930,147	110,927.50 2,646,730,348	0.51
24	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	95,072	21,368.64 2,031,560,633	27,571.76 2,621,302,462	0.51
25	ADVANCED MICRO DEVICES	アメリカ	株式	情報技術	87,027	19,356.55 1,684,545,863	27,327.99 2,378,273,064	0.46
26	SALESFORCE.COM INC	アメリカ	株式	情報技術	52,066	35,684.00 1,857,926,385	45,601.66 2,374,296,227	0.46
27	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	96,318	21,861.93 2,105,701,322	23,883.41 2,300,402,612	0.44
28	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	383,501	4,637.83 1,778,635,423	5,741.46 2,201,858,413	0.43
29	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需品	239,200	7,947.35 1,901,018,565	9,110.33 2,179,193,256	0.42

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
30	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニケー ーション・サ ービス	23,590	73,285.61 1,728,810,145	91,955.83 2,169,238,155	0.42

(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	93.44%
投資証券	1.89%
合計	95.33%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	4.44%
素材	3.62%
資本財・サービス	9.97%
一般消費財・サービス	9.68%
生活必需品	6.27%
ヘルスケア	11.74%
金融	14.69%
情報技術	23.20%
コミュニケーション・サービス	7.16%
公益事業	2.38%
不動産	0.30%
合計	93.44%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 EMINI JUN 24	買建	386	15,329,299,623	15,512,567,711	3.00%
	イギリス	FTSE 100 INDEX JUN 24	買建	76	1,138,433,815	1,160,873,674	0.22%
	オーストラ リア	SPI 200 JUN 24	買建	55	1,056,351,983	1,078,066,151	0.21%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX JUN 24	買建	61	1,806,490,522	1,829,779,595	0.35%
	ドイツ	SWISS MKT IX JUN 24	買建	73	1,420,593,671	1,426,236,916	0.28%

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
		EURO STOXX 50 JUN 24	買建	432	3,477,116,800	3,557,717,856	0.69%
為替予約取引	日本	カナダ・ドル買/円売 2024年4月	買建	11,100,000	1,227,194,700	1,239,828,930	0.24%
		スイス・フラン買/円売 2024年4月	買建	5,600,000	948,095,620	939,996,960	0.18%
		豪ドル買/円売 2024年4 月	買建	5,300,000	520,820,410	522,157,590	0.10%
		米ドル買/円売 2024年4 月	買建	40,000,000	6,050,356,000	6,049,664,000	1.17%
		英ポンド買/円売 2024年 4月	買建	2,900,000	553,352,760	553,929,000	0.11%
		ユーロ買/円売 2024年4 月	買建	9,200,000	1,502,418,380	1,500,560,480	0.29%

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

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

(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・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2024年3月29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	597,083,518	1.52
内 アメリカ	597,083,518	1.52
投資証券	37,687,565,567	95.69
内 ガーンジー	101,880,553	0.26
内 韓国	67,879,783	0.17
内 香港	347,214,114	0.88
内 シンガポール	1,248,863,911	3.17
内 イスラエル	45,471,938	0.12
内 イギリス	1,789,788,758	4.54
内 アイルランド	10,922,024	0.03
内 オランダ	56,375,180	0.14
内 ベルギー	345,798,714	0.88
内 フランス	588,621,108	1.49
内 ドイツ	12,001,180	0.03
内 スペイン	137,478,560	0.35
内 イタリア	1,717,242	0.00
内 カナダ	557,813,853	1.42
内 アメリカ	29,265,890,410	74.30
内 オーストラリア	2,997,287,050	7.61
内 ニューージーランド	112,561,189	0.29
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,101,958,812	2.80
純資産総額	39,386,607,897	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)	1,126,715,982	2.86
内 ドイツ	283,180,590	0.72
内 アメリカ	843,535,392	2.14
為替予約取引(買建)	376,176,848	0.96
内 日本	376,176,848	0.96

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

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

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

(2) 投資資産 (2024年3月29日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	169,337	17,234.39 2,918,424,672	19,716.61 3,338,751,621	8.48
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	17,206	122,669.95 2,110,661,193	124,963.21 2,150,117,082	5.46
3	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	101,435	13,372.37 1,356,434,508	14,147.75 1,435,077,062	3.64
4	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	59,730	18,780.13 1,121,745,716	23,694.15 1,415,251,633	3.59
5	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	29,003	39,204.28 1,137,045,388	43,917.98 1,273,753,307	3.23
6	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	152,416	8,126.17 1,238,560,024	8,191.28 1,248,482,285	3.17
7	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	55,504	20,947.87 1,162,693,524	21,809.09 1,210,492,087	3.07
8	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	328,669	2,308.36 758,688,332	3,334.00 1,095,783,794	2.78
9	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	38,721	19,694.80 762,606,811	22,257.27 861,823,752	2.19
10	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	189,600	4,484.61 850,302,819	4,510.50 855,191,539	2.17
11	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	25,997	25,955.15 674,759,953	28,095.63 730,402,343	1.85
12	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	53,513	9,682.21 518,131,416	12,144.59 649,893,771	1.65
13	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	63,257	8,609.32 544,600,963	9,555.48 604,451,321	1.53
14	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	45,600	12,839.26 585,473,142	13,093.93 597,083,518	1.52
15	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	105,425	5,003.04 527,450,674	5,391.71 568,421,037	1.44
16	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	28,860	16,630.72 479,965,135	19,518.26 563,297,073	1.43
17	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	73,745	6,861.14 505,980,904	6,592.39 486,155,904	1.23
18	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	22,807	19,397.58 442,403,365	19,468.29 444,013,468	1.13
19	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	11,767	32,314.67 380,248,017	37,066.68 436,163,648	1.11
20	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	21,391	18,799.82 402,149,390	19,922.52 426,162,792	1.08

	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 (%)
21	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	245,083	1,578.32 386,827,388	1,728.24 423,563,802	1.08
22	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	129,286	2,662.69 344,257,895	3,131.15 404,814,997	1.03
23	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	129,740	2,601.22 337,497,755	2,838.93 368,323,751	0.94
24	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	122,085	2,879.06 351,505,527	2,969.15 362,488,690	0.92
25	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	40,076	9,383.63 376,064,179	8,545.58 342,472,680	0.87
26	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	アメリカ	投資証券	48,936	6,944.11 339,824,369	6,975.45 341,351,047	0.87
27	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	34,166	10,578.56 361,428,130	9,750.80 333,145,969	0.85
28	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	987,074	260.23 256,934,779	334.28 329,966,895	0.84
29	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	アメリカ	投資証券	58,289	5,420.78 315,976,895	5,568.85 324,603,269	0.82
30	LINK REIT	香港	投資証券	489,200	753.42 368,583,007	650.79 318,366,957	0.81

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	1.52%
投資証券	95.69%
合計	97.20%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	アメリカ	DOW JONES US REAL ESTATE JUN 24	買建	160	854,027,499	843,535,392	2.14%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE JUN 24	買建	270	274,470,528	283,180,590	0.72%

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2024年4月	買建	1,980,000	297,207,173	299,517,780	0.76%
		ユーロ買/円売 2024年4月	買建	470,000	76,049,243	76,659,068	0.19%

(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。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2024年3月29日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	43,186,730,535	96.61
内 中国	4,366,839,230	9.77
内 タイ	4,318,848,959	9.66
内 マレーシア	4,395,326,836	9.83
内 インドネシア	4,384,346,136	9.81
内 ポーランド	3,370,464,318	7.54
内 ハンガリー	1,256,087,007	2.81
内 ルーマニア	1,778,332,956	3.98
内 トルコ	324,697,710	0.73
内 チェコ	2,775,959,908	6.21
内 メキシコ	4,340,898,712	9.71
内 ドミニカ共和国	70,311,781	0.16
内 コロンビア	2,026,949,805	4.53
内 ペルー	958,699,963	2.14
内 チリ	722,953,750	1.62
内 ブラジル	4,350,705,778	9.73
内 ウルグアイ	84,838,337	0.19
内 南アフリカ	3,660,469,349	8.19
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,516,193,499	3.39
純資産総額	44,702,924,034	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)	519,288,384	1.16
内 日本	519,288,384	1.16
為替予約取引(売建)	243,322,000	△0.54
内 日本	243,322,000	△0.54

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

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

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

(2) 投資資産 (2024年3月29日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	30,000,000	75.32 681,643,698	80.55 728,988,487	— 2026/07/01	1.63
2	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	24,700,000	78.43 584,412,633	84.61 630,427,733	— 2026/01/01	1.41
3	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	20,800,000	98.09 615,467,696	97.77 613,442,646	10.000000 2029/01/01	1.37
4	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	19,650,000	99.61 590,471,777	99.58 590,248,876	10.000000 2027/01/01	1.32
5	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	66,150,000	103.86 548,971,091	102.76 543,152,589	10.500000 2026/12/21	1.22
6	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	16,490,000	99.15 493,222,769	99.98 497,328,044	10.000000 2025/01/01	1.11
7	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	67,200,000	88.82 476,920,833	88.98 477,758,534	8.000000 2030/01/31	1.07
8	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	85,520,000	71.93 491,503,185	69.39 474,145,200	8.750000 2048/02/28	1.06
9	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	55,350,000	94.73 478,062,439	91.98 464,175,133	7.750000 2031/05/29	1.04
10	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	52,400,000	91.43 436,803,602	92.56 442,201,960	5.750000 2026/03/05	0.99
11	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	64,200,000	83.73 429,509,973	83.51 428,371,225	8.250000 2032/03/31	0.96
12	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	15,500,000	82.31 384,854,225	88.94 415,862,125	— 2025/07/01	0.93
13	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	48,030,000	95.04 416,174,276	94.59 414,230,339	7.500000 2027/06/03	0.93
14	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	63,700,000	82.48 419,817,286	79.85 406,406,955	8.875000 2035/02/28	0.91
15	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	9,900,000	104.24 391,363,450	104.10 390,841,246	6.000000 2033/10/25	0.87
16	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	9,400,000	108.52 386,870,828	108.35 386,259,277	7.500000 2028/07/25	0.86
17	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	47,000,000	88.57 379,550,782	89.94 385,392,000	5.500000 2027/03/04	0.86
18	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	58,800,000	76.08 357,436,203	73.89 347,144,086	8.500000 2037/01/31	0.78
19	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	9,190,000	91.82 320,010,366	94.42 329,074,953	2.500000 2026/07/25	0.74
20	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	9,550,000	86.09 311,821,281	88.20 319,435,369	2.750000 2029/10/25	0.71
21	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	40,620,000	88.69 328,476,823	84.97 314,671,559	7.750000 2042/11/13	0.70
22	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	35,230,000	98.99 317,954,295	96.83 311,019,762	8.500000 2029/05/31	0.70

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
23	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	13,700,000	70.73 292,316,771	72.59 299,997,354	— 2027/07/01	0.67
24	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	36,400,000	91.28 302,947,299	89.10 295,699,465	7.500000 2033/05/26	0.66
25	BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F	ブラジル	国債証券	10,000,000	95.76 288,860,112	94.91 286,291,269	10.000000 2033/01/01	0.64
26	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	35,400,000	88.99 287,217,848	86.26 278,413,213	8.000000 2047/11/07	0.62
27	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	45,400,000	76.67 278,141,399	73.91 268,105,568	9.000000 2040/01/31	0.60
28	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	31,100,000	96.91 274,786,430	92.99 263,682,484	8.500000 2038/11/18	0.59
29	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	46,200,000	73.30 270,600,031	70.02 258,488,884	8.750000 2044/01/31	0.58
30	Indonesia Treasury Bond	インドネシ ア	国債証券	26,300,000,000	100.30 253,249,142	99.33 250,808,582	6.500000 2031/02/15	0.56

(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	96.61%
合計	96.61%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	オフショア人民元買/円売 2024年5月	買建	1,000,000	20,723,900	20,717,100	0.05%
		トルコ・リラ買/円売 2024年5月	買建	3,000,000	13,283,400	13,236,600	0.03%
		チェコ・コルナ買/円売 2024年4月	買建	6,500,000	42,004,300	41,928,900	0.09%
		チェコ・コルナ買/円売 2024年5月	買建	16,000,000	102,848,000	102,521,600	0.23%
		ハンガリー・フォリント 買/円売 2024年5月	買建	70,000,000	28,469,000	28,708,470	0.06%
		タイ・バーツ買/円売 2024年4月	買建	31,851,985	132,281,292	131,828,994	0.29%

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
		ルーマニア・レイ買/円売 2024年5月	買建	2,000,000	65,260,000	65,185,400	0.15%
		南アフリカ・ランド買/円 売 2024年5月	買建	1,500,000	11,872,050	11,869,200	0.03%
		ポーランド・ズロチ買/円 売 2024年5月	買建	200,000	7,542,400	7,524,920	0.02%
		南アフリカ・ランド買/円 売 2024年4月	買建	12,000,000	95,880,000	95,767,200	0.21%
		メキシコ・ペソ売/円買 2024年4月	売建	8,000,000	72,830,400	72,836,800	△0.16%
		ポーランド・ズロチ売/円 買 2024年4月	売建	4,500,000	170,729,100	170,485,200	△0.38%

(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) 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。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況 (2024年3月29日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	296,161,115,476	97.22
内 ユーロ	95,439,439,085	31.33
内 中国	24,245,570,590	7.96
内 シンガポール	1,115,650,281	0.37
内 マレーシア	1,331,524,026	0.44
内 イスラエル	931,288,316	0.31
内 ノルウェー	526,608,843	0.17
内 スウェーデン	545,938,310	0.18
内 デンマーク	787,169,319	0.26
内 イギリス	15,143,946,902	4.97
内 ポーランド	1,586,955,361	0.52
内 カナダ	5,824,915,925	1.91
内 アメリカ	141,478,597,826	46.44
内 メキシコ	2,471,817,938	0.81
内 オーストラリア	4,039,051,328	1.33
内 ニュージーランド	692,641,426	0.23
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	8,480,202,397	2.78
純資産総額	304,641,317,873	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)	4,496,545,225	1.48
内 日本	4,496,545,225	1.48
為替予約取引(売建)	371,753,503	△0.12
内 日本	371,753,503	△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) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

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

(2) 投資資産 (2024年3月29日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	103.33 1,564,553,892	102.24 1,548,046,122	4.500000 2033/11/15	0.51
2	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,700,000	98.77 1,450,656,333	99.33 1,458,880,924	4.125000 2032/11/15	0.48
3	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,400,000	83.48 1,314,623,987	84.48 1,330,307,640	1.875000 2032/02/15	0.44
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	81.06 1,313,372,129	82.02 1,328,908,763	1.125000 2031/02/15	0.44
5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	88.86 1,278,258,484	89.70 1,290,341,002	2.750000 2032/08/15	0.42
6	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,300,000	90.04 1,267,879,026	90.81 1,278,735,577	2.875000 2032/05/15	0.42
7	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	80.39 1,253,731,730	81.47 1,270,668,149	1.250000 2031/08/15	0.42
8	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	60,000,000	99.79 1,247,174,022	100.78 1,259,593,998	2.390000 2026/11/15	0.41
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	80.62 1,220,712,843	81.70 1,237,034,841	1.375000 2031/11/15	0.41
10	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	58,000,000	100.69 1,216,473,470	100.71 1,216,725,627	2.370000 2029/01/15	0.40
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	79.93 1,186,030,565	80.96 1,201,358,405	0.875000 2030/11/15	0.39
12	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	94.06 1,139,354,193	94.72 1,147,397,092	3.500000 2033/02/15	0.38
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,700,000	83.35 1,097,955,217	84.30 1,110,456,081	1.625000 2031/05/15	0.36
14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,800,000	93.03 1,098,694,249	93.69 1,106,559,696	3.375000 2033/05/15	0.36
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	93.37 1,092,718,967	94.00 1,100,068,124	1.625000 2026/05/15	0.36
16	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	50,000,000	100.79 1,049,765,810	101.13 1,053,233,856	2.540000 2030/12/25	0.35
17	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	96.81 1,026,081,344	97.36 1,031,963,622	3.875000 2033/08/15	0.34
18	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	91.11 965,700,550	91.85 973,564,785	1.125000 2026/10/31	0.32
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	78.86 955,275,972	80.10 970,295,844	0.625000 2030/08/15	0.32
20	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,899,000	100.18 964,724,593	100.18 964,743,852	2.750000 2027/10/25	0.32
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	94.06 954,188,848	94.44 958,094,469	2.875000 2028/08/15	0.31
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	94.30 928,087,278	94.65 931,531,855	2.875000 2028/05/15	0.31

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	93.09 916,169,040	94.42 929,258,434	0.250000 2025/06/30	0.31
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	92.33 922,679,215	92.91 928,525,156	2.625000 2029/02/15	0.30
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	86.57 917,529,459	87.50 927,481,638	0.750000 2028/01/31	0.30
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,400,000	93.70 908,053,009	94.11 912,035,698	2.375000 2027/05/15	0.30
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,350,000	94.06 904,420,078	94.42 907,814,009	2.750000 2028/02/15	0.30
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	91.60 901,504,981	92.23 907,734,746	1.500000 2027/01/31	0.30
29	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	99.80 906,643,080	99.63 905,098,698	4.375000 2026/08/15	0.30
30	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	99.44 903,455,371	99.22 901,392,181	4.250000 2026/01/31	0.30

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.22%
合計	97.22%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	オフショア人民元買/円売 2024年5月	買建	60,000,000	1,245,433,200	1,243,260,000	0.41%
		米ドル買/円売 2024年5月	買建	2,454,000	369,181,723	369,217,060	0.12%
		スウェーデン・クローネ 買/円売 2024年5月	買建	350,000	4,924,710	4,930,170	0.00%
		ポーランド・ズロチ買/円 売 2024年4月	買建	3,438,000	130,128,300	130,250,692	0.04%
		カナダ・ドル買/円売 2024年4月	買建	102,000	11,368,348	11,397,990	0.00%
		イスラエル・シェケル買/ 円売 2024年4月	買建	3,411,000	140,722,005	140,375,270	0.05%

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
		ニュージーランド・ドル 買/円売 2024年5月	買建	198,000	17,791,495	17,802,655	0.01%
		米ドル買/円売 2024年4 月	買建	5,110,000	773,220,574	773,135,867	0.25%
		オフショア人民元買/円売 2024年4月	買建	61,362,000	1,279,597,695	1,277,403,434	0.42%
		英ポンド買/円売 2024年 4月	買建	168,000	32,114,880	32,104,800	0.01%
		シンガポール・ドル買/円 売 2024年5月	買建	149,000	16,633,182	16,633,376	0.01%
		ユーロ買/円売 2024年4 月	買建	1,170,000	191,922,354	190,900,125	0.06%
		豪ドル買/円売 2024年5 月	買建	268,000	26,310,230	26,291,711	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2024年5月	買建	1,829,000	203,387,909	203,322,431	0.07%
		メキシコ・ペソ買/円売 2024年5月	買建	6,618,000	59,570,140	59,519,644	0.02%
		ノルウェー・クローネ売/ 円買 2024年4月	売建	4,170,000	58,002,156	58,083,096	△0.02%
		デンマーク・クローネ売/ 円買 2024年4月	売建	228,000	4,982,564	4,985,653	△0.00%
		英ポンド売/円買 2024年 4月	売建	224,000	42,752,864	42,792,960	△0.01%
		ユーロ売/円買 2024年4 月	売建	1,630,000	265,648,125	265,891,794	△0.09%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

●iFree 8資産バランス

2024年3月29日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	17,744円
純資産総額	713億円



基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	2.6%
3カ月間	6.9%
6カ月間	10.9%
1年間	20.7%
3年間	29.5%
5年間	48.8%
設定来	77.4%

※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期				
	17年9月	18年9月	19年9月	20年9月	21年9月	22年9月	23年9月				
分配金	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。

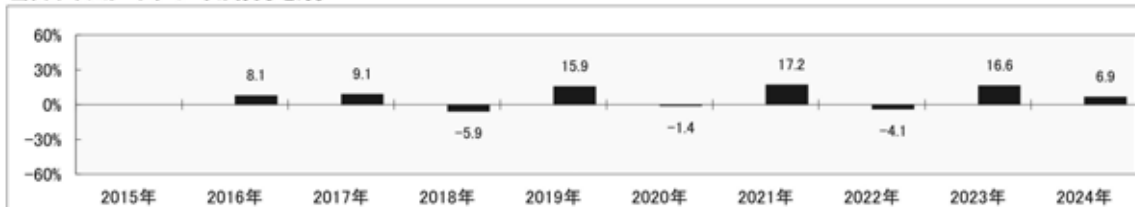
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
トピックス・インデックス・MF	12.9%	外国株式・先物	1,614	24.0%	日本円	38.3%	PROLOGIS INC	アメリカ	1.1%
外国株式INDEXMF	12.8%	外国債券	1,201	23.4%	米ドル	26.4%	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	アメリカ	0.9%
ダイワJ-REIT MF	12.4%	国内株式・先物	2,126	12.9%	ユーロ	5.5%	MSCI EMER MKT INDEX (OCE) JUN 24	アメリカ	0.9%
ダイワ・グローバルREIT INDEX MF	12.4%	外国リート・先物	308	12.5%	香港ドル	3.6%	日本ビルファンド	日本	0.8%
ダイワ新興国株式F・INDEX・MF	12.3%	国内リート・先物	59	12.4%	ブラジル・レアル	2.9%	EQUINIX INC	アメリカ	0.7%
外国債券INDEXMF	12.1%	国内債券	360	11.9%	オフショア人民元	2.9%	トヨタ自動車	日本	0.7%
ダイワ新興国債券インデックス・MF	12.0%	外国投資信託等	7	1.1%	台湾ドル	2.0%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.7%
日本債券インデックスMF(BPI)	11.9%				英ポンド	1.7%	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.6%
					メキシコ・ペソ	1.6%	野村不動産マスターF	日本	0.6%
		コール・ローン、その他		4.3%	その他	15.1%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	0.6%
合計	99.0%	合計	5,675	-	合計	100.0%	合計		7.4%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2016年は設定日(9月8日)から年末、2024年は3月29日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

(参考情報) ファンドの総経費率

	総経費率 (①+②)	運用管理費用の比率 ①	その他費用の比率 ②
iFree 8資産バランス	0.29%	0.24%	0.05%

※対象期間は2022年9月8日～2023年9月7日です。

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行またはロンドンの銀行のいずれかの休業日と同じ日付の日を取得申込受付日とする受益権の取得申込みの受け付けを行いません。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

（2024年11月4日まで）

継続申込期間においては、委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた取得の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

（2024年11月5日以降）

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

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（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受け付けを中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消することができるものとし、

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、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないません。受託会社は、信託契約締結日に生じた受益権については信託契約締結時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないません。

2【換金（解約）手続等】

(2024年11月4日まで)

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

(2024年11月5日以降)

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

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

<一部解約>

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

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行またはロンドンの銀行のいずれかの休業日と同じ日付の日を一部解約請求受付日とする一部解約の実行の請求の受けを行いません。

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生した場合には、一部解約の実行の請求の受けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受けたものとして、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に一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター）

0120-106212（営業日の9:00～17:00）

ホームページ

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

毎年9月8日から翌年9月7日までとします。

上記にかかわらず、上記により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）

が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日から次の計算期間が開始されるものとします。

(5)【その他】

- ① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が 30 億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、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。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに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、②の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
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。

② 信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第 16 条第 2 号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本②の 1. から 7. までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。
2. 委託会社は、前 1. の事項（前 1. の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前 1. の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の 2 週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前 2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本 3. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前 2. の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の 3 分の 2 以上にあ

たる多数をもって行ないます。

5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前2. から前5. までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1. から前6. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1. から前7. までの規定にしたがいます。

③ 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

④ 運用報告書

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

⑤ 公告

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

⑥ 関係法人との契約の更改

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

4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

<収益分配金および償還金にかかる請求権>

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

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

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

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

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

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

<換金請求権>

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

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間(2022年9月8日から2023年9月7日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

2023年10月20日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 秋山 範之
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹内 知明
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている i F r e e 8 資産バランスの2022年9月8日から2023年9月7日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、i F r e e 8 資産バランスの2023年9月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

1 【財務諸表】

i F r e e 8 資産バランス

(1) 【貸借対照表】

	第6期 2022年9月7日現在 金額(円)	第7期 2023年9月7日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	518,647,063	727,156,324
親投資信託受益証券	45,128,094,473	60,020,072,805
流動資産合計	45,646,741,536	60,747,229,129
資産合計	45,646,741,536	60,747,229,129
負債の部		
流動負債		
未払解約金	15,502,315	54,702,668
未払受託者報酬	4,643,907	6,109,576
未払委託者報酬	46,439,355	61,096,073
その他未払費用	1,106,352	1,108,009
流動負債合計	67,691,929	123,016,326
負債合計	67,691,929	123,016,326
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	30,252,717,145	37,138,831,604
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	15,326,332,462	23,485,381,199
(分配準備積立金)	6,473,943,266	10,613,224,628
元本等合計	45,579,049,607	60,624,212,803
純資産合計	45,579,049,607	60,624,212,803
負債純資産合計	45,646,741,536	60,747,229,129

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第6期 自2021年9月8日 至2022年9月7日 金額(円)	第7期 自2022年9月8日 至2023年9月7日 金額(円)
営業収益		
受取利息	117	215
有価証券売買等損益	1,386,390,160	4,825,485,332
その他収益	378	-
営業収益合計	1,386,390,655	4,825,485,547
営業費用		
支払利息	88,837	257,980
受託者報酬	8,638,589	11,247,319
委託者報酬	86,386,630	112,473,921
その他費用	2,199,095	2,199,910
営業費用合計	97,313,151	126,179,130
営業利益又は営業損失(△)	1,289,077,504	4,699,306,417
経常利益又は経常損失(△)	1,289,077,504	4,699,306,417
当期純利益又は当期純損失(△)	1,289,077,504	4,699,306,417
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(△)	△5,509,644	47,652,338
期首剰余金又は期首欠損金(△)	10,970,215,271	15,326,332,462
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,177,530,659	4,925,817,537
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	4,177,530,659	4,925,817,537
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,116,000,616	1,418,422,879
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	1,116,000,616	1,418,422,879
分配金 ※1	-	-
期末剰余金又は期末欠損金(△)	15,326,332,462	23,485,381,199

(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7期 自2022年9月8日 至2023年9月7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6期 2022年9月7日現在	第7期 2023年9月7日現在
1. ※1 期首元本額	23,584,320,551円	30,252,717,145円
期中追加設定元本額	9,073,700,420円	9,706,776,681円
期中一部解約元本額	2,405,303,826円	2,820,662,222円
2. 計算期間末日における受益権の総数	30,252,717,145口	37,138,831,604口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第6期 自2021年9月8日 至2022年9月7日	第7期 自2022年9月8日 至2023年9月7日
※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(1,294,595,123円)、投資信託約款に規定される収益調整金(8,852,473,979円)及び分配準備積立金(5,179,348,143円)より分配対象額は15,326,417,245円(1万口当たり5,066.13円)であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(4,651,823,728円)、投資信託約款に規定される収益調整金(12,872,404,291円)及び分配準備積立金(5,961,400,900円)より分配対象額は23,485,628,919円(1万口当たり6,323.74円)であり、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	第7期 自2022年9月8日 至2023年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

区分	第7期 自2022年9月8日 至2023年9月7日
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	第7期 2023年9月7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6期 2022年9月7日現在	第7期 2023年9月7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	1,374,333,643	4,794,063,610
合計	1,374,333,643	4,794,063,610

(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6期 2022年9月7日現在	第7期 2023年9月7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7期
自 2022年9月8日
至 2023年9月7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6期 2022年9月7日現在	第7期 2023年9月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5066円 (15,066円)	1.6324円 (16,324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	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	3,332,087,756	7,533,183,998	
	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	4,306,987,128	7,361,933,097	
	トピックス・インデックス・マザーファンド	4,560,584,662	7,726,542,534	
	外国株式インデックスマザーファンド	1,457,394,551	7,549,158,034	
	外国債券インデックスマザーファンド	2,218,246,601	7,432,457,061	
	ダイワJ-REITマザーファンド	2,227,129,451	7,563,554,328	
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	2,247,903,767	7,454,498,472	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	6,035,357,926	7,398,745,281	
親投資信託受益証券 合計			60,020,072,805	
合計			60,020,072,805	

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、「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」受益証券、「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」受益証券、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「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、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）」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。

「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年9月7日現在 金額(円)	2023年9月7日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	778,690,457	1,881,193,977
コール・ローン	618,308,382	1,074,957,158
株式	18,427,388,822	24,445,244,321
投資証券	2,245,381,056	2,670,661,404
派生商品評価勘定	13,485,160	-
未収入金	-	296,193
未収配当金	93,117,070	114,475,747
差入委託証拠金	737,829,681	459,963,654
流動資産合計	22,914,200,628	30,646,792,454
資産合計	22,914,200,628	30,646,792,454
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	100,875,270	106,175,058
未払解約金	16,723,723	14,702,700
その他未払費用	836,493	260,283
流動負債合計	118,435,486	121,138,041
負債合計	118,435,486	121,138,041
純資産の部		
元本等		
元本	※1 11,245,719,039	13,502,028,807
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	11,550,046,103	17,023,625,606
元本等合計	22,795,765,142	30,525,654,413
純資産合計	22,795,765,142	30,525,654,413
負債純資産合計	22,914,200,628	30,646,792,454

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2022 年 9 月 8 日 至 2023 年 9 月 7 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>

区分	自 2022 年 9 月 8 日 至 2023 年 9 月 7 日
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2022 年 9 月 7 日現在	2023 年 9 月 7 日現在
1. ※1 期首	2021 年 9 月 8 日	2022 年 9 月 8 日
期首元本額	8,253,886,066 円	11,245,719,039 円
期中追加設定元本額	3,465,779,206 円	2,831,987,995 円
期中一部解約元本額	473,946,233 円	575,678,227 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
新興国株式インデックスファン ド (FOFs 用) (適格機関投資家 専用)	51,752,959 円	90,470,254 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)	286,946,745 円	400,976,697 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)	348,893,955 円	325,203,695 円
D-I's 新興国株式インデッ クス	133,154,678 円	133,069,415 円
i F r e e 新興国株式インデッ クス	4,525,037,082 円	5,560,118,546 円
i F r e e 8資産バランス	2,879,253,653 円	3,332,087,756 円
ダイワ新興国株式インデックス (為替ヘッジなし) (投資一任 専用)	5,497,605 円	7,044,784 円
新興国株式ファンダメンタル・ インデックスファンド (為替ヘ ッジなし/適格機関投資家専 用)	1,226,097,453 円	1,669,321,400 円
DCダイワ新興国株式ファンダ メンタル・インデックスファン ド	1,336,122,468 円	1,503,516,736 円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式	358,090,070 円	361,669,267 円

区分	2022年9月7日現在	2023年9月7日現在
ダイワ・ノーロード 新興国株式 ファンド	94,872,371 円	118,550,257 円
計	11,245,719,039 円	13,502,028,807 円
2. 期末日における受益権の総数	11,245,719,039 口	13,502,028,807 口

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2022年9月8日 至 2023年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年9月7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。

区分	2023年9月7日現在
	(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)
売買目的有価証券

種類	2022年9月7日現在	2023年9月7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	87,652,364	△216,143,582
投資証券	△11,226,905	△40,246,781
合計	76,425,459	△256,390,363

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

(デリバティブ取引に関する注記)
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種類	2022年9月7日現在				2023年9月7日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買建	2,061,200,643	-	1,960,325,373	△100,875,270	2,819,856,971	-	2,713,681,913	△106,175,058
合計	2,061,200,643	-	1,960,325,373	△100,875,270	2,819,856,971	-	2,713,681,913	△106,175,058

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

2. 通貨関連

種類	2022年9月7日現在				2023年9月7日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の 取引								

種類	2022年9月7日現在				2023年9月7日現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1年超				うち 1年超		
為替予約取引								
買建	614,274,530	-	627,759,690	13,485,160	-	-	-	-
アメリカ・ドル	614,274,530	-	627,759,690	13,485,160	-	-	-	-
合計	614,274,530	-	627,759,690	13,485,160	-	-	-	-

(注) 1. 時価の算定方法

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

(1口当たり情報)

	2022年9月7日現在	2023年9月7日現在
1口当たり純資産額	2.0271円	2.2608円
(1万口当たり純資産額)	(20,271円)	(22,608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	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF	29,000	0.000	0.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	25,900	15.540	402,486.000	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	17,200	7.410	127,452.000	
	CANADIAN SOLAR INC	4,300	27.210	117,003.000	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	15,600	6.860	107,016.000	
	NIO INC - ADR	15,300	10.580	161,874.000	
	PINDUODUO INC-ADR	1,500	101.590	152,385.000	
	KE HOLDINGS INC-ADR	11,800	17.910	211,338.000	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	121,500	1.210	147,015.000	
	SBERBANK ROSSII	698,708	0.000	0.000	
	JINKOSOLAR HOLDING ADR REP LTD	3,500	32.180	112,630.000	
	BANK VTB	382,434,000	0.000	0.000	
	NK LUKOIL	23,088	0.000	0.000	
	MOBILNYE TELESISTEMY	70,700	0.000	0.000	
	NK ROSNEFT	97,499	0.000	0.000	
	MAGNIT	4,678	0.000	0.000	
	SURGUTNEFTEGAZ	360,750	0.000	0.000	
	TATNEFT	57,648	0.000	0.000	
	GAZPROM	853,478	0.000	0.000	
	GMK NORILSKIY NIKEL	1,829	0.000	0.000	
	NOVATEK	26,980	0.000	0.000	
	360 DIGITECH ADR INC	7,900	16.965	134,023.500	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	7,290	0.000	0.000	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	3	0.000	0.000	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	4	0.000	0.000	
	SEVERSTAL - GDR REG S	13,460	0.000	0.000	
	TATNEFT PJSC - PREF	21,009	0.000	0.000	
SISTEMA PJSFC	319,200	0.000	0.000		
INTER RAO UES PJSC	2,726,100	0.000	0.000		
ALROSA PJSC	180,310	0.000	0.000		
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	56,619	0.000	0.000		
AEROFLOT PJSC	164,910	0.000	0.000		
アメリカ・ドル 小計				1,673,222.500 (247,536,536)	
インド・ルピー	BHARTI AIRTEL PARTLY PAID LTD	8,618	486.400	4,191,795.200	
	JIO FINANCIAL SERVICES LTD	87,477	252.850	22,118,559.450	
	TATA STEEL LTD	664,891	129.600	86,169,873.600	
	AXIS BANK LTD	58,079	965.050	56,049,138.950	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,630	10,178.850	26,770,375.500	
	TATA POWER CO LTD	53,241	257.500	13,709,557.500	
	BANK OF BARODA	80,231	195.000	15,645,045.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	11,045	2,523.500	27,872,057.500	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	63,216	254.700	16,101,115.200	
	STATE BANK OF INDIA	87,110	570.500	49,696,255.000	
	NTPC LTD	179,161	231.900	41,547,435.900	
	POWER FINANCE CORPORATION	137,108	257.500	35,305,310.000	
	JSW STEEL LTD	37,761	814.900	30,771,438.900	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	158,991	254.500	40,463,209.500	
	INDIAN OIL CORP LTD	205,109	91.350	18,736,707.150	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	49,066	353.150	17,327,657.900	
	STEEL AUTHORITY OF INDIA	172,376	99.300	17,116,936.800	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	16,722	702.450	11,746,368.900	
	ULTRATECH CEMENT LTD	1,694	8,537.400	14,462,355.600	
	SHRIRAM FINANCE LTD	8,766	1,892.600	16,590,531.600	
	TECH MAHINDRA LTD	20,208	1,248.950	25,238,781.600	
	TATA MOTORS LTD-A-DVR	29,197	407.200	11,889,018.400	
	REC LTD	167,700	234.650	39,350,805.000	
	COAL INDIA LTD	124,408	255.800	31,823,566.400	
	BAJAJ FINANCE LTD	2,052	7,387.800	15,159,765.600	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE L	101,611	190.050	19,311,170.550	
	GAIL INDIA LTD	212,551	124.600	26,483,854.600	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	100,966	478.150	48,276,892.900	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	8,916	1,838.500	16,392,066.000	
	WIPRO LTD	30,047	429.300	12,899,177.100	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	16,975	3,429.900	58,222,552.500	
	INFOSYS LTD	67,287	1,477.450	99,413,178.150	
	LARSEN & TOUBRO LTD	19,069	2,730.450	52,066,951.050	
	TATA MOTORS LTD	150,626	610.250	91,919,516.500	
	ICICI BANK LTD	29,101	957.500	27,864,207.500	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	87,477	2,428.700	212,455,389.900	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	213,969	183.050	39,167,025.450	
	ITC LTD	65,064	447.450	29,112,886.800	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	27,810	1,577.000	43,856,370.000	
	HERO MOTOCORP LTD	6,397	2,938.000	18,794,386.000	
	BHARTI AIRTEL LTD	40,759	880.300	35,880,147.700	
	UPL LTD	19,876	609.350	12,111,440.600	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	16,362	1,142.350	18,691,130.700	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	16,258	1,235.850	20,092,449.300	
	VEDANTA LTD	121,575	241.350	29,342,126.250	
インド・ルピー	小計			1,598,206,581.700 (2,860,789,781)	
インドネシア・ルピア	GOTO GOJEK TOKOPEDIA	25,467,000	91.000	2,317,497,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	83,300	27,400.000	2,282,420,000.000	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	761,000	6,525.000	4,965,525,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	2,074,600	3,790.000	7,862,734,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	331,100	9,575.000	3,170,282,500.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	848,700	9,150.000	7,765,605,000.000	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	1,378,000	6,050.000	8,336,900,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	2,368,200	5,575.000	13,202,715,000.000	
	ADARO ENERGY TBK PT	949,800	2,870.000	2,725,926,000.000	
インドネシア・ルピア 小計				52,629,604,500.000 (510,507,164)	
オフショア・人 民元	CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	228,100	2.300	524,630.000	
	INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	167,600	16.290	2,730,204.000	
	BANK OF BEIJING CO LTD -A	216,300	4.570	988,491.000	
	PING AN INSURANCE GROUP CO-A	71,800	51.030	3,663,954.000	
	IND & COMM BK OF CHINA-A	474,600	4.610	2,187,906.000	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	16,000	17.640	282,240.000	
	KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	800	1,861.000	1,488,800.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	31,800	26.300	836,340.000	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	68,100	14.090	959,529.000	
	SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	342,900	7.090	2,431,161.000	
	CITIC SECURITIES CO-A	29,600	22.130	655,048.000	
	CHINA MERCHANTS BANK-A	89,500	33.360	2,985,720.000	
	PING AN BANK CO LTD-A	114,600	11.430	1,309,878.000	
	CHINA STATE CONSTRUCTION -A	583,200	5.730	3,341,736.000	
	HAIER SMART HOME CO LTD-A	22,200	24.610	546,342.000	
	SAIC MOTOR CORP LTD-A	108,200	14.800	1,601,360.000	
	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	43,900	3.840	168,576.000	
	CHINA COAL ENERGY CO-A	48,100	8.580	412,698.000	
	COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	61,660	9.840	606,734.400	
	METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	155,700	3.680	572,976.000	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	62,200	6.770	421,094.000	
	JIANGXI COPPER CO LTD-A	17,800	20.120	358,136.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP LTD A	7,500	19.680	147,600.000	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-A	30,600	6.050	185,130.000	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	918,600	3.460	3,178,356.000	
	BANK OF CHINA LTD-A	283,200	3.710	1,050,672.000	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	349,300	6.310	2,204,083.000	
	CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	58,100	21.810	1,267,161.000	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	378,600	5.560	2,105,016.000	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	42,100	29.680	1,249,528.000	
	CHINA VANKE CO LTD -A	98,900	14.170	1,401,413.000	
	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	43,400	30.480	1,322,832.000	
	CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	93,200	5.600	521,920.000	
	CHINA MINSHENG BANKING-A	354,700	3.800	1,347,860.000	
PICC HOLDING CO-A	67,700	5.930	401,461.000		
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	513,200	3.050	1,565,260.000		
CRRC CORP LTD-A	154,100	6.010	926,141.000		
CHINA UNITED NETWORK-A	230,300	5.180	1,192,954.000		
CGN POWER CO LTD-A	18,900	3.180	60,102.000		

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	HUATAI SECURITIES CO LTD-A	30,500	16.230	495,015.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD-A	46,300	9.940	460,222.000	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	291,300	6.870	2,001,231.000	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	188,000	6.420	1,206,960.000	
	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	14,200	41.560	590,152.000	
	HUAXIA BANK CO LTD-A	194,300	5.590	1,086,137.000	
	BYD CO LTD -A	2,000	250.450	500,900.000	
	WEICHAI POWER CO LTD-A	33,500	12.390	415,065.000	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	47,500	13.060	620,350.000	
	HUANENG POWER INTL INC-A	62,500	8.010	500,625.000	
	POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	180,200	4.920	886,584.000	
オフショア・人民元 小計				57,964,283.400 (1,170,426,403)	
サウジアラビア・リアル	SAUDI ARABIAN MINING	18,418	38.900	716,460.200	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS	4,565	140.000	639,100.000	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	30,537	89.900	2,745,276.300	
	SAUDI TELECOM CO	50,096	38.700	1,938,715.200	
	AL RAJHI BANK	37,678	71.900	2,709,048.200	
	RIYAD BANK	21,155	29.350	620,899.250	
	ALINMA BANK	26,079	35.500	925,804.500	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	79,803	35.250	2,813,055.750	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	81,299	34.000	2,764,166.000	
サウジアラビア・リアル 小計				15,872,525.400 (626,964,753)	
タイ・パーツ	SCB X PUBLIC COMPANY LIMITED NON-V	156,900	116.500	18,278,850.000	
	TRUE CORPORATION NON-VOTING DR PCL	684,900	6.700	4,588,830.000	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	27,100	168.000	4,552,800.000	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	60,500	311.000	18,815,500.000	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	38,500	131.000	5,043,500.000	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	97,900	131.000	12,824,900.000	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	3,155,100	1.730	5,458,323.000	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	132,700	28.000	3,715,600.000	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	46,500	214.000	9,951,000.000	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	581,700	19.500	11,343,150.000	
	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	577,300	8.400	4,849,320.000	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	158,700	27.500	4,364,250.000	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	71,100	166.000	11,802,600.000	
	IRPC PCL - NVDR	1,474,100	2.280	3,360,948.000	
	BANGCHAK CORP PCL-NVDR	120,000	38.000	4,560,000.000	
	PTT PCL-NVDR	1,511,500	35.250	53,280,375.000	
	THAI OIL PCL-NVDR	112,700	49.250	5,550,475.000	
	CP ALL PCL-NVDR	220,600	64.250	14,173,550.000	
	BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	71,100	168.000	11,944,800.000	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	444,700	8.400	3,735,480.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	459,900	21.200	9,749,880.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	241,800	36.250	8,765,250.000	
タイ・パーツ 小計				230,709,381.000 (959,751,025)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	4,301,481	40.370	173,650,787.970	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	2,472	54,080.000	133,685,760.000	
	FALABELLA SA	65,241	2,040.000	133,091,640.000	
	BANCO DE CHILE	2,345,213	89.010	208,747,409.130	
チリ・ペソ 小計				649,175,597.100 (109,745,082)	
トルコ・リラ	AKBANK T. A. S.	385,743	31.400	12,112,330.200	
	TURKIYE IS BANKASI-C	367,978	24.560	9,037,539.680	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	126,032	57.450	7,240,538.400	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	57,946	144.000	8,344,224.000	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	112,180	46.460	5,211,882.800	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	100,694	61.100	6,152,403.400	
	YAPI VE KREDI BANKASI	452,961	16.890	7,650,511.290	
	KOC HOLDING AS	82,710	141.900	11,736,549.000	
	TURK HAVA YOLLARI AO	41,697	245.000	10,215,765.000	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	31,799	258.800	8,229,581.200	
トルコ・リラ 小計				85,931,324.970 (474,693,233)	
ブラジル・リアル	ITAUSA INVESTIMENTOS ITAU PREF SA	2,118	2.600	5,506.800	
	MARFRIG FRIGORIFICOS SA	67,520	0.140	9,452.800	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	31,000	8.060	249,860.000	
	ENERGISA SA-UNITS	19,000	45.270	860,130.000	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	35,300	41.300	1,457,890.000	
	VIBRA ENERGIA SA	172,400	18.670	3,218,708.000	
	VIA SA	404,000	1.200	484,800.000	
	NATURA &CO HOLDING SA	71,000	14.990	1,064,290.000	
	TIM SA	56,726	14.380	815,719.880	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	35,800	12.500	447,500.000	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	665,400	33.520	22,304,208.000	
	USINAS SIDER MINAS GER-PF A	78,700	6.920	544,604.000	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	569,959	14.380	8,196,010.420	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	368,336	26.730	9,845,621.280	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	65,800	12.170	800,786.000	
	VALE SA	248,290	68.000	16,883,720.000	
	GERDAU SA-PREF	87,360	25.390	2,218,070.400	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	472,500	37.000	17,482,500.000	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	91,473	12.110	1,107,738.030	
	ITAUSA SA	152,342	9.010	1,372,601.420	
	BRASKEM SA-PREF A	48,400	23.850	1,154,340.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	13,400	37.570	503,438.000	
	BANCO DO BRASIL S. A.	101,400	46.780	4,743,492.000	
COSAN SA	66,000	17.450	1,151,700.000		

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
ブラジル・リアル	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	71,000	34.170	2,426,070.000	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	146,000	8.490	1,239,540.000	
	EMBRAER SA	46,200	19.410	896,742.000	
	METALURGICA GERDAU SA-PREF	139,000	11.670	1,622,130.000	
	CCR SA	77,900	12.260	955,054.000	
	BRF SA	206,900	9.040	1,870,376.000	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	20,500	57.860	1,186,130.000	
	LOJAS RENNER S. A.	43,575	15.570	678,462.750	
	JBS SA	146,600	18.550	2,719,430.000	
	USINAS SIDERURGICAS DE MINAS	28,200	7.120	200,784.000	
	SUZANO SA	24,945	49.860	1,243,757.700	
	MARFRIG GLOBAL FOODS SA	143,400	7.300	1,046,820.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	197,200	12.540	2,472,888.000	
	CIELO SA	176,928	3.710	656,402.880	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	37,500	30.700	1,151,250.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GER	31,830	19.000	604,770.000	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,000	26.700	1,201,500.000	
	TELEFONICA BRASIL S. A.	40,600	41.730	1,694,238.000	
	KLABIN SA - UNIT	39,600	22.430	888,228.000	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	130,400	18.340	2,391,536.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	59,700	22.800	1,361,160.000	
COGNA EDUCACAO	309,100	2.900	896,390.000		
BANCO BRADESCO S. A.	154,021	12.800	1,971,468.800		
AMBEV SA	206,300	13.980	2,884,074.000		
ブラジル・リアル 小計			131,181,889.160 (3,895,865,981)		
マレーシア・リンギット	MALAYAN BANKING BHD	133,800	9.180	1,228,284.000	
	PUBLIC BANK BERHAD	309,600	4.250	1,315,800.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	824,400	0.785	647,154.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	110,400	7.200	794,880.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	299,700	5.720	1,714,284.000	
マレーシア・リンギット 小計			5,700,402.000 (180,198,257)		
メキシコ・ペソ	AMERICA MOVIL L	1,382,100	16.040	22,168,884.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	21,615	146.850	3,174,162.750	
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	281,600	14.130	3,979,008.000	
	CEMEX SAB-CPO	1,206,119	13.310	16,053,443.890	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	80,800	192.400	15,545,920.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	15,700	161.720	2,539,004.000	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	37,400	84.220	3,149,828.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	127,400	83.540	10,642,996.000	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	153,600	67.380	10,349,568.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	109,300	144.840	15,831,012.000	
メキシコ・ペソ 小計			103,433,826.640 (869,578,523)		
香港・ドル	TRIP.COM GROUP LTD	13,750	302.200	4,155,250.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	7,950	418.800	3,329,460.000	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	765,000	4.240	3,243,600.000	
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	298,000	9.820	2,926,360.000	
	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	18,000	45.950	827,100.000	
	TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	116,000	11.420	1,324,720.000	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	147,000	13.120	1,928,640.000	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	150,000	7.970	1,195,500.000	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	3,521,800	4.610	16,235,498.000	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	65,500	7.950	520,725.000	
	TENCENT HOLDINGS LTD	87,700	327.600	28,730,520.000	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	158,000	15.240	2,407,920.000	
	PETROCHINA CO LTD-H	2,874,000	5.850	16,812,900.000	
	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	37,500	23.650	886,875.000	
	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	1,593,120	0.760	1,210,771.200	
	HUANENG POWER INTL INC-H	356,000	3.900	1,388,400.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	120,000	22.400	2,688,000.000	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	90,000	6.230	560,700.000	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	5,500,000	4.330	23,815,000.000	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	114,000	8.630	983,820.000	
	CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	816,000	3.590	2,929,440.000	
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	107,500	9.950	1,069,625.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	99,600	10.460	1,041,816.000	
	HENGAN INTL GROUP CO LTD	37,500	29.050	1,089,375.000	
	POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	922,000	3.940	3,632,680.000	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	240,000	23.450	5,628,000.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	211,120	5.830	1,230,829.600	
	SINOPHARM GROUP CO-H	69,600	21.100	1,468,560.000	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	190,000	34.400	6,536,000.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LTD	177,000	14.120	2,499,240.000	
	SINO BIOPHARMACEUTICAL	295,500	2.960	874,680.000	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	40,300	21.600	870,480.000	
	BYD CO LTD-H	7,000	249.200	1,744,400.000	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	4,224,000	2.760	11,658,240.000	
	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	93,600	20.500	1,918,800.000	
	PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	733,000	2.770	2,030,410.000	
	CITIC LTD	184,000	7.720	1,420,480.000	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	241,500	8.030	1,939,245.000	
	IND & COMM BK OF CHINA-H	6,956,000	3.740	26,015,440.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	24,000	42.800	1,027,200.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	170,500	5.000	852,500.000	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	62,000	10.140	628,680.000	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	2,048,000	0.770	1,576,960.000	
	XIAOMI CORP-CLASS B	590,400	11.760	6,943,104.000	
	MEITUAN-CLASS B	31,190	128.300	4,001,677.000	
	SEAZEN GROUP LTD	546,000	1.860	1,015,560.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	456,200	92.250	42,084,450.000	
	CHINA FEIHE LTD	187,000	4.760	890,120.000	
	CHINA ENERGY ENGINEERING C-H	518,000	0.920	476,560.000	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	134,000	6.090	816,060.000	
	JD.COM INC - CL A	91,245	132.600	12,099,087.000	
	NETEASE INC	38,400	157.600	6,051,840.000	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC	6,950	197.800	1,374,710.000	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	35,100	44.250	1,553,175.000	
	METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	420,000	1.740	730,800.000	
	HAIER SMART HOME CO LTD-H	73,200	24.850	1,819,020.000	
	KUAISHOU TECHNOLOGY	18,800	65.650	1,234,220.000	
	BAIDU INC-CLASS A	76,150	139.700	10,638,155.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	337,000	17.580	5,924,460.000	
	CRRC CORP LTD - H	299,000	3.900	1,166,100.000	
	CGN POWER CO LTD-H	710,000	1.980	1,405,800.000	
	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	541,500	49.050	26,560,575.000	
	CHINA COAL ENERGY CO-H	163,000	5.750	937,250.000	
	COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	240,050	7.940	1,905,997.000	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	95,000	10.040	953,800.000	
	CHINA MINSHENG BANKING COR-H	913,080	2.580	2,355,746.400	
	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	3,584,000	1.220	4,372,480.000	
	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	15,600	89.550	1,396,980.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	248,000	10.060	2,494,880.000	
	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	18,500	77.000	1,424,500.000	
	CHINA MENGNIU DAIRY CO	79,000	26.650	2,105,350.000	
	PICC PROPERTY & CASUALTY-H	500,000	9.450	4,725,000.000	
	LI NING CO LTD	16,500	38.000	627,000.000	
	WEICHAI POWER CO LTD-H	159,000	10.640	1,691,760.000	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	418,000	3.040	1,270,720.000	
	SUNNY OPTICAL TECH	13,400	64.500	864,300.000	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	270,000	4.390	1,185,300.000	
	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	211,600	19.400	4,105,040.000	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	69,600	12.380	861,648.000	
	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	327,000	12.480	4,080,960.000	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	25,200	54.950	1,384,740.000	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	205,000	4.440	910,200.000	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	136,000	13.020	1,770,720.000	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	110,000	8.810	969,100.000	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	318,000	4.330	1,376,940.000	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,109,100	4.560	5,057,496.000	
	AGILE GROUP HOLDINGS LTD	518,000	1.140	590,520.000	
	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	357,000	2.820	1,006,740.000	
	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	917,000	1.390	1,274,630.000	
	SINOTRUK HONG KONG LTD	70,000	14.520	1,016,400.000	
	CHINA MERCHANTS BANK-H	221,000	33.000	7,293,000.000	
	BANK OF CHINA LTD-H	5,310,000	2.710	14,390,100.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	CITIC SECURITIES CO LTD-H	76,500	15.780	1,207,170.000	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	499,000	2.290	1,142,710.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	231,200	4.910	1,135,192.000	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	181,000	17.900	3,239,900.000	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	124,000	6.550	812,200.000	
香港・ドル 小計				403,576,782.200 (7,611,458,112)	
台湾・ドル	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	47,000	165.000	7,755,000.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	9,000	473.000	4,257,000.000	
	SINO-AMERICAN SILICON PRODUC	27,000	158.500	4,279,500.000	
	TAIWAN CEMENT	381,247	34.400	13,114,896.800	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	239,000	118.000	28,202,000.000	
	THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	74,000	42.200	3,122,800.000	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	117,112	70.300	8,232,973.600	
	FORMOSA PLASTICS CORP	117,600	81.200	9,549,120.000	
	NAN YA PLASTICS CORP	131,140	67.100	8,799,494.000	
	WALSIN LIHWA CORP	133,000	37.400	4,974,200.000	
	CHINA STEEL CORP	452,686	26.800	12,131,984.800	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	117,616	134.500	15,819,352.000	
	DELTA ELECTRONICS INC	55,000	345.000	18,975,000.000	
	YAGEO CORPORATION	16,734	505.000	8,450,670.000	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	173,000	26.850	4,645,050.000	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	74,000	62.500	4,625,000.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	17,000	448.500	7,624,500.000	
	QUANTA COMPUTER INC	110,000	254.000	27,940,000.000	
	AUO CORP	651,600	16.850	10,979,460.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	162,400	117.000	19,000,800.000	
	MEDIATEK INC	41,003	712.000	29,194,136.000	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	40,000	182.500	7,300,000.000	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	107,800	107.000	11,534,600.000	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	188,000	42.600	8,008,800.000	
	CHINA AIRLINES LTD	171,000	23.100	3,950,100.000	
	WAN HAI LINES LTD	58,000	46.300	2,685,400.000	
	EVA AIRWAYS CORP	120,000	31.650	3,798,000.000	
	FUBON FINANCIAL HOLDING CO	237,462	61.400	14,580,166.800	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	419,838	45.800	19,228,580.400	
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	519,000	11.850	6,150,150.000	
	E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	398,140	24.350	9,694,709.000	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	265,607	24.250	6,440,969.750	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	288,809	35.550	10,267,159.950	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	251,729	17.850	4,493,362.650		
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	433,231	9.460	4,098,365.260		
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	391,863	17.150	6,720,450.450		
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	579,028	23.650	13,694,012.200		
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	223,157	26.400	5,891,344.800		
LARGAN PRECISION CO LTD	4,000	2,120.000	8,480,000.000		

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	26,000	425.000	11,050,000.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	37,000	187.000	6,919,000.000	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	49,000	93.400	4,576,600.000	
	WISTRON CORP	202,110	113.500	22,939,485.000	
	INNOLUX CORP	637,806	13.750	8,769,832.500	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	77,000	71.300	5,490,100.000	
	PEGATRON CORP	65,000	77.800	5,057,000.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	43,000	99.000	4,257,000.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	34,713	179.500	6,230,983.500	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	176,988	26.100	4,619,386.800	
	POU CHEN	130,000	28.900	3,757,000.000	
	COMPAL ELECTRONICS	172,000	32.000	5,504,000.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	464,000	550.000	255,200,000.000	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	541,902	106.000	57,441,612.000	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	20,000	267.500	5,350,000.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	39,760	403.500	16,043,160.000	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	152,000	28.600	4,347,200.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	474,000	46.700	22,135,800.000	
	台湾・ドル 小計			848,377,268.260 (3,923,066,164)	
南アフリカ・ランド	GOLD FIELDS LTD	32,182	235.120	7,566,631.840	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,041	1,592.220	3,249,721.020	
	OLD MUTUAL LTD	181,777	12.840	2,334,016.680	
	VODACOM GROUP LTD	26,291	109.610	2,881,756.510	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	23,499	244.410	5,743,390.590	
	NEDBANK GROUP LTD	19,667	207.290	4,076,772.430	
	BIDVEST GROUP LTD	11,604	264.650	3,070,998.600	
	BID CORP LTD	14,123	440.950	6,227,536.850	
	STANDARD BANK GROUP LTD	52,879	192.420	10,174,977.180	
	SASOL LTD	37,533	255.680	9,596,437.440	
	DISCOVERY LTD	20,781	146.320	3,040,675.920	
	EXXARO RESOURCES LTD	13,792	167.380	2,308,504.960	
	KUMBA IRON ORE LTD	6,200	424.430	2,631,466.000	
	SANLAM LTD	76,490	68.420	5,233,445.800	
	FIRSTRAND LTD	183,484	72.000	13,210,848.000	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	43,925	71.250	3,129,656.250	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	22,627	94.500	2,138,251.500	
	ABSA GROUP LTD	42,012	178.620	7,504,183.440	
	NASPERS LTD-N SHS	2,151	3,356.520	7,219,874.520	
	MTN GROUP LTD	78,402	121.770	9,547,011.540	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	33,374	86.000	2,870,164.000	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	17,138	323.050	5,536,430.900	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	23,478	97.180	2,281,592.040	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	3,572	617.930	2,207,245.960	
	SIBANYE STILLWATER LTD	253,840	27.040	6,863,833.600	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
南アフリカ・ランド 小計				130,645,423.570 (1,004,663,307)	
合計				24,445,244,321 [24,445,244,321]	

(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	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	971,600	18,052,328.000	
	アメリカ・ドル 小計			18,052,328.000 (2,670,661,404)	
投資証券 合計				2,670,661,404 [2,670,661,404]	
合計				2,670,661,404 [2,670,661,404]	

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 32 銘柄 投資証券 1 銘柄	8.5%	91.5%	10.8%
インド・ルピー	株式 45 銘柄	100%	-%	10.6%
インドネシア・ルピア	株式 9 銘柄	100%	-%	1.9%
オフショア・人民元	株式 50 銘柄	100%	-%	4.3%
サウジアラビア・リアル	株式 9 銘柄	100%	-%	2.3%
タイ・バーツ	株式 22 銘柄	100%	-%	3.5%
チリ・ペソ	株式 4 銘柄	100%	-%	0.4%
トルコ・リラ	株式 10 銘柄	100%	-%	1.8%
ブラジル・リアル	株式 48 銘柄	100%	-%	14.4%
マレーシア・リンギット	株式 5 銘柄	100%	-%	0.7%
メキシコ・ペソ	株式 10 銘柄	100%	-%	3.2%
香港・ドル	株式 97 銘柄	100%	-%	27.9%
台湾・ドル	株式 57 銘柄	100%	-%	14.5%
南アフリカ・ランド	株式 25 銘柄	100%	-%	3.7%

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。

「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年9月7日現在 金額(円)	2023年9月7日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	295,135,776	497,034,953
コール・ローン	242,233,592	367,334,024
国債証券	26,564,405,009	36,861,021,593
派生商品評価勘定	1,409,927	316,616
未収入金	21,074,757	-
未収利息	380,147,146	525,751,454
前払費用	47,887,203	54,669,698
流動資産合計	27,552,293,410	38,306,128,338
資産合計	27,552,293,410	38,306,128,338
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	793,388
未払金	207,104,049	419,216,339
未払解約金	988,682	-
流動負債合計	208,092,731	420,009,727
負債合計	208,092,731	420,009,727
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	18,186,563,538	22,164,970,341
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	9,157,637,141	15,721,148,270
元本等合計	27,344,200,679	37,886,118,611
純資産合計	27,344,200,679	37,886,118,611
負債純資産合計	27,552,293,410	38,306,128,338

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2022 年 9 月 8 日 至 2023 年 9 月 7 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2022 年 9 月 7 日現在	2023 年 9 月 7 日現在
1. ※1 期首	2021 年 9 月 8 日	2022 年 9 月 8 日
期首元本額	15,130,772,827 円	18,186,563,538 円
期中追加設定元本額	3,902,208,938 円	4,664,924,600 円
期中一部解約元本額	846,418,227 円	686,517,797 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
新興国債券インデックスファン ド (FOFs 用) (適格機関投資家 専用)	261,076,057 円	402,473,784 円

区分	2022年9月7日現在	2023年9月7日現在
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)	321,919,003 円	393,920,951 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)	338,976,765 円	414,654,320 円
D-I's 新興国債券インデッ クス	60,023,406 円	65,606,912 円
iFree 新興国債券インデッ クス	5,324,895,015 円	7,236,364,923 円
iFree 8資産バランス	3,823,114,293 円	4,306,987,128 円
ダイワ新興国債券インデックス (為替ヘッジなし) (投資一任 専用)	1,392,324 円	3,201,403 円
DCダイワ新興国債券インデッ クスファンド	7,877,006,947 円	9,164,725,815 円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券	146,620,019 円	138,758,177 円
ダイワ・ノーロード 新興国債券 ファンド	31,539,709 円	38,276,928 円
計	18,186,563,538 円	22,164,970,341 円
2. 期末日における受益権の総数	18,186,563,538 口	22,164,970,341 口

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2022年9月8日 至 2023年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

区分	自 2022 年 9 月 8 日 至 2023 年 9 月 7 日
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023 年 9 月 7 日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)
売買目的有価証券

種類	2022 年 9 月 7 日現在	2023 年 9 月 7 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	187,739,598	△339,490,920
合計	187,739,598	△339,490,920

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

(デリバティブ取引に関する注記)
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	2022 年 9 月 7 日現在				2023 年 9 月 7 日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	96,822,776	-	98,232,703	1,409,927	179,974,919	-	179,498,147	△476,772
アメリカ・ドル	-	-	-	-	16,245,460	-	16,270,804	25,344
チェコ・コルナ	-	-	-	-	78,152,481	-	77,898,000	△254,481

種類	2022年9月7日現在				2023年9月7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)
トルコ・リラ	-	-	-	-	21,252,328	-	21,543,600	291,272
ハンガリー・ フォリント	-	-	-	-	31,252,650	-	31,009,363	△243,287
ポーランド・ ズロチ	43,586,860	-	43,987,837	400,977	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	20,134,540	-	20,562,114	427,574	33,072,000	-	32,776,380	△295,620
南アフリカ・ ランド	33,101,376	-	33,682,752	581,376	-	-	-	-
合計	96,822,776	-	98,232,703	1,409,927	179,974,919	-	179,498,147	△476,772

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2022年9月7日現在	2023年9月7日現在
1口当たり純資産額	1.5035円	1.7093円
(1万口当たり純資産額)	(15,035円)	(17,093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	インドネシア・ルピア	8.25% Indonesia Treasury Bond 20360515	11,250,000,000.000	12,854,812,500.000	
		8.75% Indonesia Treasury Bond 20310515	8,000,000,000.000	9,090,000,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20320815	5,500,000,000.000	5,889,620,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20380515	7,300,000,000.000	7,851,734,000.000	
		8.125% Indonesia Treasury Bond 20240515	10,000,000,000.000	10,122,900,000.000	
		8.375% Indonesia Treasury Bond 20390415	6,000,000,000.000	6,953,460,000.000	
		8.25% Indonesia Treasury Bond 20290515	12,000,000,000.000	13,076,400,000.000	
		7% Indonesia Treasury Bond 20300915	19,800,000,000.000	20,384,298,000.000	
		6.5% Indonesia Treasury Bond 20250615	19,700,000,000.000	19,781,361,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20350615	13,300,000,000.000	14,252,413,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20400415	17,500,000,000.000	18,892,475,000.000	
		5.5% Indonesia Treasury Bond 20260415	18,100,000,000.000	17,801,169,000.000	
		6.5% Indonesia Treasury Bond 20310215	20,800,000,000.000	20,781,488,000.000	
		6.25% Indonesia Treasury Bond 20360615	7,300,000,000.000	7,258,536,000.000	
		6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20320415	20,600,000,000.000	20,459,920,000.000	
		5.125% INDONESIA TREASURY BOND 20270415	15,700,000,000.000	15,224,447,000.000	
		7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20420615	14,200,000,000.000	14,857,460,000.000	
		6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20370715	2,700,000,000.000	2,673,972,000.000	
		7% INDONESIA TREASURY BOND 20330215	19,800,000,000.000	20,460,726,000.000	
		6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20280815	10,600,000,000.000	10,675,154,000.000	
		7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20430615	4,600,000,000.000	4,821,444,000.000	
		7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20380615	8,200,000,000.000	8,606,638,000.000	
		11% Indonesia Treasury Bond 20250915	3,600,000,000.000	3,921,984,000.000	
10.5% Indonesia Treasury Bond 20300815	3,480,000,000.000	4,264,740,000.000			

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		9.5% Indonesia Treasury Bond 20310715	2,970,000,000.000	3,524,142,600.000	
		8.375% Indonesia Treasury Bond 20260915	16,324,000,000.000	17,264,262,400.000	
		8.25% Indonesia Treasury Bond 20320615	4,750,000,000.000	5,314,110,000.000	
		7% Indonesia Treasury Bond 20270515	12,530,000,000.000	12,837,862,100.000	
		6.125% Indonesia Treasury Bond 20280515	13,950,000,000.000	13,886,667,000.000	
		6.625% Indonesia Treasury Bond 20330515	10,575,000,000.000	10,694,074,500.000	
		8.375% Indonesia Treasury Bond 20340315	17,920,000,000.000	20,325,580,800.000	
		9% Indonesia Treasury Bond 20290315	10,620,000,000.000	11,917,976,400.000	
		インドネシア・ルピア 小計		386,721,827,300.000 (3,751,201,726)	
	ウルグアイ・ペソ	8.5% Uruguay Government International Bond 20280315	2,800,000.000	2,725,632.000	
		8.25% Uruguay Government International Bond 20310521	7,000,000.000	6,583,500.000	
		9.75% URUGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 20330720	11,000,000.000	11,360,250.000	
		ウルグアイ・ペソ 小計		20,669,382.000 (80,724,272)	
	エジプト・ポンド	16.1% ARAB REP EGYPT 20290507	1,500,000.000	1,118,895.000	
		14.35% ARAB REP EGYPT 20240910	1,000,000.000	911,350.000	
		14.4% ARAB REP EGYPT 20290910	4,000,000.000	2,756,240.000	
		13.536% ARAB REP EGYPT 20250114	1,500,000.000	1,339,140.000	
		14.664% ARAB REP EGYPT 20301006	4,500,000.000	3,040,290.000	
		14.556% ARAB REP EGYPT 20271013	2,000,000.000	1,481,820.000	
		14.369% ARAB REP EGYPT 20251020	9,000,000.000	7,604,100.000	
		14.292% ARAB REP EGYPT 20280105	6,000,000.000	4,414,500.000	
		14.06% ARAB REP EGYPT 20260112	18,800,000.000	15,456,984.000	
		14.483% ARAB REP EGYPT 20260406	9,000,000.000	7,321,680.000	
		14.563% ARAB REP EGYPT 20260706	1,000,000.000	797,930.000	
		14.531% ARAB REP EGYPT 20240914	8,300,000.000	7,603,713.000	
		エジプト・ポンド 小計		53,846,642.000 (257,500,026)	
	オフショア・人民元	3.22% China Government Bond 20251206	3,700,000.000	3,790,317.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.25% China Government Bond 20281122	4,800,000.000	4,990,896.000	
		3.19% China Government Bond 20240411	4,000,000.000	4,030,760.000	
		3.29% China Government Bond 20290523	5,900,000.000	6,148,095.000	
		3.25% China Government Bond 20260606	4,800,000.000	4,942,176.000	
		3.12% China Government Bond 20261205	4,200,000.000	4,313,316.000	
		3.13% China Government Bond 20291121	5,700,000.000	5,892,489.000	
		2.94% China Government Bond 20241017	4,500,000.000	4,546,575.000	
		2.85% China Government Bond 20270604	4,800,000.000	4,875,264.000	
		2.68% China Government Bond 20300521	8,000,000.000	8,021,440.000	
		1.99% China Government Bond 20250409	6,500,000.000	6,476,145.000	
		3.02% China Government Bond 20251022	7,000,000.000	7,126,700.000	
		3.28% China Government Bond 20271203	5,000,000.000	5,187,600.000	
		3.27% China Government Bond 20301119	6,300,000.000	6,600,321.000	
		3.03% China Government Bond 20260311	3,900,000.000	3,980,886.000	
		3.81% China Government Bond 20500914	5,800,000.000	6,659,154.000	
		2.84% China Government Bond 20240408	4,000,000.000	4,018,320.000	
		3.01% China Government Bond 20280513	5,000,000.000	5,121,300.000	
		3.72% China Government Bond 20510412	2,000,000.000	2,265,100.000	
		3.02% China Government Bond 20310527	7,000,000.000	7,203,140.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	2,500,000.000	2,528,675.000	
		2.47% CHINA GOVERNMENT BOND 20240902	3,900,000.000	3,915,249.000	
		2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	1,800,000.000	1,834,200.000	
		3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	1,000,000.000	1,097,760.000	
		2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	3,500,000.000	3,553,935.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	2,800,000.000	2,798,656.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	3,000,000.000	3,012,690.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	3,500,000.000	3,540,950.000	
		2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	2,200,000.000	2,205,478.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	2,000,000.000	2,118,140.000	
		2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	2,500,000.000	2,504,575.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	3,600,000.000	3,632,436.000	
		2.5% CHINA GOVERNMENT BOND 20270725	3,700,000.000	3,705,587.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	3,000,000.000	2,998,230.000	
		2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20250825	3,900,000.000	3,895,320.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	1,600,000.000	1,585,328.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	3,300,000.000	3,301,155.000	
		2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	3,200,000.000	3,199,712.000	
		3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	1,200,000.000	1,227,000.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	3,700,000.000	3,724,790.000	
		2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20251125	3,000,000.000	2,999,100.000	
		2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	1,200,000.000	1,211,088.000	
		2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	3,200,000.000	3,222,592.000	
		2.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20260215	2,600,000.000	2,610,530.000	
		2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	2,500,000.000	2,542,500.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	1,700,000.000	1,717,374.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	3,300,000.000	3,319,569.000	
		3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	1,200,000.000	1,252,932.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	3,200,000.000	3,204,000.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	3,000,000.000	2,996,130.000	
		オフショア・人民元 小計		187,645,675.000 (3,788,978,999)	
	コロンビア・ペソ	9.85% Colombia Government International Bond 20270628	90,000,000.000	87,003,000.000	
		10% Colombian TES 20240724	2,750,000,000.000	2,787,537,500.000	
		6% Colombian TES 20280428	5,570,000,000.000	4,708,432,400.000	
		7.5% Colombian TES 20260826	5,410,000,000.000	5,048,936,600.000	
		7.75% Colombian TES 20300918	3,600,000,000.000	3,116,988,000.000	
		7% Colombian TES 20320630	4,650,000,000.000	3,653,319,000.000	
		6.25% Colombian TES 20251126	3,700,000,000.000	3,449,473,000.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		7.25% Colombian TES 20341018	4,900,000,000.000	3,732,379,000.000	
		5.75% Colombian TES 20271103	3,200,000,000.000	2,723,136,000.000	
		7.25% Colombian TES 20501026	4,510,000,000.000	2,989,092,700.000	
		6.25% Colombian TES 20360709	1,900,000,000.000	1,280,011,000.000	
		7% COLOMBIAN TES 20310326	5,400,000,000.000	4,390,470,000.000	
		9.25% COLOMBIAN TES 20420528	4,500,000,000.000	3,778,425,000.000	
		13.25% COLOMBIAN TES 20330209	3,250,000,000.000	3,653,097,500.000	
		コロンビア・ペソ 小計		45,398,300,700.000 (1,647,640,528)	
	タイ・パーツ	4.875% Thailand Government Bond 20290622	36,050,000.000	40,370,592.500	
		3.85% Thailand Government Bond 20251212	31,610,000.000	32,644,279.200	
		3.65% Thailand Government Bond 20310620	32,700,000.000	34,535,124.000	
		3.4% Thailand Government Bond 20360617	29,600,000.000	30,814,784.000	
		2.125% Thailand Government Bond 20261217	40,400,000.000	39,987,112.000	
		3.775% Thailand Government Bond 20320625	48,500,000.000	52,217,040.000	
		2.875% Thailand Government Bond 20460617	34,900,000.000	32,856,954.000	
		2.875% Thailand Government Bond 20281217	34,500,000.000	34,911,585.000	
		3.3% Thailand Government Bond 20380617	40,500,000.000	41,879,430.000	
		1.45% Thailand Government Bond 20241217	42,000,000.000	41,587,140.000	
		1.6% Thailand Government Bond 20291217	36,500,000.000	34,215,830.000	
		1.6% Thailand Government Bond 20350617	15,500,000.000	13,506,080.000	
		0.95% Thailand Government Bond 20250617	43,000,000.000	41,980,900.000	
		0.75% Thailand Government Bond 20240617	32,900,000.000	32,525,269.000	
		1.585% Thailand Government Bond 20351217	40,900,000.000	35,261,935.000	
		2% Thailand Government Bond 20311217	54,500,000.000	51,420,205.000	
		2% Thailand Government Bond 20420617	23,000,000.000	19,293,090.000	
		1% THAILAND GOVERNMENT BOND 20270617	61,000,000.000	57,828,610.000	
		0.75% THAILAND GOVERNMENT BOND 20240917	43,000,000.000	42,344,250.000	
		2.65% THAILAND GOVERNMENT BOND 20280617	43,000,000.000	43,113,950.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.39% THAILAND GOVERNMENT BOND 20370617	24,500,000.000	25,526,795.000	
		2.35% THAILAND GOVERNMENT BOND 20260617	36,500,000.000	36,458,025.000	
		3.45% THAILAND GOVERNMENT BOND 20430617	24,000,000.000	24,844,800.000	
		3.35% THAILAND GOVERNMENT BOND 20330617	34,000,000.000	35,437,860.000	
		2.25% THAILAND GOVERNMENT BOND 20270317	12,000,000.000	11,938,440.000	
		タイ・パーツ 小計		887,500,079.700 (3,692,000,331)	
	チェコ・コロナ	2.5% Czech Republic Government Bond 20280825	19,600,000.000	17,798,956.000	
		5.7% Czech Republic Government Bond 20240525	12,100,000.000	12,123,837.000	
		2.4% Czech Republic Government Bond 20250917	21,100,000.000	20,054,917.000	
		1% Czech Republic Government Bond 20260626	23,900,000.000	21,523,384.000	
		0.95% Czech Republic Government Bond 20300515	22,000,000.000	17,533,780.000	
		0.25% Czech Republic Government Bond 20270210	22,500,000.000	19,346,850.000	
		2.75% Czech Republic Government Bond 20290723	24,500,000.000	22,255,310.000	
		2% Czech Republic Government Bond 20331013	29,500,000.000	23,732,160.000	
		1.2% Czech Republic Government Bond 20310313	22,700,000.000	18,019,714.000	
		0.05% Czech Republic Government Bond 20291129	10,000,000.000	7,616,100.000	
		4.2% Czech Republic Government Bond 20361204	13,500,000.000	13,128,615.000	
		1.75% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20320623	29,500,000.000	23,886,150.000	
		1.25% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20250214	17,500,000.000	16,504,600.000	
		1.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20400424	10,000,000.000	6,510,000.000	
		CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20241212	5,000,000.000	4,675,000.000	
		3.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20350530	13,500,000.000	12,366,000.000	
		6% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20260226	15,500,000.000	16,027,000.000	
		5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20300930	26,000,000.000	26,812,500.000	
		5.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20281212	20,500,000.000	21,484,000.000	
		1.95% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20370730	6,000,000.000	4,450,260.000	
		4.9% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20340414	5,500,000.000	5,678,750.000	
		6.2% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20310616	8,000,000.000	8,908,000.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	チェコ・コルナ	小計		340,435,883.000 (2,222,671,836)	
	チリ・ペソ	4.5% BONOS TESORERIA PESOS 20260301	500,000,000.000	485,075,000.000	
		5% BONOS TESORERIA PESOS 20350301	720,000,000.000	676,980,000.000	
		6% BONOS TESORERIA PESOS 20430101	630,000,000.000	654,387,300.000	
		4.7% BONOS TESORERIA PESOS 20300901	685,000,000.000	644,495,950.000	
		2.5% BONOS TESORERIA PESOS 20250301	1,000,000,000.000	948,730,000.000	
		2.3% BONOS TESORERIA PESOS 20281001	80,000,000.000	68,287,200.000	
		5% BONOS TESORERIA PESOS 20281001	200,000,000.000	194,000,000.000	
		7% BONOS TESORERIA PESOS 20340501	220,000,000.000	241,489,600.000	
		6% BONOS TESORERIA PESOS 20330401	500,000,000.000	509,980,000.000	
	チリ・ペソ	小計		4,423,425,050.000 (747,793,276)	
	ドミニカ・ペソ	9.75% Dominican Republic International Bond 20260605	11,000,000.000	11,231,000.000	
		13.625% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20330203	11,400,000.000	14,132,694.000	
	ドミニカ・ペソ	小計		25,363,694.000 (66,062,278)	
	トルコ・リラ	9% Turkey Government Bond 20240724	1,630,000.000	1,463,332.500	
		8% Turkey Government Bond 20250312	2,690,000.000	2,205,557.900	
		10.6% Turkey Government Bond 20260211	5,570,000.000	4,403,976.200	
		11% Turkey Government Bond 20270224	2,970,000.000	2,154,141.000	
		10.5% Turkey Government Bond 20270811	9,000,000.000	6,160,500.000	
		12.4% Turkey Government Bond 20280308	5,000,000.000	4,104,850.000	
		12.6% Turkey Government Bond 20251001	9,100,000.000	7,757,477.000	
		11.7% Turkey Government Bond 20301113	8,400,000.000	6,456,744.000	
		16.9% TURKEY GOVERNMENT BOND 20260902	8,500,000.000	7,545,535.000	
	トルコ・リラ	小計		42,252,113.600 (233,404,901)	
	ハンガリー・フ ォリント	3% Hungary Government Bond 20240626	98,500,000.000	93,914,825.000	
		3% Hungary Government Bond 20271027	270,000,000.000	229,297,500.000	
		2.75% Hungary Government Bond 20261222	130,000,000.000	111,179,900.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		6.75% Hungary Government Bond 20281022	153,000,000.000	150,007,320.000	
		3% Hungary Government Bond 20300821	225,000,000.000	177,720,750.000	
		2.5% Hungary Government Bond 20241024	220,000,000.000	204,699,000.000	
		3.25% Hungary Government Bond 20311022	272,000,000.000	212,976,000.000	
		1% Hungary Government Bond 20251126	270,000,000.000	231,471,000.000	
		3% Hungary Government Bond 20381027	202,000,000.000	124,805,700.000	
		1.5% Hungary Government Bond 20260422	169,000,000.000	143,886,600.000	
		2% Hungary Government Bond 20290523	135,000,000.000	104,989,500.000	
		2.25% Hungary Government Bond 20330420	215,000,000.000	146,952,500.000	
		1.5% Hungary Government Bond 20260826	100,000,000.000	83,650,000.000	
		3% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20410425	150,000,000.000	88,342,500.000	
		2.25% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20340622	75,000,000.000	48,907,500.000	
		4.5% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20280323	100,000,000.000	89,462,000.000	
		4.75% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20321124	170,000,000.000	142,597,700.000	
		5.5% Hungary Government Bond 20250624	282,500,000.000	267,134,825.000	
		ハンガリー・フォリント 小計		2,651,995,120.000 (1,079,372,622)	
	フィリピン・ペソ	6.25% Philippine Government International Bond 20360114	10,000,000.000	9,687,900.000	
		フィリピン・ペソ 小計		9,687,900.000 (25,157,539)	
	ブラジル・レアル	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20250101	12,890,000.000	12,777,212.500	
		10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20270101	14,850,000.000	14,605,123.500	
		10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20290101	16,800,000.000	16,136,904.000	
		10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20310101	6,300,000.000	5,937,687.000	
		10% BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F 20330101	7,300,000.000	6,763,012.000	
		Brazil Letras do Tesouro Nacional 20240701	14,600,000.000	13,405,720.000	
		BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20250701	15,500,000.000	12,966,215.000	
		BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20260101	27,200,000.000	21,633,520.000	
		BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20260701	31,000,000.000	23,434,450.000	
		ブラジル・レアル 小計		127,659,844.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
				(3,791,267,579)	
	ペルー・ソル	5.7% Peru Government Bond 20240812	1,230,000.000	1,219,077.600	
		6.35% Peru Government Bond 20280812	2,270,000.000	2,291,292.600	
		6.15% Peru Government Bond 20320812	3,350,000.000	3,203,672.000	
		5.94% Peru Government Bond 20290212	3,400,000.000	3,345,770.000	
		5.4% Peru Government Bond 20340812	2,050,000.000	1,802,237.000	
		5.35% Peru Government Bond 20400812	1,500,000.000	1,254,180.000	
		7.3% PERU GOVERNMENT BOND 20330812	2,400,000.000	2,463,672.000	
		8.2% Peru Government Bond 20260812	375,000.000	396,105.000	
		6.9% Peru Government Bond 20370812	3,465,000.000	3,408,555.150	
		6.95% Peru Government Bond 20310812	3,070,000.000	3,116,387.700	
	ペルー・ソル 小計			22,500,949.050 (897,463,853)	
	ポーランド・ズロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	8,190,000.000	7,610,967.000	
		2.5% Poland Government Bond 20270725	5,240,000.000	4,741,152.000	
		2.5% Poland Government Bond 20240425	5,600,000.000	5,512,136.000	
		2.75% Poland Government Bond 20291025	8,250,000.000	7,148,955.000	
		2.25% Poland Government Bond 20241025	6,700,000.000	6,484,930.000	
		0.75% Poland Government Bond 20250425	5,550,000.000	5,174,820.000	
		1.25% Poland Government Bond 20301025	6,900,000.000	5,231,787.000	
		0.25% Poland Government Bond 20261025	6,300,000.000	5,418,000.000	
		1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	6,950,000.000	5,162,460.000	
		3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	6,150,000.000	5,837,887.500	
		7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	4,900,000.000	5,340,559.000	
		POLAND GOVERNMENT BOND 20251025	1,300,000.000	1,173,133.000	
		6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	3,300,000.000	3,428,700.000	
		2.75% Poland Government Bond 20280425	6,950,000.000	6,242,003.500	
		3.25% Poland Government Bond 20250725	6,150,000.000	5,948,280.000	
	ポーランド・ズロチ 小計			80,455,770.000 (2,792,209,452)	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	マレーシア・リンギット	4.07% Malaysia Government Investment Issue 20260930	2,800,000.000	2,843,120.000	
		4.258% Malaysia Government Investment Issue 20270726	1,800,000.000	1,841,040.000	
		4.369% Malaysia Government Investment Issue 20281031	3,500,000.000	3,613,295.000	
		4.128% Malaysia Government Investment Issue 20250815	1,900,000.000	1,928,956.000	
		4.13% Malaysia Government Investment Issue 20290709	2,900,000.000	2,950,460.000	
		3.655% Malaysia Government Investment Issue 20241015	2,700,000.000	2,705,427.000	
		3.726% Malaysia Government Investment Issue 20260331	4,200,000.000	4,220,874.000	
		3.465% Malaysia Government Investment Issue 20301015	5,100,000.000	4,971,684.000	
		3.422% Malaysia Government Investment Issue 20270930	3,500,000.000	3,474,100.000	
		3.447% Malaysia Government Investment Issue 20360715	3,100,000.000	2,907,583.000	
		4.417% MALAYSIA T-BILL 20410930	3,300,000.000	3,362,436.000	
		3.99% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20251015	3,800,000.000	3,839,444.000	
		3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,450,000.000	2,439,440.500	
		3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	3,850,000.000	3,857,430.500	
		4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,740,000.000	1,751,223.000	
		3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	4,350,000.000	4,392,891.000	
		4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	2,300,000.000	2,342,941.000	
		3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	3,800,000.000	3,841,344.000	
		4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	1,720,000.000	1,731,661.600	
		3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	3,820,000.000	3,859,995.400	
		4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	4,300,000.000	4,610,675.000	
		3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	2,800,000.000	2,822,652.000	
		4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	2,000,000.000	2,129,500.000	
		4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	3,300,000.000	3,600,696.000	
		3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	3,000,000.000	3,033,510.000	
		3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,950,000.000	2,969,352.000	
		4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	2,450,000.000	2,668,834.000	
		3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	3,300,000.000	3,305,247.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	3,000,000.000	2,958,960.000	
		3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	3,500,000.000	3,343,410.000	
		4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	4,300,000.000	4,138,707.000	
		2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	2,900,000.000	2,669,856.000	
		3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	2,400,000.000	2,352,360.000	
		4.193% MALAYSIAN GOVERNMENT 20321007	3,400,000.000	3,475,242.000	
		4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	3,500,000.000	3,745,420.000	
		3.599% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280731	600,000.000	598,890.000	
		4.291% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430814	2,100,000.000	2,117,073.000	
		4.662% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380331	1,400,000.000	1,499,890.000	
		4.245% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300930	2,400,000.000	2,462,040.000	
		4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	750,000.000	772,762.500	
		3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	1,300,000.000	1,294,423.000	
		マレーシア・リングgit 小計		119,444,845.500 (3,775,830,733)	
	メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	52,400,000.000	47,336,064.000	
		8% Mexican Bonos 20471107	29,300,000.000	25,132,661.000	
		8% Mexican Bonos 20240905	39,000,000.000	37,814,010.000	
		5.5% MEXICAN BONOS 20270304	33,000,000.000	28,786,890.000	
		5% MEXICAN BONOS 20250306	25,700,000.000	23,803,340.000	
		8% MEXICAN BONOS 20530731	21,000,000.000	17,848,110.000	
		7.5% MEXICAN BONOS 20330526	25,800,000.000	22,631,502.000	
		10% Mexican Bonos 20241205	30,550,000.000	30,198,675.000	
		7.5% Mexican Bonos 20270603	40,030,000.000	37,127,424.700	
		10% Mexican Bonos 20361120	9,390,000.000	9,768,229.200	
		8.5% Mexican Bonos 20290531	35,230,000.000	33,663,674.200	
		8.5% Mexican Bonos 20381118	25,100,000.000	22,994,361.000	
		7.75% Mexican Bonos 20310529	55,350,000.000	50,030,865.000	
		7.75% Mexican Bonos 20421113	34,120,000.000	28,741,664.400	
		7.75% Mexican Bonos 20341123	10,430,000.000	9,218,555.500	
		メキシコ・ペソ 小計		425,096,026.000 (3,573,824,800)	
	ルーマニア・レイ	4.75% Romania Government Bond 20250224	2,450,000.000	2,402,102.500	
		5.8% Romania Government Bond 20270726	2,800,000.000	2,744,140.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.25% Romania Government Bond 20240429	1,600,000.000	1,570,256.000	
		5% Romania Government Bond 20290212	2,600,000.000	2,431,494.000	
		4.85% Romania Government Bond 20260422	2,500,000.000	2,411,125.000	
		3.65% Romania Government Bond 20310924	2,900,000.000	2,396,038.000	
		4.5% Romania Government Bond 20240617	2,500,000.000	2,467,450.000	
		3.65% Romania Government Bond 20250728	2,300,000.000	2,197,558.000	
		4.15% Romania Government Bond 20280126	1,600,000.000	1,470,192.000	
		3.7% Romania Government Bond 20241125	2,200,000.000	2,143,482.000	
		3.25% Romania Government Bond 20260624	2,100,000.000	1,944,642.000	
		4.15% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20301024	2,500,000.000	2,166,900.000	
		4.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20341011	2,700,000.000	2,268,162.000	
		2.5% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20271025	2,300,000.000	1,987,821.000	
		4.85% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20290725	2,300,000.000	2,125,844.000	
		6.7% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20320225	2,000,000.000	2,000,100.000	
		4.25% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20360428	2,300,000.000	1,807,961.000	
		3.5% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20251125	2,000,000.000	1,895,200.000	
		8.25% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20320929	2,100,000.000	2,304,498.000	
		8.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20281030	700,000.000	768,299.000	
		8% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20300429	500,000.000	535,025.000	
		7.9% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20380224	2,100,000.000	2,298,933.000	
		ルーマニア・レイ 小計		44,337,222.500 (1,416,844,716)	
	ロシア・ルーブル	8.15% Russian Federal Bond - OFZ 20270203	46,760,000.000	0.000	
		7.05% Russian Federal Bond - OFZ 20280119	46,160,000.000	0.000	
		8.5% Russian Federal Bond - OFZ 20310917	43,000,000.000	0.000	
		7.75% Russian Federal Bond - OFZ 20260916	45,600,000.000	0.000	
		7.7% Russian Federal Bond - OFZ 20330323	46,100,000.000	0.000	
		7.1% Russian Federal Bond - OFZ 20241016	48,600,000.000	0.000	
		6.5% Russian Federal Bond - OFZ 20240228	48,000,000.000	0.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		7.25% Russian Federal Bond - OFZ 20340510	55,000,000.000	0.000	
		6.9% Russian Federal Bond - OFZ 20290523	49,000,000.000	0.000	
		7.95% Russian Federal Bond - OFZ 20261007	46,000,000.000	0.000	
		7.4% Russian Federal Bond - OFZ 20240717	55,000,000.000	0.000	
		7.15% Russian Federal Bond - OFZ 20251112	59,000,000.000	0.000	
		7.65% Russian Federal Bond - OFZ 20300410	65,000,000.000	0.000	
		7.7% Russian Federal Bond - OFZ 20390316	38,000,000.000	0.000	
		6% Russian Federal Bond - OFZ 20271006	68,000,000.000	0.000	
		4.5% Russian Federal Bond - OFZ 20250716	71,000,000.000	0.000	
		6.1% Russian Federal Bond - OFZ 20350718	63,000,000.000	0.000	
		5.7% Russian Federal Bond - OFZ 20280517	65,000,000.000	0.000	
		6.9% RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 20310723	74,000,000.000	0.000	
		6.7% RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 20290314	50,000,000.000	0.000	
		ロシア・ルーブル 小計		0.000 (-)	
	南アフリカ・ランド	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	66,150,000.000	68,805,922.500	
		6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	17,720,000.000	11,146,766.000	
		6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	16,280,000.000	9,436,702.000	
		7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	29,540,000.000	23,717,666.000	
		8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	63,520,000.000	45,137,312.000	
		8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	45,800,000.000	34,441,600.000	
		8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	62,200,000.000	55,333,120.000	
		8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	40,200,000.000	28,749,030.000	
		8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	52,200,000.000	43,699,230.000	
		8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	49,200,000.000	39,847,080.000	
		9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	36,400,000.000	27,434,680.000	
		11.625% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20530331	5,500,000.000	5,108,125.000	
		南アフリカ・ランド 小計		392,857,233.500 (3,021,072,126)	
国債証券	合計			36,861,021,593	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
				[36,861,021,593]	
合計				36,861,021,593 [36,861,021,593]	

- (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
インドネシア・ルピア	国債証券 32 銘柄	100%	10.2%
ウルグアイ・ペソ	国債証券 3 銘柄	100%	0.2%
エジプト・ポンド	国債証券 12 銘柄	100%	0.7%
オフショア・人民元	国債証券 50 銘柄	100%	10.4%
コロンビア・ペソ	国債証券 14 銘柄	100%	4.5%
タイ・バーツ	国債証券 25 銘柄	100%	10.0%
チェコ・コルナ	国債証券 22 銘柄	100%	6.0%
チリ・ペソ	国債証券 9 銘柄	100%	2.0%
ドミニカ・ペソ	国債証券 2 銘柄	100%	0.2%
トルコ・リラ	国債証券 9 銘柄	100%	0.6%
ハンガリー・フォリント	国債証券 18 銘柄	100%	2.9%
フィリピン・ペソ	国債証券 1 銘柄	100%	0.1%
ブラジル・リアル	国債証券 9 銘柄	100%	10.3%
ペルー・ソル	国債証券 10 銘柄	100%	2.4%
ポーランド・ズロチ	国債証券 15 銘柄	100%	7.6%
マレーシア・リンギット	国債証券 41 銘柄	100%	10.2%
メキシコ・ペソ	国債証券 15 銘柄	100%	9.7%
ルーマニア・レイ	国債証券 22 銘柄	100%	3.8%
ロシア・ルーブル	国債証券 20 銘柄	-%	-%
南アフリカ・ランド	国債証券 12 銘柄	100%	8.2%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年9月7日現在 金額(円)	2023年9月7日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	12,330,157,483	8,271,683,142
株式 ※2※3	187,268,579,370	270,705,844,599
派生商品評価勘定	146,700	18,822,950
未収配当金	119,145,822	147,738,931
未収利息	694,750	445,513
前払金	12,615,000	-
その他未収収益 ※4	7,667,503	5,133,170
差入委託証拠金	35,820,000	-
流動資産合計	199,774,826,628	279,149,668,305
資産合計	199,774,826,628	279,149,668,305
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	31,688,250	1,611,000
前受金	-	29,830,000
未払解約金	33,328,030	199,745,260
受入担保金	6,307,055,790	4,731,746,627
流動負債合計	6,372,072,070	4,962,932,887
負債合計	6,372,072,070	4,962,932,887
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	145,845,153,885	161,837,366,239
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	47,557,600,673	112,349,369,179
元本等合計	193,402,754,558	274,186,735,418
純資産合計	193,402,754,558	274,186,735,418
負債純資産合計	199,774,826,628	279,149,668,305

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2022 年 9 月 8 日 至 2023 年 9 月 7 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2022 年 9 月 7 日現在	2023 年 9 月 7 日現在
1. ※1 期首	2021 年 9 月 8 日	2022 年 9 月 8 日
期首元本額	138,110,552,502 円	145,845,153,885 円
期中追加設定元本額	21,860,168,849 円	30,026,484,362 円
期中一部解約元本額	14,125,567,466 円	14,034,272,008 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	2,917,028,229 円	2,793,318,390 円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA	5,100,025,134 円	4,449,282,916 円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドVA2	919,282 円	912,820 円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	22,914,284 円	15,316,355 円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	309,766,472 円	211,418,762 円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	20,861,610 円	13,274,124 円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	623,209,920 円	431,729,482 円

区分	2022年9月7日現在	2023年9月7日現在
日本株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	411,525,762 円	622,737,314 円
D-I's TOPIXインデックス	31,220,370 円	13,698,264 円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	205,919,431 円	240,356,411 円
iFree TOPIXインデックス	6,016,503,572 円	6,920,808,054 円
iFree 8資産バランス	4,107,777,908 円	4,560,584,662 円
iFree 年金バランス	739,333,771 円	935,557,156 円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2060	-円	773,520 円
DCダイワ日本株式インデックス	68,872,398,480 円	70,174,462,134 円
ダイワ・ライフ・バランス30	3,258,351,019 円	3,127,446,388 円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,647,636,589 円	4,821,354,951 円
ダイワ・ライフ・バランス70	4,614,321,177 円	5,432,843,858 円
年金ダイワ日本株式インデックス	6,616,170,343 円	7,258,940,422 円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	59,300,522 円	52,401,134 円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	68,797,227 円	74,035,108 円
ダイワつみたてインデックス日本株式	2,343,262,160 円	4,235,923,782 円
ダイワつみたてインデックス バランス30	12,113,839 円	13,296,558 円
ダイワつみたてインデックス バランス50	10,132,276 円	10,469,291 円
ダイワつみたてインデックス バランス70	25,524,777 円	27,950,303 円
ダイワ国内株式インデックス (ラップ専用)	861,004,190 円	8,828,703,798 円
ダイワ世界バランスファンド4 0VA	80,584,476 円	57,636,044 円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	44,620,861 円	22,132,245 円
ダイワ・バランスファンド35 VA	5,379,500,249 円	4,030,569,248 円
ダイワ・バランスファンド25 VA (適格機関投資家専用)	495,554,875 円	393,692,268 円
ダイワ国内バランスファンド2 5VA (適格機関投資家専用)	70,111,584 円	58,225,411 円
ダイワ国内バランスファンド3 0VA (適格機関投資家専用)	110,064,644 円	77,438,203 円
ダイワ・ノーロード TOPIX ファンド	217,095,115 円	210,811,908 円
ダイワファンドラップ TOPIX インデックス	11,504,859,511 円	12,158,605,124 円

区分	2022年9月7日現在	2023年9月7日現在
ダイワTOPIXインデックス (ダイワSMA専用)	1,659,739,755 円	5,648,467,601 円
ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス	3,221,121,856 円	3,440,682,772 円
ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,205,170,804 円	1,174,081,455 円
ダイワライフスタイル25	135,770,055 円	113,164,999 円
ダイワライフスタイル50	558,491,615 円	500,033,785 円
ダイワライフスタイル75	423,357,277 円	413,530,274 円
DC・ダイワ・トピックス・イン デックス (確定拠出年金専用 ファンド)	8,843,092,864 円	8,270,698,945 円
計	145,845,153,885 円	161,837,366,239 円
2. 期末日における受益権の総数	145,845,153,885 口	161,837,366,239 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 5,953,773,350 円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 4,468,010,220 円
4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 844,940,000 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 1,155,240,000 円
5. ※4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2022年9月8日 至 2023年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。

区分	自 2022 年 9 月 8 日 至 2023 年 9 月 7 日
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023 年 9 月 7 日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022 年 9 月 7 日現在	2023 年 9 月 7 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	△12,946,123,641	46,580,138,955
合計	△12,946,123,641	46,580,138,955

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種類	2022 年 9 月 7 日現在				2023 年 9 月 7 日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超				1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								

種類	2022年9月7日現在				2023年9月7日現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち 1年超	(円)	(円)	(円)	うち 1年超	(円)	(円)
買建	6,123,945,000	-	6,092,580,000	△31,365,000	3,553,855,000	-	3,571,150,000	17,295,000
合計	6,123,945,000	-	6,092,580,000	△31,365,000	3,553,855,000	-	3,571,150,000	17,295,000

(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)

	2022年9月7日現在	2023年9月7日現在
1口当たり純資産額	1.3261円	1.6942円
(1万口当たり純資産額)	(13,261円)	(16,942円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
極 洋	4,300.0	3,990.00	17,157,000	
ニッスイ	112,200.0	768.00	86,169,600	
マルハニチロ	16,700.0	2,640.50	44,096,350	
雪国まいたけ	9,600.0	922.00	8,851,200	貸付株式数 3,700 株
カネコ種苗	3,500.0	1,416.00	4,956,000	
サカタのタネ	12,800.0	4,260.00	54,528,000	
ホクト	9,900.0	1,856.00	18,374,400	
ホクリヨウ	1,100.0	965.00	1,061,500	貸付株式数 400 株
ショーボンドHD	15,300.0	6,013.00	91,998,900	
ミライト・ワン	37,100.0	1,981.50	73,513,650	
タマホーム	7,000.0	3,605.00	25,235,000	貸付株式数 2,700 株
サンヨーホームズ	900.0	726.00	653,400	貸付株式数 300 株
日本アクア	3,000.0	1,015.00	3,045,000	
ファーストコーポレーション	1,900.0	782.00	1,485,800	貸付株式数 700 株
ベステラ	1,700.0	1,108.00	1,883,600	貸付株式数 600 株
キャンディル	1,400.0	626.00	876,400	貸付株式数 700 株
住石ホールディングス	11,600.0	389.00	4,512,400	貸付株式数 5,100 株
日鉄鉱業	4,500.0	5,480.00	24,660,000	
三井松島HLDGS	5,100.0	2,906.00	14,820,600	貸付株式数 1,900 株
INPEX	414,500.0	2,236.00	926,822,000	
石油資源開発	13,000.0	5,230.00	67,990,000	
K&Oエナジーグループ	5,100.0	2,424.00	12,362,400	
ダイセキ環境ソリューション	1,500.0	1,294.00	1,941,000	
第一カッター興業	2,800.0	1,318.00	3,690,400	
明豊ファシリティワークス	3,000.0	752.00	2,256,000	
安藤・間	64,600.0	1,238.00	79,974,800	
東急建設	31,100.0	812.00	25,253,200	
コムシスホールディングス	35,500.0	3,125.00	110,937,500	
ビーアールホールディングス	18,200.0	395.00	7,189,000	
高松コンストラクションGP	7,200.0	2,685.00	19,332,000	
東建コーポレーション	3,200.0	7,850.00	25,120,000	
ソネック	800.0	1,006.00	804,800	貸付株式数 300 株 (100 株)
ヤマウラ	5,500.0	1,281.00	7,045,500	貸付株式数 200 株
オリエンタル白石	39,200.0	331.00	12,975,200	
大成建設	73,300.0	5,215.00	382,259,500	
大 林 組	279,800.0	1,372.00	383,885,600	
清水建設	221,800.0	1,022.00	226,679,600	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
飛島建設	8,600.0	1,378.00	11,850,800	
長谷工コーポレーション	80,700.0	1,885.50	152,159,850	
松井建設	7,100.0	776.00	5,509,600	
銭高組	600.0	3,985.00	2,391,000	貸付株式数 200株
鹿島建設	173,600.0	2,549.50	442,593,200	
不動テトラ	5,500.0	1,955.00	10,752,500	貸付株式数 1,300株
大末建設	1,900.0	1,496.00	2,842,400	
鉄建建設	5,500.0	2,152.00	11,836,000	
西松建設	13,200.0	3,807.00	50,252,400	
三井住友建設	62,300.0	418.00	26,041,400	
大豊建設	3,200.0	4,145.00	13,264,000	貸付株式数 700株
佐田建設	3,300.0	483.00	1,593,900	
ナカノフドー建設	3,600.0	401.00	1,443,600	
奥村組	12,600.0	4,670.00	58,842,000	
東鉄工業	10,800.0	2,960.00	31,968,000	
イチケン	1,100.0	2,082.00	2,290,200	
富士ピー・エス	2,300.0	474.00	1,090,200	貸付株式数 900株 (500株)
浅沼組	6,100.0	3,665.00	22,356,500	
戸田建設	96,100.0	823.60	79,147,960	
熊谷組	12,900.0	3,450.00	44,505,000	
北野建設	1,000.0	3,150.00	3,150,000	
植木組	1,500.0	1,538.00	2,307,000	
矢作建設	10,500.0	1,309.00	13,744,500	
ピーエス三菱	10,300.0	829.00	8,538,700	
日本ハウスHLDGS	16,300.0	377.00	6,145,100	貸付株式数 6,500株
大東建託	28,800.0	16,220.00	467,136,000	
新日本建設	10,900.0	1,246.00	13,581,400	
東亜道路	3,100.0	5,100.00	15,810,000	
日本道路	1,600.0	9,710.00	15,536,000	
東亜建設	6,700.0	3,695.00	24,756,500	貸付株式数 2,400株
日本国土開発	21,900.0	631.00	13,818,900	
若築建設	3,500.0	3,090.00	10,815,000	
東洋建設	25,300.0	1,135.00	28,715,500	貸付株式数 9,400株
五洋建設	111,100.0	896.00	99,545,600	
世紀東急	10,100.0	1,707.00	17,240,700	
福田組	2,900.0	4,960.00	14,384,000	貸付株式数 800株
日本ドライケミカル	1,300.0	2,100.00	2,730,000	貸付株式数 400株
住友林業	67,700.0	4,069.00	275,471,300	
日本基礎技術	3,100.0	501.00	1,553,100	
巴コーポレーション	6,000.0	543.00	3,258,000	
大和ハウス	216,600.0	4,146.00	898,023,600	
ライト工業	14,600.0	2,039.00	29,769,400	
積水ハウス	237,600.0	3,081.00	732,045,600	
日特建設	7,600.0	1,121.00	8,519,600	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
北陸電気工事	5,500.0	999.00	5,494,500	
ユアテック	17,500.0	1,027.00	17,972,500	
日本リーテック	6,900.0	1,315.00	9,073,500	
四電工	3,300.0	2,881.00	9,507,300	
中電工	12,300.0	2,468.00	30,356,400	
関電工	43,200.0	1,332.00	57,542,400	
きんでん	55,400.0	2,130.00	118,002,000	貸付株式数 300株
東京エネシス	7,600.0	1,018.00	7,736,800	
トーエネック	2,600.0	4,305.00	11,193,000	
住友電設	7,500.0	2,908.00	21,810,000	
日本電設工業	12,900.0	2,206.00	28,457,400	
エクシオグループ	36,200.0	3,169.00	114,717,800	
新日本空調	4,200.0	2,560.00	10,752,000	
九電工	19,100.0	4,657.00	88,948,700	
三機工業	17,600.0	1,625.00	28,600,000	
日揮ホールディングス	77,400.0	2,064.50	159,792,300	
中外炉工業	2,500.0	2,095.00	5,237,500	
ヤマト	4,400.0	944.00	4,153,600	
太平電業	4,800.0	4,130.00	19,824,000	
高砂熱学	19,000.0	2,984.00	56,696,000	貸付株式数 5,300株
三晃金属	600.0	4,225.00	2,535,000	
NEC ネットエスアイ	26,800.0	2,050.00	54,940,000	
朝日工業社	3,300.0	2,441.00	8,055,300	
明星工業	13,600.0	1,007.00	13,695,200	
大気社	9,100.0	4,765.00	43,361,500	
ダイダン	5,300.0	3,030.00	16,059,000	
日比谷総合設備	6,400.0	2,327.00	14,892,800	
ニッポン	21,300.0	2,123.00	45,219,900	
日清製粉G本社	72,800.0	1,945.50	141,632,400	
日東富士製粉	1,400.0	4,995.00	6,993,000	
昭和産業	6,900.0	3,095.00	21,355,500	
鳥越製粉	4,800.0	670.00	3,216,000	貸付株式数 200株
中部飼料	11,000.0	1,159.00	12,749,000	
フィード・ワン	11,600.0	834.00	9,674,400	
東洋精糖	1,000.0	2,171.00	2,171,000	
日本甜菜糖	4,600.0	1,926.00	8,859,600	
DM三井製糖ホールディ	7,800.0	3,055.00	23,829,000	
塩水港精糖	6,400.0	252.00	1,612,800	
ウエルネオシュガー	4,100.0	2,176.00	8,921,600	貸付株式数 1,400株
LIFULL	27,900.0	242.00	6,751,800	貸付株式数 10,900株
MIXI	18,600.0	2,420.00	45,012,000	
ジェイエイシーリクルート メント	7,500.0	2,610.00	19,575,000	
日本M&Aセンターホール デ	141,100.0	806.30	113,768,930	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考	
		単価	金額		
メンバーズ	2,400.0	1,266.00	3,038,400	貸付株式数	900株
中広	1,100.0	425.00	467,500	貸付株式数	400株
UTグループ	12,100.0	2,359.00	28,543,900		
アイティメディア	3,000.0	1,180.00	3,540,000	貸付株式数	100株
E・Jホールディングス	5,000.0	1,740.00	8,700,000	貸付株式数	1,400株
オープンアップグループ	24,700.0	1,971.00	48,683,700	貸付株式数	9,600株
コシダカホールディングス	24,600.0	1,346.00	33,111,600		
アルトナー	1,400.0	1,705.00	2,387,000	貸付株式数	500株
パソナグループ	10,100.0	1,701.00	17,180,100		
CDS	1,400.0	1,728.00	2,419,200		
リンクアンドモチベーション	23,800.0	468.00	11,138,400	貸付株式数	9,200株
エス・エム・エス	31,500.0	2,793.50	87,995,250		
サニーサイドアップG	1,700.0	783.00	1,331,100	貸付株式数	400株
パーソルホールディングス	90,700.0	2,565.00	232,645,500		
リニカル	3,200.0	704.00	2,252,800		
クックパッド	21,900.0	164.00	3,591,600	貸付株式数	1,700株
エスクリ	2,200.0	352.00	774,400	貸付株式数	1,200株
アイ・ケイ・ケイホールディング	2,600.0	667.00	1,734,200	貸付株式数	1,300株
森永製菓	14,000.0	5,395.00	75,530,000		
中村屋	1,900.0	3,120.00	5,928,000	貸付株式数	600株
江崎グリコ	22,500.0	3,938.00	88,605,000		
名糖産業	3,100.0	1,646.00	5,102,600	貸付株式数	1,200株
井村屋グループ	4,300.0	2,367.00	10,178,100		
不二家	5,400.0	2,490.00	13,446,000	貸付株式数	2,000株
山崎製パン	52,700.0	2,849.50	150,168,650		
第一屋製パン	1,000.0	406.00	406,000	貸付株式数	300株
モロゾフ	2,500.0	3,740.00	9,350,000		
亀田製菓	5,000.0	4,405.00	22,025,000		
寿スピリッツ	8,400.0	11,940.00	100,296,000		
カルビー	36,000.0	2,945.00	106,020,000		
森永乳業	14,300.0	5,972.00	85,399,600		
六甲バター	5,800.0	1,457.00	8,450,600	貸付株式数	2,000株
ヤクルト	56,200.0	7,597.00	426,951,400		
明治ホールディングス	96,500.0	3,716.00	358,594,000		
雪印メグミルク	19,100.0	2,361.00	45,095,100		
プリマハム	10,600.0	2,521.00	26,722,600		
日本ハム	30,800.0	4,581.00	141,094,800		
林兼産業	1,600.0	552.00	883,200	貸付株式数	600株
丸大食品	7,900.0	1,725.00	13,627,500	貸付株式数	3,000株
S Foods	8,700.0	3,385.00	29,449,500		
柿安本店	3,200.0	2,570.00	8,224,000	貸付株式数	800株
伊藤ハム米久HLDGS	60,300.0	812.00	48,963,600		
学情	4,200.0	1,926.00	8,089,200	貸付株式数	1,500株 (1,100株)

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
スタジオアリス	4,000.0	2,108.00	8,432,000	貸付株式数 1,600株
クロスキャット	4,600.0	1,054.00	4,848,400	貸付株式数 1,700株
シミックホールディングス	4,100.0	1,772.00	7,265,200	貸付株式数 1,400株
エプロ	1,800.0	743.00	1,337,400	貸付株式数 500株
システナ	134,700.0	289.00	38,928,300	
N J S	1,900.0	3,000.00	5,700,000	
デジタルアーツ	5,100.0	4,830.00	24,633,000	
日鉄ソリューションズ	13,700.0	4,120.00	56,444,000	
総合警備保障	152,800.0	950.50	145,236,400	
キューブシステム	4,700.0	1,201.00	5,644,700	貸付株式数 1,800株
いちご	90,700.0	323.00	29,296,100	
日本駐車場開発	83,200.0	228.00	18,969,600	
コア	3,500.0	1,768.00	6,188,000	貸付株式数 600株
カカコム	60,300.0	1,708.00	102,992,400	
アイロムグループ	3,000.0	1,865.00	5,595,000	貸付株式数 1,100株
セントケア・ホールディング	5,100.0	830.00	4,233,000	貸付株式数 2,000株
サイネックス	900.0	661.00	594,900	貸付株式数 300株
ルネサンス	5,600.0	934.00	5,230,400	貸付株式数 2,200株
ディップ	14,400.0	3,595.00	51,768,000	
S B Sホールディングス	7,100.0	2,975.00	21,122,500	
デジタルホールディングス	4,200.0	1,077.00	4,523,400	
新日本科学	8,700.0	2,151.00	18,713,700	貸付株式数 3,300株
キャリアデザインセンター	1,200.0	2,134.00	2,560,800	
ベネフィット・ワン	38,100.0	1,199.50	45,700,950	
エムスリー	162,300.0	2,848.50	462,311,550	貸付株式数 63,200株
ツカダ・グローバルHOLD	3,400.0	483.00	1,642,200	貸付株式数 600株
プラス	600.0	838.00	502,800	貸付株式数 200株
アウトソーシング	52,800.0	1,185.50	62,594,400	
ウエルネット	4,400.0	596.00	2,622,400	貸付株式数 1,600株
ワールドホールディングス	3,800.0	2,430.00	9,234,000	貸付株式数 400株
ディー・エヌ・エー	32,800.0	1,531.50	50,233,200	
博報堂DYHLDGS	104,900.0	1,378.50	144,604,650	
ぐるなび	15,000.0	336.00	5,040,000	
タカミヤ	11,400.0	518.00	5,905,200	
ジャパンベストレスキュー	4,200.0	728.00	3,057,600	
ファンコミュニケーションズ	12,400.0	397.00	4,922,800	
ライク	3,100.0	1,552.00	4,811,200	貸付株式数 1,100株
ビジネス・ブレークスルー	2,000.0	388.00	776,000	貸付株式数 800株
エスプール	23,700.0	496.00	11,755,200	
WDBホールディングス	4,300.0	2,135.00	9,180,500	
手間いらず	1,300.0	3,310.00	4,303,000	
ティア	3,100.0	467.00	1,447,700	貸付株式数 1,100株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
CDG	700.0	1,295.00	906,500	貸付株式数 200株
アドウェイズ	11,200.0	563.00	6,305,600	
バリューコマース	7,100.0	1,253.00	8,896,300	
インフォマート	85,300.0	491.00	41,882,300	
サッポロホールディングス	25,900.0	4,600.00	119,140,000	
アサヒグループホールディングン	181,900.0	5,767.00	1,049,017,300	
麒麟HD	327,900.0	2,065.00	677,113,500	
宝ホールディングス	53,800.0	1,247.00	67,088,600	
オエノンホールディングス	23,500.0	440.00	10,340,000	
養命酒	2,600.0	1,915.00	4,979,000	貸付株式数 1,000株
コカ・コーラボトラーズJHD	61,700.0	1,949.50	120,284,150	
サントリー食品インター	55,400.0	4,821.00	267,083,400	
ダイドーグループHD	4,500.0	5,980.00	26,910,000	貸付株式数 1,500株
伊藤園	26,700.0	4,782.00	127,679,400	貸付株式数 10,300株
キーコーヒー	8,800.0	2,072.00	18,233,600	貸付株式数 3,400株
ユニカフェ	1,700.0	948.00	1,611,600	貸付株式数 700株
ジャパンフーズ	800.0	1,116.00	892,800	
日清オイリオグループ	11,100.0	4,220.00	46,842,000	
不二製油グループ	18,300.0	2,384.00	43,627,200	
かどや製油	600.0	3,545.00	2,127,000	
J-オイルミルズ	8,100.0	1,813.00	14,685,300	
ローソン	21,000.0	7,117.00	149,457,000	
サンエー	6,400.0	4,955.00	31,712,000	貸付株式数 1,300株
カワチ薬品	6,600.0	2,303.00	15,199,800	
エービーシー・マート	37,100.0	2,722.50	101,004,750	貸付株式数 4,800株
ハードオフコーポレーション	2,300.0	1,570.00	3,611,000	
高千穂交易	2,000.0	3,225.00	6,450,000	貸付株式数 1,000株
アスクル	17,500.0	2,003.00	35,052,500	貸付株式数 6,800株
ゲオホールディングス	8,300.0	2,583.00	21,438,900	貸付株式数 3,200株
アダストリア	10,200.0	2,961.00	30,202,200	貸付株式数 3,600株
ジーフット	3,700.0	277.00	1,024,900	貸付株式数 1,200株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	800.0	819.00	655,200	貸付株式数 200株
オルバヘルスケアHLDGS	800.0	1,770.00	1,416,000	
伊藤忠食品	1,900.0	6,350.00	12,065,000	
くら寿司	9,900.0	3,220.00	31,878,000	貸付株式数 3,700株
キャンドゥ	3,000.0	2,796.00	8,388,000	貸付株式数 1,100株
エレマテック	7,600.0	1,916.00	14,561,600	
IKホールディングス	1,700.0	387.00	657,900	貸付株式数 600株
パルグループHLDGS	16,600.0	2,052.00	34,063,200	
エディオン	33,700.0	1,510.00	50,887,000	貸付株式数 7,600株
あらた	6,500.0	5,700.00	37,050,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
サーラコーポレーション	17,800.0	767.00	13,652,600	
ワッツ	2,700.0	616.00	1,663,200	貸付株式数 1,000株
トーメンデバイス	1,200.0	5,060.00	6,072,000	貸付株式数 400株
ハローズ	3,800.0	4,240.00	16,112,000	貸付株式数 400株
J Pホールディングス	23,500.0	329.00	7,731,500	貸付株式数 8,800株
フジオフードG本社	9,600.0	1,399.00	13,430,400	貸付株式数 300株 (100株)
あみやき亭	2,100.0	3,570.00	7,497,000	貸付株式数 600株
東京エレクトロデバイス	3,100.0	10,590.00	32,829,000	
ひらまつ	12,200.0	267.00	3,257,400	貸付株式数 5,200株
円谷フィールズホールディ	14,500.0	2,352.00	34,104,000	貸付株式数 5,600株
双日	84,300.0	3,289.00	277,262,700	
アルフレッサホールディン グス	84,900.0	2,508.00	212,929,200	
大黒天物産	2,600.0	6,810.00	17,706,000	
ハニーズホールディングス	6,700.0	1,680.00	11,256,000	貸付株式数 2,100株
ファーマライズHD	1,200.0	646.00	775,200	貸付株式数 500株
キッコーマン	52,200.0	8,516.00	444,535,200	
味の素	190,000.0	6,110.00	1,160,900,000	
ブルドックソース	4,200.0	2,145.00	9,009,000	貸付株式数 1,600株
キューピー	42,300.0	2,477.50	104,798,250	貸付株式数 16,400株
ハウス食品G本社	24,100.0	3,198.00	77,071,800	
カゴメ	33,900.0	3,393.00	115,022,700	貸付株式数 500株
焼津水産化工	2,000.0	1,170.00	2,340,000	
アリアケジャパン	6,900.0	5,238.00	36,142,200	
ピエトロ	700.0	1,856.00	1,299,200	
エバラ食品工業	2,100.0	3,000.00	6,300,000	貸付株式数 200株
やまみ	500.0	1,753.00	876,500	貸付株式数 200株
ニチレイ	36,100.0	3,573.00	128,985,300	
横浜冷凍	23,000.0	1,396.00	32,108,000	
東洋水産	39,800.0	5,982.00	238,083,600	
イートアンドHLDGS	3,500.0	2,125.00	7,437,500	貸付株式数 1,200株
大冷	700.0	2,009.00	1,406,300	
ヨシムラ・フード・HLD GS	5,000.0	1,329.00	6,645,000	貸付株式数 1,800株
日清食品HD	27,700.0	12,620.00	349,574,000	
永谷園ホールディングス	3,900.0	2,346.00	9,149,400	
一正蒲鉾	2,200.0	764.00	1,680,800	貸付株式数 300株
フジッコ	8,100.0	1,963.00	15,900,300	
ロックフィールド	8,800.0	1,620.00	14,256,000	貸付株式数 3,300株
日本たばこ産業	478,300.0	3,254.00	1,556,388,200	
ケンコーマヨネーズ	5,400.0	1,472.00	7,948,800	
わらべや日洋HD	5,800.0	2,906.00	16,854,800	
なとり	4,900.0	1,986.00	9,731,400	
イフジ産業	900.0	1,744.00	1,569,600	貸付株式数 100株
ファーマフーズ	11,300.0	1,540.00	17,402,000	貸付株式数 4,400株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
北の達人コーポ	34,000.0	249.00	8,466,000	貸付株式数 13,100株 (1,100株)
ユーグレナ	49,000.0	838.00	41,062,000	貸付株式数 19,100株
紀文食品	6,200.0	1,130.00	7,006,000	貸付株式数 2,400株
ピクルスホールディングス	4,600.0	1,259.00	5,791,400	貸付株式数 1,200株
スター・マイカ・HLDG S	9,200.0	641.00	5,897,200	
SREホールディングス	3,900.0	3,430.00	13,377,000	貸付株式数 1,500株
ADワークスグループ	13,400.0	231.00	3,095,400	貸付株式数 2,800株
片倉工業	7,300.0	1,737.00	12,680,100	貸付株式数 2,600株
グンゼ	5,700.0	4,590.00	26,163,000	
ヒューリック	183,700.0	1,354.50	248,821,650	
神栄	700.0	1,655.00	1,158,500	
ラサ商事	2,500.0	1,596.00	3,990,000	貸付株式数 900株
アルペン	7,100.0	1,929.00	13,695,900	貸付株式数 2,700株
ハブ	1,900.0	920.00	1,748,000	貸付株式数 700株
ラクーンホールディングス	6,600.0	794.00	5,240,400	貸付株式数 2,400株
クオールホールディングス	11,600.0	1,939.00	22,492,400	
アルコニックス	11,000.0	1,400.00	15,400,000	
神戸物産	65,500.0	3,542.00	232,001,000	貸付株式数 500株
ソリトンシステムズ	4,100.0	1,200.00	4,920,000	
ジンズホールディングス	5,000.0	3,450.00	17,250,000	貸付株式数 1,800株
ビックカメラ	45,200.0	1,079.00	48,770,800	貸付株式数 17,900株
DCMホールディングス	49,300.0	1,278.00	63,005,400	
ペッパーフードサービス	18,400.0	119.00	2,189,600	貸付株式数 7,300株
ハイパー	1,200.0	360.00	432,000	貸付株式数 400株
Monotaro	120,000.0	1,693.50	203,220,000	
東京一番フーズ	1,400.0	544.00	761,600	貸付株式数 600株
DDグループ	3,700.0	1,637.00	6,056,900	貸付株式数 1,000株
あいホールディングス	13,600.0	2,509.00	34,122,400	
ディービーエックス	1,500.0	898.00	1,347,000	貸付株式数 200株
きちりホールディングス	1,400.0	874.00	1,223,600	貸付株式数 500株
J.フロントリテイリング	105,100.0	1,589.00	167,003,900	
ドトール・日レスHD	15,100.0	2,378.00	35,907,800	
マツキヨココカラ&カンパニー	51,300.0	8,729.00	447,797,700	
ブロンコビリー	5,000.0	3,120.00	15,600,000	貸付株式数 1,900株
ZOZO	55,900.0	2,913.50	162,864,650	
トレジャー・ファクトリー	3,500.0	1,435.00	5,022,500	貸付株式数 1,300株
物語コーポレーション	14,100.0	4,695.00	66,199,500	
三越伊勢丹HD	142,400.0	1,740.00	247,776,000	
東洋紡	34,700.0	1,095.50	38,013,850	
ユニチカ	24,100.0	218.00	5,253,800	貸付株式数 4,800株
富士紡ホールディングス	3,100.0	3,610.00	11,191,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
日清紡ホールディングス	60,600.0	1,115.00	67,569,000	
倉敷紡績	6,000.0	2,413.00	14,478,000	
ダイワボウHD	34,600.0	2,939.50	101,706,700	
シキボウ	2,900.0	1,054.00	3,056,600	
日東紡績	9,000.0	3,925.00	35,325,000	
トヨタ紡織	33,700.0	2,810.50	94,713,850	
マクニカホールディングス	20,000.0	6,800.00	136,000,000	
H a m e e	2,900.0	1,123.00	3,256,700	貸付株式数 1,100 株
マーケットエンタープライズ	600.0	1,242.00	745,200	貸付株式数 200 株
ラクト・ジャパン	3,300.0	2,071.00	6,834,300	貸付株式数 500 株
ウエルシアHD	43,800.0	2,713.00	118,829,400	
クリエイトSDH	13,900.0	3,795.00	52,750,500	貸付株式数 5,100 株
グリムス	3,600.0	2,405.00	8,658,000	
バイタルKSKHD	10,500.0	968.00	10,164,000	
八洲電機	6,900.0	1,313.00	9,059,700	貸付株式数 2,600 株
メディアスホールディングス	5,400.0	757.00	4,087,800	貸付株式数 1,800 株
レスターホールディングス	8,100.0	2,495.00	20,209,500	
ジュテックHD	1,300.0	1,236.00	1,606,800	貸付株式数 500 株
丸善CHI HD	7,300.0	344.00	2,511,200	
大光	2,300.0	626.00	1,439,800	貸付株式数 1,100 株
OCHIホールディングス	1,200.0	1,426.00	1,711,200	
TOKAIホールディングス	41,600.0	946.00	39,353,600	
黒谷	1,500.0	604.00	906,000	貸付株式数 700 株
ミサワ	1,000.0	624.00	624,000	
ティーライフ	800.0	1,400.00	1,120,000	貸付株式数 100 株
C o m i n i x	1,100.0	858.00	943,800	貸付株式数 400 株
エー・ピーホールディングス	1,200.0	979.00	1,174,800	貸付株式数 500 株
三洋貿易	9,500.0	1,383.00	13,138,500	
チムニー	1,800.0	1,523.00	2,741,400	貸付株式数 700 株
シュッピン	6,300.0	1,181.00	7,440,300	貸付株式数 2,300 株
ビューティガレージ	1,300.0	4,585.00	5,960,500	貸付株式数 500 株
オイシックス・ラ・大地	11,400.0	1,718.00	19,585,200	貸付株式数 4,400 株
ウイン・パートナーズ	6,100.0	1,118.00	6,819,800	貸付株式数 500 株
ネクステージ	19,300.0	2,680.00	51,724,000	貸付株式数 7,700 株
ジョイフル本田	24,700.0	1,760.00	43,472,000	貸付株式数 1,500 株
鳥貴族ホールディングス	3,100.0	3,125.00	9,687,500	貸付株式数 1,100 株
ホットランド	6,500.0	1,690.00	10,985,000	
すかいらくHD	115,700.0	2,036.50	235,623,050	貸付株式数 2,900 株
SFPホールディングス	4,700.0	2,372.00	11,148,400	貸付株式数 1,800 株
綿半ホールディングス	6,500.0	1,373.00	8,924,500	貸付株式数 1,500 株
日本毛織	21,100.0	1,324.00	27,936,400	
ダイトウボウ	8,500.0	93.00	790,500	貸付株式数 5,300 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
トーア紡コーポレーション	2,000.0	447.00	894,000	貸付株式数 400株
ダイドーリミテッド	7,600.0	310.00	2,356,000	貸付株式数 3,700株
ヨシックスホールディングス	1,100.0	2,863.00	3,149,300	貸付株式数 400株
ユナイテッド・スーパーマーカー	27,400.0	1,143.00	31,318,200	貸付株式数 10,000株
三栄建築設計	3,700.0	2,021.00	7,477,700	
野村不動産HLDGS	49,300.0	3,887.00	191,629,100	
三重交通グループHD	16,800.0	616.00	10,348,800	貸付株式数 6,500株
サムティ	12,600.0	2,375.00	29,925,000	貸付株式数 4,600株
地主	6,000.0	1,896.00	11,376,000	貸付株式数 2,300株
プレサンスコーポレーション	12,500.0	1,981.00	24,762,500	貸付株式数 4,800株
フィル・カンパニー	1,300.0	753.00	978,900	貸付株式数 500株
ハウコム	800.0	922.00	737,600	貸付株式数 300株
JPMC	4,500.0	1,141.00	5,134,500	
サンセイランディック	1,600.0	1,059.00	1,694,400	貸付株式数 500株
エストラスト	700.0	633.00	443,100	貸付株式数 200株
フージャースHD	12,200.0	1,118.00	13,639,600	
オープンハウスグループ	28,800.0	5,258.00	151,430,400	
東急不動産HD	236,700.0	965.10	228,439,170	
飯田GHD	67,100.0	2,544.50	170,735,950	
イーランド	800.0	1,557.00	1,245,600	貸付株式数 400株
帝国繊維	9,000.0	2,028.00	18,252,000	貸付株式数 3,100株
日本コークス工業	72,400.0	119.00	8,615,600	
ゴルフダイジェスト・オン	3,800.0	714.00	2,713,200	貸付株式数 1,500株
ミタチ産業	1,400.0	1,191.00	1,667,400	貸付株式数 600株
BEENOS	3,500.0	1,648.00	5,768,000	貸付株式数 1,600株
あさひ	7,300.0	1,282.00	9,358,600	
日本調剤	5,700.0	1,438.00	8,196,600	貸付株式数 2,100株
コスモス薬品	8,400.0	17,010.00	142,884,000	貸付株式数 3,200株
シップヘルスケアHD	30,400.0	2,412.00	73,324,800	
トーエル	2,400.0	767.00	1,840,800	貸付株式数 1,300株
ソフトクリエイトHD	6,600.0	1,758.00	11,602,800	
セブン&アイ・HLDGS	291,500.0	6,012.00	1,752,498,000	
クリエイト・レストランツ・ホール	63,700.0	1,213.00	77,268,100	貸付株式数 24,800株 (900株)
明治電機工業	3,200.0	1,489.00	4,764,800	貸付株式数 1,200株
ツルハホールディングス	17,800.0	10,730.00	190,994,000	
デリカフーズHLDGS	2,200.0	679.00	1,493,800	貸付株式数 900株
スターティアホールディングス	1,100.0	1,743.00	1,917,300	貸付株式数 400株
サンマルクホールディングス	6,900.0	1,897.00	13,089,300	
フェリシモ	1,400.0	1,001.00	1,401,400	貸付株式数 400株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
トリドールホールディングス	21,100.0	3,945.00	83,239,500	貸付株式数 8,200株
帝人	77,000.0	1,504.50	115,846,500	
東レ	536,400.0	815.90	437,648,760	
クラレ	116,700.0	1,687.00	196,872,900	
旭化成	499,700.0	968.20	483,809,540	
TOKYO BASE	8,800.0	303.00	2,666,400	貸付株式数 3,300株
稲葉製作所	4,200.0	1,571.00	6,598,200	貸付株式数 1,700株
宮地エンジニアリングG	2,300.0	6,110.00	14,053,000	貸付株式数 800株
トーカロ	21,900.0	1,449.00	31,733,100	
アルファCO	2,000.0	1,583.00	3,166,000	
SUMCO	146,600.0	1,981.00	290,414,600	
川田テクノロジーズ	1,900.0	6,220.00	11,818,000	
RS TECHNOLOGIES	5,500.0	2,751.00	15,130,500	
ジェイテックコーポレーション	700.0	2,643.00	1,850,100	貸付株式数 300株
信和	3,000.0	791.00	2,373,000	貸付株式数 1,100株
ビーロット	3,600.0	928.00	3,340,800	貸付株式数 1,400株
ファーストブラザーズ	1,000.0	1,198.00	1,198,000	
AND DOホールディングス	4,700.0	1,026.00	4,822,200	貸付株式数 1,700株
シーアールイー	4,400.0	1,577.00	6,938,800	貸付株式数 400株 (200株)
プロパティエージェント	700.0	1,368.00	957,600	
ケイアイスター不動産	3,800.0	4,805.00	18,259,000	
アグレ都市デザイン	900.0	1,562.00	1,405,800	貸付株式数 400株
ジェイ・エス・ビー	1,900.0	5,650.00	10,735,000	
ロードスターキャピタル	5,100.0	1,782.00	9,088,200	貸付株式数 1,600株
テンポイノベーション	1,600.0	1,306.00	2,089,600	貸付株式数 400株
グローバルリンクマネジメント	1,000.0	1,995.00	1,995,000	貸付株式数 300株
フェイスネットワーク	1,400.0	1,454.00	2,035,600	貸付株式数 600株
住江織物	1,100.0	2,245.00	2,469,500	貸付株式数 400株
日本フエルト	2,900.0	429.00	1,244,100	
イチカラ	700.0	1,475.00	1,032,500	
エコナックホールディングス	9,200.0	84.00	772,800	貸付株式数 4,200株
日東製網	500.0	1,448.00	724,000	貸付株式数 100株
芦森工業	1,000.0	2,182.00	2,182,000	
アツギ	3,000.0	446.00	1,338,000	
ウイルプラスHLDGS	900.0	1,185.00	1,066,500	貸付株式数 400株
JMホールディングス	6,400.0	1,922.00	12,300,800	貸付株式数 2,400株
コマダホールディングス	20,800.0	2,977.00	61,921,600	貸付株式数 500株
サツドラホールディングス	2,700.0	805.00	2,173,500	貸付株式数 1,100株
アレンザホールディングス	6,600.0	1,019.00	6,725,400	貸付株式数 900株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
串カツ田中HLDGS	2,300.0	1,628.00	3,744,400	貸付株式数 900株
バロックジャパン	5,400.0	841.00	4,541,400	貸付株式数 2,000株
クスリのアオキHLDGS	7,600.0	9,104.00	69,190,400	
ダイニック	1,300.0	803.00	1,043,900	
共和レザー	3,000.0	677.00	2,031,000	
ピーバンドットコム	800.0	455.00	364,000	貸付株式数 300株
力の源HD	3,300.0	2,257.00	7,448,100	貸付株式数 800株
FOOD&LIFE COMPANY	45,100.0	2,879.00	129,842,900	
アセンテック	2,800.0	629.00	1,761,200	貸付株式数 100株
セーレン	15,400.0	2,381.00	36,667,400	貸付株式数 6,000株
ソトー	1,600.0	789.00	1,262,400	貸付株式数 100株
東海染工	500.0	1,078.00	539,000	
小松マテーレ	11,500.0	745.00	8,567,500	
ワコールホールディングス	14,600.0	3,228.00	47,128,800	
ホギメディカル	10,700.0	3,255.00	34,828,500	
クラウドディアHLDGS	1,300.0	677.00	880,100	貸付株式数 500株
T S Iホールディングス	26,900.0	752.00	20,228,800	貸付株式数 10,500株
マツオカコーポレーション	1,400.0	1,513.00	2,118,200	
ワールド	10,400.0	1,674.00	17,409,600	
T I S	87,700.0	3,433.00	301,074,100	
J N Sホールディングス	2,400.0	456.00	1,094,400	貸付株式数 1,000株
グリーン	21,400.0	609.00	13,032,600	
GMOペパボ	1,000.0	1,385.00	1,385,000	貸付株式数 400株
コーエーテクモHD	50,200.0	2,262.50	113,577,500	貸付株式数 16,700株
三菱総合研究所	4,000.0	5,140.00	20,560,000	
ボルテージ	1,500.0	293.00	439,500	貸付株式数 800株
電算	600.0	1,595.00	957,000	貸付株式数 200株
AGS	2,200.0	741.00	1,630,200	
ファインデックス	6,300.0	708.00	4,460,400	
ブレインパッド	6,000.0	899.00	5,394,000	貸付株式数 2,300株
K L a b	14,700.0	281.00	4,130,700	貸付株式数 5,700株
ポールトゥウィンホールディングン	13,800.0	695.00	9,591,000	
ネクソン	178,800.0	2,976.00	532,108,800	
アイスタイル	23,700.0	476.00	11,281,200	貸付株式数 9,200株 (6,600株)
エムアップホールディングス	9,800.0	1,421.00	13,925,800	
エイチーム	4,600.0	679.00	3,123,400	貸付株式数 200株
エニグモ	10,400.0	390.00	4,056,000	貸付株式数 3,900株
テクノスジャパン	4,500.0	728.00	3,276,000	
e n i s h	4,200.0	253.00	1,062,600	貸付株式数 1,700株
コロプラ	31,100.0	652.00	20,277,200	
オルトプラス	4,400.0	236.00	1,038,400	貸付株式数 2,100株
ブロードリーフ	38,000.0	533.00	20,254,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
クロス・マーケティングG	3,300.0	723.00	2,385,900	貸付株式数 1,400株
デジタルハーツHLDGS	5,000.0	1,130.00	5,650,000	
システム情報	6,300.0	774.00	4,876,200	貸付株式数 1,600株
メディアドゥ	3,100.0	1,188.00	3,682,800	
じげん	23,500.0	602.00	14,147,000	
ブイキューブ	9,500.0	422.00	4,009,000	貸付株式数 3,600株 (100株)
エンカレッジ・テクノロジー	1,200.0	511.00	613,200	貸付株式数 600株
サイバーリンクス	2,000.0	760.00	1,520,000	貸付株式数 1,000株
ディー・エル・イー	4,300.0	248.00	1,066,400	
フィックスターズ	9,000.0	1,228.00	11,052,000	
CARTA HOLDINGS	3,700.0	1,231.00	4,554,700	貸付株式数 1,400株
オプティム	6,600.0	867.00	5,722,200	
セレス	3,300.0	996.00	3,286,800	貸付株式数 1,200株
SHIFT	5,300.0	28,720.00	152,216,000	
特種東海製紙	3,600.0	3,360.00	12,096,000	貸付株式数 600株
ティーガイア	8,500.0	1,804.00	15,334,000	
セック	700.0	3,365.00	2,355,500	
テクマトリックス	14,600.0	1,641.00	23,958,600	
プロシップ	3,500.0	1,276.00	4,466,000	貸付株式数 1,200株
ガンホー・オンライン・エンター	20,900.0	2,348.50	49,083,650	
GMOペイメントゲートウェイ	16,000.0	9,390.00	150,240,000	
ザッパラス	1,400.0	483.00	676,200	貸付株式数 700株
システムリサーチ	2,500.0	2,680.00	6,700,000	貸付株式数 900株
インターネットイニシアティブ	43,700.0	2,658.00	116,154,600	
さくらインターネット	9,000.0	1,393.00	12,537,000	貸付株式数 3,500株
ヴィンクス	1,300.0	1,293.00	1,680,900	
GMOグローバルサインHD	2,400.0	3,060.00	7,344,000	貸付株式数 900株
SRAホールディングス	4,100.0	3,620.00	14,842,000	
システムインテグレータ	1,500.0	429.00	643,500	貸付株式数 600株
朝日ネット	8,400.0	632.00	5,308,800	
eBASE	11,300.0	705.00	7,966,500	
アバントグループ	10,100.0	1,380.00	13,938,000	
アドソル日進	3,300.0	1,766.00	5,827,800	
ODKソリューションズ	1,100.0	598.00	657,800	貸付株式数 600株
フリービット	4,200.0	1,176.00	4,939,200	
コムチュア	10,600.0	2,477.00	26,256,200	
サイバーコム	800.0	1,329.00	1,063,200	貸付株式数 400株
アステリア	6,200.0	819.00	5,077,800	貸付株式数 1,900株
アイル	3,700.0	2,905.00	10,748,500	
王子ホールディングス	333,700.0	619.70	206,793,890	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
日本製紙	41,700.0	1,330.00	55,461,000	
三菱製紙	6,400.0	497.00	3,180,800	貸付株式数 2,500 株
北越コーポレーション	50,600.0	952.00	48,171,200	貸付株式数 19,700 株
中越パルプ	2,200.0	1,381.00	3,038,200	貸付株式数 300 株
巴川製紙	1,700.0	678.00	1,152,600	貸付株式数 700 株
大王製紙	35,300.0	1,278.00	45,113,400	
阿波製紙	1,300.0	531.00	690,300	貸付株式数 600 株
マークラインズ	4,400.0	3,115.00	13,706,000	
メディカル・データ・ビジ	9,500.0	763.00	7,248,500	貸付株式数 4,400 株
g u m i	11,800.0	581.00	6,855,800	貸付株式数 4,600 株
ショーケース	1,200.0	384.00	460,800	貸付株式数 500 株
モバイルファクトリー	1,100.0	825.00	907,500	貸付株式数 500 株
テラスカイ	3,500.0	2,089.00	7,311,500	貸付株式数 1,200 株
デジタル・インフォメーシ ョン	4,600.0	1,845.00	8,487,000	
P C I ホールディングス	2,000.0	1,090.00	2,180,000	貸付株式数 200 株
アイビーシー	800.0	620.00	496,000	貸付株式数 400 株
ネオジャパン	2,700.0	1,140.00	3,078,000	貸付株式数 1,000 株
P R T I M E S	2,000.0	1,762.00	3,524,000	貸付株式数 400 株
ラクス	37,900.0	2,332.50	88,401,750	
ランドコンピュータ	1,300.0	1,218.00	1,583,400	
ダブルスタンダード	3,300.0	1,455.00	4,801,500	貸付株式数 1,200 株
オープンドア	5,600.0	1,020.00	5,712,000	貸付株式数 2,100 株
マイネット	1,700.0	371.00	630,700	貸付株式数 600 株
アカツキ	3,800.0	2,179.00	8,280,200	
ベネフィットジャパン	300.0	1,198.00	359,400	貸付株式数 200 株
U B I C O M ホールディン グス	2,500.0	1,330.00	3,325,000	
カナミックネットワーク	8,600.0	517.00	4,446,200	
ノムラシステムコーポレー ション	5,700.0	116.00	661,200	貸付株式数 2,900 株
レンゴー	72,900.0	1,002.50	73,082,250	
トーモク	4,600.0	2,357.00	10,842,200	
ザ・バック	6,000.0	3,095.00	18,570,000	
チェンジホールディングス	19,600.0	1,987.00	38,945,200	
シンクロ・フード	3,300.0	572.00	1,887,600	貸付株式数 1,300 株
オークネット	3,100.0	1,850.00	5,735,000	貸付株式数 1,500 株
キャピタル・アセット・プ ラン	1,000.0	876.00	876,000	貸付株式数 500 株
セグエグループ	1,700.0	947.00	1,609,900	貸付株式数 700 株
エイトレッド	800.0	1,467.00	1,173,600	貸付株式数 400 株
マクロミル	15,900.0	785.00	12,481,500	
ビーグリー	1,100.0	1,131.00	1,244,100	
オロ	2,900.0	2,121.00	6,150,900	
ユーザーローカル	2,900.0	1,922.00	5,573,800	貸付株式数 1,100 株
テモナ	1,200.0	300.00	360,000	貸付株式数 500 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ニーズウェル	2,900.0	702.00	2,035,800	貸付株式数 1,200株
マネーフワード	17,800.0	5,401.00	96,137,800	貸付株式数 6,900株
サインポスト	2,200.0	449.00	987,800	
レゾナック・ホールディング	77,400.0	2,519.00	194,970,600	
住友化学	594,000.0	416.50	247,401,000	
住友精化	3,400.0	4,645.00	15,793,000	
日産化学	37,800.0	6,291.00	237,799,800	
ラサ工業	3,100.0	2,075.00	6,432,500	
クレハ	6,400.0	8,720.00	55,808,000	
多木化学	3,100.0	3,765.00	11,671,500	貸付株式数 1,200株
テイカ	5,400.0	1,366.00	7,376,400	
石原産業	14,500.0	1,532.00	22,214,000	
片倉コープアグリ	1,100.0	1,183.00	1,301,300	貸付株式数 400株
日本曹達	8,600.0	5,460.00	46,956,000	
東ソー	106,900.0	1,961.00	209,630,900	
トクヤマ	25,900.0	2,421.00	62,703,900	
セントラル硝子	12,900.0	3,055.00	39,409,500	
東亜合成	40,200.0	1,388.50	55,817,700	
大阪ソーダ	4,800.0	6,800.00	32,640,000	貸付株式数 500株
関東電化	15,500.0	854.00	13,237,000	
SUN ASTERISK	5,700.0	1,422.00	8,105,400	
デンカ	29,100.0	2,794.50	81,319,950	
イビデン	46,300.0	8,859.00	410,171,700	
信越化学	665,600.0	4,698.00	3,126,988,800	
日本カーバイド	2,000.0	1,729.00	3,458,000	
電算システムHD	3,500.0	3,140.00	10,990,000	
堺化学	6,100.0	2,113.00	12,889,300	
第一稀元素化学工	7,300.0	972.00	7,095,600	貸付株式数 800株
エア・ウォーター	75,600.0	1,872.00	141,523,200	
日本酸素HLDGS	77,700.0	3,536.00	274,747,200	
日本化学工業	2,700.0	1,941.00	5,240,700	
東邦アセチレン	1,100.0	1,589.00	1,747,900	
日本パーカラライジング	39,700.0	1,210.00	48,037,000	貸付株式数 1,900株
高圧ガス	11,700.0	784.00	9,172,800	
チタン工業	600.0	1,452.00	871,200	貸付株式数 200株
四国化成ホールディング	10,200.0	1,456.00	14,851,200	
戸田工業	1,800.0	1,993.00	3,587,400	貸付株式数 700株
ステラ ケミファ	4,700.0	3,225.00	15,157,500	
保土谷化学	2,300.0	3,340.00	7,682,000	
日本触媒	12,200.0	5,677.00	69,259,400	貸付株式数 2,500株
大日精化	5,600.0	2,383.00	13,344,800	
カネカ	18,300.0	4,222.00	77,262,600	
協和キリン	96,800.0	2,620.00	253,616,000	
APPIER GROUP	27,400.0	1,750.00	47,950,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
三菱瓦斯化学	59,800.0	2,073.50	123,995,300	
三井化学	66,000.0	4,012.00	264,792,000	
J S R	74,700.0	4,053.00	302,759,100	
東京応化工業	12,700.0	9,893.00	125,641,100	
大阪有機化学	6,700.0	2,621.00	17,560,700	
三菱ケミカルグループ	540,400.0	906.90	490,088,760	
KHネオケム	12,200.0	2,329.00	28,413,800	
ダイセル	111,600.0	1,307.00	145,861,200	
住友ベークライト	11,900.0	7,060.00	84,014,000	
積水化学	162,200.0	2,236.50	362,760,300	
日本ゼオン	48,000.0	1,632.00	78,336,000	
アイカ工業	20,100.0	3,517.00	70,691,700	
U B E	41,300.0	2,550.00	105,315,000	
積水樹脂	11,000.0	2,409.00	26,499,000	
タキロンシーアイ	17,100.0	593.00	10,140,300	
旭有機材	5,300.0	4,100.00	21,730,000	
ニチバン	4,900.0	1,891.00	9,265,900	貸付株式数 1,800 株
リケンテクノス	17,300.0	758.00	13,113,400	
大倉工業	3,700.0	2,637.00	9,756,900	貸付株式数 1,300 株
積水化成製品	11,300.0	476.00	5,378,800	
群栄化学	1,900.0	3,465.00	6,583,500	
タイガース ポリマー	2,400.0	848.00	2,035,200	
ミライアル	1,600.0	1,470.00	2,352,000	貸付株式数 600 株
ダイキアクシス	2,200.0	736.00	1,619,200	貸付株式数 700 株
ダイキョーニシカワ	17,700.0	820.00	14,514,000	
竹本容器	2,000.0	811.00	1,622,000	
森六ホールディングス	4,100.0	2,280.00	9,348,000	
恵和	5,800.0	1,271.00	7,371,800	貸付株式数 2,200 株
日本化薬	61,200.0	1,320.00	80,784,000	
カーリットホールディングス	7,200.0	939.00	6,760,800	貸付株式数 100 株
ソルクシーズ	4,200.0	429.00	1,801,800	
C Lホールディングス	2,100.0	830.00	1,743,000	貸付株式数 800 株
プレステージ・インター	34,900.0	617.00	21,533,300	
フェイス	1,500.0	496.00	744,000	貸付株式数 300 株
プロトコーポレーション	10,000.0	1,228.00	12,280,000	
ハイマックス	2,500.0	1,449.00	3,622,500	
アミューズ	4,400.0	1,558.00	6,855,200	
野村総合研究所	159,700.0	4,271.00	682,078,700	
ドリームインキュベータ	2,500.0	3,095.00	7,737,500	貸付株式数 900 株
サイバネットシステム	5,700.0	765.00	4,360,500	
クイック	6,300.0	2,168.00	13,658,400	貸付株式数 1,100 株
T A C	2,600.0	199.00	517,400	貸付株式数 1,000 株
C Eホールディングス	2,700.0	595.00	1,606,500	
日本システム技術	2,200.0	2,236.00	4,919,200	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
電通グループ	80,800.0	4,452.00	359,721,600	
インテージホールディングス	9,100.0	2,298.00	20,911,800	
テイクアンドギヴニーズ	2,100.0	1,096.00	2,301,600	
東邦システムサイエンス	2,150.0	1,418.00	3,048,700	
びあ	2,700.0	3,835.00	10,354,500	貸付株式数 1,000 株
イオンファンタジー	3,500.0	3,170.00	11,095,000	貸付株式数 1,300 株
ソースネクスト	40,600.0	182.00	7,389,200	貸付株式数 15,800 株
シーティーエス	9,300.0	707.00	6,575,100	
ネクシーズグループ	1,800.0	819.00	1,474,200	貸付株式数 600 株
インフォコム	10,300.0	2,958.00	30,467,400	
メディカルシステムネットワーク	7,500.0	394.00	2,955,000	
日本精化	4,600.0	2,522.00	11,601,200	貸付株式数 1,600 株
扶桑化学工業	7,400.0	4,315.00	31,931,000	
トリケミカル	10,700.0	2,846.00	30,452,200	貸付株式数 4,100 株
シンプレクスHD	13,700.0	2,896.00	39,675,200	
HEROZ	2,700.0	1,704.00	4,600,800	貸付株式数 1,000 株
ラクスル	19,300.0	1,418.00	27,367,400	貸付株式数 7,400 株
メルカリ	48,500.0	3,153.00	152,920,500	貸付株式数 18,800 株
I P S	2,600.0	2,399.00	6,237,400	貸付株式数 1,000 株
F I G	6,100.0	299.00	1,823,900	貸付株式数 2,800 株
システムサポート	3,100.0	2,095.00	6,494,500	貸付株式数 1,100 株
ADEKA	27,900.0	2,852.50	79,584,750	
日油	24,800.0	6,717.00	166,581,600	
ミヨシ油脂	2,000.0	1,170.00	2,340,000	
新日本理化	7,200.0	234.00	1,684,800	貸付株式数 2,800 株
ハリマ化成グループ	3,800.0	858.00	3,260,400	
イーソル	5,800.0	774.00	4,489,200	貸付株式数 2,200 株
東海ソフト	800.0	1,099.00	879,200	
ウイングアーク1ST	8,300.0	2,596.00	21,546,800	
ヒト・コミュニケーションズHD	2,200.0	1,395.00	3,069,000	貸付株式数 800 株
サーバーワークス	1,600.0	3,745.00	5,992,000	貸付株式数 600 株
東名	400.0	2,214.00	885,600	貸付株式数 100 株
ヴィッツ	500.0	1,137.00	568,500	貸付株式数 200 株
トビラシステムズ	1,500.0	1,012.00	1,518,000	貸付株式数 600 株
S a n s a n	26,200.0	1,394.50	36,535,900	
L i n k - U	1,200.0	916.00	1,099,200	貸付株式数 500 株
ギフティ	7,000.0	1,606.00	11,242,000	貸付株式数 3,000 株
花 王	181,100.0	5,632.00	1,019,955,200	
第一工業製薬	2,900.0	1,702.00	4,935,800	
石原ケミカル	3,600.0	1,622.00	5,839,200	貸付株式数 1,400 株
日華化学	2,100.0	862.00	1,810,200	貸付株式数 900 株
ニイタカ	1,000.0	1,984.00	1,984,000	貸付株式数 500 株
三洋化成	4,900.0	4,205.00	20,604,500	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
メドレー	10,800.0	5,530.00	59,724,000	
ベース	2,700.0	4,560.00	12,312,000	貸付株式数 1,000 株
JMDC	13,300.0	4,684.00	62,297,200	
武田薬品	709,500.0	4,526.00	3,211,197,000	
アステラス製薬	757,300.0	2,207.50	1,671,739,750	
住友ファーマ	59,500.0	513.50	30,553,250	
塩野義製薬	101,100.0	6,419.00	648,960,900	
わかもと製薬	4,900.0	228.00	1,117,200	
日本新薬	18,900.0	6,625.00	125,212,500	
中外製薬	251,000.0	4,461.00	1,119,711,000	
科研製薬	13,700.0	3,551.00	48,648,700	
エーザイ	97,500.0	8,996.00	877,110,000	
理研ビタミン	6,800.0	2,374.00	16,143,200	
ロート製薬	77,700.0	3,765.00	292,540,500	
小野薬品	154,700.0	2,784.50	430,762,150	
久光製薬	17,800.0	5,199.00	92,542,200	貸付株式数 4,500 株
有機合成薬品	3,800.0	296.00	1,124,800	貸付株式数 600 株
持田製薬	9,200.0	3,380.00	31,096,000	
参天製薬	146,100.0	1,377.50	201,252,750	
扶桑薬品	2,500.0	2,163.00	5,407,500	
日本ケミファ	500.0	1,887.00	943,500	貸付株式数 200 株
ツムラ	25,200.0	2,767.50	69,741,000	
テルモ	245,900.0	4,386.00	1,078,517,400	
HUグループHD	24,000.0	2,605.50	62,532,000	
キッセイ薬品工業	11,800.0	3,355.00	39,589,000	
生化学工業	15,300.0	820.00	12,546,000	
栄研化学	13,000.0	1,401.00	18,213,000	
鳥居薬品	4,300.0	3,735.00	16,060,500	
JCRファーマ	27,100.0	1,217.00	32,980,700	貸付株式数 9,900 株
東和薬品	12,300.0	2,783.00	34,230,900	
富士製薬工業	5,900.0	1,194.00	7,044,600	
ゼリア新薬工業	11,100.0	2,419.00	26,850,900	
そーせいグループ	25,800.0	1,652.00	42,621,600	貸付株式数 10,000 株
第一三共	698,400.0	4,127.00	2,882,296,800	
杏林製薬	17,400.0	1,781.00	30,989,400	
大幸薬品	15,900.0	347.00	5,517,300	貸付株式数 6,200 株
ダイト	6,050.0	2,368.00	14,326,400	
大塚ホールディングス	166,800.0	5,560.00	927,408,000	
大正製薬HD	17,800.0	6,217.00	110,662,600	
ペプチドリーム	38,900.0	1,786.00	69,475,400	
大日本塗料	9,800.0	994.00	9,741,200	貸付株式数 2,300 株
日本ペイントHOLD	425,200.0	1,196.50	508,751,800	
関西ペイント	64,200.0	2,323.00	149,136,600	
神東塗料	4,300.0	140.00	602,000	貸付株式数 1,800 株
中国塗料	13,200.0	1,455.00	19,206,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
日本特殊塗料	3,400.0	1,425.00	4,845,000	
藤倉化成	10,800.0	478.00	5,162,400	
太陽ホールディングス	12,200.0	2,654.00	32,378,800	貸付株式数 2,000 株
D I C	31,400.0	2,513.00	78,908,200	
サカティンクス	17,800.0	1,388.00	24,706,400	貸付株式数 4,700 株
東洋インキ S C ホールディ ン	17,500.0	2,277.00	39,847,500	
T & K TOKA	7,200.0	1,402.00	10,094,400	
アルプス技研	7,900.0	2,598.00	20,524,200	
サニックス	13,300.0	309.00	4,109,700	
日本空調サービス	9,400.0	790.00	7,426,000	
オリエンタルランド	434,800.0	5,281.00	2,296,178,800	
フォーカスシステムズ	5,800.0	991.00	5,747,800	
ダスキン	18,200.0	3,395.00	61,789,000	
パーク 2 4	51,100.0	2,082.00	106,390,200	
明光ネットワークジャパン	9,700.0	646.00	6,266,200	貸付株式数 3,700 株
ファルコホールディングス	3,700.0	2,022.00	7,481,400	貸付株式数 400 株
クレスコ	6,200.0	1,908.00	11,829,600	
フジ・メディア・HD	77,100.0	1,572.00	121,201,200	貸付株式数 10,100 株
秀英予備校	1,200.0	408.00	489,600	貸付株式数 500 株
田谷	900.0	481.00	432,900	
ラウンドワン	68,600.0	590.00	40,474,000	貸付株式数 26,700 株
リゾートトラスト	32,500.0	2,341.50	76,098,750	
オービック	26,800.0	25,300.00	678,040,000	
ジャストシステム	11,500.0	3,017.00	34,695,500	
TDCソフト	6,700.0	1,779.00	11,919,300	貸付株式数 700 株
Zホールディングス	1,140,700.0	443.70	506,128,590	
ビー・エム・エル	10,200.0	2,877.00	29,345,400	
トレンドマイクロ	37,900.0	6,177.00	234,108,300	
I Dホールディングス	5,400.0	1,422.00	7,678,800	
リソー教育	37,100.0	250.00	9,275,000	
日本オラクル	15,300.0	10,445.00	159,808,500	
早稲田アカデミー	4,400.0	1,499.00	6,595,600	貸付株式数 1,700 株
アルファシステムズ	2,500.0	3,180.00	7,950,000	貸付株式数 900 株
フューチャー	17,100.0	1,530.00	26,163,000	
CAC HOLDINGS	4,300.0	1,770.00	7,611,000	
S Bテクノロジー	3,400.0	2,426.00	8,248,400	
トーセ	1,500.0	737.00	1,105,500	貸付株式数 100 株
ユー・エス・エス	84,600.0	2,556.00	216,237,600	
オービックビジネスC	15,800.0	6,410.00	101,278,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	41,900.0	4,322.00	181,091,800	
アイティフォー	10,500.0	1,085.00	11,392,500	
東京個別指導学院	9,500.0	484.00	4,598,000	貸付株式数 3,800 株
東計電算	1,100.0	6,610.00	7,271,000	貸付株式数 300 株
サイバーエージェント	181,500.0	917.50	166,526,250	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
楽天グループ	703,200.0	574.90	404,269,680	貸付株式数 274,000 株
エクスネット	700.0	1,050.00	735,000	貸付株式数 300 株
クリーク・アンド・リバー社	4,900.0	2,143.00	10,500,700	
SBIグローバルアセット	13,800.0	568.00	7,838,400	
テー・オー・ダブリュー	17,400.0	311.00	5,411,400	
大塚商会	39,800.0	6,574.00	261,645,200	貸付株式数 3,600 株
サイボウズ	11,000.0	2,129.00	23,419,000	
山田コンサルティングGP	4,200.0	1,676.00	7,039,200	
セントラルスポーツ	3,000.0	2,471.00	7,413,000	貸付株式数 1,100 株
パラカ	2,700.0	2,064.00	5,572,800	
電通国際情報S	9,700.0	5,900.00	57,230,000	
ACCESS	9,400.0	847.00	7,961,800	
デジタルガレージ	14,200.0	3,490.00	49,558,000	
イーエムシステムズ	13,300.0	759.00	10,094,700	
ウェザーニューズ	2,500.0	6,430.00	16,075,000	貸付株式数 100 株
C I J	13,200.0	571.00	7,537,200	貸付株式数 100 株
ビジネスエンジニアリング	1,100.0	3,380.00	3,718,000	貸付株式数 400 株
日本エンタープライズ	5,400.0	134.00	723,600	貸付株式数 2,100 株
WOWOW	6,000.0	1,166.00	6,996,000	貸付株式数 2,300 株
スカラ	7,300.0	759.00	5,540,700	
インテリジェント ウェイブ	2,800.0	905.00	2,534,000	
フルキャストホールディングス	7,900.0	2,071.00	16,360,900	
エン・ジャパン	14,900.0	2,550.00	37,995,000	貸付株式数 5,700 株
あすか製薬HD	8,200.0	1,667.00	13,669,400	
サワイグループHD	18,300.0	4,333.00	79,293,900	
富士フイルムHLDGS	153,800.0	8,731.00	1,342,827,800	
コニカミノルタ	180,300.0	465.50	83,929,650	
資生堂	167,400.0	5,820.00	974,268,000	
ライオン	104,900.0	1,559.00	163,539,100	貸付株式数 40,800 株
高砂香料	5,400.0	2,960.00	15,984,000	
マンダム	17,300.0	1,441.00	24,929,300	
ミルボン	10,900.0	4,634.00	50,510,600	
ファンケル	35,100.0	2,500.00	87,750,000	
コーセー	16,300.0	11,815.00	192,584,500	
コタ	7,300.0	1,623.00	11,847,900	貸付株式数 1,300 株
シーボン	700.0	1,553.00	1,087,100	
ポーラ・オルビスHD	41,100.0	1,868.50	76,795,350	
ノエビアホールディングス	7,100.0	5,700.00	40,470,000	
アジュバンホールディング	1,300.0	940.00	1,222,000	
新日本製薬	4,600.0	1,593.00	7,327,800	貸付株式数 1,700 株
アクシージア	4,100.0	1,205.00	4,940,500	
エステー	6,100.0	1,547.00	9,436,700	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
アグロカネショウ	3,200.0	1,434.00	4,588,800	貸付株式数 300株 (300株)
コニシ	13,400.0	2,592.00	34,732,800	貸付株式数 800株
長谷川香料	15,300.0	3,425.00	52,402,500	
星光PMC	3,200.0	1,066.00	3,411,200	貸付株式数 100株
小林製薬	23,300.0	7,182.00	167,340,600	
荒川化学工業	6,800.0	1,054.00	7,167,200	
メック	6,600.0	3,960.00	26,136,000	貸付株式数 2,500株
日本高純度化学	2,000.0	2,614.00	5,228,000	
タカラバイオ	21,600.0	1,422.00	30,715,200	
JCU	9,000.0	3,415.00	30,735,000	
新田ゼラチン	3,300.0	725.00	2,392,500	貸付株式数 1,500株
OATアグリオ	2,000.0	1,798.00	3,596,000	
デクセリアルズ	21,900.0	3,789.00	82,979,100	
アース製薬	7,300.0	4,955.00	36,171,500	貸付株式数 2,600株
北興化学	8,100.0	928.00	7,516,800	
大成ラミック	2,500.0	3,240.00	8,100,000	
クミアイ化学	31,900.0	1,162.00	37,067,800	
日本農薬	14,700.0	686.00	10,084,200	
富士興産	1,300.0	1,929.00	2,507,700	
ニチレキ	9,500.0	2,049.00	19,465,500	
ユシロ化学	4,200.0	1,563.00	6,564,600	
ビーピー・カストロール	2,000.0	890.00	1,780,000	
富士石油	16,300.0	327.00	5,330,100	貸付株式数 6,000株
MORESCO	1,700.0	1,194.00	2,029,800	貸付株式数 200株
出光興産	89,100.0	3,276.00	291,891,600	
ENEOSホールディングス	1,360,200.0	582.60	792,452,520	
コスモエネルギーHLDGS	31,700.0	5,549.00	175,903,300	
テスホールディングス	16,900.0	504.00	8,517,600	
インフロニアHD	81,800.0	1,545.50	126,421,900	
横浜ゴム	40,600.0	2,936.00	119,201,600	
TOYO TIRE	46,100.0	2,222.50	102,457,250	
ブリヂストン	234,700.0	5,687.00	1,334,738,900	
住友ゴム	78,600.0	1,593.50	125,249,100	貸付株式数 30,600株
藤倉コンポジット	3,800.0	1,143.00	4,343,400	
オカモト	4,300.0	4,700.00	20,210,000	
アキレス	5,000.0	1,510.00	7,550,000	貸付株式数 1,100株
フコク	4,200.0	1,490.00	6,258,000	
ニッタ	8,200.0	3,470.00	28,454,000	
クリエートメディック	1,700.0	925.00	1,572,500	
住友理工	15,600.0	1,125.00	17,550,000	
三ツ星ベルト	11,700.0	4,990.00	58,383,000	貸付株式数 4,500株
バンドー化学	11,900.0	1,599.00	19,028,100	
AGC	74,800.0	5,265.00	393,822,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
日本板硝子	40,900.0	832.00	34,028,800	
石塚硝子	800.0	2,600.00	2,080,000	貸付株式数 500株
有沢製作所	13,000.0	1,056.00	13,728,000	貸付株式数 4,700株
日本山村硝子	2,000.0	1,923.00	3,846,000	
日本電気硝子	32,800.0	2,639.00	86,559,200	
オハラ	3,800.0	1,410.00	5,358,000	貸付株式数 1,200株
住友大阪セメント	11,300.0	3,959.00	44,736,700	
太平洋セメント	51,100.0	2,807.00	143,437,700	
リソルホールディングス	500.0	4,825.00	2,412,500	貸付株式数 200株
日本ヒューム	7,100.0	903.00	6,411,300	貸付株式数 2,700株
日本コンクリート	15,700.0	333.00	5,228,100	
三谷セキサン	3,400.0	5,180.00	17,612,000	
アジアパイルHD	12,600.0	683.00	8,605,800	
東海カーボン	74,000.0	1,185.50	87,727,000	
日本カーボン	4,300.0	4,490.00	19,307,000	
東洋炭素	5,700.0	5,820.00	33,174,000	貸付株式数 1,800株
ノリタケ	4,000.0	6,370.00	25,480,000	
TOTO	52,800.0	4,020.00	212,256,000	
日本碍子	93,200.0	1,960.50	182,718,600	
日本特殊陶業	61,000.0	3,467.00	211,487,000	
ダントーホールディングス	3,500.0	934.00	3,269,000	貸付株式数 2,000株
MARUWA	3,000.0	25,920.00	77,760,000	
品川リフラクトリーズ	2,300.0	7,870.00	18,101,000	
黒崎播磨	1,600.0	10,540.00	16,864,000	
ヨータイ	4,300.0	1,509.00	6,488,700	
東京窯業	5,000.0	349.00	1,745,000	貸付株式数 1,900株
ニッカトー	2,400.0	633.00	1,519,200	
フジミインコーポレーテッド	19,200.0	3,360.00	64,512,000	
クニミネ工業	1,600.0	1,072.00	1,715,200	貸付株式数 900株
エーアンドエーマテリアル	1,000.0	1,183.00	1,183,000	
ニチアス	20,100.0	3,080.00	61,908,000	
日本製鉄	369,300.0	3,555.00	1,312,861,500	
神戸製鋼所	165,900.0	2,006.50	332,878,350	
中山製鋼所	17,000.0	984.00	16,728,000	貸付株式数 6,400株
合同製鐵	4,100.0	4,780.00	19,598,000	
JFEホールディングス	220,400.0	2,239.00	493,475,600	貸付株式数 88,100株
東京製鐵	23,200.0	1,732.00	40,182,400	
共英製鋼	9,400.0	2,044.00	19,213,600	
大和工業	13,600.0	7,221.00	98,205,600	
東京鐵鋼	3,900.0	3,725.00	14,527,500	貸付株式数 1,100株
大阪製鐵	3,800.0	1,802.00	6,847,600	貸付株式数 400株
淀川製鋼所	9,400.0	3,565.00	33,511,000	
中部鋼鈑	6,800.0	2,220.00	15,096,000	
丸一鋼管	25,100.0	3,751.00	94,150,100	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
モリ工業	1,300.0	3,670.00	4,771,000	
大同特殊鋼	10,400.0	6,267.00	65,176,800	
日本高周波	1,800.0	541.00	973,800	貸付株式数 900株
日本冶金工	6,000.0	4,825.00	28,950,000	
山陽特殊製鋼	8,100.0	2,919.00	23,643,900	
愛知製鋼	4,800.0	4,200.00	20,160,000	
日本金属	1,200.0	912.00	1,094,400	貸付株式数 400株
大平洋金属	5,800.0	1,642.00	9,523,600	貸付株式数 2,200株
新日本電工	40,900.0	283.00	11,574,700	
栗本鉄工所	3,900.0	2,862.00	11,161,800	
虹 技	600.0	1,573.00	943,800	
日本鑄鉄管	500.0	1,162.00	581,000	貸付株式数 100株
日本製鋼所	22,200.0	2,975.00	66,045,000	
三菱製鋼	5,200.0	1,580.00	8,216,000	
日亜鋼業	5,400.0	312.00	1,684,800	
日本精線	1,100.0	4,865.00	5,351,500	貸付株式数 100株
エンビプロHD	3,900.0	612.00	2,386,800	貸付株式数 1,600株
大紀アルミニウム	11,700.0	1,477.00	17,280,900	貸付株式数 2,600株
日本軽金属HD	22,200.0	1,613.00	35,808,600	
三井金属	24,000.0	3,816.00	91,584,000	
東邦亜鉛	4,900.0	1,726.00	8,457,400	
三菱マテリアル	55,100.0	2,524.00	139,072,400	
住友鉱山	95,600.0	4,568.00	436,700,800	
DOWAホールディングス	18,500.0	4,812.00	89,022,000	貸付株式数 2,200株
古河機金	12,100.0	1,829.00	22,130,900	
エス・サイエンス	32,200.0	24.00	772,800	貸付株式数 15,200株
大阪チタニウム	12,100.0	3,200.00	38,720,000	貸付株式数 4,700株
東邦チタニウム	14,900.0	1,897.00	28,265,300	貸付株式数 5,600株
UACJ	11,600.0	3,110.00	36,076,000	
CKサンエツ	2,000.0	3,820.00	7,640,000	貸付株式数 100株
古河電工	27,500.0	2,609.50	71,761,250	
住友電工	284,800.0	1,825.00	519,760,000	
フジクラ	88,500.0	1,230.00	108,855,000	
SWCC	9,200.0	1,977.00	18,188,400	
タツタ電線	16,800.0	704.00	11,827,200	貸付株式数 900株
カナレ電気	900.0	1,430.00	1,287,000	貸付株式数 300株
平河ヒューテック	4,700.0	1,514.00	7,115,800	貸付株式数 1,600株
いよぎんホールディング	93,700.0	1,088.00	101,945,600	
しずおかフィナンシャル	175,000.0	1,230.50	215,337,500	
ちゅうぎんフィナンシャ	66,400.0	1,075.50	71,413,200	
楽天銀行	27,300.0	1,914.00	52,252,200	貸付株式数 10,600株
リョービ	8,800.0	3,010.00	26,488,000	
アーレステイ	6,100.0	804.00	4,904,400	
AREホールディングス	33,400.0	1,930.00	64,462,000	
東洋製罐グループHD	49,200.0	2,602.50	128,043,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ホッカンホールディングス	4,400.0	1,603.00	7,053,200	
コロナ	4,500.0	916.00	4,122,000	
横河ブリッジHLDGS	10,400.0	2,836.00	29,494,400	
駒井ハルテック	900.0	1,853.00	1,667,700	
高田機工	500.0	3,255.00	1,627,500	
三和ホールディングス	75,700.0	2,238.50	169,454,450	
文化シヤッター	23,200.0	1,124.00	26,076,800	貸付株式数 400 株
三協立山	9,300.0	913.00	8,490,900	貸付株式数 3,500 株
アルインコ	6,100.0	1,098.00	6,697,800	貸付株式数 1,600 株
東洋シヤッター	1,200.0	644.00	772,800	貸付株式数 300 株
L I X I L	120,000.0	1,820.00	218,400,000	貸付株式数 29,900 株
日本ファイルコン	3,500.0	486.00	1,701,000	
ノーリツ	13,300.0	1,597.00	21,240,100	
長府製作所	8,100.0	2,133.00	17,277,300	
リンナイ	44,700.0	2,856.00	127,663,200	
ユニプレス	14,300.0	1,200.00	17,160,000	貸付株式数 1,500 株
ダイニチ工業	2,700.0	741.00	2,000,700	
日東精工	12,000.0	569.00	6,828,000	
三洋工業	600.0	2,138.00	1,282,800	
岡 部	14,400.0	755.00	10,872,000	
ジーテクト	9,200.0	1,848.00	17,001,600	
東 プ レ	14,500.0	1,777.00	25,766,500	
高周波熱錬	12,800.0	1,027.00	13,145,600	貸付株式数 2,600 株
東京製綱	4,900.0	1,365.00	6,688,500	
サンコール	4,800.0	507.00	2,433,600	
モリテックスチル	4,000.0	323.00	1,292,000	貸付株式数 2,300 株
パイオラックス	11,400.0	2,410.00	27,474,000	
エイチワン	8,400.0	798.00	6,703,200	
日本発条	73,000.0	1,152.50	84,132,500	
中央発條	6,100.0	775.00	4,727,500	
アドバネクス	700.0	1,079.00	755,300	貸付株式数 400 株
三浦工業	33,700.0	3,293.00	110,974,100	
タ ク マ	24,600.0	1,659.00	40,811,400	
テクノプロ・ホールディング	48,700.0	3,555.00	173,128,500	貸付株式数 18,900 株
アトラグループ	1,600.0	250.00	400,000	貸付株式数 600 株
アイ・アールジャパンHD	4,300.0	2,181.00	9,378,300	貸付株式数 1,600 株
K e e P e r 技研	5,100.0	6,520.00	33,252,000	
ファーストロジック	1,200.0	562.00	674,400	
三機サービス	800.0	1,081.00	864,800	貸付株式数 400 株
G u n o s y	6,500.0	602.00	3,913,000	貸付株式数 1,600 株
デザインワン・ジャパン	1,300.0	168.00	218,400	貸付株式数 200 株
イー・ガーディアン	3,000.0	2,624.00	7,872,000	貸付株式数 1,100 株
リブセンス	2,500.0	317.00	792,500	貸付株式数 1,000 株
ジャパンマテリアル	25,100.0	2,645.00	66,389,500	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ベクトル	13,000.0	1,325.00	17,225,000	
ウチヤマホールディングス	2,300.0	356.00	818,800	貸付株式数 200株
チャームケアコーポレーション	6,800.0	1,152.00	7,833,600	
キャリアリンク	3,000.0	2,454.00	7,362,000	貸付株式数 1,100株
I B J	6,200.0	611.00	3,788,200	貸付株式数 2,400株
アサンテ	4,300.0	1,650.00	7,095,000	貸付株式数 1,500株
バリューHR	7,100.0	1,274.00	9,045,400	貸付株式数 2,800株
M&Aキャピタルパートナー	6,600.0	2,856.00	18,849,600	貸付株式数 2,500株
ライドオンエクスプレスHD	3,000.0	1,010.00	3,030,000	貸付株式数 900株
E R Iホールディングス	1,400.0	2,288.00	3,203,200	
アビスト	900.0	3,565.00	3,208,500	貸付株式数 400株
シグマシス・ホールディング	12,500.0	1,625.00	20,312,500	
ウィルグループ	7,000.0	1,100.00	7,700,000	
エスクローAJ	6,700.0	142.00	951,400	貸付株式数 2,900株
メドピア	7,200.0	1,090.00	7,848,000	貸付株式数 2,700株
レアジョブ	1,000.0	1,050.00	1,050,000	貸付株式数 400株
リクルートホールディングス	608,400.0	5,308.00	3,229,387,200	
エラン	10,800.0	848.00	9,158,400	
ツガミ	17,900.0	1,189.00	21,283,100	
オークマ	8,100.0	7,030.00	56,943,000	
芝浦機械	8,100.0	4,280.00	34,668,000	
アマダ	128,900.0	1,553.50	200,246,150	
アイダエンジニア	16,600.0	1,017.00	16,882,200	
TAKISAWA	1,400.0	2,549.00	3,568,600	
FUJI	35,100.0	2,430.50	85,310,550	
牧野フライス	8,900.0	7,060.00	62,834,000	
オーエスジー	35,600.0	1,859.50	66,198,200	
ダイジェット	500.0	926.00	463,000	貸付株式数 200株
旭ダイヤモンド	22,500.0	919.00	20,677,500	
DMG森精機	49,000.0	2,679.50	131,295,500	貸付株式数 19,500株
ソディック	19,700.0	730.00	14,381,000	貸付株式数 2,500株
ディスコ	38,900.0	28,280.00	1,100,092,000	
日東工器	3,900.0	2,008.00	7,831,200	
日進工具	6,700.0	1,160.00	7,772,000	
パンチ工業	4,800.0	465.00	2,232,000	貸付株式数 2,100株
富士ダイス	2,500.0	670.00	1,675,000	貸付株式数 1,100株
土木管理総合試験	3,200.0	341.00	1,091,200	貸付株式数 100株
日本郵政	988,900.0	1,177.50	1,164,429,750	
ベルシステム24HLDGS	11,200.0	1,620.00	18,144,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
鎌倉新書	9,300.0	673.00	6,258,900	貸付株式数 3,600株 (1,300株)
SMN	1,300.0	415.00	539,500	貸付株式数 500株
一蔵	700.0	584.00	408,800	貸付株式数 200株
グローバルキッズCOMP	1,000.0	679.00	679,000	
エアトリ	6,000.0	2,287.00	13,722,000	貸付株式数 2,300株
アトラエ	4,900.0	1,170.00	5,733,000	
ストライク	3,500.0	3,340.00	11,690,000	貸付株式数 1,300株
ソラスト	22,500.0	669.00	15,052,500	
セラク	2,500.0	1,309.00	3,272,500	貸付株式数 900株
インソース	17,900.0	1,056.00	18,902,400	貸付株式数 6,900株
豊田自動織機	58,400.0	10,640.00	621,376,000	
豊和工業	2,900.0	813.00	2,357,700	貸付株式数 1,100株
石川製作所	1,300.0	1,303.00	1,693,900	貸付株式数 100株
東洋機械金属	3,700.0	715.00	2,645,500	
津田駒工業	1,000.0	426.00	426,000	貸付株式数 400株
エンシュウ	1,100.0	811.00	892,100	貸付株式数 400株
島精機製作所	12,800.0	1,888.00	24,166,400	
オプトラン	13,300.0	1,933.00	25,708,900	
NCホールディングス	1,100.0	1,791.00	1,970,100	
イワキポンプ	5,400.0	1,998.00	10,789,200	
フリー	8,400.0	1,673.00	14,053,200	
ヤマシンフィルタ	19,300.0	347.00	6,697,100	貸付株式数 200株
日阪製作所	7,800.0	971.00	7,573,800	
やまびこ	13,200.0	1,575.00	20,790,000	
野村マイクロ・サイエンス	2,700.0	6,030.00	16,281,000	
平田機工	3,900.0	7,770.00	30,303,000	
PEGASUS	8,900.0	614.00	5,464,600	貸付株式数 3,300株
マルマエ	3,500.0	1,791.00	6,268,500	貸付株式数 400株
タツモ	4,900.0	2,941.00	14,410,900	
ナブテスコ	50,700.0	2,810.00	142,467,000	
三井海洋開発	10,100.0	1,779.00	17,967,900	
レオン自動機	8,500.0	1,377.00	11,704,500	
SMC	26,200.0	71,110.00	1,863,082,000	
ホソカワミクロン	5,200.0	4,240.00	22,048,000	貸付株式数 900株
ユニオンツール	3,500.0	3,810.00	13,335,000	
瑞光	5,800.0	1,323.00	7,673,400	貸付株式数 2,200株
オイレス工業	11,300.0	2,116.00	23,910,800	貸付株式数 3,600株
日精エーエスビー	3,200.0	4,475.00	14,320,000	
サトーホールディングス	11,500.0	2,074.00	23,851,000	貸付株式数 900株
技研製作所	7,600.0	2,068.00	15,716,800	貸付株式数 1,300株
日本エアータック	3,800.0	1,263.00	4,799,400	
カワタ	1,500.0	1,121.00	1,681,500	
日精樹脂工業	6,000.0	1,062.00	6,372,000	
オカダアイヨン	1,700.0	2,171.00	3,690,700	貸付株式数 800株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ワイエイシイホールディングス	2,300.0	2,791.00	6,419,300	貸付株式数 700株
小松製作所	378,300.0	4,271.00	1,615,719,300	
住友重機械	47,800.0	3,833.00	183,217,400	
日立建機	32,200.0	4,758.00	153,207,600	
日工	12,100.0	676.00	8,179,600	
巴工業	3,100.0	3,050.00	9,455,000	貸付株式数 1,200株
井関農機	7,600.0	1,204.00	9,150,400	
TOWA	8,200.0	3,915.00	32,103,000	
丸山製作所	900.0	2,254.00	2,028,600	
北川鉄工所	3,200.0	1,485.00	4,752,000	
シンニッタン	5,800.0	251.00	1,455,800	
ローツェ	4,200.0	11,550.00	48,510,000	貸付株式数 1,600株
タカキタ	1,500.0	493.00	739,500	貸付株式数 800株
クボタ	423,700.0	2,397.00	1,015,608,900	
荏原実業	4,100.0	2,999.00	12,295,900	
東洋エンジニア	10,100.0	642.00	6,484,200	
三菱化工機	2,500.0	2,798.00	6,995,000	
月島ホールディングス	10,700.0	1,433.00	15,333,100	
帝国電機製作所	5,700.0	2,660.00	15,162,000	
東京機械	1,200.0	407.00	488,400	
新東工業	16,300.0	1,124.00	18,321,200	
渋谷工業	7,600.0	2,661.00	20,223,600	
アイチ コーポレーション	11,300.0	964.00	10,893,200	
小森コーポレーション	18,700.0	1,135.00	21,224,500	
鶴見製作所	6,200.0	3,065.00	19,003,000	
日本ギア工業	1,800.0	405.00	729,000	貸付株式数 800株
酒井重工業	900.0	5,320.00	4,788,000	
荏原製作所	33,100.0	7,378.00	244,211,800	
石井鉄工所	600.0	3,120.00	1,872,000	
西島製作所	6,900.0	1,962.00	13,537,800	
北越工業	8,100.0	2,217.00	17,957,700	貸付株式数 900株
ダイキン工業	96,400.0	25,675.00	2,475,070,000	
オルガノ	11,100.0	3,900.00	43,290,000	
トーヨーカネツ	3,000.0	3,470.00	10,410,000	
栗田工業	45,100.0	5,652.00	254,905,200	
椿本チエイン	11,500.0	3,970.00	45,655,000	
大同工業	2,100.0	733.00	1,539,300	貸付株式数 900株
日機装	18,600.0	1,016.00	18,897,600	
木村化工機	6,000.0	733.00	4,398,000	貸付株式数 100株 (100株)
レイズネクスト	11,000.0	1,461.00	16,071,000	
アネスト岩田	13,700.0	1,252.00	17,152,400	貸付株式数 100株
ダイフク	124,900.0	2,739.00	342,101,100	貸付株式数 48,600株
サムコ	2,200.0	5,150.00	11,330,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
加藤製作所	2,600.0	1,292.00	3,359,200	
油研工業	800.0	2,273.00	1,818,400	
タダノ	46,500.0	1,312.50	61,031,250	
フジテック	28,300.0	3,740.00	105,842,000	
CKD	22,400.0	2,168.00	48,563,200	
平和	26,800.0	2,258.00	60,514,400	
理想科学工業	6,400.0	2,340.00	14,976,000	
SANKYO	15,900.0	6,320.00	100,488,000	
日本金銭機械	8,900.0	1,012.00	9,006,800	貸付株式数 3,400 株
マースグループHLDGS	4,600.0	2,910.00	13,386,000	
フクシマガリレイ	5,900.0	5,250.00	30,975,000	
オーイズミ	2,000.0	430.00	860,000	貸付株式数 1,000 株
ダイコク電機	4,400.0	5,470.00	24,068,000	貸付株式数 1,700 株
竹内製作所	14,700.0	4,920.00	72,324,000	
アマノ	22,900.0	3,260.00	74,654,000	
JUKI	12,500.0	633.00	7,912,500	
サンデン	7,800.0	193.00	1,505,400	貸付株式数 4,200 株
ジャノメ	8,100.0	682.00	5,524,200	
ブラザー工業	107,900.0	2,452.50	264,624,750	
マックス	9,900.0	2,775.00	27,472,500	
モリタホールディングス	14,000.0	1,663.00	23,282,000	
グローリー	19,400.0	3,125.00	60,625,000	
新晃工業	8,200.0	2,099.00	17,211,800	
大和冷機工業	12,400.0	1,444.00	17,905,600	
セガサミーホールディングス	64,900.0	2,846.50	184,737,850	
日本ピストンリング	1,800.0	1,711.00	3,079,800	
リケン	3,200.0	3,375.00	10,800,000	
TPR	9,200.0	1,898.00	17,461,600	
ツバキ・ナカシマ	16,200.0	817.00	13,235,400	貸付株式数 1,900 株
ホシザキ	47,700.0	5,728.00	273,225,600	
大豊工業	6,900.0	884.00	6,099,600	
日本精工	148,400.0	869.10	128,974,440	
NTN	159,400.0	286.80	45,715,920	
ジェイテクト	71,900.0	1,418.00	101,954,200	
不二越	6,000.0	4,130.00	24,780,000	
ミネベアミツミ	140,500.0	2,398.00	336,919,000	
日本トムソン	19,800.0	572.00	11,325,600	
THK	46,600.0	2,639.50	123,000,700	
ユーシン精機	6,300.0	703.00	4,428,900	
前澤給装工業	5,500.0	1,238.00	6,809,000	貸付株式数 1,000 株
イーグル工業	8,900.0	1,762.00	15,681,800	
前澤工業	3,000.0	1,028.00	3,084,000	
日本ピラー工業	7,500.0	4,220.00	31,650,000	
キッツ	27,100.0	1,061.00	28,753,100	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
日立	392,600.0	10,025.00	3,935,815,000	
東芝	151,400.0	4,600.00	696,440,000	
三菱電機	834,400.0	1,928.00	1,608,723,200	
富士電機	49,100.0	6,927.00	340,115,700	
東洋電機製造	1,800.0	1,028.00	1,850,400	
安川電機	95,700.0	5,764.00	551,614,800	
シンフォニアテクノロジー	8,900.0	1,621.00	14,426,900	
明電舎	12,300.0	2,255.00	27,736,500	
オリジン	1,200.0	1,270.00	1,524,000	
山洋電気	3,500.0	7,150.00	25,025,000	
デンヨー	6,200.0	2,117.00	13,125,400	
PHCホールディングス	11,300.0	1,528.00	17,266,400	
ソシオネクスト	11,600.0	15,780.00	183,048,000	
ベイカレントコンサルティング	65,100.0	5,126.00	333,702,600	
ORCHESTRA HLDGS	1,700.0	1,182.00	2,009,400	
アイモバイル	3,600.0	1,229.00	4,424,400	
キャリアインデックス	1,800.0	276.00	496,800	貸付株式数 700株
MS-Japan	1,900.0	1,177.00	2,236,300	貸付株式数 600株
船場	1,200.0	876.00	1,051,200	貸付株式数 200株
ジャパンエレベーターSHD	29,300.0	2,300.00	67,390,000	
フルテック	800.0	1,149.00	919,200	
グリーンズ	1,800.0	1,750.00	3,150,000	貸付株式数 700株
ツナググループHLDGS	1,500.0	862.00	1,293,000	貸付株式数 500株
GAMEWITH	1,600.0	329.00	526,400	貸付株式数 600株
MS&CONSULTING	800.0	680.00	544,000	貸付株式数 100株
ウェルビー	6,000.0	557.00	3,342,000	貸付株式数 2,300株
エル・ティー・エス	900.0	4,155.00	3,739,500	
ミダックホールディングス	5,000.0	1,891.00	9,455,000	貸付株式数 1,900株
日総工産	6,300.0	795.00	5,008,500	
キュービーネットHLDGS	3,900.0	1,577.00	6,150,300	
RPAホールディングス	11,100.0	352.00	3,907,200	
三桜工業	12,200.0	1,025.00	12,505,000	
マキタ	100,400.0	3,907.00	392,262,800	
東芝テック	11,700.0	3,565.00	41,710,500	
芝浦メカトロニクス	1,400.0	23,560.00	32,984,000	貸付株式数 200株
マブチモーター	20,000.0	4,488.00	89,760,000	
ニデック	196,400.0	7,387.00	1,450,806,800	
ユーエムシーエレクトロニクス	5,900.0	500.00	2,950,000	貸付株式数 2,200株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
トレックス・セミコンダクター	3,800.0	2,362.00	8,975,600	貸付株式数 1,400株
東光高岳	4,900.0	2,181.00	10,686,900	貸付株式数 1,800株
ダブル・スコープ	23,100.0	1,128.00	26,056,800	貸付株式数 9,000株
宮越ホールディングス	3,600.0	1,054.00	3,794,400	貸付株式数 1,400株
ダイヘン	7,300.0	5,310.00	38,763,000	
ヤーマン	13,900.0	1,050.00	14,595,000	貸付株式数 5,400株
JVCケンウッド	73,500.0	668.00	49,098,000	
ミマキエンジニアリング	7,600.0	774.00	5,882,400	
I-PEX	5,600.0	1,680.00	9,408,000	貸付株式数 900株
大崎電気	19,200.0	645.00	12,384,000	
オムロン	74,000.0	7,013.00	518,962,000	
日東工業	10,900.0	3,830.00	41,747,000	
IDEC	11,900.0	3,170.00	37,723,000	
正興電機製作所	1,800.0	1,132.00	2,037,600	
不二電機工業	1,000.0	1,130.00	1,130,000	貸付株式数 600株 (100株)
ジーエス・ユアサコーポ	26,500.0	2,736.00	72,504,000	
サクサホールディングス	1,100.0	2,575.00	2,832,500	
メルコホールディングス	2,000.0	3,170.00	6,340,000	
テクノメディカ	1,900.0	2,161.00	4,105,900	貸付株式数 700株
ダイヤモンドエレクトリックHD	2,700.0	849.00	2,292,300	貸付株式数 1,000株
日本電気	114,200.0	8,061.00	920,566,200	
富士通	80,400.0	18,805.00	1,511,922,000	
沖電気	36,500.0	1,054.00	38,471,000	
岩崎通信機	2,300.0	829.00	1,906,700	
電気興業	3,200.0	2,498.00	7,993,600	
サンケン電気	7,500.0	10,940.00	82,050,000	
ナカヨ	800.0	1,267.00	1,013,600	貸付株式数 300株
アイホン	4,800.0	2,979.00	14,299,200	貸付株式数 1,900株
ルネサスエレクトロニクス	526,900.0	2,474.00	1,303,550,600	
セイコーエプソン	103,600.0	2,296.00	237,865,600	
ワコム	61,400.0	613.00	37,638,200	貸付株式数 22,600株
アルバック	19,200.0	5,757.00	110,534,400	
アクセル	2,000.0	1,789.00	3,578,000	
EIZO	5,900.0	5,170.00	30,503,000	
ジャパンディスプレイ	61,700.0	40.00	2,468,000	
日本信号	18,500.0	970.00	17,945,000	
京三製作所	17,100.0	461.00	7,883,100	
能美防災	10,900.0	1,841.00	20,066,900	
ホーチキ	6,100.0	1,694.00	10,333,400	
星和電機	2,400.0	496.00	1,190,400	貸付株式数 1,000株
エレコム	19,300.0	1,816.00	35,048,800	
パナソニックホールディング	953,600.0	1,723.00	1,643,052,800	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
シャープ	97,200.0	934.80	90,862,560	貸付株式数 37,800 株 (1,200 株)
アンリツ	56,900.0	1,102.00	62,703,800	
富士通ゼネラル	22,900.0	2,822.50	64,635,250	
ソニーグループ	565,400.0	12,630.00	7,141,002,000	※
T D K	127,800.0	5,311.00	678,745,800	
帝国通信工業	3,600.0	1,934.00	6,962,400	
タムラ製作所	34,600.0	583.00	20,171,800	貸付株式数 1,500 株
アルプスアルパイン	72,100.0	1,223.00	88,178,300	
池上通信機	1,700.0	743.00	1,263,100	貸付株式数 700 株
日本電波工業	9,700.0	1,499.00	14,540,300	貸付株式数 900 株
鈴木	4,300.0	1,126.00	4,841,800	
メイコー	8,800.0	3,445.00	30,316,000	
日本トリム	1,800.0	3,100.00	5,580,000	
ローランド ディー. ジー.	4,400.0	3,525.00	15,510,000	
フオスター電機	7,500.0	882.00	6,615,000	
S M K	1,900.0	2,566.00	4,875,400	
ヨコオ	6,400.0	1,671.00	10,694,400	
ティアック	8,100.0	114.00	923,400	貸付株式数 3,200 株
ホシデン	18,800.0	1,856.00	34,892,800	
ヒロセ電機	13,000.0	17,590.00	228,670,000	
日本航空電子	16,500.0	3,125.00	51,562,500	
T O A	9,200.0	1,102.00	10,138,400	
マクセル	16,400.0	1,621.00	26,584,400	
古野電気	10,500.0	1,360.00	14,280,000	
スミダコーポレーション	10,800.0	1,633.00	17,636,400	
アイコム	3,100.0	3,460.00	10,726,000	貸付株式数 1,000 株
リオン	3,300.0	2,317.00	7,646,100	
横河電機	88,300.0	2,991.00	264,105,300	
新電元工業	3,100.0	3,185.00	9,873,500	
アズビル	55,900.0	4,933.00	275,754,700	
東亜ディーケーケー	2,400.0	883.00	2,119,200	貸付株式数 1,100 株
日本光電工業	36,900.0	3,939.00	145,349,100	
チノール	3,300.0	2,061.00	6,801,300	貸付株式数 1,100 株
共和電業	4,900.0	367.00	1,798,300	
日本電子材料	5,300.0	1,540.00	8,162,000	
堀場製作所	15,300.0	7,923.00	121,221,900	
アドバンテスト	63,000.0	17,265.00	1,087,695,000	
小野測器	2,100.0	460.00	966,000	
エスペック	6,400.0	2,451.00	15,686,400	
キーエンス	80,000.0	59,900.00	4,792,000,000	※
日置電機	3,800.0	7,620.00	28,956,000	
シスメックス	69,000.0	7,736.00	533,784,000	
日本マイクロニクス	14,400.0	2,274.00	32,745,600	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
メガチップス	6,600.0	4,255.00	28,083,000	
OBARA GROUP	4,400.0	4,175.00	18,370,000	貸付株式数 1,400 株
IMAGICA GROUP	6,600.0	605.00	3,993,000	貸付株式数 2,600 株
澤藤電機	600.0	1,272.00	763,200	貸付株式数 300 株
デンソー	164,900.0	10,280.00	1,695,172,000	
原田工業	2,300.0	832.00	1,913,600	貸付株式数 500 株
コーセル	9,600.0	1,314.00	12,614,400	
イリソ電子工業	7,300.0	4,360.00	31,828,000	貸付株式数 2,700 株
オプテックスグループ	14,700.0	1,747.00	25,680,900	
千代田インテグレ	3,100.0	2,919.00	9,048,900	
レーザーテック	36,600.0	22,105.00	809,043,000	
スタンレー電気	56,300.0	2,511.00	141,369,300	
ウシオ電機	40,600.0	1,891.00	76,774,600	
岡谷電機	4,000.0	319.00	1,276,000	貸付株式数 1,900 株
ヘリオステクノH	4,900.0	442.00	2,165,800	貸付株式数 2,300 株
エノモト	1,300.0	1,719.00	2,234,700	貸付株式数 600 株
日本セラミック	6,500.0	2,599.00	16,893,500	
遠藤照明	2,400.0	1,280.00	3,072,000	
古河電池	5,900.0	987.00	5,823,300	
双信電機	2,100.0	347.00	728,700	貸付株式数 900 株
山一電機	6,500.0	1,781.00	11,576,500	
図 研	6,900.0	4,355.00	30,049,500	
日本電子	20,000.0	4,635.00	92,700,000	
カ シ オ	59,600.0	1,265.00	75,394,000	
ファナック	389,800.0	4,124.00	1,607,535,200	
日本シイエムケイ	16,900.0	635.00	10,731,500	
エンプラス	2,300.0	11,500.00	26,450,000	貸付株式数 900 株
大真空	9,700.0	818.00	7,934,600	貸付株式数 2,400 株
ロ ー ム	36,900.0	11,805.00	435,604,500	
浜松ホトニクス	64,100.0	6,690.00	428,829,000	
三井ハイテック	8,300.0	10,090.00	83,747,000	貸付株式数 3,200 株 (200 株)
新光電気工業	28,300.0	5,975.00	169,092,500	
京 セ ラ	124,200.0	7,519.00	933,859,800	
協栄産業	500.0	2,200.00	1,100,000	貸付株式数 200 株
太陽誘電	38,900.0	4,228.00	164,469,200	
村田製作所	242,400.0	8,115.00	1,967,076,000	
双葉電子工業	15,100.0	569.00	8,591,900	
日東電工	58,200.0	10,265.00	597,423,000	
北陸電気工業	2,000.0	1,490.00	2,980,000	
東海理化電機	22,500.0	2,404.00	54,090,000	
ニチコン	16,300.0	1,370.00	22,331,000	
日本ケミコン	7,900.0	1,422.00	11,233,800	
K O A	12,100.0	1,873.00	22,663,300	貸付株式数 3,800 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
三井E & S	21,700.0	613.00	13,302,100	
日立造船	65,800.0	884.00	58,167,200	
三菱重工業	141,200.0	9,119.00	1,287,602,800	
川崎重工業	60,200.0	4,108.00	247,301,600	
I H I	50,900.0	3,834.00	195,150,600	
名村造船所	13,700.0	1,089.00	14,919,300	貸付株式数 7,200 株
サノヤスホールディングス	7,400.0	152.00	1,124,800	貸付株式数 3,600 株
スプリックス	1,500.0	834.00	1,251,000	
マネジメントソリューションズ	3,500.0	3,905.00	13,667,500	貸付株式数 1,600 株
プロレド・パートナーズ	2,100.0	501.00	1,052,100	貸付株式数 200 株
AND FACTORY	1,600.0	340.00	544,000	貸付株式数 500 株
テノ. ホールディングス	700.0	623.00	436,100	貸付株式数 200 株
フロンティア・マネジメント	2,100.0	1,445.00	3,034,500	
ピアラ	1,100.0	429.00	471,900	貸付株式数 400 株
コプロ・ホールディングス	900.0	2,587.00	2,328,300	貸付株式数 100 株
ギークス	700.0	729.00	510,300	貸付株式数 400 株
アンビスホールディングス	8,800.0	2,933.00	25,810,400	
カーブスホールディングス	22,500.0	731.00	16,447,500	
フォーラムエンジニアリング	4,900.0	1,299.00	6,365,100	
FAST FITNESS JAP	2,800.0	1,409.00	3,945,200	
日本車輛	3,100.0	2,068.00	6,410,800	貸付株式数 300 株
三菱ロジスネクスト	12,800.0	1,370.00	17,536,000	
近畿車輛	800.0	2,050.00	1,640,000	貸付株式数 300 株
一家ホールディングス	1,300.0	718.00	933,400	貸付株式数 600 株
フルサト・マルカHD	7,600.0	2,858.00	21,720,800	
ヤマエグループHD	4,800.0	4,145.00	19,896,000	
ジャパングラフトホールデイ	3,400.0	222.00	754,800	貸付株式数 1,800 株
F P G	26,600.0	1,473.00	39,181,800	
島根銀行	1,800.0	540.00	972,000	貸付株式数 800 株
じもとホールディングス	4,600.0	422.00	1,941,200	
全国保証	20,600.0	5,063.00	104,297,800	
めぶきフィナンシャルG	390,800.0	417.10	163,002,680	
ジャパンインベストメントA	6,400.0	1,918.00	12,275,200	
東京きらぼしFG	10,100.0	4,235.00	42,773,500	
九州フィナンシャルG	138,600.0	764.60	105,973,560	貸付株式数 36,400 株
かんぽ生命保険	91,700.0	2,468.00	226,315,600	
ゆうちょ銀行	216,300.0	1,205.00	260,641,500	
あんしん保証	2,500.0	295.00	737,500	貸付株式数 1,100 株
富山第一銀行	25,000.0	936.00	23,400,000	貸付株式数 9,400 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
コンコルディア・フィナンシャル	422,500.0	687.60	290,511,000	
ジェイリース	1,700.0	2,162.00	3,675,400	
西日本フィナンシャルHD	48,900.0	1,603.00	78,386,700	
イントラスト	2,000.0	928.00	1,856,000	
日本モーゲージサービス	2,800.0	574.00	1,607,200	貸付株式数 1,200 株
C a s a	2,000.0	867.00	1,734,000	貸付株式数 700 株
アルヒ	9,700.0	937.00	9,088,900	貸付株式数 3,700 株 (3,600 株)
プレミアグループ	13,200.0	1,655.00	21,846,000	
日産自動車	1,135,600.0	634.70	720,765,320	
いすゞ自動車	232,400.0	1,906.50	443,070,600	
トヨタ自動車	4,389,200.0	2,637.00	11,574,320,400	
日野自動車	103,000.0	576.30	59,358,900	
三菱自動車工業	311,900.0	588.40	183,521,960	貸付株式数 110,600 株
エフテック	3,700.0	823.00	3,045,100	
レシップホールディングス	2,100.0	550.00	1,155,000	
GMB	1,000.0	2,033.00	2,033,000	貸付株式数 400 株
ファルテック	800.0	584.00	467,200	貸付株式数 200 株
武蔵精密工業	19,500.0	1,734.00	33,813,000	
日産車体	14,100.0	939.00	13,239,900	貸付株式数 3,700 株
新明和工業	25,100.0	1,455.00	36,520,500	
極東開発工業	13,200.0	1,910.00	25,212,000	
トピー工業	6,500.0	2,403.00	15,619,500	
ティラド	2,000.0	2,194.00	4,388,000	
タチエス	12,600.0	1,807.00	22,768,200	
N O K	31,000.0	2,119.00	65,689,000	
フタバ産業	21,400.0	745.00	15,943,000	
K Y B	7,700.0	4,925.00	37,922,500	
市光工業	14,400.0	568.00	8,179,200	
大同メタル工業	15,500.0	562.00	8,711,000	
プレス工業	35,700.0	684.00	24,418,800	
ミクニ	6,100.0	495.00	3,019,500	
太平洋工業	18,300.0	1,491.00	27,285,300	
河西工業	7,000.0	289.00	2,023,000	貸付株式数 2,700 株
アイシン	61,600.0	4,991.00	307,445,600	
マ ツ ダ	264,400.0	1,643.00	434,409,200	
今仙電機製作所	3,300.0	657.00	2,168,100	
本田技研	649,800.0	4,931.00	3,204,163,800	※
スズキ	146,800.0	5,941.00	872,138,800	
S U B A R U	252,900.0	2,922.00	738,973,800	
安永	2,300.0	828.00	1,904,400	貸付株式数 1,200 株
ヤマハ発動機	115,200.0	3,895.00	448,704,000	
小糸製作所	96,100.0	2,459.50	236,357,950	貸付株式数 11,100 株
T B K	5,100.0	453.00	2,310,300	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
エクセディ	13,100.0	2,740.00	35,894,000	
ミツバ	15,000.0	774.00	11,610,000	
豊田合成	23,300.0	3,275.00	76,307,500	
愛三工業	13,200.0	1,353.00	17,859,600	
盟和産業	700.0	1,022.00	715,400	貸付株式数 300株
日本プラス	4,100.0	501.00	2,054,100	
ヨロズ	7,500.0	958.00	7,185,000	貸付株式数 2,700株
エフ・シー・シー	14,200.0	1,965.00	27,903,000	
新家工業	1,200.0	2,896.00	3,475,200	
シマノ	32,400.0	21,680.00	702,432,000	貸付株式数 12,600株
テイ・エス テック	36,600.0	1,759.50	64,397,700	貸付株式数 14,200株
33FG	7,000.0	1,851.00	12,957,000	
第四北越フィナンシャルG	12,400.0	3,835.00	47,554,000	
ひろぎんHLDGS	102,700.0	940.60	96,599,620	
マーキュリアホールディングス	2,700.0	782.00	2,111,400	貸付株式数 1,000株
おきなわFG	7,200.0	2,433.00	17,517,600	
ダイレクトマーケティングミクス	8,500.0	572.00	4,862,000	
ポピンズ	1,200.0	1,242.00	1,490,400	
LITALICO	6,400.0	2,230.00	14,272,000	
コンフィデンス・インターワーク	300.5	1,619.00	486,509	貸付株式数 100株
十六FG	10,200.0	3,860.00	39,372,000	
北國FHD	8,300.0	5,450.00	45,235,000	貸付株式数 600株
ネットプロHD	26,000.0	392.00	10,192,000	貸付株式数 8,100株
プロクレアホールディングス	9,600.0	2,055.00	19,728,000	
あいちフィナンシャルグル	11,000.0	2,624.00	28,864,000	
ジャムコ	2,900.0	1,725.00	5,002,500	貸付株式数 500株
小野建	8,300.0	1,727.00	14,334,100	
はるやまHLDGS	2,600.0	519.00	1,349,400	貸付株式数 1,100株
南陽	1,000.0	2,230.00	2,230,000	貸付株式数 500株
ノジマ	27,600.0	1,310.00	36,156,000	
佐鳥電機	3,500.0	1,766.00	6,181,000	
カップ・クリエイト	13,400.0	1,613.00	21,614,200	貸付株式数 5,100株
エコートレーディング	1,100.0	1,378.00	1,515,800	貸付株式数 400株
伯東	4,800.0	5,370.00	25,776,000	
コンドーテック	6,300.0	1,185.00	7,465,500	貸付株式数 2,200株
中山福	2,900.0	350.00	1,015,000	
ライトオン	4,400.0	544.00	2,393,600	貸付株式数 1,600株
ナガイレーベン	10,700.0	2,261.00	24,192,700	貸付株式数 200株
三菱食品	7,800.0	4,020.00	31,356,000	
良品計画	92,400.0	1,916.50	177,084,600	
パリミキホールディングス	7,300.0	397.00	2,898,100	貸付株式数 2,600株
松田産業	6,400.0	2,293.00	14,675,200	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
第一興商	32,700.0	2,826.00	92,410,200	
メディopalHD	80,900.0	2,536.00	205,162,400	
アドヴァングループ	7,800.0	1,021.00	7,963,800	
S PK	3,700.0	2,059.00	7,618,300	
萩原電気HLDGS	3,500.0	4,385.00	15,347,500	
アルビス	2,900.0	2,449.00	7,102,100	
アズワン	12,100.0	5,827.00	70,506,700	
スズデン	2,900.0	2,287.00	6,632,300	
尾家産業	1,300.0	1,926.00	2,503,800	貸付株式数 300株
シモジマ	5,800.0	1,216.00	7,052,800	貸付株式数 200株
ドウシシャ	8,900.0	2,439.00	21,707,100	
小津産業	1,200.0	1,625.00	1,950,000	貸付株式数 600株
コナカ	6,500.0	449.00	2,918,500	
高速	4,400.0	2,068.00	9,099,200	
ハウス ローゼ	800.0	1,614.00	1,291,200	
G-7ホールディングス	10,600.0	1,283.00	13,599,800	
たけびし	3,300.0	1,927.00	6,359,100	貸付株式数 1,200株
イオン北海道	12,400.0	860.00	10,664,000	貸付株式数 4,600株
コジマ	14,300.0	641.00	9,166,300	貸付株式数 5,400株
ヒマラヤ	2,000.0	943.00	1,886,000	貸付株式数 900株
コーナン商事	11,500.0	3,755.00	43,182,500	
ネットワンシステムズ	29,900.0	2,824.50	84,452,550	
エコス	3,100.0	2,054.00	6,367,400	貸付株式数 1,100株
ワタミ	10,200.0	1,200.00	12,240,000	貸付株式数 3,900株
マルシェ	1,900.0	299.00	568,100	貸付株式数 800株
リックス	1,200.0	3,125.00	3,750,000	
システムソフト	27,200.0	80.00	2,176,000	貸付株式数 1,500株
パンパシフィックHD	170,700.0	3,131.00	534,461,700	
丸文	7,600.0	1,208.00	9,180,800	
西松屋チェーン	18,800.0	1,662.00	31,245,600	貸付株式数 7,200株
ゼンショーホールディングス	46,300.0	6,820.00	315,766,000	貸付株式数 18,000株
ハピネット	7,200.0	2,632.00	18,950,400	
幸楽苑ホールディングス	5,600.0	1,033.00	5,784,800	貸付株式数 2,100株
ハークスレイ	2,000.0	777.00	1,554,000	
橋本総業HLDGS	3,300.0	1,152.00	3,801,600	
日本ライフライン	24,800.0	1,201.00	29,784,800	
サイゼリヤ	12,500.0	4,675.00	58,437,500	貸付株式数 4,400株
タカショー	7,300.0	653.00	4,766,900	貸付株式数 2,800株
VTホールディングス	32,000.0	527.00	16,864,000	
アルゴグラフィックス	7,300.0	3,420.00	24,966,000	
魚力	2,700.0	2,226.00	6,010,200	貸付株式数 1,000株
IDOM	25,600.0	783.00	20,044,800	貸付株式数 9,900株
日本エム・ディ・エム	4,700.0	771.00	3,623,700	
ポプラ	1,400.0	228.00	319,200	貸付株式数 200株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
フジ・コーポレーション	4,200.0	2,055.00	8,631,000	
ユナイテッドアローズ	9,100.0	2,054.00	18,691,400	貸付株式数 1,000 株
進和	5,200.0	2,376.00	12,355,200	貸付株式数 2,000 株
エスケイジャパン	1,300.0	716.00	930,800	
ダイトロン	3,300.0	3,205.00	10,576,500	
ハイデイ日高	12,600.0	2,982.00	37,573,200	貸付株式数 4,700 株
シークス	12,100.0	1,550.00	18,755,000	貸付株式数 4,100 株
YU-WA CREATION H	4,000.0	186.00	744,000	
コロワイド	39,000.0	2,590.50	101,029,500	貸付株式数 15,100 株
田中商事	1,500.0	708.00	1,062,000	貸付株式数 100 株
オーハシテクニカ	4,100.0	1,723.00	7,064,300	
壺番屋	6,700.0	5,690.00	38,123,000	貸付株式数 1,300 株
白銅	3,000.0	2,383.00	7,149,000	貸付株式数 1,100 株
トップカルチャー	2,200.0	187.00	411,400	貸付株式数 600 株
PLANT	1,300.0	821.00	1,067,300	
スギホールディングス	17,000.0	6,583.00	111,911,000	
ダイコー通産	600.0	1,198.00	718,800	貸付株式数 200 株
薬王堂ホールディングス	4,800.0	2,650.00	12,720,000	
島津製作所	97,300.0	4,258.00	414,303,400	
J M S	7,300.0	555.00	4,051,500	
クボテック	1,200.0	288.00	345,600	貸付株式数 400 株
長野計器	5,800.0	2,638.00	15,300,400	
ブイ・テクノロジー	3,900.0	2,358.00	9,196,200	
スター精密	15,300.0	1,913.00	29,268,900	
東京計器	6,100.0	1,526.00	9,308,600	貸付株式数 1,800 株
愛知時計	3,000.0	1,730.00	5,190,000	
インターアクション	3,800.0	1,077.00	4,092,600	貸付株式数 1,200 株
オーバル	4,600.0	437.00	2,010,200	貸付株式数 1,800 株
東京精密	17,600.0	8,300.00	146,080,000	
マニー	32,000.0	1,890.50	60,496,000	
ニコン	115,600.0	1,613.00	186,462,800	
トプコン	42,100.0	1,714.50	72,180,450	
オリンパス	492,000.0	2,033.00	1,000,236,000	
理研計器	5,000.0	5,400.00	27,000,000	
SCREENホールディングス	13,700.0	14,470.00	198,239,000	
キヤノン電子	8,800.0	1,859.00	16,359,200	貸付株式数 1,200 株
タムロン	4,900.0	4,490.00	22,001,000	
HOYA	169,400.0	16,105.00	2,728,187,000	
シード	2,600.0	793.00	2,061,800	
ノーリツ鋼機	7,600.0	3,240.00	24,624,000	
A&Dホロンホールディングス	11,700.0	1,750.00	20,475,000	
朝日インテック	89,300.0	2,922.00	260,934,600	
キヤノン	398,700.0	3,609.00	1,438,908,300	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
リコー	200,400.0	1,232.00	246,892,800	
シチズン時計	73,500.0	916.00	67,326,000	貸付株式数 19,300株
リズム	1,600.0	1,716.00	2,745,600	
大研医器	3,900.0	552.00	2,152,800	
メニコン	27,500.0	2,031.50	55,866,250	
シンシア	600.0	551.00	330,600	貸付株式数 200株
KYORITSU	7,700.0	183.00	1,409,100	
中本パックス	1,800.0	1,664.00	2,995,200	貸付株式数 100株
スノーピーク	11,400.0	1,447.00	16,495,800	貸付株式数 4,800株 (100株)
パラマウントベッドHD	18,400.0	2,389.00	43,957,600	
トランザクション	5,300.0	1,887.00	10,001,100	貸付株式数 2,000株
粧美堂	1,500.0	501.00	751,500	貸付株式数 600株
ニホンフラッシュ	7,300.0	906.00	6,613,800	
前田工織	6,700.0	3,120.00	20,904,000	貸付株式数 2,400株
永大産業	5,500.0	224.00	1,232,000	
アートネイチャー	8,000.0	788.00	6,304,000	
バンダイナムコHLDGS	219,000.0	3,336.00	730,584,000	
アイフィスジャパン	1,400.0	600.00	840,000	貸付株式数 400株
SHOEI	18,000.0	2,422.00	43,596,000	
フランスベッドHLDGS	9,000.0	1,223.00	11,007,000	貸付株式数 3,400株
マーベラス	12,800.0	690.00	8,832,000	
パイロットコーポレーション	11,200.0	4,713.00	52,785,600	
萩原工業	5,300.0	1,728.00	9,158,400	貸付株式数 2,000株 (400株)
エイベックス	13,600.0	1,471.00	20,005,600	
フジシールインターナショナル	16,200.0	1,769.00	28,657,800	
タカラトミー	36,400.0	2,395.00	87,178,000	
広済堂ホールディングス	3,600.0	2,741.00	9,867,600	
エステールホールディングス	1,200.0	637.00	764,400	貸付株式数 700株
レック	11,400.0	960.00	10,944,000	
タカノ	1,900.0	922.00	1,751,800	貸付株式数 800株
三光合成	10,100.0	757.00	7,645,700	
プロネクサス	6,900.0	1,122.00	7,741,800	
ホクシン	4,000.0	134.00	536,000	貸付株式数 2,000株
ウッドワン	1,700.0	1,056.00	1,795,200	貸付株式数 100株
大建工業	4,700.0	3,045.00	14,311,500	
きもと	7,700.0	186.00	1,432,200	
凸版印刷	98,300.0	3,664.00	360,171,200	
大日本印刷	87,400.0	4,065.00	355,281,000	
共同印刷	2,300.0	3,270.00	7,521,000	
NISSHA	13,800.0	1,731.00	23,887,800	
光村印刷	600.0	1,319.00	791,400	貸付株式数 200株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
藤森工業	6,300.0	3,885.00	24,475,500	
ヴィア・ホールディングス	9,000.0	103.00	927,000	貸付株式数 300株
TAKARA & COMPANY	5,200.0	2,475.00	12,870,000	
前澤化成工業	5,000.0	1,528.00	7,640,000	貸付株式数 1,800株
未来工業	2,800.0	3,345.00	9,366,000	
アシックス	68,100.0	5,215.00	355,141,500	
ツツミ	1,400.0	2,533.00	3,546,200	貸付株式数 600株
ウェーブロックHLDGS	1,700.0	668.00	1,135,600	貸付株式数 1,200株
ジェイエスピー	5,600.0	2,030.00	11,368,000	貸付株式数 1,400株
ニチハ	9,900.0	3,220.00	31,878,000	
ローランド	5,900.0	3,930.00	23,187,000	
エフピコ	15,200.0	2,728.00	41,465,600	
小松ウオール工業	2,900.0	3,005.00	8,714,500	
ヤマハ	50,400.0	4,450.00	224,280,000	
河合楽器	2,200.0	3,380.00	7,436,000	
クリナップ	8,700.0	725.00	6,307,500	貸付株式数 2,800株
ビジョン	50,900.0	1,707.00	86,886,300	
天馬	6,500.0	2,584.00	16,796,000	
キングジム	6,900.0	875.00	6,037,500	貸付株式数 2,700株
象印マホービン	21,700.0	1,893.00	41,078,100	
リンテック	16,100.0	2,494.00	40,153,400	
信越ポリマー	14,800.0	1,377.00	20,379,600	
東リ	11,700.0	351.00	4,106,700	
イトーキ	16,400.0	1,483.00	24,321,200	
任天堂	504,700.0	6,368.00	3,213,929,600	
三菱鉛筆	11,300.0	1,890.00	21,357,000	
松風	3,600.0	2,201.00	7,923,600	
タカラスタンダード	14,300.0	1,897.00	27,127,100	
コクヨ	34,600.0	2,404.50	83,195,700	
ナカバヤシ	8,500.0	551.00	4,683,500	
ニフコ	28,900.0	4,384.00	126,697,600	
立川ブラインド	3,600.0	1,430.00	5,148,000	
グローブライド	6,400.0	2,064.00	13,209,600	
オカムラ	24,000.0	2,305.00	55,320,000	
バルカー	6,700.0	4,360.00	29,212,000	
MUTOHホールディングス	700.0	2,002.00	1,401,400	
伊藤忠	521,100.0	5,771.00	3,007,268,100	
丸紅	660,000.0	2,473.00	1,632,180,000	
スクロール	12,600.0	1,014.00	12,776,400	貸付株式数 1,600株
高島	900.0	3,920.00	3,528,000	
ヨンドシーホールディングス	7,200.0	1,849.00	13,312,800	貸付株式数 100株
三陽商会	2,000.0	2,021.00	4,042,000	貸付株式数 200株
長瀬産業	38,800.0	2,551.50	98,998,200	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ナイガイ	1,700.0	287.00	487,900	貸付株式数 500株
蝶理	4,600.0	2,922.00	13,441,200	
豊田通商	74,100.0	9,016.00	668,085,600	
オンワードホールディングス	51,900.0	553.00	28,700,700	
三共生興	11,700.0	757.00	8,856,900	
兼松	32,800.0	2,171.00	71,208,800	
美津濃	7,900.0	4,615.00	36,458,500	
ツカモトコーポレーション	800.0	1,298.00	1,038,400	
ルックホールディングス	1,700.0	2,021.00	3,435,700	貸付株式数 800株
三井物産	600,200.0	5,653.00	3,392,930,600	
日本紙パルプ	4,500.0	4,980.00	22,410,000	
東京エレクトロン	169,200.0	21,960.00	3,715,632,000	
カメイ	9,000.0	1,520.00	13,680,000	
東都水産	300.0	6,380.00	1,914,000	貸付株式数 100株
OUGホールディングス	800.0	2,517.00	2,013,600	
スターゼン	6,500.0	2,650.00	17,225,000	
セイコーグループ	12,400.0	2,699.00	33,467,600	
山善	22,800.0	1,142.00	26,037,600	
椿本興業	1,400.0	5,290.00	7,406,000	貸付株式数 500株
住友商事	511,800.0	3,111.00	1,592,209,800	
BIPROGY	29,500.0	3,881.00	114,489,500	
内田洋行	3,400.0	6,960.00	23,664,000	
三菱商事	515,600.0	7,583.00	3,909,794,800	
第一実業	3,000.0	5,660.00	16,980,000	
キャノンマーケティングJPN	19,600.0	3,898.00	76,400,800	
西華産業	3,200.0	2,157.00	6,902,400	
佐藤商事	5,900.0	1,543.00	9,103,700	
菱洋エレクトロ	7,200.0	3,360.00	24,192,000	貸付株式数 1,200株
東京産業	7,500.0	842.00	6,315,000	
ユアサ商事	7,300.0	4,360.00	31,828,000	
神鋼商事	2,100.0	6,000.00	12,600,000	
トルク	2,900.0	252.00	730,800	
阪和興業	15,200.0	4,960.00	75,392,000	
正栄食品	5,600.0	4,600.00	25,760,000	貸付株式数 2,100株
カナデン	5,600.0	1,424.00	7,974,400	貸付株式数 2,200株
RYODEN	6,800.0	2,394.00	16,279,200	貸付株式数 2,400株
ニプロ	66,600.0	1,222.00	81,385,200	貸付株式数 22,400株
岩谷産業	19,200.0	7,700.00	147,840,000	
ナイス	2,500.0	1,523.00	3,807,500	
ニチモウ	700.0	4,070.00	2,849,000	
極東貿易	5,000.0	1,933.00	9,665,000	貸付株式数 400株
アステナホールディングス	15,800.0	466.00	7,362,800	貸付株式数 5,100株
三愛オブリ	22,400.0	1,742.00	39,020,800	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
稲畑産業	16,700.0	3,325.00	55,527,500	
G S I クレオス	4,900.0	2,228.00	10,917,200	貸付株式数 1,900 株
明和産業	11,200.0	675.00	7,560,000	貸付株式数 4,300 株
クワザワホールディングス	1,800.0	561.00	1,009,800	貸付株式数 1,000 株
ゴールドウイン	14,200.0	10,900.00	154,780,000	
ユニ・チャーム	167,000.0	5,690.00	950,230,000	
デサント	13,800.0	3,620.00	49,956,000	
キ ン グ	2,300.0	662.00	1,522,600	貸付株式数 100 株
ワ キ タ	15,600.0	1,415.00	22,074,000	
ヤマトインターナショナル	4,100.0	286.00	1,172,600	貸付株式数 100 株
東邦ホールディングス	21,100.0	2,899.00	61,168,900	貸付株式数 7,900 株
サンゲツ	21,200.0	3,030.00	64,236,000	
ミツウロコグループ	10,800.0	1,373.00	14,828,400	
シナネンホールディングス	2,700.0	4,100.00	11,070,000	
伊藤忠エネクス	21,000.0	1,514.00	31,794,000	
サンリオ	24,000.0	7,691.00	184,584,000	
サンワ テクノス	4,300.0	2,232.00	9,597,600	
リョーサン	9,000.0	4,405.00	39,645,000	
新光商事	11,400.0	1,216.00	13,862,400	
トーヨー	3,600.0	3,780.00	13,608,000	貸付株式数 1,100 株
三信電気	3,400.0	2,205.00	7,497,000	
東陽テクニカ	8,500.0	1,339.00	11,381,500	
モスフード サービス	12,500.0	3,380.00	42,250,000	貸付株式数 4,800 株
加賀電子	6,900.0	6,710.00	46,299,000	
三益半導体	6,400.0	2,846.00	18,214,400	
都築電気	4,200.0	2,482.00	10,424,400	貸付株式数 1,600 株
ソーダニツカ	4,100.0	984.00	4,034,400	
立花エレテック	6,200.0	2,811.00	17,428,200	貸付株式数 2,000 株
木曾路	12,900.0	2,625.00	33,862,500	貸付株式数 4,900 株
S R S ホールディングス	14,100.0	1,083.00	15,270,300	貸付株式数 5,200 株
千 趣 会	16,000.0	408.00	6,528,000	貸付株式数 5,800 株
タカキユー	4,200.0	92.00	386,400	貸付株式数 600 株
リテールパートナーズ	12,500.0	1,699.00	21,237,500	貸付株式数 4,800 株
ケーヨー	13,900.0	885.00	12,301,500	
上新電機	7,700.0	2,375.00	18,287,500	
日本瓦斯	44,800.0	2,337.50	104,720,000	
ロイヤルホールディングス	14,900.0	2,692.00	40,110,800	貸付株式数 5,600 株
東 天 紅	500.0	836.00	418,000	貸付株式数 100 株
いなげや	8,200.0	1,542.00	12,644,400	
チョダ	8,300.0	977.00	8,109,100	貸付株式数 1,300 株
ライフコーポレーション	7,400.0	3,685.00	27,269,000	
リンガーハット	11,000.0	2,320.00	25,520,000	貸付株式数 3,800 株
M r M a x HD	12,200.0	619.00	7,551,800	
テンアライド	6,700.0	330.00	2,211,000	貸付株式数 3,100 株
A O K I ホールディングス	15,600.0	1,071.00	16,707,600	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
オークワ	13,400.0	909.00	12,180,600	貸付株式数 200株
コメリ	13,100.0	3,205.00	41,985,500	貸付株式数 5,000株
青山商事	18,100.0	1,670.00	30,227,000	
しまむら	9,900.0	15,085.00	149,341,500	
はせがわ	2,900.0	350.00	1,015,000	
高島屋	63,700.0	2,209.00	140,713,300	
松屋	14,300.0	1,105.00	15,801,500	
エイチ・ツー・オーリテイ リング	41,100.0	1,867.00	76,733,700	
近鉄百貨店	3,600.0	2,942.00	10,591,200	貸付株式数 1,400株 (100株)
丸井グループ	62,300.0	2,603.00	162,166,900	貸付株式数 14,100株
クレディセゾン	49,900.0	2,379.50	118,737,050	
アクシアル リテイリング	5,800.0	3,800.00	22,040,000	
井筒屋	2,600.0	371.00	964,600	貸付株式数 700株
イオン	286,700.0	3,065.00	878,735,500	
イズミ	12,800.0	3,870.00	49,536,000	
フオーバル	3,300.0	1,294.00	4,270,200	貸付株式数 1,200株
平和堂	14,100.0	2,517.00	35,489,700	貸付株式数 5,200株
フジ	13,000.0	1,814.00	23,582,000	貸付株式数 5,000株
ヤオコー	9,600.0	7,910.00	75,936,000	
ゼビオホールディングス	11,600.0	1,037.00	12,029,200	貸付株式数 2,500株
ケーズホールディングス	60,000.0	1,374.00	82,440,000	
PALTAC	13,300.0	4,901.00	65,183,300	
三谷産業	14,400.0	331.00	4,766,400	
OLYMPICグループ	2,000.0	533.00	1,066,000	貸付株式数 100株
日産東京販売HD	7,200.0	468.00	3,369,600	
あおぞら銀行	49,500.0	2,990.50	148,029,750	貸付株式数 19,200株
三菱UFJフィナンシャル G	4,930,300.0	1,228.00	6,054,408,400	※
りそなホールディングス	988,500.0	821.80	812,349,300	
三井住友トラストHD	141,400.0	5,717.00	808,383,800	
三井住友フィナンシャルG	559,500.0	6,987.00	3,909,226,500	※
千葉銀行	219,400.0	1,087.50	238,597,500	
群馬銀行	152,800.0	709.30	108,381,040	
武蔵野銀行	10,100.0	2,747.00	27,744,700	
千葉興業銀行	12,300.0	845.00	10,393,500	
筑波銀行	34,500.0	268.00	9,246,000	
七十七銀行	25,200.0	3,310.00	83,412,000	
秋田銀行	5,300.0	1,945.00	10,308,500	
山形銀行	8,700.0	1,156.00	10,057,200	貸付株式数 1,700株
岩手銀行	5,400.0	2,693.00	14,542,200	
東邦銀行	62,300.0	285.00	17,755,500	
東北銀行	2,500.0	1,150.00	2,875,000	
ふくおかフィナンシャルG	62,900.0	3,618.00	227,572,200	
スルガ銀行	63,000.0	629.00	39,627,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
八十二銀行	166,300.0	826.30	137,413,690	
山梨中央銀行	8,100.0	1,605.00	13,000,500	
大垣共立銀行	15,000.0	2,105.00	31,575,000	
福井銀行	7,000.0	1,612.00	11,284,000	
清水銀行	3,100.0	1,603.00	4,969,300	
富山銀行	800.0	1,792.00	1,433,600	
滋賀銀行	13,100.0	3,400.00	44,540,000	
南都銀行	11,900.0	2,722.00	32,391,800	
百五銀行	74,100.0	530.00	39,273,000	
京都銀行	24,900.0	8,561.00	213,168,900	
紀陽銀行	28,200.0	1,564.00	44,104,800	貸付株式数 7,100 株
ほくほくフィナンシャルG	50,000.0	1,415.50	70,775,000	
山陰合同銀行	49,300.0	962.00	47,426,600	
鳥取銀行	1,700.0	1,311.00	2,228,700	
百十四銀行	7,200.0	2,340.00	16,848,000	
四国銀行	12,500.0	976.00	12,200,000	
阿波銀行	11,100.0	2,373.00	26,340,300	
大分銀行	4,700.0	2,617.00	12,299,900	
宮崎銀行	5,100.0	2,768.00	14,116,800	
佐賀銀行	4,600.0	1,960.00	9,016,000	
琉球銀行	18,000.0	1,101.00	19,818,000	
セブン銀行	282,100.0	319.40	90,102,740	
みずほフィナンシャルG	1,138,500.0	2,495.50	2,841,126,750	
高知銀行	1,800.0	1,007.00	1,812,600	
山口フィナンシャルG	77,300.0	1,266.50	97,900,450	
芙蓉総合リース	7,200.0	12,710.00	91,512,000	
みずほリース	11,700.0	4,940.00	57,798,000	
東京センチュリー	14,700.0	6,095.00	89,596,500	
SBIホールディングス	114,100.0	3,114.00	355,307,400	
日本証券金融	28,900.0	1,391.00	40,199,900	
アイフル	130,100.0	367.00	47,746,700	
日本アジア投資	4,100.0	280.00	1,148,000	
名古屋銀行	5,200.0	4,595.00	23,894,000	
北洋銀行	119,300.0	342.00	40,800,600	
大光銀行	1,500.0	1,300.00	1,950,000	貸付株式数 300 株
愛媛銀行	10,600.0	964.00	10,218,400	
トマト銀行	1,700.0	1,196.00	2,033,200	
京葉銀行	36,100.0	648.00	23,392,800	
栃木銀行	36,000.0	324.00	11,664,000	
北日本銀行	2,700.0	2,227.00	6,012,900	貸付株式数 300 株
東和銀行	14,400.0	603.00	8,683,200	
福島銀行	5,400.0	237.00	1,279,800	貸付株式数 2,100 株
大東銀行	2,000.0	710.00	1,420,000	貸付株式数 500 株
リコーリース	7,400.0	4,475.00	33,115,000	貸付株式数 400 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
イオンフィナンシャルサービス	45,200.0	1,294.50	58,511,400	
アコム	140,100.0	369.50	51,766,950	
ジャックス	8,400.0	5,320.00	44,688,000	
オリコ	20,300.0	1,149.00	23,324,700	
オリックス	516,800.0	2,883.50	1,490,192,800	
三菱HCキャピタル	306,600.0	1,002.00	307,213,200	
ジャフコグループ	26,200.0	1,898.50	49,740,700	
九州リースサービス	2,400.0	899.00	2,157,600	貸付株式数 1,200株
トモニホールディングス	63,900.0	439.00	28,052,100	
大和証券G本社	548,400.0	859.70	471,459,480	
野村ホールディングス	1,418,800.0	597.40	847,591,120	
岡三証券グループ	69,100.0	608.00	42,012,800	貸付株式数 20,900株
丸三証券	26,100.0	534.00	13,937,400	貸付株式数 1,600株
東洋証券	26,000.0	349.00	9,074,000	
東海東京HD	85,700.0	462.00	39,593,400	
光世証券	1,200.0	634.00	760,800	貸付株式数 200株
水戸証券	21,000.0	451.00	9,471,000	
いちよし証券	14,400.0	721.00	10,382,400	
松井証券	46,600.0	847.00	39,470,200	
SOMP Oホールディングス	135,100.0	6,562.00	886,526,200	
日本取引所グループ	221,200.0	2,629.00	581,534,800	
マネックスG	84,800.0	543.00	46,046,400	
極東証券	9,700.0	821.00	7,963,700	
岩井コスモホールディング	9,000.0	1,771.00	15,939,000	
アイザワ証券グループ	11,300.0	900.00	10,170,000	
フィデアホール	8,100.0	1,595.00	12,919,500	
池田泉州HD	100,700.0	293.00	29,505,100	
アニコムホールディングス	26,800.0	694.00	18,599,200	
MS&AD	160,300.0	5,544.00	888,703,200	
マネーパートナーズGP	5,300.0	285.00	1,510,500	
スパークス・グループ	8,800.0	1,567.00	13,789,600	
小林洋行	2,200.0	237.00	521,400	貸付株式数 100株
第一生命HLDGS	384,700.0	2,956.50	1,137,365,550	
東京海上HD	778,200.0	3,383.00	2,632,650,600	
アドバンテッジリスクマネ	2,500.0	470.00	1,175,000	
イー・ギャランティ	12,700.0	1,960.00	24,892,000	
アサックス	2,300.0	668.00	1,536,400	貸付株式数 1,300株
NECキャピタルソリューション	3,800.0	3,310.00	12,578,000	
T&Dホールディングス	211,300.0	2,467.50	521,382,750	
アドバンスクリエイト	4,600.0	1,162.00	5,345,200	貸付株式数 1,700株
三井不動産	336,000.0	3,467.00	1,164,912,000	
三菱地所	475,100.0	2,006.00	953,050,600	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
平和不動産	12,800.0	4,135.00	52,928,000	
東京建物	68,800.0	2,079.00	143,035,200	
京阪神ビルディング	13,200.0	1,329.00	17,542,800	
住友不動産	142,300.0	4,136.00	588,552,800	
太平洋興発	2,000.0	785.00	1,570,000	貸付株式数 800株
テーオーシー	14,200.0	657.00	9,329,400	
東京楽天地	1,300.0	4,160.00	5,408,000	貸付株式数 500株
スターツコーポレーション	11,300.0	3,085.00	34,860,500	
フジ住宅	11,100.0	756.00	8,391,600	
空港施設	9,400.0	607.00	5,705,800	
明和地所	2,500.0	1,097.00	2,742,500	
ゴールドクレスト	7,500.0	2,067.00	15,502,500	
リログループ	45,700.0	1,695.50	77,484,350	
エスリード	3,700.0	3,250.00	12,025,000	貸付株式数 1,200株
日神グループHLDGS	12,300.0	538.00	6,617,400	貸付株式数 4,400株
日本エスコン	14,800.0	930.00	13,764,000	
MIRARTHホールディング	39,900.0	492.00	19,630,800	
AVANTIA	3,000.0	885.00	2,655,000	貸付株式数 600株
イオンモール	40,800.0	1,791.50	73,093,200	
毎日コムネット	1,900.0	779.00	1,480,100	貸付株式数 900株
ファースト住建	2,200.0	1,204.00	2,648,800	貸付株式数 900株
ランド	473,600.0	8.00	3,788,800	貸付株式数 119,600株
カチタス	21,200.0	2,353.00	49,883,600	貸付株式数 8,200株
東祥	5,700.0	1,272.00	7,250,400	貸付株式数 2,000株
トーセイ	13,100.0	1,936.00	25,361,600	
穴吹興産	1,000.0	2,062.00	2,062,000	貸付株式数 600株
サンフロンティア不動産	13,200.0	1,520.00	20,064,000	
インテリックス	1,300.0	520.00	676,000	
ランドビジネス	1,900.0	295.00	560,500	貸付株式数 700株
サンネクスタグループ	1,500.0	970.00	1,455,000	貸付株式数 200株
グランディハウス	4,500.0	629.00	2,830,500	
東武鉄道	87,800.0	4,152.00	364,545,600	
相鉄ホールディングス	26,400.0	2,886.00	76,190,400	
東急	224,200.0	1,850.00	414,770,000	
京浜急行	90,600.0	1,365.00	123,669,000	
小田急電鉄	121,200.0	2,244.00	271,972,800	
京王電鉄	42,300.0	5,245.00	221,863,500	
京成電鉄	51,500.0	5,718.00	294,477,000	
富士急行	9,800.0	5,270.00	51,646,000	貸付株式数 3,800株
東日本旅客鉄道	135,600.0	8,500.00	1,152,600,000	
西日本旅客鉄道	102,100.0	6,507.00	664,364,700	
東海旅客鉄道	61,600.0	19,025.00	1,171,940,000	
西武ホールディングス	96,600.0	1,541.00	148,860,600	
鴻池運輸	13,600.0	2,063.00	28,056,800	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
西日本鉄道	21,400.0	2,658.50	56,891,900	
ハマキョウレックス	6,200.0	4,175.00	25,885,000	
サカイ引越センター	3,800.0	5,410.00	20,558,000	
近鉄グループHLDGS	79,800.0	4,584.00	365,803,200	
阪急阪神HLDGS	106,400.0	5,453.00	580,199,200	
南海電鉄	38,100.0	3,130.00	119,253,000	
京阪ホールディングス	44,000.0	4,140.00	182,160,000	
神戸電鉄	2,100.0	3,095.00	6,499,500	貸付株式数 800株
名古屋鉄道	88,200.0	2,411.50	212,694,300	
山陽電鉄	6,000.0	2,271.00	13,626,000	貸付株式数 2,300株
アルプス物流	6,300.0	1,600.00	10,080,000	貸付株式数 2,200株
トランコム	2,300.0	7,640.00	17,572,000	
ヤマトホールディングス	102,200.0	2,611.50	266,895,300	
山 九	20,300.0	5,201.00	105,580,300	
日 新	6,100.0	2,826.00	17,238,600	
丸 運	2,500.0	254.00	635,000	貸付株式数 1,300株
丸全昭和運輸	4,900.0	3,965.00	19,428,500	
センコーグループHLDGS	42,200.0	1,084.00	45,744,800	
トナミホールディングス	1,800.0	4,925.00	8,865,000	
ニッコンホールディングス	25,500.0	3,309.00	84,379,500	
日石輸送	500.0	2,642.00	1,321,000	
福山通運	6,100.0	3,665.00	22,356,500	
セイノーホールディングス	44,900.0	2,195.50	98,577,950	貸付株式数 500株
エスライングループ本社	1,500.0	884.00	1,326,000	貸付株式数 700株
神奈川中央交通	2,200.0	3,335.00	7,337,000	貸付株式数 800株
AZ-COM丸和ホールディング	19,300.0	2,247.00	43,367,100	
C&Fロジホールディングス	7,700.0	1,416.00	10,903,200	貸付株式数 800株
日本郵船	213,500.0	3,928.00	838,628,000	
商船三井	140,700.0	4,221.00	593,894,700	
川崎汽船	60,000.0	5,354.00	321,240,000	
NSユニテッド海運	4,300.0	4,150.00	17,845,000	貸付株式数 1,600株
明治海運	5,100.0	791.00	4,034,100	貸付株式数 1,000株
飯野海運	29,300.0	1,064.00	31,175,200	貸付株式数 3,700株
共栄タンカー	900.0	864.00	777,600	貸付株式数 300株
九州旅客鉄道	56,400.0	3,242.00	182,848,800	
SGホールディングス	153,100.0	2,089.50	319,902,450	
NIPPON EXPRESS	27,100.0	7,582.00	205,472,200	
ID&E ホールディングス	4,900.0	3,440.00	16,856,000	
日本航空	196,000.0	2,972.50	582,610,000	
ANAホールディングス	217,100.0	3,285.00	713,173,500	
ビーウィズ	2,100.0	2,302.00	4,834,200	貸付株式数 800株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
パスコ	1,200.0	1,705.00	2,046,000	
TREホールディングス	17,400.0	1,257.00	21,871,800	
人・夢・技術グループ	3,000.0	1,761.00	5,283,000	貸付株式数 1,200 株
西本WISMETTACHD	2,200.0	4,370.00	9,614,000	貸付株式数 800 株
シルバーライフ	1,600.0	1,206.00	1,929,600	貸付株式数 700 株
ヤマシタヘルスケアHLDGS	400.0	2,029.00	811,600	
GENKY DRUGSTORES	3,700.0	5,100.00	18,870,000	貸付株式数 1,300 株
コア商事HLDGS	4,600.0	722.00	3,321,200	貸付株式数 1,800 株
KPPグループホールディングン	19,700.0	674.00	13,277,800	貸付株式数 7,600 株
ナルミヤ・インターナショナル	900.0	1,189.00	1,070,100	貸付株式数 600 株
ブックオフGHD	3,800.0	1,239.00	4,708,200	貸付株式数 1,700 株
ギフトホールディングス	3,600.0	2,698.00	9,712,800	
三菱倉庫	17,200.0	3,945.00	67,854,000	
三井倉庫HOLD	7,400.0	4,240.00	31,376,000	
住友倉庫	21,500.0	2,565.00	55,147,500	貸付株式数 7,900 株
渋沢倉庫	3,200.0	3,250.00	10,400,000	
ヤマタネ	3,700.0	2,092.00	7,740,400	
東陽倉庫	6,900.0	286.00	1,973,400	
乾汽船	10,100.0	1,246.00	12,584,600	貸付株式数 3,900 株
日本トランスシティ	16,000.0	661.00	10,576,000	
ケイヒン	900.0	1,870.00	1,683,000	
中央倉庫	3,800.0	1,126.00	4,278,800	貸付株式数 1,400 株
川西倉庫	900.0	1,080.00	972,000	貸付株式数 200 株
安田倉庫	5,400.0	1,080.00	5,832,000	
ファイズホールディングス	1,000.0	1,171.00	1,171,000	貸付株式数 400 株
大栄環境	21,000.0	2,293.00	48,153,000	
日本管財ホールディングク	8,600.0	2,697.00	23,194,200	貸付株式数 3,300 株
東洋埠頭	1,500.0	1,500.00	2,250,000	
上組	38,300.0	3,271.00	125,279,300	
サンリツ	1,200.0	743.00	891,600	貸付株式数 300 株
キムラユニティー	2,600.0	1,422.00	3,697,200	貸付株式数 900 株
キューソー流通システム	2,700.0	967.00	2,610,900	貸付株式数 1,200 株
東海運	3,000.0	290.00	870,000	貸付株式数 1,400 株
エーアイテイナー	5,000.0	1,810.00	9,050,000	
内外トランスライン	3,200.0	2,589.00	8,284,800	貸付株式数 900 株
ショーエイコーポ	1,900.0	607.00	1,153,300	貸付株式数 600 株
日本コンセプト	2,900.0	1,846.00	5,353,400	
TBSホールディングス	41,100.0	2,622.00	107,764,200	
日本テレビHLD S	71,000.0	1,367.00	97,057,000	
朝日放送グループHD	7,300.0	677.00	4,942,100	貸付株式数 2,900 株
テレビ朝日HD	19,500.0	1,713.00	33,403,500	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
スカパー J S A T H D	71,000.0	712.00	50,552,000	
テレビ東京HD	5,800.0	3,100.00	17,980,000	貸付株式数 2,200株
日本BS放送	1,900.0	910.00	1,729,000	貸付株式数 800株
ビジョン	12,000.0	1,549.00	18,588,000	
スマートバリュー	1,300.0	384.00	499,200	貸付株式数 600株
USEN-NEXT HD DGS	9,000.0	3,530.00	31,770,000	貸付株式数 3,400株
ワイヤレスゲート	2,300.0	214.00	492,200	貸付株式数 100株
日本通信	73,900.0	223.00	16,479,700	
クロップス	900.0	1,010.00	909,000	
日本電信電話	25,680,600.0	171.60	4,406,790,960	
KDDI	619,500.0	4,437.00	2,748,721,500	
ソフトバンク	1,288,500.0	1,722.50	2,219,441,250	
光通信	9,400.0	23,935.00	224,989,000	
エムティーアイ	5,400.0	594.00	3,207,600	貸付株式数 2,000株
GMOインターネットグループ	29,600.0	2,414.00	71,454,400	
ファイバーゲート	4,300.0	1,527.00	6,566,100	貸付株式数 200株
アイドママーケティング コミュ	2,100.0	263.00	552,300	貸付株式数 600株
KADOKAWA	42,400.0	3,270.00	138,648,000	
学研ホールディングス	13,300.0	872.00	11,597,600	貸付株式数 2,600株
ゼンリン	13,600.0	921.00	12,525,600	
昭文社ホールディングス	2,200.0	307.00	675,400	
インプレスホールディング ス	4,600.0	189.00	869,400	貸付株式数 1,800株
東京電力HD	720,600.0	620.00	446,772,000	貸付株式数 255,600株
中部電力	294,600.0	1,937.50	570,787,500	
関西電力	308,700.0	2,147.50	662,933,250	
中国電力	127,300.0	955.60	121,647,880	
北陸電力	75,500.0	832.40	62,846,200	
東北電力	195,400.0	1,032.50	201,750,500	
四国電力	68,200.0	1,038.00	70,791,600	
九州電力	184,300.0	979.20	180,466,560	
北海道電力	77,200.0	648.80	50,087,360	
沖縄電力	18,700.0	1,131.00	21,149,700	貸付株式数 3,100株
電源開発	60,200.0	2,351.50	141,560,300	
エフオン	5,300.0	520.00	2,756,000	
イーレックス	14,200.0	865.00	12,283,000	貸付株式数 5,600株
レノバ	21,300.0	1,376.00	29,308,800	貸付株式数 8,300株
東京瓦斯	169,000.0	3,444.00	582,036,000	
大阪瓦斯	161,900.0	2,430.50	393,497,950	
東邦瓦斯	31,500.0	2,678.00	84,357,000	
北海道瓦斯	4,800.0	2,405.00	11,544,000	貸付株式数 1,000株
広島ガス	16,800.0	395.00	6,636,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
西部ガスHLDGS	7,500.0	2,070.00	15,525,000	
静岡ガス	15,900.0	1,037.00	16,488,300	
メタウォーター	9,400.0	1,954.00	18,367,600	
アイネット	4,800.0	1,804.00	8,659,200	貸付株式数 1,600 株
松竹	4,600.0	11,120.00	51,152,000	
東宝	50,100.0	5,677.00	284,417,700	
エイチ・アイ・エス	23,800.0	1,914.00	45,553,200	貸付株式数 9,300 株
東映	2,200.0	19,070.00	41,954,000	
ラックランド	3,800.0	3,035.00	11,533,000	貸付株式数 1,400 株
NTTデータグループ	251,500.0	1,986.50	499,604,750	
共立メンテナンス	14,100.0	6,380.00	89,958,000	貸付株式数 5,400 株
イチネンホールディングス	8,900.0	1,406.00	12,513,400	
建設技術研究所	4,300.0	4,745.00	20,403,500	
スペース	5,200.0	938.00	4,877,600	
アインホールディングス	11,600.0	4,613.00	53,510,800	
燦ホールディングス	3,400.0	2,152.00	7,316,800	
ピー・シー・エー	4,600.0	1,268.00	5,832,800	
スバル興業	300.0	11,550.00	3,465,000	貸付株式数 100 株
東京テアトル	2,000.0	1,138.00	2,276,000	貸付株式数 1,000 株
タナベコンサルティンググループ	2,200.0	1,134.00	2,494,800	
ビジネスB太田昭和	3,400.0	2,164.00	7,357,600	
ナガワ	2,200.0	7,170.00	15,774,000	貸付株式数 800 株
東京都競馬	6,900.0	3,965.00	27,358,500	貸付株式数 1,700 株
常磐興産	1,800.0	1,367.00	2,460,600	貸付株式数 1,000 株
カナモト	12,800.0	2,679.00	34,291,200	
DTS	17,100.0	3,320.00	56,772,000	
スクウェア・エニックス・HD	40,300.0	5,564.00	224,229,200	
シーイーシー	11,200.0	1,784.00	19,980,800	
カプコン	79,700.0	6,203.00	494,379,100	
ニシオホールディングス	7,600.0	3,730.00	28,348,000	貸付株式数 1,600 株
アイ・エス・ビー	4,100.0	1,443.00	5,916,300	貸付株式数 1,200 株
アゴーラホスピタリティーG	34,500.0	26.00	897,000	貸付株式数 15,600 株
日本空港ビルデング	27,800.0	6,698.00	186,204,400	
トランス・コスモス	10,200.0	3,195.00	32,589,000	貸付株式数 3,200 株
乃村工藝社	36,100.0	878.00	31,695,800	
ジャステック	4,900.0	1,479.00	7,247,100	貸付株式数 1,400 株
SCSK	65,400.0	2,606.00	170,432,400	
藤田観光	3,300.0	4,870.00	16,071,000	貸付株式数 1,100 株
KNT-CTホールディングス	4,900.0	1,450.00	7,105,000	貸付株式数 1,900 株
トーカイ	7,400.0	1,922.00	14,222,800	
白洋舎	800.0	2,711.00	2,168,800	貸付株式数 100 株
セコム	83,700.0	10,215.00	854,995,500	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
NSW	3,100.0	2,966.00	9,194,600	
セントラル警備保障	4,500.0	3,155.00	14,197,500	貸付株式数 200株
アイネス	5,600.0	1,700.00	9,520,000	
丹青社	15,700.0	848.00	13,313,600	
メイテック	32,200.0	2,613.50	84,154,700	
TKC	12,800.0	3,700.00	47,360,000	
富士ソフト	16,100.0	4,455.00	71,725,500	貸付株式数 800株
応用地質	7,700.0	2,624.00	20,204,800	
船井総研ホールディング	17,200.0	2,714.00	46,680,800	
NSD	28,600.0	2,465.00	70,499,000	
進学会ホールディングス	1,800.0	292.00	525,600	貸付株式数 900株
丸紅建材リース	600.0	2,731.00	1,638,600	
オオバ	3,600.0	894.00	3,218,400	
コナミグループ	34,300.0	8,511.00	291,927,300	
いであ	1,600.0	1,690.00	2,704,000	貸付株式数 200株
学究社	3,200.0	2,014.00	6,444,800	
ベネッセホールディングス	30,600.0	1,876.00	57,405,600	
イオンディライト	9,200.0	3,220.00	29,624,000	貸付株式数 3,200株
ナック	3,900.0	980.00	3,822,000	貸付株式数 1,200株
福井コンピュータHLDS	5,600.0	2,719.00	15,226,400	
ダイセキ	16,800.0	4,380.00	73,584,000	
ステップ	2,900.0	1,793.00	5,199,700	貸付株式数 1,100株
泉州電業	4,200.0	3,855.00	16,191,000	貸付株式数 1,400株
元気寿司	2,400.0	5,310.00	12,744,000	貸付株式数 900株
トラスコ中山	17,800.0	2,664.00	47,419,200	
ヤマダホールディングス	347,500.0	465.60	161,796,000	
オートバックスセブン	29,700.0	1,627.00	48,321,900	
モリト	6,000.0	1,298.00	7,788,000	
アーケランズ	25,429.0	1,650.00	41,957,850	
ニトリホールディングス	34,200.0	17,565.00	600,723,000	
グルメ杵屋	7,000.0	1,146.00	8,022,000	貸付株式数 2,500株
愛眼	4,800.0	181.00	868,800	貸付株式数 1,800株
ケーユーホールディングス	4,900.0	1,249.00	6,120,100	
吉野家ホールディングス	33,200.0	2,888.00	95,881,600	貸付株式数 12,100株
加藤産業	10,500.0	4,275.00	44,887,500	
北恵	1,400.0	875.00	1,225,000	
イノテック	5,300.0	1,620.00	8,586,000	
イエローハット	15,100.0	1,947.00	29,399,700	
松屋フーズHLDS	4,100.0	4,255.00	17,445,500	貸付株式数 600株
JBCホールディングス	5,800.0	2,681.00	15,549,800	
JKホールディングス	6,300.0	1,000.00	6,300,000	
サガミホールディングス	13,700.0	1,420.00	19,454,000	貸付株式数 5,200株
日伝	5,000.0	2,559.00	12,795,000	貸付株式数 1,800株
関西フードマーケット	7,600.0	1,489.00	11,316,400	
ミロク情報サービス	7,300.0	1,607.00	11,731,100	貸付株式数 2,700株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
北沢産業	2,900.0	326.00	945,400	貸付株式数 1,400株
杉本商事	3,700.0	2,329.00	8,617,300	貸付株式数 400株
因幡電機産業	22,000.0	3,190.00	70,180,000	
王将フードサービス	5,600.0	7,050.00	39,480,000	貸付株式数 1,800株
ミニストップ	6,100.0	1,468.00	8,954,800	貸付株式数 2,400株
アークス	15,500.0	2,739.00	42,454,500	
パローホールディングス	16,100.0	2,217.00	35,693,700	
東 テ ク	2,800.0	5,330.00	14,924,000	
ミスミグループ本社	127,700.0	2,534.00	323,591,800	
アルテック	2,900.0	258.00	748,200	
ベ ル ク	4,200.0	6,850.00	28,770,000	
大 庄	3,100.0	1,166.00	3,614,600	貸付株式数 1,400株
タキヒヨー	1,400.0	1,127.00	1,577,800	貸付株式数 700株
ファーストリテイリング	38,100.0	34,150.00	1,301,115,000	
ソフトバンクグループ	395,500.0	6,351.00	2,511,820,500	
蔵王産業	900.0	2,639.00	2,375,100	
スズケン	24,800.0	4,378.00	108,574,400	
サンドラッグ	32,100.0	4,400.00	141,240,000	
サックスパーホールディング グ	8,100.0	981.00	7,946,100	
ジェコス	4,900.0	962.00	4,713,800	
ヤマザワ	1,000.0	1,268.00	1,268,000	
や ま や	1,300.0	3,085.00	4,010,500	貸付株式数 600株
グローセル	6,800.0	430.00	2,924,000	
ベルーナ	20,600.0	754.00	15,532,400	
合計			270,705,844,599	

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

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

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

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年9月7日現在 金額(円)	2023年9月7日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	473,361,003	1,917,359,599
コール・ローン	4,919,868,759	7,969,622,467
株式	268,032,205,781	369,025,891,697
新株予約権証券	-	677,067
投資証券	7,280,561,932	7,863,588,380
派生商品評価勘定	181,856,269	178,197,741
未収入金	13,807,577	22,629,419
未収配当金	543,020,604	569,139,290
差入委託証拠金	2,584,711,528	7,582,758,561
流動資産合計	284,029,393,453	395,129,864,221
資産合計	284,029,393,453	395,129,864,221
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	171,223,399	235,260,850
未払解約金	12,992,200	44,491,900
流動負債合計	184,215,599	279,752,750
負債合計	184,215,599	279,752,750
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	65,876,384,035	76,227,957,902
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	217,968,793,819	318,622,153,569
元本等合計	283,845,177,854	394,850,111,471
純資産合計	283,845,177,854	394,850,111,471
負債純資産合計	284,029,393,453	395,129,864,221

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2022 年 9 月 8 日 至 2023 年 9 月 7 日
<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p>

区分	自 2022 年 9 月 8 日 至 2023 年 9 月 7 日
3. 収益及び費用の計上基準	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p> <p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2022 年 9 月 7 日現在	2023 年 9 月 7 日現在
1. ※1 期首	2021 年 9 月 8 日	2022 年 9 月 8 日
期首元本額	60,251,266,888 円	65,876,384,035 円
期中追加設定元本額	13,048,541,062 円	14,448,980,049 円
期中一部解約元本額	7,423,423,915 円	4,097,406,182 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	336,207,237 円	266,142,130 円
ダイワ国内重視バランスファンド 30VA (一般投資家私募)	3,645,389 円	2,431,213 円
ダイワ国内重視バランスファンド 50VA (一般投資家私募)	41,790,479 円	28,769,357 円
ダイワ国際分散バランスファンド 30VA (一般投資家私募)	6,522,948 円	4,226,482 円
ダイワ国際分散バランスファンド 50VA (一般投資家私募)	194,506,793 円	138,562,474 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)	59,267,896 円	93,024,761 円
ダイワバランスファンド 2023-01 (適格機関投資家専用)	-円	90,561,111 円

区分	2022年9月7日現在	2023年9月7日現在
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)	512,844,484 円	686,532,691 円
ダイワファンドラップ 外国株式 インデックス (為替ヘッジな し)	2,922,731,671 円	4,091,559,346 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)	649,866,356 円	580,726,284 円
D-I's 外国株式インデック ス	16,221,194 円	20,194,422 円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	42,984,902 円	51,142,609 円
iFree 外国株式インデック ス (為替ヘッジなし)	5,464,783,930 円	7,210,449,916 円
iFree 8資産バランス	1,304,789,990 円	1,457,394,551 円
iFree 年金バランス	234,843,904 円	298,658,157 円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2060	-円	3,735,460 円
DCダイワ外国株式インデック ス	42,376,597,980 円	46,490,450,097 円
ダイワ・ライフ・バランス30	516,375,683 円	507,850,174 円
ダイワ・ライフ・バランス50	985,289,025 円	1,044,087,634 円
ダイワ・ライフ・バランス70	813,971,233 円	982,686,811 円
大和DC海外株式インデックス ファンド	1,854,332,102 円	1,991,165,737 円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	12,334,479 円	11,868,804 円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	11,668,360 円	12,631,727 円
ダイワつみたてインデックス外 国株式	1,175,940,588 円	1,940,135,571 円
ダイワつみたてインデックスバ ランス30	1,935,989 円	2,127,648 円
ダイワつみたてインデックスバ ランス50	2,157,242 円	2,236,515 円
ダイワつみたてインデックスバ ランス70	4,469,808 円	4,975,739 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)	2,946,119 円	8,327,442 円
ダイワ世界バランスファンド4 0VA	76,187,314 円	55,216,016 円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	71,098,436 円	35,351,507 円
ダイワ・バランスファンド35 VA	1,260,639,867 円	970,948,063 円
ダイワ・バランスファンド25 VA (適格機関投資家専用)	66,268,874 円	54,476,271 円

区分	2022年9月7日現在	2023年9月7日現在
ダイワバランスファンド 2021-02 (適格機関投資家専用)	173,081,567 円	140,584,660 円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,101,819,537 円	1,336,428,135 円
ダイワ・ノーロード 外国株式フ ァンド	406,624,891 円	429,292,129 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)	265,642,951 円	2,033,235,410 円
ダイワ投信倶楽部外国株式イン デックス	2,818,337,246 円	2,977,492,751 円
ダイワライフスタイル 2 5	10,585,119 円	9,029,390 円
ダイワライフスタイル 5 0	44,026,353 円	40,429,242 円
ダイワライフスタイル 7 5	33,046,099 円	33,165,466 円
ダイワバランスファンド 2023-08 (適格機関投資家専用)	-円	89,653,999 円
計	65,876,384,035 円	76,227,957,902 円
2. 期末日における受益権の総数	65,876,384,035 口	76,227,957,902 口

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2022年9月8日 至 2023年9月7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。

区分	自 2022 年 9 月 8 日 至 2023 年 9 月 7 日
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023 年 9 月 7 日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)
売買目的有価証券

種類	2022 年 9 月 7 日現在	2023 年 9 月 7 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	△47,079,059,401	33,931,663,367
新株予約権証券	-	164,199
投資証券	△1,019,126,579	△416,145,155
合計	△48,098,185,980	33,515,682,411

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

(デリバティブ取引に関する注記)
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種類	2022 年 9 月 7 日現在				2023 年 9 月 7 日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買建	8,594,315,830	-	8,497,651,250	△96,664,580	18,686,004,353	-	18,549,278,564	△136,725,789

種類	2022年9月7日現在				2023年9月7日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
合計	8,594,315,830	-	8,497,651,250	△96,664,580	18,686,004,353	-	18,549,278,564	△136,725,789

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

2. 通貨関連

種類	2022年9月7日現在				2023年9月7日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買建	4,893,979,550	-	5,001,277,000	107,297,450	8,547,732,760	-	8,627,395,440	79,662,680
アメリカ・ド ル	2,922,771,240	-	2,998,170,000	75,398,760	5,131,119,790	-	5,198,083,850	66,964,060
イギリス・ ポンド	241,897,500	-	246,045,000	4,147,500	459,161,550	-	460,044,000	882,450
オーストラ リア・ドル	327,267,690	-	330,889,500	3,621,810	563,735,400	-	563,751,000	15,600
カナダ・ドル	285,344,100	-	292,491,000	7,146,900	665,808,060	-	669,192,040	3,383,980
スイス・フラ ンク	334,486,740	-	341,337,500	6,850,760	641,992,810	-	645,752,640	3,759,830
ユーロ	782,212,280	-	792,344,000	10,131,720	1,085,915,150	-	1,090,571,910	4,656,760
合計	4,893,979,550	-	5,001,277,000	107,297,450	8,547,732,760	-	8,627,395,440	79,662,680

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

- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
- (2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
 3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2022年9月7日現在	2023年9月7日現在
1口当たり純資産額	4,308 円	5,179 円
(1万口当たり純資産額)	(43,088 円)	(51,799 円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	5,700	185.290	1,056,153.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	14,800	245.210	3,629,108.000	
	FIRST SOLAR INC	4,900	182.090	892,241.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	8,600	133.980	1,152,228.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	6,200	114.400	709,280.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,100	136.560	423,336.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	21,100	31.730	669,503.000	
	ABBOTT LABORATORIES	84,066	101.560	8,537,742.960	
	HOWMET AEROSPACE INC	18,983	48.430	919,346.690	
	VERISK ANALYTICS INC	7,100	243.470	1,728,637.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	16,600	52.430	870,338.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	28,800	87.960	2,533,248.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,200	523.180	1,150,996.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	28,700	55.320	1,587,684.000	
	QORVO INC	4,820	106.240	512,076.800	
	AFLAC INC	27,800	74.230	2,063,594.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	5,900	148.950	878,805.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	7,900	80.700	637,530.000	
	ADOBE INC	22,020	561.940	12,373,918.800	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	9,400	81.030	761,682.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	5,600	399.000	2,234,400.000	
	GARMIN LTD	7,400	103.660	767,084.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	10,700	293.350	3,138,845.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	32,200	184.510	5,941,222.000	
	WR BERKLEY CORP	10,142	61.530	624,037.260	
	AUTOZONE INC	920	2,568.890	2,363,378.800	
	DOLLAR TREE INC	10,271	117.370	1,205,507.270	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	58,300	9.480	552,684.000	
	CELANESE CORP	4,950	126.930	628,303.500	
	DR HORTON INC	14,916	115.630	1,724,737.080	
	DENTSPLY SIRONA INC	10,300	36.700	378,010.000	
	AUTODESK INC	10,300	222.200	2,288,660.000	
	MOODY'S CORP	8,000	340.680	2,725,440.000	
	DEVON ENERGY CORP	31,000	53.490	1,658,190.000	
	ALBEMARLE CORP	5,700	189.830	1,082,031.000	
	ATMOS ENERGY CORP	7,000	112.270	785,890.000	
	ALLIANT ENERGY CORP	12,200	49.600	605,120.000	
	CITIGROUP INC	94,173	41.370	3,895,937.010	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	20,000	251.050	5,021,000.000	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	24,900	76.380	1,901,862.000	
DOMINO'S PIZZA INC	1,730	384.440	665,081.200		
HESS CORP	13,400	157.810	2,114,654.000		

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	DAVITA INC	2,750	98.890	271,947.500	
	DANAHER CORP	33,950	256.990	8,724,810.500	
	FORTIVE CORP	17,100	77.680	1,328,328.000	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	27,100	113.610	3,078,831.000	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	26,300	77.460	2,037,198.000	
	BUNGE LTD	7,300	110.810	808,913.000	
	TE CONNECTIVITY LTD	15,195	130.060	1,976,261.700	
	APPLE INC	760,400	182.910	139,084,764.000	
	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	12,400	91.510	1,134,724.000	
	BOEING CO/THE	27,700	217.950	6,037,215.000	
	CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,615	104.520	795,919.800	
	BECTON DICKINSON AND CO	13,699	266.640	3,652,701.360	
	LEIDOS HOLDINGS INC	6,300	96.510	608,013.000	
	NISOURCE INC	20,000	26.310	526,200.000	
	C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,500	87.380	480,590.000	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	37,571	44.680	1,678,672.280	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	203,404	34.180	6,952,348.720	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	62,750	361.670	22,694,792.500	
	ANSYS INC	4,200	320.970	1,348,074.000	
	TRUIST FINANCIAL CORP	64,417	29.720	1,914,473.240	
	BLACKSTONE GROUP INC/THE	34,200	107.900	3,690,180.000	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	101,600	59.670	6,062,472.000	
	JPMORGAN CHASE & CO	141,270	144.960	20,478,499.200	
	T ROWE PRICE GROUP INC	10,900	111.500	1,215,350.000	
	LKQ CORP	12,900	50.820	655,578.000	
	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	15,012	63.580	954,462.960	
	CADENCE DESIGN SYS INC	13,200	246.700	3,256,440.000	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,000	339.710	1,698,550.000	
	DOLLAR GENERAL CORP	10,600	126.460	1,340,476.000	
	SERVICENOW INC	9,900	598.510	5,925,249.000	
	CATERPILLAR INC	24,900	282.900	7,044,210.000	
	BROWN & BROWN INC	11,700	72.730	850,941.000	
	ESSENTIAL UTILITIES INC	12,100	35.550	430,155.000	
	CHARLES RIVER LABORATORIES	2,500	204.440	511,100.000	
	CMS ENERGY CORP	14,100	54.930	774,513.000	
	MOSAIC CO/THE	16,100	38.190	614,859.000	
	DELTA AIR LINES INC	7,800	41.710	325,338.000	
	CORNING INC	39,100	31.860	1,245,726.000	
	CISCO SYSTEMS INC	197,050	57.160	11,263,378.000	
	MORGAN STANLEY	60,552	84.160	5,096,056.320	
	DECKERS OUTDOOR CORP	1,300	525.820	683,566.000	
	MSCI INC	3,900	541.840	2,113,176.000	
	FAIR ISAAC CORP	1,200	907.880	1,089,456.000	
	LENNOX INTERNATIONAL INC	1,500	378.630	567,945.000	
	MANHATTAN ASSOCIATES INC	3,200	201.020	643,264.000	
	SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	10,800	55.910	603,828.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	BROADCOM INC	19,912	872.270	17,368,640.240	
	UNITED THERAPEUTICS CORP	2,300	223.360	513,728.000	
	DICK'S SPORTING GOODS INC	3,100	111.800	346,580.000	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,000	201.450	1,208,700.000	
	ARAMARK	12,000	37.230	446,760.000	
	DTE ENERGY COMPANY	10,000	100.890	1,008,900.000	
	CENTENE CORP	26,507	63.320	1,678,423.240	
	CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,100	149.980	764,898.000	
	CITIZENS FINANCIAL GROUP	23,400	27.680	647,712.000	
	DARLING INGREDIENTS INC	7,500	57.870	434,025.000	
	ARTHUR J GALLAGHER & CO	10,400	227.740	2,368,496.000	
	GARTNER INC	3,850	350.580	1,349,733.000	
	SPLUNK INC	7,600	124.560	946,656.000	
	DOMINION ENERGY INC	40,441	45.950	1,858,263.950	
	MONSTER BEVERAGE CORP	38,000	56.280	2,138,640.000	
	SMITH (A. O.) CORP	6,000	71.850	431,100.000	
	DEERE & CO	13,500	414.290	5,592,915.000	
	QUANTA SERVICES INC	7,000	209.090	1,463,630.000	
	POOL CORP	1,900	350.000	665,000.000	
	GLOBAL PAYMENTS INC	12,684	127.350	1,615,307.400	
	VMWARE INC-CLASS A	11,500	166.160	1,910,840.000	
	BURLINGTON STORES INC	3,100	160.720	498,232.000	
	NASDAQ INC	16,600	51.580	856,228.000	
	VAIL RESORTS INC	1,900	243.050	461,795.000	
	TARGA RESOURCES CORP	10,400	85.030	884,312.000	
	AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,400	113.450	385,730.000	
	WESTLAKE CORP	1,800	127.600	229,680.000	
	CONSOLIDATED EDISON INC	16,800	86.800	1,458,240.000	
	COGNEX CORP	8,400	45.560	382,704.000	
	WEBSTER FINANCIAL CORP	8,500	41.650	354,025.000	
	TELEFLEX INC	2,300	210.020	483,046.000	
	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,000	185.580	742,320.000	
	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,600	404.850	1,457,460.000	
	BIO-RAD LABORATORIES-A	1,100	369.980	406,978.000	
	CATALENT INC	8,700	49.700	432,390.000	
	VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	7,000	222.470	1,557,290.000	
	MOLINA HEALTHCARE INC	2,800	310.820	870,296.000	
	CARLISLE COS INC	2,500	253.650	634,125.000	
	IDEX CORP	3,700	222.840	824,508.000	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	38,100	72.320	2,755,392.000	
	ROLLINS INC	11,607	38.080	441,994.560	
	AECOM	6,400	85.480	547,072.000	
	WATSCO INC	1,600	354.920	567,872.000	
	GRACO INC	8,000	77.000	616,000.000	
	AMETEK INC	11,200	157.100	1,759,520.000	
	TORO CO	4,900	99.730	488,677.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	CHURCH & DWIGHT CO INC	11,800	94.120	1,110,616.000	
	KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,850	52.750	414,087.500	
	HEICO CORP	2,100	166.070	348,747.000	
	GENERAC HOLDINGS INC	3,000	118.460	355,380.000	
	FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,800	430.510	774,918.000	
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	12,600	99.670	1,255,842.000	
	TYLER TECHNOLOGIES INC	2,000	390.640	781,280.000	
	COSTCO WHOLESALE CORP	21,360	546.690	11,677,298.400	
	EPAM SYSTEMS INC	2,800	261.740	732,872.000	
	RPM INTERNATIONAL INC	6,200	98.060	607,972.000	
	RELIANCE STEEL & ALUMINUM	2,800	268.990	753,172.000	
	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,300	1,954.120	2,540,356.000	
	CUMMINS INC	6,800	235.690	1,602,692.000	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	38,100	92.070	3,507,867.000	
	CDW CORP/DE	6,500	213.280	1,386,320.000	
	COSTAR GROUP INC	19,800	82.990	1,643,202.000	
	OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,800	423.860	2,034,528.000	
	MERCADOLIBRE INC	2,190	1,425.970	3,122,874.300	
	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,500	153.700	537,950.000	
	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	12,816	149.200	1,912,147.200	
	DEXCOM INC	18,700	106.880	1,998,656.000	
	NORDSON CORP	2,490	239.550	596,479.500	
	COPART INC	41,500	45.470	1,887,005.000	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	8,300	156.100	1,295,630.000	
	SEAGEN INC	6,800	206.100	1,401,480.000	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	3,500	369.700	1,293,950.000	
	LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,800	234.590	891,442.000	
	TRANSDIGM GROUP INC	2,690	882.980	2,375,216.200	
	BIO-TECHNE CORP	7,620	75.510	575,386.200	
	NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,600	110.170	506,782.000	
	HORIZON THERAPEUTICS PLC	9,400	115.500	1,085,700.000	
	KINDER MORGAN INC	97,481	16.630	1,621,109.030	
	HCA HEALTHCARE INC	10,200	274.570	2,800,614.000	
	MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,800	228.860	411,948.000	
	COTERRA ENERGY INC	36,600	28.070	1,027,362.000	
	T-MOBILE US INC	26,027	134.130	3,491,001.510	
	ZILLOW GROUP INC - C	7,450	52.050	387,772.500	
	COCA-COLA CO/THE	198,750	58.780	11,682,525.000	
	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	10,700	61.980	663,186.000	
	EXPEDITORS INTL WASH INC	7,350	115.590	849,586.500	
	FRANKLIN RESOURCES INC	14,000	26.110	365,540.000	
	CSX CORP	99,100	29.730	2,946,243.000	
	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	4,300	204.600	879,780.000	
	EXPEDIA GROUP INC	6,825	108.410	739,898.250	
	AMAZON.COM INC	446,700	135.360	60,465,312.000	
	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	29,300	76.960	2,254,928.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	EXXON MOBIL CORP	195,505	114.510	22,387,277.550	
	AES CORP	32,400	17.430	564,732.000	
	EVEREST GROUP LTD	2,100	366.310	769,251.000	
	EOG RESOURCES INC	28,300	133.120	3,767,296.000	
	EQT CORP	17,500	42.330	740,775.000	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	7,300	103.800	757,740.000	
	FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	500	1,326.500	663,250.000	
	CENCORA INC	8,300	174.670	1,449,761.000	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	14,300	117.940	1,686,542.000	
	FORD MOTOR CO	190,123	12.070	2,294,784.610	
	EXACT SCIENCES CORP	8,700	82.170	714,879.000	
	ENTEGRIS INC	7,200	99.680	717,696.000	
	AERCAP HOLDINGS NV	8,200	62.190	509,958.000	
	FORTINET INC	32,300	62.230	2,010,029.000	
	MARKEL CORP	610	1,460.000	890,600.000	
	NEXTERA ENERGY INC	97,880	65.690	6,429,737.200	
	FREEMPORT-MCMORAN INC	69,308	40.410	2,800,736.280	
	INSULET CORP	3,400	193.400	657,560.000	
	US BANCORP	74,100	36.120	2,676,492.000	
	UNITED RENTALS INC	3,300	475.060	1,567,698.000	
	F5 NETWORKS INC	2,900	163.820	475,078.000	
	SUPER MICRO COMPUTER INC	2,500	274.030	685,075.000	
	FASTENAL CO	27,600	55.860	1,541,736.000	
	FISERV INC	29,833	122.500	3,654,542.500	
	GENERAL ELECTRIC CO	52,706	112.680	5,938,912.080	
	AXON ENTERPRISE INC	3,400	213.500	725,900.000	
	PAYLOCITY HOLDING CORP	2,200	201.500	443,300.000	
	GENERAL MOTORS CO	67,300	32.820	2,208,786.000	
	GENERAL DYNAMICS CORP	11,300	218.050	2,463,965.000	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,150	321.130	5,186,249.500	
	FIRST HORIZON CORP	25,700	11.980	307,886.000	
	ALPHABET INC-CL A	287,300	134.460	38,630,358.000	
	ALPHABET INC-CL C	255,440	135.370	34,578,912.800	
	OWENS CORNING	4,400	142.500	627,000.000	
	GENERAL MILLS INC	28,300	65.870	1,864,121.000	
	FIRSTENERGY CORP	26,318	35.090	923,498.620	
	GENUINE PARTS CO	6,850	151.780	1,039,693.000	
	FIFTH THIRD BANCORP	33,000	26.600	877,800.000	
	L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	9,250	170.190	1,574,257.500	
	HALLIBURTON CO	43,600	40.880	1,782,368.000	
	REPLIGEN CORP	2,600	167.760	436,176.000	
	HOME DEPOT INC	48,650	326.000	15,859,900.000	
	ASSURANT INC	2,650	137.980	365,647.000	
	HUNTINGTON BANCSHARES INC	69,800	10.920	762,216.000	
	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,910	209.200	399,572.000	
	HERSHEY CO/THE	7,100	210.390	1,493,769.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	HUMANA INC	6,000	465.070	2,790,420.000	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	12,600	207.790	2,618,154.000	
	HENRY SCHEIN INC	6,300	74.120	466,956.000	
	HP INC	47,300	30.130	1,425,149.000	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	62,500	17.750	1,109,375.000	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	18,000	76.440	1,375,920.000	
	KRAFT HEINZ CO/THE	41,803	32.570	1,361,523.710	
	ENPHASE ENERGY INC	6,600	123.030	811,998.000	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	43,900	148.060	6,499,834.000	
	HUBBELL INC	2,600	316.920	823,992.000	
	INTERNATIONAL PAPER CO	16,000	33.880	542,080.000	
	FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	6,100	66.500	405,650.000	
	ZOETIS INC	22,400	186.860	4,185,664.000	
	TRANE TECHNOLOGIES PLC	10,999	204.200	2,245,995.800	
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	6,800	95.870	651,916.000	
	CHENIERE ENERGY INC	11,700	161.760	1,892,592.000	
	HYATT HOTELS CORP - CL A	2,300	112.370	258,451.000	
	ALLEGION PLC	4,350	108.470	471,844.500	
	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	6,800	140.560	955,808.000	
	LIBERTY GLOBAL PLC- C	12,973	19.140	248,303.220	
	WASTE CONNECTIONS INC	12,537	137.590	1,724,965.830	
	JUNIPER NETWORKS INC	15,600	29.250	456,300.000	
	JM SMUCKER CO/THE	5,000	141.130	705,650.000	
	JOHNSON & JOHNSON	116,500	158.010	18,408,165.000	
	ABBVIE INC	85,272	145.610	12,416,455.920	
	HOLOGIC INC	11,900	74.100	881,790.000	
	KIMBERLY-CLARK CORP	16,300	126.590	2,063,417.000	
	KROGER CO	33,000	45.160	1,490,280.000	
	KLA CORP	6,600	513.470	3,388,902.000	
	LOCKHEED MARTIN CORP	11,000	423.940	4,663,340.000	
	FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,400	275.480	936,632.000	
	BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	10,500	37.340	392,070.000	
	LOWE'S COS INC	28,300	229.610	6,497,963.000	
	ELI LILLY & CO	38,985	559.950	21,829,650.750	
	LAM RESEARCH CORP	6,480	696.240	4,511,635.200	
	LOEWS CORP	9,400	61.720	580,168.000	
	MCDONALD'S CORP	35,350	275.440	9,736,804.000	
	3M CO	26,690	106.370	2,839,015.300	
	META PLATFORMS INC CLASS A	107,000	299.170	32,011,190.000	
	S&P GLOBAL INC	15,939	394.150	6,282,356.850	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,000	438.660	1,315,980.000	
	SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	2,720	155.900	424,048.000	
	PHILLIPS 66	22,200	116.640	2,589,408.000	
	ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	7,300	206.400	1,506,720.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	MGM RESORTS INTERNATIONAL	16,050	43.470	697,693.500	
	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	12,100	80.100	969,210.000	
	METLIFE INC	31,500	63.200	1,990,800.000	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	41,600	56.710	2,359,136.000	
	ARISTA NETWORKS INC	12,700	197.540	2,508,758.000	
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,098	280.920	2,274,890.160	
	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,100	1,192.610	1,311,871.000	
	BAKER HUGHES CO	49,023	37.220	1,824,636.060	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	5,600	310.480	1,738,688.000	
	MERCK & CO. INC.	122,721	106.490	13,068,559.290	
	DUPONT DE NEMOURS INC	22,551	75.960	1,712,973.960	
	MASCO CORP	10,900	57.680	628,712.000	
	M & T BANK CORP	7,999	121.790	974,198.210	
	MARSH & MCLENNAN COS	23,870	193.930	4,629,109.100	
	HEICO CORP-CLASS A	3,620	133.700	483,994.000	
	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	12,402	202.420	2,510,412.840	
	WORKDAY INC-CLASS A	10,000	248.410	2,484,100.000	
	BLOCK INC CLASS A	26,312	57.640	1,516,623.680	
	TRANSUNION	9,300	81.660	759,438.000	
	VISTRA CORP	17,600	32.810	577,456.000	
	NETAPP INC	10,300	79.920	823,176.000	
	NIKE INC -CL B	59,600	100.180	5,970,728.000	
	NORFOLK SOUTHERN CORP	11,000	198.420	2,182,620.000	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	26,300	81.060	2,131,878.000	
	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,605	105.140	1,009,869.700	
	ALLY FINANCIAL INC	14,200	28.000	397,600.000	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	7,000	423.640	2,965,480.000	
	APTIV PLC	13,700	102.350	1,402,195.000	
	NEWMONT CORP	38,411	38.500	1,478,823.500	
	MCKESSON CORP	6,500	411.250	2,673,125.000	
	XYLEM INC	11,600	97.810	1,134,596.000	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	75,100	93.550	7,025,605.000	
	NUCOR CORP	12,200	168.600	2,056,920.000	
	GODADDY INC - CLASS A	7,000	74.270	519,890.000	
	EVERGY INC	11,150	53.310	594,406.500	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	33,524	65.570	2,198,168.680	
	ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,250	273.960	342,450.000	
	OKTA INC	7,500	87.500	656,250.000	
	LIBERTY BROADBAND-C	5,800	90.450	524,610.000	
	WIX.COM LTD	2,810	96.880	272,232.800	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	16,800	28.430	477,624.000	
	KKR & CO INC	29,200	61.720	1,802,224.000	
	PAYCHEX INC	15,700	120.370	1,889,809.000	
	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,900	944.790	2,739,891.000	
	ALTRIA GROUP INC	86,300	43.530	3,756,639.000	
	P G & E CORP	92,000	16.450	1,513,400.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	PFIZER INC	273,113	34.370	9,386,893.810	
	CIGNA CORP	14,300	275.630	3,941,509.000	
	DELL TECHNOLOGIES -C	12,401	70.470	873,898.470	
	XCEL ENERGY INC	26,600	56.340	1,498,644.000	
	STERIS PLC	4,800	223.790	1,074,192.000	
	SEA LTD-ADR	19,000	39.220	745,180.000	
	FOX CORP - CLASS B	6,533	28.990	189,391.670	
	FOX CORP - CLASS A	13,699	31.380	429,874.620	
	STRYKER CORP	16,480	289.100	4,764,368.000	
	DOW INC	34,218	54.890	1,878,226.020	
	TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	5,300	84.520	447,956.000	
	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	11,500	74.000	851,000.000	
	PARKER HANNIFIN CORP	6,200	411.860	2,553,532.000	
	UBER TECHNOLOGIES INC	88,100	45.900	4,043,790.000	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	11,300	241.370	2,727,481.000	
	PROCTER & GAMBLE CO/THE	113,967	152.140	17,338,939.380	
	EXELON CORP	48,122	39.860	1,918,142.920	
	INGERSOLL-RAND INC	19,608	70.010	1,372,756.080	
	NVR INC	160	6,318.150	1,010,904.000	
	CONOCOPHILLIPS	58,502	123.070	7,199,841.140	
	TWILIO INC - A	8,300	66.080	548,464.000	
	DOCUSIGN INC	9,800	52.780	517,244.000	
	PAYCOM SOFTWARE INC	2,500	293.140	732,850.000	
	CERIDIAN HCM HOLDING INC	7,100	73.760	523,696.000	
	PEPSICO INC	66,600	174.730	11,637,018.000	
	CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,220	171.550	380,841.000	
	DROPBOX INC-CLASS A	12,600	27.570	347,382.000	
	MONGODB INC	3,400	382.260	1,299,684.000	
	SNAP INC - A	49,700	9.630	478,611.000	
	CORTEVA INC	34,368	50.500	1,735,584.000	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	17,600	94.320	1,660,032.000	
	AMCOR PLC	71,100	9.280	659,808.000	
	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	10,800	166.230	1,795,284.000	
	ROKU INC	6,000	86.190	517,140.000	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,400	135.730	1,275,862.000	
	ACCENTURE PLC-CL A	30,500	326.300	9,952,150.000	
	PENTAIR PLC	7,975	69.630	555,299.250	
	QUALCOMM INC	53,900	114.680	6,181,252.000	
	INVESCO LTD	16,700	15.550	259,685.000	
	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	11,800	76.190	899,042.000	
	DATADOG INC - CLASS A	12,200	97.660	1,191,452.000	
	PINTEREST INC- CLASS A	28,700	27.650	793,555.000	
	REGENERON PHARMACEUTICALS	5,200	818.390	4,255,628.000	
	REPUBLIC SERVICES INC	10,700	144.150	1,542,405.000	
	BOOKING HOLDINGS INC	1,800	3,141.210	5,654,178.000	
	ROSS STORES INC	16,500	119.950	1,979,175.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	PACKAGING CORP OF AMERICA	4,330	144.780	626,897.400	
	RESMED INC	7,100	153.330	1,088,643.000	
	QUEST DIAGNOSTICS INC	5,430	127.140	690,370.200	
	ROBERT HALF INTL INC	5,200	72.260	375,752.000	
	MODERNA INC	15,700	108.240	1,699,368.000	
	HUBSPOT INC	2,280	544.140	1,240,639.200	
	REVVITY INC	6,100	111.430	679,723.000	
	CARRIER GLOBAL CORP	40,387	56.400	2,277,826.800	
	OTIS WORLDWIDE CORP	20,038	84.390	1,691,006.820	
	BILL HOLDINGS INC	4,500	116.610	524,745.000	
	AVANTOR INC	32,700	20.770	679,179.000	
	CARLYLE GROUP INC/THE	10,200	32.320	329,664.000	
	DYNATRACE INC	12,200	48.160	587,552.000	
	TRADE DESK INC/THE -CLASS A	21,500	83.470	1,794,605.000	
	REGIONS FINANCIAL CORP	45,385	18.110	821,922.350	
	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	13,200	17.870	235,884.000	
	ROYALTY PHARMA PLC- CL A	18,400	29.070	534,888.000	
	MATCH GROUP INC	13,500	45.260	611,010.000	
	CHEVRON CORP	87,818	166.630	14,633,113.340	
	ZSCALER INC	4,200	158.350	665,070.000	
	EDISON INTERNATIONAL	18,500	67.730	1,253,005.000	
	ETSY INC	6,000	72.740	436,440.000	
	TESLA INC	137,950	251.920	34,752,364.000	
	SNOWFLAKE INC-CLASS A	12,600	157.490	1,984,374.000	
	GEN DIGITAL INC	27,900	20.240	564,696.000	
	UNITY SOFTWARE INC	11,300	39.290	443,977.000	
	STANLEY BLACK & DECKER INC	7,402	93.700	693,567.400	
	SYNOPSIS INC	7,400	465.690	3,446,106.000	
	CHEWY INC - CLASS A	5,750	24.420	140,415.000	
	CLOUDFLARE INC - CLASS A	13,300	63.990	851,067.000	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	5,005	419.980	2,101,999.900	
	VIATRIS INC	58,021	10.120	587,172.520	
	DOORDASH INC - A	12,250	82.590	1,011,727.500	
	ROBLOX CORP -CLASS A	20,300	29.090	590,527.000	
	AIRBNB INC-CLASS A	19,900	141.770	2,821,223.000	
	CBRE GROUP INC - A	15,000	85.840	1,287,600.000	
	SOUTHERN CO/THE	52,700	66.250	3,491,375.000	
	SYSCO CORP	24,500	68.450	1,677,025.000	
	TRAVELERS COS INC/THE	11,203	160.610	1,799,313.830	
	FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,900	64.190	186,151.000	
	SEI INVESTMENTS COMPANY	5,300	60.830	322,399.000	
	STEEL DYNAMICS INC	8,150	103.990	847,518.500	
	SCHLUMBERGER LTD	68,952	61.000	4,206,072.000	
	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,400	38.230	282,902.000	
	AT&T INC	345,891	14.610	5,053,467.510	
	APA CORP	14,900	44.650	665,285.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	SOUTHWEST AIRLINES CO	6,950	29.970	208,291.500	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	20,900	99.490	2,079,341.000	
	CAESARS ENTERTAINMENT INC	10,400	53.740	558,896.000	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	11,900	269.070	3,201,933.000	
	SEMPRA ENERGY	30,400	69.610	2,116,144.000	
	BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	10,500	50.160	526,680.000	
	CLARIVATE PLC	17,500	7.210	126,175.000	
	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	87,700	15.300	1,341,810.000	
	UIPATH INC - CLASS A	17,500	16.220	283,850.000	
	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	8,850	71.230	630,385.500	
	COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	8,100	78.040	632,124.000	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	43,900	168.050	7,377,395.000	
	SALESFORCE.COM INC	46,966	221.620	10,408,604.920	
	WESTROCK CO	12,400	31.880	395,312.000	
	APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	19,209	87.060	1,672,335.540	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	33,234	57.580	1,913,613.720	
	TERADYNE INC	7,500	105.580	791,850.000	
	UNION PACIFIC CORP	29,480	212.830	6,274,228.400	
	MARATHON OIL CORP	29,900	27.090	809,991.000	
	MARATHON PETROLEUM CORP	22,188	147.890	3,281,383.320	
	RTX CORP	70,679	83.510	5,902,403.290	
	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	35,100	162.310	5,697,081.000	
	IQVIA HOLDINGS INC	9,004	218.820	1,970,255.280	
	AMEREN CORPORATION	12,700	77.670	986,409.000	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	44,966	476.940	21,446,084.040	
	TOAST INC CLASS A	14,400	21.370	307,728.000	
	VERISIGN INC	4,500	205.580	925,110.000	
	LUCID GROUP INC	44,900	6.140	275,686.000	
	RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	30,900	23.260	718,734.000	
	ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	22,200	10.790	239,538.000	
	VALERO ENERGY CORP	17,642	134.030	2,364,557.260	
	ULTA BEAUTY INC	2,400	408.490	980,376.000	
	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	12,488	42.300	528,242.400	
	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,130	127.480	399,012.400	
	ELEVANCE HEALTH INC	11,500	446.000	5,129,000.000	
	WALT DISNEY CO/THE	88,362	80.980	7,155,554.760	
	WELLS FARGO & CO	177,122	41.020	7,265,544.440	
	WASTE MANAGEMENT INC	19,700	155.970	3,072,609.000	
	WILLIAMS COS INC	58,900	33.840	1,993,176.000	
	TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,300	215.740	1,143,422.000	
	WHIRLPOOL CORP	2,700	138.180	373,086.000	
	WALMART INC	71,600	161.470	11,561,252.000	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,100	122.670	1,238,967.000	
	WYNN RESORTS LTD	5,000	95.830	479,150.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	97,400	3.680	358,432.000	
	WABTEC CORP	8,711	109.960	957,861.560	
	TJX COMPANIES INC	55,600	90.760	5,046,256.000	
	WATERS CORP	2,900	272.860	791,294.000	
	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,500	272.380	680,950.000	
	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	35,500	22.640	803,720.000	
	WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,063	204.540	1,035,586.020	
	WESTERN DIGITAL CORP	15,500	45.440	704,320.000	
	WEC ENERGY GROUP INC	15,300	82.070	1,255,671.000	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	24,100	59.240	1,427,684.000	
	VISA INC-CLASS A SHARES	78,250	246.160	19,262,020.000	
	PPL CORP	35,700	24.400	871,080.000	
	CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	15,724	106.640	1,676,807.360	
	PULTEGROUP INC	10,850	79.210	859,428.500	
	WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	111,853	11.490	1,285,190.970	
	PPG INDUSTRIES INC	11,400	137.050	1,562,370.000	
	NORTHERN TRUST CORP	10,100	76.330	770,933.000	
	FERGUSON PLC	9,900	156.070	1,545,093.000	
	NVIDIA CORP	119,480	470.610	56,228,482.800	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	19,313	118.360	2,285,886.680	
	DRAFTKINGS INC CLASS A	21,600	30.370	655,992.000	
	ASPEN TECHNOLOGY CORP	1,400	188.650	264,110.000	
	TYSON FOODS INC-CL A	13,800	51.520	710,976.000	
	NETFLIX INC	21,490	445.760	9,579,382.400	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	18,700	536.700	10,036,290.000	
	NRG ENERGY INC	11,150	38.020	423,923.000	
	GLOBE LIFE INC	4,255	108.630	462,220.650	
	TEXTRON INC	9,800	75.980	744,604.000	
	NEWS CORP - CLASS A	17,887	21.210	379,383.270	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	350	1,830.970	640,839.500	
	OMNICOM GROUP	9,700	80.170	777,649.000	
	JACOBS SOLUTIONS INC	6,120	132.180	808,941.600	
	ORACLE CORP	78,833	124.330	9,801,306.890	
	MASTERCARD INC - A	40,900	413.180	16,899,062.000	
	ONEOK INC	21,600	63.650	1,374,840.000	
	ROPER TECHNOLOGIES INC	5,200	495.000	2,574,000.000	
	U HAUL NON VOTING SERIES N	4,600	52.590	241,914.000	
	ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	7,800	101.720	793,416.000	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	5,500	88.400	486,200.000	
	HF SINCLAIR CORP	7,300	57.250	417,925.000	
	OVINTIV INC	12,100	47.120	570,152.000	
	YUM! BRANDS INC	13,600	126.880	1,725,568.000	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	8,200	140.970	1,155,954.000	
	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	9,200	62.030	570,676.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	BANK OF AMERICA CORP	346,801	28.390	9,845,680.390	
	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,300	414.010	952,223.000	
	BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,100	91.000	828,100.000	
	AMERICAN EXPRESS CO	30,600	158.000	4,834,800.000	
	GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	20,035	66.980	1,341,944.300	
	LINDE PLC	23,746	383.290	9,101,604.340	
	ANALOG DEVICES INC	24,191	182.180	4,407,116.380	
	ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	15,400	23.040	354,816.000	
	MONDAYCOM LTD	1,100	172.710	189,981.000	
	ADVANCED MICRO DEVICES	77,927	109.280	8,515,862.560	
	LIBERTY MEDIA LIBERTY SIRIUSXM COR	8,028	23.650	189,862.200	
	LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER	9,600	67.050	643,680.000	
	CONFLUENT INC CLASS A	8,500	33.340	283,390.000	
	KENVUE INC	74,100	22.380	1,658,358.000	
	GLOBAL E ONLINE LTD	4,700	41.120	193,264.000	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	34,972	59.190	2,069,992.680	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,700	106.180	817,586.000	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,100	98.860	1,097,346.000	
	AVERY DENNISON CORP	3,930	183.450	720,958.500	
	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	24,500	71.300	1,746,850.000	
	EMERSON ELECTRIC CO	27,600	98.670	2,723,292.000	
	AON PLC-CLASS A	9,900	331.640	3,283,236.000	
	AMGEN INC	25,800	249.010	6,424,458.000	
	EATON CORP PLC	19,336	231.610	4,478,410.960	
	CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,000	258.810	2,070,480.000	
	APPLIED MATERIALS INC	40,600	153.180	6,219,108.000	
	CME GROUP INC	17,400	203.660	3,543,684.000	
	ECOLAB INC	12,400	181.620	2,252,088.000	
	EQUIFAX INC	5,900	204.190	1,204,721.000	
	GILEAD SCIENCES INC	60,300	74.240	4,476,672.000	
	KEURIG DR PEPPER INC	44,100	33.200	1,464,120.000	
	HORMEL FOODS CORP	14,500	37.250	540,125.000	
	STATE STREET CORP	16,713	69.860	1,167,570.180	
	SCHWAB (CHARLES) CORP	72,740	58.270	4,238,559.800	
	BAXTER INTERNATIONAL INC	24,400	39.640	967,216.000	
	CAMPBELL SOUP CO	9,400	41.100	386,340.000	
	CROWN HOLDINGS INC	5,780	90.810	524,881.800	
	CARDINAL HEALTH INC	12,300	87.250	1,073,175.000	
	FEDEX CORP	11,500	257.470	2,960,905.000	
	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	18,454	101.460	1,872,342.840	
	FMC CORP	6,050	82.190	497,249.500	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	12,313	70.990	874,099.870	
	INTEL CORP	201,700	36.980	7,458,866.000	
	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	18,700	32.400	605,880.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	15,050	71.850	1,081,342.500	
	WOLFSPEED INC	5,800	43.540	252,532.000	
	ILLINOIS TOOL WORKS	14,700	244.200	3,589,740.000	
	SIRIUS XM HOLDINGS INC	38,600	4.290	165,594.000	
	ILLUMINA INC	7,600	159.990	1,215,924.000	
	SEALED AIR CORP	6,700	35.470	237,649.000	
	INTUITIVE SURGICAL INC	17,000	307.840	5,233,280.000	
	CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,850	133.860	649,221.000	
	SNAP-ON INC	2,600	262.500	682,500.000	
	CARMAX INC	7,700	81.560	628,012.000	
	DUKE ENERGY CORP	37,328	87.490	3,265,826.720	
	TARGET CORP	22,300	123.710	2,758,733.000	
	DOVER CORP	6,800	143.860	978,248.000	
	WW GRAINGER INC	2,200	693.540	1,525,788.000	
	JABIL INC	6,800	111.680	759,424.000	
	CINTAS CORP	4,400	495.730	2,181,212.000	
	CONAGRA BRANDS INC	23,100	29.050	671,055.000	
	LAMB WESTON HOLDINGS INC	7,000	96.730	677,110.000	
	CLOROX COMPANY	6,000	153.600	921,600.000	
	ENTERGY CORP	10,200	93.850	957,270.000	
	MICROSOFT CORP	341,600	332.880	113,711,808.000	
	INCYTE CORP	9,200	63.190	581,348.000	
	CVS HEALTH CORP	61,969	65.510	4,059,589.190	
	MEDTRONIC PLC	64,298	80.710	5,189,491.580	
	MICRON TECHNOLOGY INC	53,000	70.410	3,731,730.000	
	BLACKROCK INC	7,200	694.180	4,998,096.000	
	CENTERPOINT ENERGY INC	30,500	27.360	834,480.000	
	HASBRO INC	6,400	72.920	466,688.000	
	KELLOGG CO	13,300	59.300	788,690.000	
	KEYCORP	45,300	11.090	502,377.000	
	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	65,911	69.690	4,593,337.590	
	COOPER COS INC/THE	2,400	356.650	855,960.000	
	CHUBB LTD	19,999	201.940	4,038,598.060	
	ARROW ELECTRONICS INC	2,900	129.890	376,681.000	
	ALLSTATE CORP	12,700	107.930	1,370,711.000	
	EBAY INC	25,900	44.120	1,142,708.000	
	PAYPAL HOLDINGS INC	51,250	62.800	3,218,500.000	
	EASTMAN CHEMICAL CO	5,800	82.710	479,718.000	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	11,200	156.580	1,753,696.000	
	TRIMBLE INC	12,000	53.040	636,480.000	
	LENNAR CORP-A	12,200	116.940	1,426,668.000	
	LEAR CORP	2,900	143.250	415,425.000	
	PROGRESSIVE CORP	28,300	134.840	3,815,972.000	
	PACCAR INC	25,255	82.750	2,089,851.250	
	BIOGEN INC	7,000	263.720	1,846,040.000	
	IDEXX LABORATORIES INC	4,000	487.960	1,951,840.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	STARBUCKS CORP	55,400	95.950	5,315,630.000	
	PTC INC	5,400	146.000	788,400.000	
	EVERSOURCE ENERGY	16,900	60.980	1,030,562.000	
	INTUIT INC	13,480	550.950	7,426,806.000	
	BORGWARNER INC	11,400	40.500	461,700.000	
	BEST BUY CO INC	9,550	73.740	704,217.000	
	BALL CORP	15,204	52.930	804,747.720	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	69,497	53.860	3,743,108.420	
	ELECTRONIC ARTS INC	12,800	120.900	1,547,520.000	
	VULCAN MATERIALS CO	6,400	215.200	1,377,280.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,500	344.320	4,304,000.000	
	VF CORP	16,000	19.590	313,440.000	
	PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	27,125	13.400	363,475.000	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	2,500	96.220	240,550.000	
	CARNIVAL CORP	48,700	15.430	751,441.000	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	25,000	14.950	373,750.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	200,990	44.930	9,030,480.700	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,700	47.710	415,077.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	57,600	3.590	206,784.000	
	アメリカ・ドル 小計			1,874,169,669.260 (277,264,660,871)	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	316,434	24.890	7,876,042.260	
	HALEON PLC	264,482	3.128	827,299.690	
	WISE PLC CLASS A	30,273	6.456	195,442.480	
	BP PLC	818,883	5.159	4,224,617.390	
	UNILEVER PLC	119,031	39.815	4,739,219.260	
	BARCLAYS PLC	736,615	1.492	1,099,176.900	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	398,738	2.147	856,090.480	
	PRUDENTIAL PLC	130,355	9.332	1,216,472.860	
	NATWEST GROUP PLC	275,393	2.279	627,620.640	
	JOHNSON MATTHEY PLC	8,388	17.820	149,474.160	
	BAE SYSTEMS PLC	144,309	10.140	1,463,293.260	
	AVIVA PLC	127,014	3.699	469,824.780	
	GSK	193,876	13.766	2,668,897.010	
	INFORMA PLC	66,343	7.308	484,834.640	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	70,266	5.090	357,653.940	
	AUTO TRADER GROUP PLC	43,578	5.956	259,550.560	
	DCC PLC	4,696	42.890	201,411.440	
	OCADO GROUP PLC	27,677	8.470	234,424.190	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,502	99.100	347,048.200	
	HALMA PLC	18,019	21.620	389,570.780	
	ENTAIN PLC	30,469	11.585	352,983.360	
	JD SPORTS FASHION PLC	123,236	1.393	171,667.740	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	35,703	5.106	182,299.510	
	M&G PLC	104,504	1.917	200,386.420	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	ENDEAVOUR MINING PLC	9,141	15.880	145,159.080	
	RELX PLC	89,622	26.370	2,363,332.140	
	DIAGEO PLC	106,361	31.755	3,377,493.550	
	RIO TINTO PLC	53,307	49.785	2,653,888.990	
	STANDARD CHARTERED PLC	112,254	7.024	788,472.090	
	TESCO PLC	338,702	2.570	870,464.140	
	SMITH & NEPHEW PLC	41,344	10.435	431,424.640	
	GLENCORE PLC	497,895	4.294	2,138,210.070	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	16,956	7.412	125,677.870	
	SMITHS GROUP PLC	16,614	16.500	274,131.000	
	PEARSON PLC	30,619	8.606	263,507.110	
	SAINSBURY (J) PLC	78,274	2.655	207,817.470	
	NEXT PLC	5,620	70.080	393,849.600	
	TAYLOR WIMPEY PLC	167,629	1.129	189,253.140	
	WHITBREAD PLC	9,218	35.540	327,607.720	
	BUNZL PLC	15,999	28.130	450,051.870	
	VODAFONE GROUP PLC	1,145,592	0.733	840,406.290	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,627	52.180	345,796.860	
	KINGFISHER PLC	85,779	2.277	195,318.780	
	WPP PLC	50,889	7.650	389,300.850	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	32,280	9.270	299,235.600	
	SEVERN TRENT PLC	11,946	23.680	282,881.280	
	RENTOKIL INITIAL PLC	119,317	5.856	698,720.350	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	33,978	56.780	1,929,270.840	
	ST JAMES' S PLACE PLC	26,055	8.542	222,561.810	
	SCHRODERS PLC	39,815	4.069	162,007.230	
	SSE PLC	51,622	15.900	820,789.800	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	46,260	4.400	203,544.000	
	ASTRAZENECA PLC	73,382	106.060	7,782,894.920	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	283,052	2.139	605,448.220	
	3I GROUP PLC	46,084	19.570	901,863.880	
	ASHTREAD GROUP PLC	20,746	52.340	1,085,845.640	
	SAGE GROUP PLC/THE	48,536	9.904	480,700.540	
	NATIONAL GRID PLC	174,349	9.732	1,696,764.460	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,016,079	0.414	1,251,521.980	
	IMPERIAL BRANDS PLC	40,812	17.445	711,965.340	
	CENTRICA PLC	279,988	1.560	436,921.270	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	4,918	39.840	195,933.120	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	100,593	25.835	2,598,820.150	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,469	19.575	322,380.670	
	HSBC HOLDINGS PLC	934,951	5.853	5,472,268.200	
	ANGLO AMERICAN PLC	60,164	20.860	1,255,021.040	
	MONDI PLC	22,986	12.960	297,898.560	
	COMPASS GROUP PLC	82,031	19.865	1,629,545.810	
	PERSIMMON PLC	15,188	10.305	156,512.340	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	BT GROUP PLC	345,300	1.141	393,987.300	
	COCA-COLA HBC AG-DI	10,136	22.250	225,526.000	
	BURBERRY GROUP PLC	17,870	20.850	372,589.500	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	8,005	60.660	485,583.300	
	INTERTEK GROUP PLC	7,660	41.400	317,124.000	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	18,886	82.640	1,560,739.040	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,866	20.950	164,792.700	
	ADMIRAL GROUP PLC	9,779	24.040	235,087.160	
	ANTOFAGASTA PLC	18,717	14.960	280,006.320	
	ABRDN PLC	90,862	1.577	143,289.370	
	EXPERIAN PLC	43,565	27.870	1,214,156.550	
イギリス・ポンド 小計				83,260,663.500 (15,392,398,860)	
イスラエル・シ ュケル	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,314	18.950	1,218,750.300	
	AZRIELI GROUP LTD	2,207	200.500	442,503.500	
	ICL GROUP LTD	38,090	22.700	864,643.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,383	755.900	1,045,409.700	
	BANK HAPOALIM BM	66,050	31.360	2,071,328.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	79,801	29.100	2,322,209.100	
	NICE LTD	3,290	741.900	2,440,851.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,029	124.700	1,001,216.300	
イスラエル・シケル 小計				11,406,910.900 (440,249,725)	
オーストラリ ア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	100,640	4.890	492,129.600	
	TELSTRA GROUP LTD	182,347	3.950	720,270.650	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	135,560	25.060	3,397,133.600	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	124,781	3.530	440,476.930	
	BHP GROUP LTD	228,501	46.100	10,533,896.100	
	SOUTH32 LTD	205,649	3.440	707,432.560	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	85,646	38.520	3,299,083.920	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	76,385	20.340	1,553,670.900	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	141,629	28.660	4,059,087.140	
	WESTPAC BANKING CORP	158,275	21.190	3,353,847.250	
	SANTOS LTD	144,925	7.930	1,149,255.250	
	RIO TINTO LTD	16,744	115.980	1,941,969.120	
	ORIGIN ENERGY LTD	75,281	8.370	630,101.970	
	AURIZON HOLDINGS LTD	83,843	3.580	300,157.940	
	PILBARA MINERALS LTD	122,421	4.700	575,378.700	
	XERO LTD	6,482	122.230	792,294.860	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	10,388	33.310	346,024.280	
	COLES GROUP LTD	60,347	15.850	956,499.950	
	WISETECH GLOBAL LTD	7,381	69.730	514,677.130	
	IDP EDUCATION LTD	11,169	24.650	275,315.850	
IGO LTD	30,405	14.770	449,081.850		
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	51,949	11.190	581,309.310		

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	REECE LTD	10,500	19.740	207,270.000	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	64,915	5.430	352,488.450	
	SEEK LTD	16,268	22.560	367,006.080	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	30,976	11.260	348,789.760	
	NEWCREST MINING LTD	40,320	25.670	1,035,014.400	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	75,526	101.510	7,666,644.260	
	AMPOL LTD	10,454	34.410	359,722.140	
	ORICA LTD	19,499	15.380	299,894.620	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	67,299	15.150	1,019,579.850	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	54,970	38.090	2,093,807.300	
	QANTAS AIRWAYS LTD	39,082	5.700	222,767.400	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	19,914	46.050	917,039.700	
	MACQUARIE GROUP LTD	16,561	170.210	2,818,847.810	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	26,526	41.210	1,093,136.460	
	CSL LTD	21,758	271.200	5,900,769.600	
	WESFARMERS LTD	51,174	53.710	2,748,555.540	
	COCHLEAR LTD	2,968	267.850	794,978.800	
	BLUESCOPE STEEL LTD	20,666	21.490	444,112.340	
	SUNCORP GROUP LTD	57,284	13.740	787,082.160	
	ASX LTD	8,754	56.650	495,914.100	
	COMPUTERSHARE LTD	25,169	25.420	639,795.980	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	110,468	5.790	639,609.720	
	SONIC HEALTHCARE LTD	19,599	31.340	614,232.660	
	BRAMBLES LTD	62,638	15.120	947,086.560	
	MINERAL RESOURCES LTD	7,602	73.350	557,606.700	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	8,291	49.950	414,135.450	
	REA GROUP LTD	2,395	162.640	389,522.800	
	オーストラリア・ドル 小計			71,244,505.500 (6,719,069,314)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	35,800	71.560	2,561,848.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	16,181	46.730	756,138.130	
	CONSTELLATION SOFTWARE RIGHTS EXP	900	0.215	193.500	
	IMPERIAL OIL LTD	9,500	79.160	752,020.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	900	2,792.300	2,513,070.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	13,587	91.280	1,240,221.360	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	20,900	57.100	1,193,390.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	8,150	193.450	1,576,617.500	
	BCE INC	4,930	55.420	273,220.600	
	FRANCO-NEVADA CORP	8,800	192.320	1,692,416.000	
	SUNCOR ENERGY INC	60,630	46.980	2,848,397.400	
	METRO INC/CN	10,700	71.050	760,235.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	15,500	92.380	1,431,890.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	54,800	64.320	3,524,736.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	41,700	53.780	2,242,626.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	TORONTO-DOMINION BANK	84,600	81.750	6,916,050.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	12,500	39.670	495,875.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	63,750	121.240	7,729,050.000	
	TOURMALINE OIL CORP	14,800	70.600	1,044,880.000	
	TC ENERGY CORP	46,850	48.500	2,272,225.000	
	PEMBINA PIPELINE CORP	25,329	41.580	1,053,179.820	
	BARRICK GOLD CORP	80,700	21.600	1,743,120.000	
	CAE INC	14,200	32.740	464,908.000	
	THOMSON REUTERS CORP	7,241	173.100	1,253,417.100	
	EMPIRE CO LTD 'A'	7,100	34.970	248,287.000	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,500	98.310	344,085.000	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	6,950	60.140	417,973.000	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	17,600	20.800	366,080.000	
	HYDRO ONE LTD	15,200	35.200	535,040.000	
	LOBLAW COMPANIES LTD	7,360	119.080	876,428.800	
	STANTEC INC	5,800	90.570	525,306.000	
	NORTHLAND POWER INC	11,200	23.700	265,440.000	
	WSP GLOBAL INC	5,700	190.050	1,083,285.000	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,700	112.080	414,696.000	
	PARKLAND CORP	6,600	38.060	251,196.000	
	QUEBECOR INC -CL B	6,800	30.340	206,312.000	
	EMERA INC	12,600	49.500	623,700.000	
	TFI INTERNATIONAL INC	3,500	183.710	642,985.000	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	6,100	31.680	193,248.000	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	16,300	54.480	888,024.000	
	BRP INC/CA- SUB VOTING	1,600	102.000	163,200.000	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	26,700	11.910	317,997.000	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	22,617	64.180	1,451,559.060	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	29,300	9.820	287,726.000	
	AIR CANADA	7,600	21.910	166,516.000	
	KINROSS GOLD CORP	56,100	6.600	370,260.000	
	BANK OF MONTREAL	32,800	115.180	3,777,904.000	
	POWER CORP OF CANADA	26,600	37.040	985,264.000	
	SHOPIFY INC - CLASS A	55,200	89.810	4,957,512.000	
	NUTRIEN LTD	23,119	86.360	1,996,556.840	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,300	34.970	220,311.000	
	CAMECO CORP	20,000	50.250	1,005,000.000	
	FIRSTSERVICE CORP	1,800	206.950	372,510.000	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	10,800	44.040	475,632.000	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,600	25.190	65,494.000	
	TELUS CORP	10,800	23.240	250,992.000	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	20,900	56.090	1,172,281.000	
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,400	154.680	371,232.000	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	50,900	89.210	4,540,789.000	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,000	1,116.330	1,116,330.000	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	12,500	81.180	1,014,750.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	WESTON (GEORGE) LTD	3,137	154.160	483,599.920	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	17,000	21.140	359,380.000	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	3,800	102.530	389,614.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	27,000	67.270	1,816,290.000	
	ENBRIDGE INC	93,100	45.310	4,218,361.000	
	BROOKFIELD CORP	64,725	45.770	2,962,463.250	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	84,600	25.230	2,134,458.000	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	42,820	106.630	4,565,896.600	
	IA FINANCIAL CORP INC	4,700	85.180	400,346.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	8,300	39.210	325,443.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	25,950	149.290	3,874,075.500	
	CGI INC - CLASS A	9,700	139.370	1,351,889.000	
	ONEX CORPORATION	3,200	84.420	270,144.000	
	IGM FINANCIAL INC	3,600	38.110	137,196.000	
	TMX GROUP LTD	12,500	29.330	366,625.000	
	OPEN TEXT CORP	12,100	54.450	658,845.000	
	SAPUTO INC	11,700	29.120	340,704.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	27,100	35.090	950,939.000	
	FORTIS INC	22,300	52.440	1,169,412.000	
	RB GLOBAL INC	8,400	88.670	744,828.000	
	LUNDIN MINING CORP	30,400	10.650	323,760.000	
	CENOVUS ENERGY INC	65,900	27.740	1,828,066.000	
	DOLLARAMA INC	12,800	87.710	1,122,688.000	
	ALTAGAS LTD	13,000	26.580	345,540.000	
	KEYERA CORP	10,200	32.730	333,846.000	
	ARC RESOURCES LTD	28,600	21.080	602,888.000	
カナダ・ドル 小計				111,378,923.380 (12,073,475,294)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	135,300	3.130	423,489.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	65,700	28.600	1,879,020.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	94,200	33.400	3,146,280.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,375	6.750	522,281.250	
	KEPPEL CORP LTD	75,700	6.810	515,517.000	
	UOL GROUP LTD	22,900	6.530	149,537.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	24,600	6.710	165,066.000	
	SEATRUM	2,306,022	0.140	322,843.080	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,100	33.120	168,912.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	176,100	12.570	2,213,577.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	314,400	0.885	278,244.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	429,350	2.340	1,004,679.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	81,200	3.880	315,056.000	
	SEMBICORP INDUSTRIES LTD	46,500	5.080	236,220.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	44,600	9.650	430,390.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	99,900	3.690	368,631.000	
シンガポール・ドル 小計				12,139,742.330 (1,316,069,466)	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
スイス・フラン	DUFY AG-REG	4,854	38.040	184,646.160	
	UBS GROUP AG-REG	152,627	23.130	3,530,262.510	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,447	272.600	394,452.200	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	326	668.000	217,768.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	7,458	37.280	278,034.240	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	32,581	252.400	8,223,444.400	
	SIKA AG-REG	6,789	245.500	1,666,699.500	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	103,200.000	516,000.000	
	ABB LTD-REG	74,342	33.480	2,488,970.160	
	SWISS RE AG	13,988	86.800	1,214,158.400	
	NESTLE SA-REG	123,371	104.200	12,855,258.200	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,052	1,021.000	1,074,092.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,893	193.150	365,632.950	
	JULIUS BAER GROUP LTD	9,536	60.400	575,974.400	
	SGS SA-REG	6,925	81.140	561,894.500	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,091	182.900	199,543.900	
	TEMENOS AG - REG	2,973	66.280	197,050.440	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	1,828	135.600	247,876.800	
	VAT GROUP AG	1,255	361.200	453,306.000	
	BKW AG	942	152.600	143,749.200	
	ALCON INC	23,173	73.280	1,698,117.440	
	SIG GROUP N AG	14,178	22.820	323,541.960	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,342	247.000	331,474.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,977	413.500	2,884,989.500	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,134	141.200	301,320.800	
	CLARIANT AG-REG	9,678	14.680	142,073.040	
	NOVARTIS AG-REG	94,701	87.210	8,258,874.210	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	159	1,534.000	243,906.000	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,575	77.450	121,983.750	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	24,207	117.000	2,832,219.000	
	SWISSCOM AG-REG	1,201	533.800	641,093.800	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,344	95.650	128,553.600	
	GEBERIT AG-REG	1,559	450.100	701,705.900	
	GIVAUDAN-REG	428	2,927.000	1,252,756.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	5,176	133.750	692,290.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,415	228.000	550,620.000	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	7,619	64.080	488,225.520	
	LONZA GROUP AG-REG	3,453	496.100	1,713,033.300	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,269	46.850	106,302.650	
	HOLCIM LTD	24,669	57.120	1,409,093.280	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,372	565.600	776,003.200		
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,519	259.100	652,672.900		
SWISS PRIME SITE-REG	3,575	84.100	300,657.500		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	44	10,390.000	457,160.000		
スイス・フラン 小計				62,397,481.310 (10,348,622,276)	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
スウェーデン・クローナ	SAGAX CLASS B	10,255	229.900	2,357,624.500	
	VOLVO CAR CLASS B	28,514	39.310	1,120,885.340	
	ERICSSON LM-B SHS	152,246	58.330	8,880,509.180	
	VOLVO AB-B SHS	78,458	222.400	17,449,059.200	
	SKF AB-B SHARES	17,719	183.450	3,250,550.550	
	TELE2 AB-B SHS	26,333	77.400	2,038,174.200	
	GETINGE AB-B SHS	11,892	189.550	2,254,128.600	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	82,504	128.050	10,564,637.200	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	75,834	93.340	7,078,345.560	
	SWEDBANK AB - A SHARES	43,333	193.650	8,391,435.450	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	34,946	165.020	5,766,788.920	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	31,500	146.500	4,614,750.000	
	SKANSKA AB-B SHS	17,689	164.900	2,916,916.100	
	SANDVIK AB	55,435	211.000	11,696,785.000	
	INVESTOR AB-B SHS	89,989	214.950	19,343,135.550	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	139,653	149.000	20,808,297.000	
	VOLVO AB-A SHS	10,411	224.600	2,338,310.600	
	HOLMEN AB-B SHARES	4,877	416.500	2,031,270.500	
	SECURITAS AB-B SHS	25,570	89.300	2,283,401.000	
	TELIA CO AB	122,866	22.040	2,707,966.640	
	ALFA LAVAL AB	15,043	390.300	5,871,282.900	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	81,153	130.450	10,586,408.850	
	ASSA ABLOY AB-B	52,111	246.400	12,840,150.400	
	SAAB AB-B	3,943	588.600	2,320,849.800	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	6,768	293.200	1,984,377.600	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	30,192	52.000	1,569,984.000	
	INDUTRADE AB	13,454	215.000	2,892,610.000	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	10,125	217.800	2,205,225.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,951	461.700	1,824,176.700	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,843	203.700	1,393,919.100	
	LIFCO AB-B SHS	12,120	206.500	2,502,780.000	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	78,793	81.500	6,421,629.500	
	BEIJER REF AB	20,012	128.700	2,575,544.400	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	31,669	247.500	7,838,077.500	
BOLIDEN AB	14,220	299.350	4,256,757.000		
EPIROC AB-A	34,263	220.100	7,541,286.300		
EPIROC AB-B	19,202	187.900	3,608,055.800		
HUSQVARNA AB-B SHS	19,395	90.000	1,745,550.000		
NORDEA BANK ABP	167,488	121.300	20,316,294.400		
EQT AB	18,489	221.000	4,086,069.000		
EVOLUTION AB	9,528	1,195.000	11,385,960.000		
HEXAGON AB-B SHS	107,944	97.620	10,537,493.280		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,028	292.600	2,348,992.800		
スウェーデン・クローナ 小計				266,546,445.420 (3,547,733,189)	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	82,358	1,327.400	109,322,009.200	
	DANSKE BANK A/S	35,861	155.550	5,578,178.550	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	153	12,490.000	1,910,970.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	52,505	154.600	8,117,273.000	
	CARLSBERG AS-B	5,120	985.600	5,046,272.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	10,634	306.300	3,257,194.200	
	COLOPLAST-B	6,177	781.800	4,829,178.600	
	DSV PANALPINA A/S	9,678	1,303.000	12,610,434.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	426	1,773.500	755,511.000	
	DEMANT A/S	5,239	283.200	1,483,684.800	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	252	12,710.000	3,202,920.000	
	TRYG A/S	17,729	130.850	2,319,839.650	
	PANDORA A/S	4,341	713.800	3,098,605.800	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,484	464.400	2,546,769.600	
	GENMAB A/S	3,433	2,601.000	8,929,233.000	
ORSTED A/S	9,835	382.000	3,756,970.000		
デンマーク・クローネ 小計				176,765,043.400 (3,759,792,473)	
ニュージーランド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	67,152	5.235	351,540.720	
	MERCURY NZ LTD	34,143	6.120	208,955.160	
	EBOS GROUP LTD	7,660	36.800	281,888.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	92,147	4.930	454,284.710	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	65,088	8.130	529,165.440	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	30,125	22.120	666,365.000	
ニュージーランド・ドル 小計				2,492,199.030 (216,322,875)	
ノルウェー・クローネ	DNB BANK	48,122	210.200	10,115,244.400	
	NORSK HYDRO ASA	68,982	62.020	4,278,263.640	
	ORKLA ASA	39,050	79.040	3,086,512.000	
	TELENOR ASA	36,380	112.550	4,094,569.000	
	EQUINOR ASA	46,908	343.300	16,103,516.400	
	YARA INTERNATIONAL ASA	8,608	408.400	3,515,507.200	
	MOWI ASA	22,853	191.100	4,367,208.300	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	10,398	161.100	1,675,117.800	
	AKER BP ASA	16,430	300.000	4,929,000.000	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	4,573	478.600	2,188,637.800	
	SALMAR ASA	3,573	527.800	1,885,829.400	
ADEVINTA ASA	13,944	72.400	1,009,545.600		
ノルウェー・クローネ 小計				57,248,951.540 (790,608,021)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	38,360	23.060	884,581.600	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	23,124	31.990	739,736.760	
	EXOR NV	5,095	81.420	414,834.900	
	DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	5,338	101.850	543,675.300	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	CORPORACION ACCIONA ENERGIAS RENOV	2,938	25.980	76,329.240	
	DSM FIRMENICH AG	8,774	81.330	713,589.420	
	FERROVIAL	24,640	29.100	717,024.000	
	LOTUS BAKERIES NV	21	7,270.000	152,670.000	
	BAYER AG-REG	46,056	50.120	2,308,326.720	
	EVONIK INDUSTRIES AG	9,486	18.085	171,554.310	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	90,946	9.571	870,444.160	
	COMMERZBANK AG	49,895	9.292	463,624.340	
	VOLKSWAGEN AG	1,304	123.450	160,978.800	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	9,657	107.500	1,038,127.500	
	SIEMENS AG-REG	35,631	137.260	4,890,711.060	
	E.ON SE	105,252	11.305	1,189,873.860	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	14,909	96.300	1,435,736.700	
	GEA GROUP AG	7,218	36.600	264,178.800	
	CONTINENTAL AG	5,168	68.260	352,767.680	
	BASF SE	41,885	45.805	1,918,542.420	
	ALLIANZ SE-REG	18,907	221.250	4,183,173.750	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	7,926	71.000	562,746.000	
	RHEINMETALL AG	2,042	246.700	503,761.400	
	RWE AG	29,664	37.050	1,099,051.200	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27,029	8.081	218,421.340	
	BRENTAG SE	6,969	75.080	523,232.520	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	19,800	28.100	556,380.000	
	SAP SE	48,954	128.960	6,313,107.840	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,379	358.100	2,284,319.900	
	ZALANDO SE	10,553	26.670	281,448.510	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	6,804	72.540	493,562.160	
	COVESTRO AG	9,078	48.000	435,744.000	
	RATIONAL AG	242	662.500	160,325.000	
	SARTORIUS AG-VORZUG	1,210	356.800	431,728.000	
	TALANX AG	3,119	63.300	197,432.700	
	PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	7,194	48.860	351,498.840	
	DELIVERY HERO SE	8,246	32.455	267,623.930	
	CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,894	88.040	166,747.760	
	BECHTLE AG	3,626	45.070	163,423.820	
	NEMETSCHEK SE	2,557	63.520	162,420.640	
	SCOUT24 AG	3,600	63.120	227,232.000	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	13,218	45.020	595,074.360	
	KNORR-BREMSE AG	3,413	62.440	213,107.720	
	HELLOFRESH SE	7,177	29.220	209,711.940	
	SIEMENS ENERGY AG	23,742	12.640	300,098.880	
	BEIERSDORF AG	4,725	120.650	570,071.250	
	MERCK KGAA	6,059	167.650	1,015,791.350	
	ADIDAS AG	7,575	181.960	1,378,347.000	
	PUMA SE	4,969	61.280	304,500.320	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	HENKEL AG & CO KGAA	4,883	63.940	312,219.020	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	151,948	19.942	3,030,147.010	
	FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	9,650	40.680	392,562.000	
	MERCEDES-BENZ GROUP N AG	38,764	66.240	2,567,727.360	
	QIAGEN N. V.	10,690	39.730	424,713.700	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	61,222	33.070	2,024,611.540	
	HANNOVER RUECK SE	2,826	198.000	559,548.000	
	DHL GROUP	46,385	41.240	1,912,917.400	
	DEUTSCHE BOERSE AG	8,907	161.550	1,438,925.850	
	MTU AERO ENGINES AG	2,524	210.600	531,554.400	
	WACKER CHEMIE AG	899	136.250	122,488.750	
	SYMRISE AG	6,224	94.100	585,678.400	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	41,312	1.732	71,573.040	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	2,686	88.400	237,442.400	
	VONOVIA SE	34,542	22.500	777,195.000	
	LEG IMMOBILIEN SE	3,501	67.240	235,407.240	
	KONINKLIJKE PHILIPS NV	43,515	20.060	872,910.900	
	NN GROUP NV	12,086	35.170	425,064.620	
	ARCELORMITTAL	25,700	24.895	639,801.500	
	HEINEKEN NV	13,649	87.940	1,200,293.060	
	AEGON NV	77,429	4.660	360,819.140	
	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	46,015	28.720	1,321,550.800	
	AKZO NOBEL N. V.	7,841	74.100	581,018.100	
	WOLTERS KLUWER	12,073	112.400	1,357,005.200	
	ING GROEP NV	169,586	12.892	2,186,302.710	
	KONINKLIJKE KPN NV	151,671	3.210	486,863.910	
	ASML HOLDING NV	18,899	616.800	11,656,903.200	
	ABN AMRO BANK NV-CVA	18,975	13.400	254,265.000	
	IMCD NV	2,678	124.700	333,946.600	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	4,008	107.500	430,860.000	
	ASR NEDERLAND NV	8,311	38.990	324,045.890	
	ADYEN NV	1,018	762.900	776,632.200	
	PROSUS NV	36,049	65.400	2,357,604.600	
	JDE PEET' S NV	5,785	25.300	146,360.500	
	ASM INTERNATIONAL NV	2,201	452.150	995,182.150	
	RANDSTAD NV	5,275	52.620	277,570.500	
	HEINEKEN HOLDING NV	6,143	72.700	446,596.100	
	OCI NV	4,987	24.720	123,278.640	
	TOTALENERGIES SE	109,487	59.510	6,515,571.370	
	MICHELIN (CGDE)	31,804	30.090	956,982.360	
	AIR LIQUIDE SA	24,554	164.660	4,043,061.640	
	KERING	3,490	468.700	1,635,763.000	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	25,520	157.740	4,025,524.800	
	BOUYGUES SA	9,572	31.510	301,613.720	
	BNP PARIBAS	50,023	58.600	2,931,347.800	
	THALES SA	4,927	136.700	673,520.900	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	DANONE	30,195	52.730	1,592,182.350	
	CARREFOUR SA	28,025	16.615	465,635.370	
	VIVENDI	31,166	8.340	259,924.440	
	L'OREAL	11,309	398.200	4,503,243.800	
	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	22,086	57.710	1,274,583.060	
	LEGRAND SA	12,508	91.360	1,142,730.880	
	PERNOD RICARD SA	9,578	176.600	1,691,474.800	
	EURAZEO SE	1,981	56.000	110,936.000	
	SOCIETE GENERALE SA	35,528	25.530	907,029.840	
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	12,945	731.500	9,469,267.500	
	ACCOR SA	8,355	33.490	279,808.950	
	CAPGEMINI SE	7,730	170.450	1,317,578.500	
	VALEO SA	9,148	17.600	161,004.800	
	PUBLICIS GROUPE	10,730	72.760	780,714.800	
	BUREAU VERITAS SA	13,862	24.890	345,025.180	
	EIFFAGE	3,675	90.900	334,057.500	
	SODEXO SA	4,157	99.560	413,870.920	
	IPSEN	1,706	115.100	196,360.600	
	AMUNDI SA	2,888	53.750	155,230.000	
	TELEPERFORMANCE	2,771	128.400	355,796.400	
	EURONEXT NV	3,876	65.650	254,459.400	
	EUROFINS SCIENTIFIC	6,342	55.160	349,824.720	
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,302	262.400	341,644.800	
	SEB SA	1,182	92.100	108,862.200	
	ESSILORLUXOTTICA	13,842	172.220	2,383,869.240	
	DASSAULT AVIATION SA	1,108	180.000	199,440.000	
	WORLDLINE SA	11,265	28.220	317,898.300	
	LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	4,944	32.520	160,778.880	
	AXA SA	86,016	27.585	2,372,751.360	
	EDENRED	11,699	58.240	681,349.760	
	RENAULT SA	9,048	35.880	324,642.240	
	HERMES INTERNATIONAL	1,485	1,833.400	2,722,599.000	
	STMICROELECTRONICS NV	32,041	42.845	1,372,796.640	
	REMY COINTREAU	1,009	138.150	139,393.350	
	DASSAULT SYSTEMES SE	31,420	36.565	1,148,872.300	
	WENDEL	1,124	84.000	94,416.000	
	ORANGE	87,788	10.552	926,338.970	
	ALSTOM	14,107	24.880	350,982.160	
	SANOFI	53,273	98.240	5,233,539.520	
	VINCI SA	24,919	102.360	2,550,708.840	
	AIRBUS SE	27,790	133.940	3,722,192.600	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	31,858	27.810	885,970.980	
	CREDIT AGRICOLE SA	56,733	11.260	638,813.580	
	BIOMERIEUX	1,852	91.740	169,902.480	
	ENGIE	85,625	14.504	1,241,905.000	
	SAFRAN SA	16,024	146.040	2,340,144.960	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	ARKEMA	2,829	95.500	270,169.500	
	ADP	1,343	118.000	158,474.000	
	GETLINK SE	19,411	15.115	293,397.260	
	BOLLORE	39,141	5.225	204,511.720	
	UCB SA	5,940	82.300	488,862.000	
	KBC GROUP NV	11,734	59.440	697,468.960	
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,383	74.840	328,023.720	
	SOLVAY SA	3,489	111.050	387,453.450	
	UMICORE	9,840	24.290	239,013.600	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	40,720	52.460	2,136,171.200	
	AGEAS	7,499	36.250	271,838.750	
	D' IETEREN GROUP	1,036	155.400	160,994.400	
	ELIA GROUP SA/NV	1,462	102.300	149,562.600	
	SOFINA	670	206.600	138,422.000	
	ARGENX SE	2,624	482.400	1,265,817.600	
	PRYSMIAN SPA	12,378	37.520	464,422.560	
	ASSICURAZIONI GENERALI	48,878	18.765	917,195.670	
	MEDIOBANCA SPA	26,230	12.025	315,415.750	
	TENARIS SA	22,187	14.935	331,362.840	
	UNICREDIT SPA	86,265	20.935	1,805,957.770	
	TELECOM ITALIA SPA	434,374	0.303	131,875.940	
	INTESA SANPAOLO	721,438	2.391	1,725,318.970	
	POSTE ITALIANE SPA	24,593	10.075	247,774.470	
	MONCLER SPA	9,654	58.520	564,952.080	
	RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	4,912	44.360	217,896.320	
	ENI SPA	110,008	14.792	1,627,238.330	
	DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	24,606	11.815	290,719.890	
	DIASORIN SPA	1,144	93.340	106,780.960	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,810	11.400	180,234.000	
	NEXI SPA	27,866	6.364	177,339.220	
	AMPLIFON SPA	5,632	29.240	164,679.680	
	ENEL SPA	381,294	6.103	2,327,037.280	
	SNAM SPA	94,744	4.728	447,949.630	
	TERNA SPA	65,948	7.496	494,346.200	
	CNH INDUSTRIAL NV	47,963	12.870	617,283.810	
	FINCOBANK SPA	28,693	12.635	362,536.050	
	STELLANTIS NV	103,531	16.920	1,751,744.520	
	FERRARI NV	5,909	280.800	1,659,247.200	
	TELEFONICA SA	242,511	3.761	912,083.870	
	ENDESA SA	14,367	18.830	270,530.610	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	279,358	7.020	1,961,093.160	
	IBERDROLA SA	285,848	10.690	3,055,715.120	
	REPSOL SA	60,600	14.595	884,457.000	
	GRIFOLS SA	14,039	12.605	176,961.590	
	BANCO SANTANDER SA	757,556	3.407	2,580,993.290	
	AMADEUS IT GROUP SA	21,119	62.400	1,317,825.600	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	10,300	26.160	269,448.000	
	CAIXABANK SA	195,084	3.591	700,546.640	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	10,306	32.240	332,265.440	
	AENA SME SA	3,515	143.950	505,984.250	
	CELLNEX TELECOM SA	26,497	35.130	930,839.610	
	ACCIONA SA	1,117	125.850	140,574.450	
	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	51,138	35.280	1,804,148.640	
	ENAGAS SA	11,714	15.580	182,504.120	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	19,067	14.850	283,144.950	
	UPM-KYMMENE OYJ	25,022	31.160	779,685.520	
	NOKIA OYJ	251,161	3.769	946,751.380	
	WARTSILA OYJ ABP	22,236	12.030	267,499.080	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	26,320	11.665	307,022.800	
	ELISA OYJ	6,414	45.060	289,014.840	
	SAMPO OYJ-A SHS	21,514	40.670	874,974.380	
	FORTUM OYJ	21,078	12.115	255,359.970	
	KESKO OYJ-B SHS	12,355	17.980	222,142.900	
	KONE OYJ-B	15,931	42.570	678,182.670	
	NESTE OYJ	19,834	34.020	674,752.680	
	ORION OYJ-CLASS B	4,846	37.480	181,628.080	
	METSO CORPORATION	31,351	10.945	343,136.690	
	VERBUND AG	3,205	73.650	236,048.250	
	OMV AG	6,920	44.670	309,116.400	
	ERSTE GROUP BANK AG	16,116	33.240	535,695.840	
	VOESTALPINE AG	5,480	27.720	151,905.600	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	12,188	37.510	457,171.880	
	AIB GROUP PLC	67,931	4.098	278,381.230	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	49,516	8.734	432,472.740	
	KINGSPAN GROUP PLC	7,249	75.140	544,689.860	
	JERONIMO MARTINS	13,330	21.880	291,660.400	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	148,083	4.149	614,396.360	
	GALP ENERGIA SGPS SA	23,118	13.380	309,318.840	
	EDP RENOVAVEIS SA	14,554	16.655	242,396.870	
	KERRY GROUP PLC-A	7,471	84.700	632,793.700	
	CRH PLC	33,942	51.020	1,731,720.840	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	8,275	162.450	1,344,273.750	
ユーロ 小計				218,491,716.480 (34,650,601,317)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	72,000	38.350	2,761,200.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	114,000	50.450	5,751,300.000	
	MTR CORP	81,000	32.250	2,612,250.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	75,500	89.150	6,730,825.000	
	SINO LAND CO	182,000	9.170	1,668,940.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	139,669	41.800	5,838,164.200	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	24,000	56.150	1,347,600.000	
	CLP HOLDINGS LTD	85,500	59.400	5,078,700.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	75,507	21.400	1,615,849.800	
	HONG KONG & CHINA GAS	582,475	5.740	3,343,406.500	
	HANG SENG BANK LTD	39,800	98.650	3,926,270.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	79,500	17.080	1,357,860.000	
	WH GROUP LTD	433,500	4.060	1,760,010.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	62,600	312.000	19,531,200.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	97,000	10.640	1,032,080.000	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	87,000	11.860	1,031,820.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	60,800	16.560	1,006,848.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	102,669	42.200	4,332,631.800	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	30,000	38.250	1,147,500.000	
	AIA GROUP LTD	600,600	68.800	41,321,280.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	64,000	14.200	908,800.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	87,000	32.300	2,810,100.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	89,500	16.760	1,500,020.000	
	ESR CAYMAN LTD	113,800	11.860	1,349,668.000	
	SANDS CHINA LTD	126,400	26.450	3,343,280.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	71,500	76.900	5,498,350.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	192,500	22.250	4,283,125.000	
香港・ドル 小計				132,889,078.300 (2,506,288,016)	
合計				369,025,891,697 [369,025,891,697]	

(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
新株予約 権証券	カナダ・ドル	CONSTELLATION SOFTWARE IN- 28	900.000	6,246.000	
	カナダ・ドル 小計			6,246.000 (677,067)	
新株予約権証券 合計				677,067 [677,067]	
投資証券	アメリカ・ドル	AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,937	1,244,289.690	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	15,807	1,829,660.250	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,200	475,992.000	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	5,200	1,133,548.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	17,400	1,106,814.000	
		EQUINIX INC	4,508	3,461,738.280	
		AMERICAN TOWER CORP	22,500	4,005,225.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	34,443	550,054.710	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	15,700	555,937.000	
		KIMCO REALTY CORP	30,000	558,600.000	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	18,500	314,500.000	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	12,700	613,791.000	
		INVITATION HOMES INC	29,600	1,005,216.000	
		VICI PROPERTIES INC	48,600	1,507,086.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		VENTAS INC	19,400	827,216.000	
		WEYERHAEUSER CO	35,414	1,147,059.460	
		CROWN CASTLE INTL CORP	21,000	2,079,000.000	
		IRON MOUNTAIN INC	14,100	902,682.000	
		SUN COMMUNITIES INC	6,000	717,120.000	
		PROLOGIS INC	44,654	5,420,102.520	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,900	916,005.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,200	544,752.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,100	732,871.000	
		WELLTOWER INC	24,000	1,967,520.000	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	26,500	540,865.000	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,600	790,328.000	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,600	565,966.000	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	23,900	475,371.000	
		REALTY INCOME CORP	32,595	1,792,399.050	
		PUBLIC STORAGE	7,700	2,069,221.000	
		REGENCY CENTERS CORP	8,100	515,160.000	
		UDR INC	15,100	589,957.000	
		WP CAREY INC	10,300	651,681.000	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	14,100	1,832,718.000	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,500	1,328,880.000	
		アメリカ・ドル 小計		44,769,325.960 (6,623,174,083)	
	イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	33,482	195,936.660	
		SEGRO PLC	55,182	401,173.140	
		イギリス・ポンド 小計		597,109.800 (110,387,689)	
	オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	48,731	369,380.980	
		LENLEASE GROUP	31,401	240,845.670	
		TRANSURBAN GROUP	138,948	1,809,102.960	
		APA GROUP	53,350	458,810.000	
		SCENTRE GROUP	235,284	630,561.120	
		GPT GROUP	86,791	361,918.470	
		MIRVAC GROUP	173,080	408,468.800	
		STOCKLAND	104,777	429,585.700	
		GOODMAN GROUP	76,496	1,766,292.640	
		VICINITY CENTRES	175,417	323,644.360	
		オーストラリア・ドル 小計		6,798,610.700 (641,176,975)	
	カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,800	189,430.000	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	6,900	135,585.000	
		カナダ・ドル 小計		325,015.000 (35,231,626)	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	194,000	535,440.000		
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	276,670	525,673.000		
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	170,200	285,936.000		
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	112,700	167,923.000		
	シンガポール・ドル 小計				1,514,972.000 (164,238,115)	
	ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	5,554	274,034.360		
		GECINA SA	2,164	212,288.400		
		KLEPIERRE	10,126	246,365.580		
		COVIVIO	2,399	105,843.880		
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,389	186,202.800		
	ユーロ 小計				1,024,735.020 (162,512,727)	
	香港・ドル	LINK REIT	131,500	5,095,625.000		
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	197,000	1,631,160.000		
	香港・ドル 小計				6,726,785.000 (126,867,165)	
投資証券 合計				7,863,588,380 [7,863,588,380]		
合計				7,864,265,447 [7,864,265,447]		

新株予約権証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入新株予約 権証券時価比 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	株式 605 銘柄 投資証券 35 銘柄	97.7%	-%	2.3%	75.4%
イギリス・ポンド	株式 80 銘柄 投資証券 2 銘柄	99.3%	-%	0.7%	4.1%
イスラエル・シケル	株式 8 銘柄	100%	-%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 49 銘柄 投資証券 10 銘柄	91.3%	-%	8.7%	2.0%
カナダ・ドル	株式 87 銘柄 新株予約権証券 1 銘柄 投資証券 2 銘柄	99.7%	0.0%	0.3%	3.2%
シンガポール・ドル	株式 16 銘柄 投資証券 4 銘柄	88.9%	-%	11.1%	0.4%
スイス・フラン	株式 44 銘柄	100%	-%	-%	2.7%
スウェーデン・クローナ	株式 43 銘柄	100%	-%	-%	0.9%
デンマーク・クローネ	株式 16 銘柄	100%	-%	-%	1.0%
ニュージーランド・ドル	株式 6 銘柄	100%	-%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 12 銘柄	100%	-%	-%	0.2%
ユーロ	株式 223 銘柄 投資証券 5 銘柄	99.5%	-%	0.5%	9.2%
香港・ドル	株式 27 銘柄 投資証券 2 銘柄	95.2%	-%	4.8%	0.7%

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。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年9月7日現在 金額(円)	2023年9月7日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	5,136,837,121	5,169,670,190
コール・ローン	418,459,889	2,142,004,041
国債証券	241,423,721,923	266,541,276,843
派生商品評価勘定	7,686,476	14,837,311
未収利息	1,347,969,651	1,760,176,571
前払費用	78,126,707	106,662,157
流動資産合計	248,412,801,767	275,734,627,113
資産合計	248,412,801,767	275,734,627,113
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	48,376
未払金	4,013,342,648	2,505,365,151
未払解約金	23,785,636	185,238,837
流動負債合計	4,037,128,284	2,690,652,364
負債合計	4,037,128,284	2,690,652,364
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	75,361,838,720	81,490,428,967
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	169,013,834,763	191,553,545,782
元本等合計	244,375,673,483	273,043,974,749
純資産合計	244,375,673,483	273,043,974,749
負債純資産合計	248,412,801,767	275,734,627,113

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2022 年 9 月 8 日 至 2023 年 9 月 7 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2022 年 9 月 7 日現在	2023 年 9 月 7 日現在
1. ※1 期首	2021 年 9 月 8 日	2022 年 9 月 8 日
期首元本額	73,446,052,175 円	75,361,838,720 円
期中追加設定元本額	9,117,900,857 円	11,462,056,956 円
期中一部解約元本額	7,202,114,312 円	5,333,466,709 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	456,914,944 円	402,712,308 円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	9,695,471 円	7,360,920 円

区分	2022年9月7日現在	2023年9月7日現在
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	56,708,153円	43,963,859円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	21,013,629円	15,130,453円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	262,492,877円	209,031,796円
外国債券インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	305,013,468円	516,076,270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)	583,870,307円	808,911,779円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)	2,544,715,025円	3,391,527,422円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)	612,608,084円	852,087,032円
D-I's 外国債券インデックス	1,038,760円	2,130,624円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	11,777,227円	18,843,191円
iFree 外国債券インデックス	2,011,137,086円	2,168,952,293円
iFree 8資産バランス	1,749,743,615円	2,218,246,601円
iFree 年金バランス	314,594,981円	457,574,246円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	-円	382,798円
DCダイワ外国債券インデックス	50,731,627,427円	51,018,771,217円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,031,504,692円	1,141,716,911円
ダイワ・ライフ・バランス50	662,725,726円	781,538,835円
ダイワ・ライフ・バランス70	440,285,503円	608,476,406円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	628,690,680円	690,011,616円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	500,135,582円	543,955,599円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	190,959,697円	215,733,645円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	31,998,294円	34,639,105円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	13,493,031円	18,191,164円
ダイワつみたてインデックス外国債券	1,206,742,268円	1,767,734,506円
ダイワつみたてインデックスバランス30	3,883,659円	4,818,337円
ダイワつみたてインデックスバランス50	1,440,814円	1,698,924円

区分	2022年9月7日現在	2023年9月7日現在
ダイワつみたてインデックスバ ランス70	2,450,390円	2,999,998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)	71,874,140円	843,244,763円
ダイワ世界バランスファンド4 0VA	118,041,581円	99,236,250円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	47,489,426円	27,226,820円
ダイワ・バランスファンド35 VA	3,385,180,844円	2,960,692,945円
ダイワ・バランスファンド25 VA (適格機関投資家専用)	210,337,455円	190,500,217円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	149,237,588円	159,757,160円
ダイワ・ノーロード 外国債券フ ァンド	48,968,243円	67,677,570円
ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジなし) (ダイワS MA専用)	1,150,326,488円	3,339,608,775円
ダイワ投信倶楽部外国債券イン デックス	5,690,808,040円	5,754,077,250円
ダイワライフスタイル25	29,029,179円	27,435,793円
ダイワライフスタイル50	58,273,398円	60,909,034円
ダイワライフスタイル75	15,010,948円	16,844,535円
計	75,361,838,720円	81,490,428,967円
2. 期末日における受益権の総数	75,361,838,720口	81,490,428,967口

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	自2022年9月8日 至2023年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

区分	自 2022 年 9 月 8 日 至 2023 年 9 月 7 日
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023 年 9 月 7 日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)
売買目的有価証券

種類	2022 年 9 月 7 日現在	2023 年 9 月 7 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	△37,637,641,822	△9,604,905,666
合計	△37,637,641,822	△9,604,905,666

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

(デリバティブ取引に関する注記)
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	2022 年 9 月 7 日現在				2023 年 9 月 7 日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超				1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建	531,234,144	-	538,920,620	7,686,476	2,103,689,590	-	2,118,478,525	14,788,935

種類	2022年9月7日現在				2023年9月7日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
アメリカ・ドル	91,373,287	-	91,951,414	578,127	219,265,105	-	220,091,367	826,262
イギリス・ポンド	25,835,812	-	26,075,871	240,059	191,209,766	-	191,592,927	383,161
オーストラリア・ドル	27,119,320	-	27,431,976	312,656	31,562,798	-	31,574,121	11,323
オフショア・人民元	129,704,724	-	132,267,240	2,562,516	1,134,657,071	-	1,146,041,075	11,384,004
カナダ・ドル	-	-	-	-	74,458,616	-	75,025,458	566,842
シンガポール・ドル	41,723,036	-	42,696,978	973,942	80,779,313	-	81,243,598	464,285
デンマーク・クローネ	8,766,342	-	8,901,500	135,158	-	-	-	-
ポーランド・ズロチ	20,476,366	-	20,719,338	242,972	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	22,089,227	-	22,764,695	675,468	-	-	-	-
ユーロ	164,146,030	-	166,111,608	1,965,578	371,756,921	-	372,909,979	1,153,058
合計	531,234,144	-	538,920,620	7,686,476	2,103,689,590	-	2,118,478,525	14,788,935

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2022年9月7日現在	2023年9月7日現在
1口当たり純資産額	3,2427円	3,3506円
(1万口当たり純資産額)	(32,427円)	(33,506円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	876,306.600	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	751,369.840	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	763,682.400	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	789,191.340	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,547,251.850	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,209,762.960	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	909,593.300	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	550,822.200	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	527,532.360	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	945,201.450	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,101,819.690	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,070,472.800	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,202,667.400	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,033,563.300	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	1,663,770.560	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,014,029.950	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,432,319.070	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,297,300.620	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,346,272.200	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,374,599.210	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,196,076.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,332,937.440	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,084,875.990	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	4,018,768.060			

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,248,661.500	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,132,180.700	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,788,303.600	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	2,809,228.840	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	1,851,195.170	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	2,883,968.560	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	2,788,558.320	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,550,202.270	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	5,706,896.640	
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,157,861.720	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,485,311.590	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	1,836,492.020	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,505,892.880	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	1,835,000.000	1,435,483.800	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,422,310.880	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,430,316.450	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,515,588.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	514,026.590	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,506,743.220	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	2,232,372.720	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,117,867.970	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	1,998,571.080	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	4,923,882.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	1,866,158.400	
		2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	4,879,922.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	758,750.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,365,143.600	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	1,818,641.300	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	5,917,248.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,550,380.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,410,005.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,450,000.000	1,810,207.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	1,931,960.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,415,250.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,019,575.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	1,845,000.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,377,535.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,076,288.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,690,884.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	5,900,483.500	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,502,630.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,604,285.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,321,940.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	2,787,567.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	3,009,714.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,058,910.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	1,831,049.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,416,981.500	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	2,878,860.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,227,047.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,490,702.200	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,401,550.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,445,164.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,402,225.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,400,000.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,471,192.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,502,825.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	2,870,610.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,500,000.000	1,425,810.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,020,124.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,373,025.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	3,635,497.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,363,950.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,347,550.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	3,511,819.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,497,481.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,633,400.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,798,430.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,592,128.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,308,000.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,026,913.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	3,042,624.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,541,644.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	3,840,320.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,284,075.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	2,879,670.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	956,870.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,732,790.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	2,850,000.000	2,450,772.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	3,059,640.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,818,500.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	2,862,480.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,278,900.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,387,150.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,700,000.000	1,611,073.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,193,350.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	5,861,375.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	3,357,882.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	266,658.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	4,897,516.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,500,000.000	2,324,700.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,392,048.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,329,704.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,497,068.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,071,872.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	2,835,168.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	3,022,250.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,012,170.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,759,040.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	6,500,000.000	5,960,175.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,004,120.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,106,852.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,223,680.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,256,050.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,700,000.000	3,506,579.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	5,000,000.000	2,996,050.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	2,985,640.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	4,000,000.000	3,634,040.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,384,200.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,187,310.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	7,741,216.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,620,920.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,392,320.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	3,812,352.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,178,983.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,614,684.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,251,950.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,241,000.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,000,000.000	903,040.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	5,955,460.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	3,528,908.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	8,574,124.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,496,650.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,317,150.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,187,070.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,698,710.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,466,240.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,615,760.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	7,186,287.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,052,430.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,188,560.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	4,318,976.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	2,735,696.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	6,000,000.000	5,178,000.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	3,950,848.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,305,150.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,498,800.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,197,667.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	6,900,000.000	4,247,640.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	3,700,000.000	2,426,164.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,339,520.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,240,600.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,258,000.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,453,900.000	
		0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240915	3,500,000.000	3,325,140.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,275,450.000	
		0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,124,695.000	
		0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241015	2,000,000.000	1,898,280.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241115	4,500,000.000	4,261,815.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	10,000,000.000	7,986,700.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,600,000.000	3,929,772.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	2,733,200.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,152,020.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	7,000,000.000	6,276,480.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,592,800.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	4,831,512.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241215	2,200,000.000	2,083,554.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	4,000,000.000	3,422,160.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,587,800.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250115	1,000,000.000	945,720.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	10,400,000.000	8,610,784.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250215	3,700,000.000	3,507,748.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,745,171.000	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	3,900,000.000	2,553,096.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	1,816,000.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,378,900.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	5,000,000.000	4,559,950.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250315	5,000,000.000	4,746,950.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,693,880.000	
		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,656,600.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250415	3,000,000.000	2,882,220.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	9,300,000.000	8,326,383.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250515	3,000,000.000	2,884,080.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	3,770,100.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,251,555.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,764,680.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,813,430.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	6,000,000.000	5,486,460.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,864,880.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250615	4,000,000.000	3,848,560.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,755,200.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,860,770.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250715	3,000,000.000	2,889,960.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	3,804,717.400	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250815	4,500,000.000	4,340,880.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	9,500,000.000	8,395,625.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	5,200,000.000	4,026,308.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	2,000,000.000	1,696,240.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,045,504.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240831	3,890,000.000	3,808,543.400	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,368,825.000	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,259,620.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250915	2,300,000.000	2,233,415.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240930	3,500,000.000	3,457,510.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,424,500.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	3,500,000.000	3,442,845.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251015	3,400,000.000	3,350,428.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241031	1,000,000.000	988,330.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031	3,000,000.000	2,950,530.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	9,700,000.000	9,549,941.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251115	1,500,000.000	1,485,630.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	3,700,000.000	3,472,783.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	2,928,630.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241130	3,000,000.000	2,968,290.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	2,500,000.000	2,423,625.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	3,000,000.000	2,922,420.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20421115	2,500,000.000	2,319,900.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251215	3,500,000.000	3,431,085.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260115	1,500,000.000	1,465,830.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	5,000,000.000	4,846,650.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271231	1,500,000.000	1,461,255.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241231	3,000,000.000	2,958,270.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250131	1,000,000.000	984,250.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	5,000,000.000	4,743,350.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260215	3,500,000.000	3,430,385.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	8,000,000.000	7,498,720.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	2,500,000.000	2,274,600.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	4,500,000.000	3,941,010.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131	3,700,000.000	3,549,965.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250228	4,500,000.000	4,459,455.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300228	1,000,000.000	976,360.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280229	3,000,000.000	2,938,710.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260315	2,500,000.000	2,487,200.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250331	3,000,000.000	2,939,280.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,800,000.000	1,719,270.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280331	3,700,000.000	3,567,170.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260415	2,000,000.000	1,948,040.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	3,000,000.000	2,843,880.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280430	2,000,000.000	1,917,500.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260515	1,000,000.000	970,660.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	6,800,000.000	6,303,804.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	4,400,000.000	3,857,216.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	2,500,000.000	2,273,025.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250430	4,000,000.000	3,917,720.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250531	3,600,000.000	3,546,252.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280531	3,700,000.000	3,568,317.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531	1,500,000.000	1,442,865.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260615	3,000,000.000	2,950,770.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250630	2,500,000.000	2,478,800.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	3,000,000.000	2,885,610.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630	3,500,000.000	3,428,600.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260715	2,000,000.000	1,986,080.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250731	4,000,000.000	3,976,400.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	3,500,000.000	3,448,305.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815	2,000,000.000	1,932,340.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260815	6,000,000.000	5,940,180.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815	2,000,000.000	1,919,360.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430815	1,300,000.000	1,268,917.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	3,000,000.000	2,929,200.000	
	アメリカ・ドル	小計		879,825,843.910 (130,161,435,348)	
	イギリス・ポンド	2% United Kingdom Gilt 20250907	921,000.000	868,604.310	
		2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,282,000.000	788,942.800	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,339,874.350	
		1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	940,209.600	
		1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,013,796.500	
		1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	922,683.700	
		1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,410,000.000	1,242,435.600	
		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,303,335.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,040,000.000	463,944.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	674,599.200	
		1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	424,005.500	
		0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,500,000.000	1,214,460.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20250607	1,900,000.000	1,764,302.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	686,725.200	
		0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,300,000.000	978,757.000	
		0.5% United Kingdom Gilt 20611022	1,700,000.000	478,533.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,345,575.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,317,856.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	414,766.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,700,000.000	1,084,600.000	
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	1,804,350.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20460131	2,000,000.000	931,300.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20261022	3,500,000.000	3,058,755.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,800,000.000	833,040.000	
		0.25% UNITED KINGDOM GILT 20250131	1,100,000.000	1,030,106.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	2,100,000.000	1,274,889.000	
		0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	2,700,000.000	2,174,310.000	
		0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	2,300,000.000	1,634,173.000	
		1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	1,300,000.000	631,228.000	
		1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	3,600,000.000	2,726,892.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	820,000.000	285,507.600	
		4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	2,000,000.000	1,950,000.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	1,000,000.000	895,600.000	
		3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	1,100,000.000	992,970.000	
		3.5% UNITED KINGDOM GILT 20251022	400,000.000	386,260.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	1,300,000.000	1,082,900.000	
		4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	800,000.000	704,800.000	
		4.5% UNITED KINGDOM GILT 20280607	700,000.000	691,096.000	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,010,438.260	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	2,240,000.000	2,209,222.400	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,471,190.400	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,362,000.000	1,313,376.600	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	1,359,334.040	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	1,572,009.040	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,255,190.080	
		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,212,756.160	
		4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	2,036,882.760	
		4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,600,000.000	1,628,640.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,231,087.810	
		4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	1,362,580.260	
		4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,548,658.800	
		4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	1,038,344.300	
		4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,478,327.110	
		3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,302,904.000	
		3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,866,000.000	1,487,425.920	
		3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	1,102,978.800	
		2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,066,556.400	
		3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,524,000.000	1,254,800.640	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	イギリス・ポンド	小計		70,298,885.140 (12,996,154,896)	
	イスラエル・シ ュケル	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	1,916,874.000	
		5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,600,000.000	1,875,440.000	
		1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,191,371.000	
		2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,685,556.000	
		3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,221,728.000	
		2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,110,504.000	
		1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,000,784.000	
		0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	1,600,000.000	1,503,904.000	
		1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,245,267.000	
		0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	182,804.000	
		0.4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20241031	900,000.000	858,978.000	
		1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	300,000.000	243,153.000	
		2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129	600,000.000	452,766.000	
		3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290228	3,000,000.000	2,977,470.000	
	イスラエル・シ ュケル	小計		20,466,599.000 (789,908,388)	
	オーストラリ ア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,052,508.770	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,310,387.660	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,798,000.000	1,779,768.280	
		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	2,258,000.000	2,326,959.320	
		4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,748,000.000	1,767,734.920	
		3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,052,653.140	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,132,986.020	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	690,655.680	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,604,183.680	
		2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,098,956.200	
		3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	979,977.960	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,422,675.000	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,777,564.000	
		2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,623,811.400	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,102,478.500	
		1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,360,721.600	
		1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	2,700,000.000	2,141,802.000	
		0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,295,240.000	
		1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,622,260.000	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	790,202.000	
		0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,600,000.000	1,480,240.000	
		1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	1,968,625.000	
		0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,087,608.000	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,600,000.000	1,312,192.000	
		3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,300,000.000	1,178,840.000	
		3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	1,200,000.000	1,159,764.000	
		3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221	1,100,000.000	1,034,858.000	
		オーストラリア・ドル 小計		41,155,653.130 (3,881,389,646)	
	オフショア・人民元	3.22% China Government Bond 20251206	5,200,000.000	5,326,932.000	
		3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,198,850.000	
		3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,210,250.000	
		3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,148,100.000	
		3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,323,760.000	
		3.13% China Government Bond 20291121	8,000,000.000	8,270,160.000	
		2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,203,840.000	
		2.68% China Government Bond 20300521	11,500,000.000	11,530,820.000	
		3.02% China Government Bond 20251022	18,000,000.000	18,325,800.000	
		3.28% China Government Bond 20271203	9,000,000.000	9,337,680.000	
		3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	13,095,875.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.03% China Government Bond 20260311	7,000,000.000	7,145,180.000	
		3.81% China Government Bond 20500914	7,300,000.000	8,381,349.000	
		3.01% China Government Bond 20280513	7,000,000.000	7,169,820.000	
		3.72% China Government Bond 20510412	14,000,000.000	15,855,700.000	
		3.02% China Government Bond 20310527	15,800,000.000	16,258,516.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,551,615.000	
		2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,060,200.000	
		3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,777,860.000	
		3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20240921	15,000,000.000	15,292,350.000	
		3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,320,150.000	
		3.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20250607	17,000,000.000	17,506,430.000	
		3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,743,630.000	
		4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	4,500,000.000	5,342,670.000	
		3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	6,300,000.000	7,249,788.000	
		3.77% CHINA GOVERNMENT BOND 20250308	11,000,000.000	11,318,340.000	
		3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	12,000,000.000	12,838,920.000	
		2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,604,500.000	
		3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	11,500,000.000	12,624,240.000	
		2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	6,000,000.000	6,092,460.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	17,000,000.000	16,991,840.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	7,200,000.000	7,230,456.000	
		2.26% CHINA GOVERNMENT BOND 20250224	10,000,000.000	10,012,100.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	15,175,500.000	
		3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	5,824,885.000	
		2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	5,009,150.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	4,000,000.000	4,036,040.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	4,000,000.000	3,997,640.000	
		2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20250825	25,000,000.000	24,970,000.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	32,000,000.000	31,706,560.000	
		1.99% CHINA GOVERNMENT BOND 20240915	22,000,000.000	21,982,840.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	9,503,325.000	
		2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	17,200,000.000	17,198,452.000	
		3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	14,000,000.000	14,315,000.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	5,500,000.000	5,536,850.000	
		2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20251125	18,000,000.000	17,994,600.000	
		2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	19,000,000.000	19,175,560.000	
		2.29% CHINA GOVERNMENT BOND 20241225	5,000,000.000	5,014,900.000	
		2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	20,000,000.000	20,141,200.000	
		2.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20260215	18,000,000.000	18,072,900.000	
		2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	15,000,000.000	15,255,000.000	
		2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20250315	23,000,000.000	23,071,300.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	15,000,000.000	15,153,300.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	25,000,000.000	25,148,250.000	
		3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	16,000,000.000	16,705,760.000	
		2.3% CHINA GOVERNMENT BOND 20260515	7,000,000.000	7,001,820.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	40,000,000.000	40,050,000.000	
		2% CHINA GOVERNMENT BOND 20250615	9,000,000.000	8,975,700.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	33,000,000.000	32,957,430.000	
		2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	35,000,000.000	34,931,400.000	
		2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	20,000,000.000	19,816,400.000	
		2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	30,000,000.000	29,891,700.000	
		オフショア・人民元 小計		823,953,643.000 (16,637,436,750)	
	カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	605,000.000	505,108.450	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,080,611.900	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,301,729.460	
		5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,152,921.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	954,842.790	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	947,334.580	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,161,344.940	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,109,586.600	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	899,571.150	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,111,139.200	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	597,532.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,705,072.300	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,125,291.400	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,353,170.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	2,936,709.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	700,000.000	664,699.000	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,665,649.300	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,589,900.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	1,894,998.000	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	272,631.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	2,890,034.000	
		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241001	1,000,000.000	956,820.000	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	2,650,000.000	1,789,969.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	2,200,000.000	1,992,474.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,100,000.000	1,770,216.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250401	200,000.000	189,968.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,308,615.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	91,701.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	400,000.000	380,440.000	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20251001	1,000,000.000	968,260.000	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	2,270,000.000	2,057,891.200	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241101	360,000.000	351,853.200	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	200,000.000	195,690.000	
		3. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250201	300,000.000	295,194.000	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260401	600,000.000	579,228.000	
		2. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	600,000.000	554,514.000	
		3. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250501	300,000.000	295,032.000	
		2. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201	400,000.000	341,160.000	
		3. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280901	1,200,000.000	1,161,456.000	
		3. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250801	500,000.000	489,385.000	
		3. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20331201	1,000,000.000	963,590.000	
		4. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20251101	2,000,000.000	1,995,820.000	
		カナダ・ドル 小計		47,649,152.470 (5,165,168,127)	
	シンガポール・ドル	3. 5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	778,176.000	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	923,000.000	917,462.000	
		2. 875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	792,820.000	
		2. 75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	380,208.000	
		3. 375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	576,309.840	
		2. 875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	614,375.000	
		2. 375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	513,687.680	
		2. 75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	651,536.000	
		2. 125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	435,060.000	
		2. 25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	677,250.000	
		2. 625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	537,625.000	
		2. 375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	316,718.500	
		1. 875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	423,360.000	
		0. 5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	750,000.000	704,475.000	
		1. 625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	534,900.000	
		1. 875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	500,000.000	388,740.000	
		1. 25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	187,660.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	229,080.000	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	220,000.000	219,230.000	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	100,000.000	98,850.000	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20280801	400,000.000	395,300.000	
		シンガポール・ドル 小計		10,372,823.020 (1,124,517,744)	
	スウェーデン・ クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	3,655,000.000	3,901,968.350	
		2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	7,477,733.200	
		1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	6,718,397.800	
		0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,569,442.000	
		2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,153,843.000	
		0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	5,645,440.000	
		0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,076,350.000	
		1.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20331111	2,000,000.000	1,812,440.000	
		スウェーデン・クローナ 小計		37,355,614.350 (497,203,227)	
	デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	16,319,668.860	
		1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	5,843,493.530	
		0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,638,654.000	
		0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	8,590,000.000	7,482,405.400	
		0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	1,700,370.000	
		DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	398,535.000	
		DANISH GOVERNMENT BOND 20241115	1,000,000.000	961,490.000	
		2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20331115	2,000,000.000	1,884,620.000	
		デンマーク・クローネ 小計		39,229,236.790 (834,405,867)	
	ニュージーラン ド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	600,000.000	588,066.000	
		3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	1,500,000.000	1,328,550.000	
		2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	376,378.800	
		3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	600,000.000	541,902.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	530,000.000	412,695.100	
		1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	211,438.500	
		0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	1,100,000.000	883,575.000	
		0.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20260515	500,000.000	441,630.000	
		2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	440,000.000	347,520.800	
		2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	244,480.600	
		2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20250415	640,000.000	613,113.600	
		4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20340515	200,000.000	187,004.000	
		4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20300515	500,000.000	485,855.000	
		ニュージーランド・ドル 小計		6,662,209.400 (578,279,775)	
	ノルウェー・クローネ	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,198,028.550	
		1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,072,873.000	
		1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,115,404.500	
		2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,204,320.000	
		1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,399,588.500	
		1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,058,880.000	
		1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	2,860,830.000	
		2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	1,700,000.000	1,476,416.000	
		3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20330815	1,500,000.000	1,392,240.000	
		ノルウェー・クローネ 小計		29,778,580.550 (411,242,197)	
	ポーランド・ズロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,067,546.100	
		2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	2,868,216.000	
		2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,194,053.600	
		2.25% Poland Government Bond 20241025	3,400,000.000	3,290,860.000	
		0.75% Poland Government Bond 20250425	2,000,000.000	1,864,800.000	
		1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,274,690.000	
		0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	1,892,000.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,800,000.000	1,337,040.000	
		3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	500,000.000	474,625.000	
		7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	1,000,000.000	1,089,910.000	
		POLAND GOVERNMENT BOND 20251025	1,500,000.000	1,353,615.000	
		6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	2,000,000.000	2,078,000.000	
		5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	840,149.300	
		2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,278,174.500	
		3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	4,440,415.200	
		ポーランド・ズロチ 小計		35,344,094.700 (1,226,613,272)	
	マレーシア・リンギット	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,362,772.370	
		4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,229,078.080	
		4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,546,248.200	
		4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,333,501.000	
		3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	737,900.640	
		3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,419,137.230	
		3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,889,639.980	
		4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,419,093.000	
		3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,754,126.820	
		4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,242,777.400	
		4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	991,612.500	
		3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,566,864.000	
		4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	1,550,000.000	1,560,509.000	
		3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,202,459.300	
		4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,090,887.500	
		3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,209,708.000	
		4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,277,700.000	
		4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	2,000,000.000	2,182,240.000	
		3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	657,260.500	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,325,153.600	
		4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,307,184.000	
		3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,282,216.000	
		3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,671,705.000	
		4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,550,598.500	
		2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,657,152.000	
		3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	1,400,000.000	1,372,210.000	
		4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	1,900,000.000	2,033,228.000	
		4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	518,990.000	
		4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	700,000.000	721,245.000	
		3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	1,000,000.000	995,710.000	
		マレーシア・リンギット 小計		44,108,907.620 (1,394,348,733)	
	メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	37,290,000.000	33,686,294.400	
		8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	18,270,501.000	
		8% Mexican Bonos 20240905	23,800,000.000	23,076,242.000	
		5.5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	6,106,310.000	
		5% MEXICAN BONOS 20250306	1,000,000.000	926,200.000	
		8% MEXICAN BONOS 20530731	14,000,000.000	11,898,740.000	
		7.5% MEXICAN BONOS 20330526	10,000,000.000	8,771,900.000	
		7% MEXICAN BONOS 20260903	3,000,000.000	2,761,560.000	
		8% MEXICAN BONOS 20350524	5,000,000.000	4,497,150.000	
		8.5% MEXICAN BONOS 20290301	10,000,000.000	9,501,900.000	
		10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	23,643,931.500	
		7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	25,940,040.320	
		10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,231,444.720	
		8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	28,230,473.760	
		8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	17,308,982.340	
		7.75% Mexican Bonos 20310529	44,515,000.000	40,237,108.500	
		7.75% Mexican Bonos 20421113	29,654,000.000	24,979,639.980	
		7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	7,021,304.400	
		メキシコ・ペソ 小計		296,089,722.920 (2,489,255,909)	
	ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	306,953.920	
		0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	266,548.230	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	760,134.080	
		1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	247,528.800	
		0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	724,848.000	
		1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	381,898.500	
		0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	441,755.000	
		0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	430,950.000	
		Finland Government Bond 20240915	200,000.000	193,082.000	
		0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	208,068.900	
		0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	239,716.000	
		Finland Government Bond 20300915	500,000.000	404,080.000	
		0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	171,288.000	
		0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	474,162.000	
		FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	182,462.000	
		0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	265,986.000	
		1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	1,300,000.000	1,133,093.000	
		1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	254,858.400	
		2.75% FINLAND GOVERNMENT BOND 20380415	400,000.000	370,336.000	
		3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20330915	300,000.000	295,047.000	
		2.875% FINLAND GOVERNMENT BOND 20290415	1,000,000.000	990,870.000	
		1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,318,821.420	
		0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,049,409.480	
		1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	546,400.960	
		1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	130,346.400	
		0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,169,292.800	
		2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	364,311.000	
		0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,085,616.000	
		0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,117,299.200	
		Austria Government Bond 20300220	980,000.000	804,197.800	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.75% Austria Government Bond 20510320	1,200,000.000	645,696.000	
		Austria Government Bond 20401020	400,000.000	226,264.000	
		0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	134,235.500	
		Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	952,608.000	
		Austria Government Bond 20250420	480,000.000	455,582.400	
		0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	404,376.000	
		0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	121,383.000	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	300,000.000	256,920.000	
		0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	1,500,000.000	1,249,170.000	
		1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	300,000.000	222,132.000	
		2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	300,000.000	291,048.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	300,000.000	291,801.000	
		3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20531020	300,000.000	285,234.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20290523	1,000,000.000	991,920.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,627,591.030	
		1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,515,474.980	
		1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	862,460.440	
		1% Belgium Government Bond 20260622	1,463,000.000	1,382,681.300	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	845,733.400	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	512,820.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,013,408.000	
		0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,016,547.000	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	425,754.800	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	468,402.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,347,421.900	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	547,553.500	
		0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,334,865.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	468,972.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,000,802.600	
		0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	519,156.200	
		Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,061,472.000	
		Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,242,192.000	
		0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	196,762.500	
		0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	1,400,000.000	1,097,068.000	
		1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	476,192.000	
		2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	400,000.000	362,588.000	
		3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	1,500,000.000	1,464,360.000	
		3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	600,000.000	553,146.000	
		3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20430622	700,000.000	681,023.000	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,322,946.210	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,421,375.140	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,040,886.500	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,363,734.050	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,634,252.320	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	2,748,136.250	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,271,000.000	3,714,056.950	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	1,567,210.000	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,188,514.110	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,974,000.000	2,098,638.360	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	2,683,212.480	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	2,561,043.630	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,110,145.320	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,050,774.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	4,168,000.000	3,932,049.520	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,230,272.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	4,200,000.000	3,859,674.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,033,822.000	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	3,470,000.000	2,551,664.500	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,731,812.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,655,642.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	4,700,000.000	4,147,750.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,579,070.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,850,000.000	1,389,888.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,486,310.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,100,000.000	1,536,318.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,791,260.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,510,344.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,008,324.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	900,000.000	745,713.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	1,400,000.000	992,950.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,749,380.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	539,363.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	3,600,000.000	2,944,800.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	573,146.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	3,800,000.000	3,066,068.000	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	1,600,000.000	1,257,712.000	
		1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,508,921.000	
		1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,200,000.000	965,484.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	200,000.000	194,196.000	
		2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	100,000.000	97,328.000	
		2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,700,000.000	1,656,038.000	
		1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,000,000.000	806,660.000	
		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330815	900,000.000	896,067.000	
		2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,478,280.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	2,100,000.000	969,549.000	
		0.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240913	530,000.000	514,243.100	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20241212	1,500,000.000	1,478,745.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250313	1,500,000.000	1,483,230.000	
		2.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250612	1,000,000.000	993,240.000	
		3.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250918	100,000.000	99,970.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,637,916.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,282,304.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,159,723.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	94,023.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,042,964.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	2,800,000.000	2,569,420.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	100,000.000	90,724.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,840,730.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	407,855.000	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	100,000.000	97,998.000	
		2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20281019	100,000.000	98,788.000	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,195,216.750	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,743,957.640	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	3,227,000.000	3,889,019.050	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,025,702.690	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	1,889,649.720	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,533,461.580	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,576,269.200	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	1,848,127.290	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	3,678,084.800	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,899,000.000	5,838,712.220	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	3,088,000.000	2,950,861.920	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	4,935,458.270	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	4,899,000.000	4,801,264.950	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,331,368.000	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	4,868,037.330	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,591,052.800	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	4,387,000.000	4,091,974.250	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	3,269,163.040	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	859,565.510	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	3,705,021.000	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	2,053,866.900	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,160,572.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	1,902,121.500	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	4,873,014.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	3,244,925.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,421,043.000	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,850,000.000	1,848,823.500	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	5,350,000.000	4,661,455.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	4,330,000.000	4,116,357.800	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,496,836.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,390,900.100	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	2,779,950.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,375,286.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	5,000,000.000	4,032,500.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	1,480,000.000	504,517.200	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	1,500,000.000	843,405.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,589,104.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	3,100,000.000	2,793,782.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,600,000.000	1,272,310.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	3,600,000.000	2,759,652.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250225	2,100,000.000	2,000,712.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	1,200,000.000	898,560.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	2,300,000.000	2,086,169.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	4,800,000.000	4,367,808.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	851,920.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	1,100,000.000	971,674.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260924	2,200,000.000	2,160,312.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20330525	2,200,000.000	2,166,538.000	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290225	600,000.000	591,810.000	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,257,228.200	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	1,932,412.950	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	1,889,831.580	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,416,487.880	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	1,842,291.450	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,698,369.480	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,938,000.000	1,807,456.320	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,028,246.000	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,221,048.000	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,032,540.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	606,564.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,152,970.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	725,656.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,250,000.000	551,325.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,039,701.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	581,562.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	772,722.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	100,000.000	93,104.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	600,000.000	488,040.000	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	900,000.000	721,665.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715	900,000.000	867,294.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300115	1,300,000.000	1,268,267.000	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,224,885.000	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,644,666.960	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,787,243.500	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,212,028.800	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,394,906.390	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,697,574.550	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	2,891,000.000	2,786,952.910	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,169,745.500	
		1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,256,798.100	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	1,813,533.400	
		1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	988,914.600	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	640,999.920	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,276,545.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,430,543.800	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,650,000.000	1,358,263.500	
		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,536,461.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,557,872.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,072,669.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	1,949,682.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,252,602.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,423,214.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,511,498.000	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,144,257.300	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,650,000.000	1,439,575.500	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	2,900,000.000	2,759,814.000	
		2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,009,847.000	
		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,031,312.500	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,610,554.000	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,240,902.000	
		0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,140,145.000	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,030,703.500	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,068,915.000	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	1,500,000.000	1,451,940.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,629,900.000	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,781,976.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	1,972,894.000	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,575,526.000	
		1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	996,330.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,900,000.000	1,507,897.000	
		1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	664,896.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	452,123.000	
		0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,622,942.000	
		0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,375,974.000	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	2,200,000.000	1,277,694.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	1,000,758.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	250,727.600	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	682,960.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,479,758.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	3,100,000.000	2,787,334.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,700,000.000	1,300,840.000	
		0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	900,000.000	749,061.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241215	300,000.000	286,227.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	485,480.000	
		1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	273,981.000	
		1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250815	500,000.000	476,690.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	753,384.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,600,000.000	1,389,344.000	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	300,000.000	257,220.000	
		2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	200,000.000	191,266.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	500,000.000	480,105.000	
		3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260115	3,300,000.000	3,284,622.000	
		4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	2,800,000.000	2,823,604.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	300,000.000	297,519.000	
		3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,500,000.000	1,473,375.000	
		4.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20430901	100,000.000	96,469.000	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	500,000.000	476,030.000	
		3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250328	400,000.000	397,744.000	
		3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260415	500,000.000	500,990.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311030	900,000.000	891,531.000	
		3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	1,200,000.000	1,174,716.000	
		4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	2,100,000.000	2,098,635.000	
		3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280801	700,000.000	697,655.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260915	400,000.000	401,212.000	
		3.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250929	300,000.000	299,139.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	3,254,000.000	3,492,615.820	
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,210,082.260	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,009,596.750	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,411,636.100	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,602,506.800	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	2,128,131.040	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,155,488.600	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,336,219.080	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,107,860.300	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,507,677.300	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	1,822,898.980	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,199,591.360	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,255,576.260	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	1,885,675.920	
		5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,193,484.160	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	1,745,440.720	
		4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,033,622.590	
		4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	827,923.200	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	656,650.890	
		3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	723,917.700	
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,063,579.600	
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	928,787.280	
		2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	722,428.070	
		1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,017,965.830	
		1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	449,988.000	
		0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	729,256.000	
		1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	637,342.500	
		1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	667,275.000	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	858,239.500	
		1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	394,404.000	
		0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	255,325.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	451,130.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	658,264.000	
		IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	629,320.000	
		0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	248,352.000	
		0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	78,923.000	
		3% IRISH TREASURY 20431018	200,000.000	188,374.000	
		6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	917,400.000	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,483,485.310	
		4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	909,667.500	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	366,189.200	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	698,005.890	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	712,357.740	
		1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	913,518.440	
		4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	675,424.210	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	384,495.380	
		2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	366,104.640	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	2,993,975.400	
		1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	1,984,570.250	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	1,868,469.120	
		2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,138,054.880	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	2,636,306.460	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,601,674.560	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	1,307,859.000	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,472,463.000	
		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,782,485.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,562,872.500	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	1,903,097.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,204,448.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	2,200,000.000	1,709,466.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,651,441.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,445,088.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	2,250,000.000	1,838,947.500	
		0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,375,072.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	2,560,000.000	2,124,057.600	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	2,500,000.000	2,382,350.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	693,574.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,181,888.000	
		1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,070,192.000	
		1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	848,484.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	461,490.000	
		0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,708,652.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	286,682.500	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	2,500,000.000	2,165,000.000	
		0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	1,900,000.000	1,283,336.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,499,822.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	361,404.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	900,000.000	804,438.000	
		0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,661,037.000	
		1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	600,000.000	369,840.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20250531	100,000.000	94,240.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	1,100,000.000	949,696.000	
		2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,700,000.000	1,563,354.000	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,000,000.000	909,180.000	
		3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	1,500,000.000	1,439,955.000	
		2.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260531	300,000.000	295,299.000	
		3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730	800,000.000	787,032.000	
		3.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20331031	1,500,000.000	1,481,100.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,540,474.310	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,815,337.380	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,858,000.000	2,052,198.160	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,137,567.930	
		4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,789,000.000	2,850,302.220	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,098,561.050	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	1,918,503.000	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	1,491,485.820	
		2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,076,994.620	
	ユーロ 小計			557,121,615.260 (88,353,916,964)	
国債証券 合計				266,541,276,843 [266,541,276,843]	
合計				266,541,276,843 [266,541,276,843]	

- (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 273 銘柄	100%	48.9%
イギリス・ポンド	国債証券 58 銘柄	100%	4.9%
イスラエル・シケル	国債証券 14 銘柄	100%	0.3%
オーストラリア・ドル	国債証券 27 銘柄	100%	1.5%
オフショア・人民元	国債証券 62 銘柄	100%	6.2%
カナダ・ドル	国債証券 42 銘柄	100%	1.9%
シンガポール・ドル	国債証券 21 銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8 銘柄	100%	0.2%
デンマーク・クローネ	国債証券 8 銘柄	100%	0.3%
ニュージーランド・ドル	国債証券 13 銘柄	100%	0.2%
ノルウェー・クローネ	国債証券 9 銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 15 銘柄	100%	0.5%
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%	0.9%
ユーロ	国債証券 373 銘柄	100%	33.1%

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Ｊ－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

	2022年9月7日現在 金額(円)	2023年9月7日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,400,084,818	5,028,627,020
投資証券 ※2	492,034,040,000	453,591,003,450
派生商品評価勘定	-	45,304,000
未収入金	-	660,039,743
未収配当金	5,861,732,424	6,082,827,389
前払金	21,280,000	-
流動資産合計	504,317,137,242	465,407,801,602
資産合計	504,317,137,242	465,407,801,602
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	10,696,000	-
前受金	-	51,520,000
未払金	891,530,150	-
未払解約金	125,915,000	1,133,310,100
流動負債合計	1,028,141,150	1,184,830,100
負債合計	1,028,141,150	1,184,830,100
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	145,851,213,788	136,692,550,176
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	357,437,782,304	327,530,421,326
元本等合計	503,288,996,092	464,222,971,502
純資産合計	503,288,996,092	464,222,971,502
負債純資産合計	504,317,137,242	465,407,801,602

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2022 年 9 月 8 日 至 2023 年 9 月 7 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	2022 年 9 月 7 日現在	2023 年 9 月 7 日現在
1. ※1 期首	2021 年 9 月 8 日	2022 年 9 月 8 日
期首元本額	138,556,634,922 円	145,851,213,788 円
期中追加設定元本額	32,886,466,478 円	22,487,516,622 円
期中一部解約元本額	25,591,887,612 円	31,646,180,234 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ J-REIT オープン	4,583,372,818 円	4,291,859,572 円
ダイワ J-REIT オープン (毎月分配型)	129,070,791,974 円	118,848,053,138 円
ダイワ J-REIT オープン (年 1 回決算型)	353,397,764 円	438,308,348 円
DC ダイワ・ターゲットイヤー 2050	12,620,822 円	18,808,722 円
iFree J-REIT インデックス	615,985,156 円	612,932,660 円
iFree 8 資産バランス	1,629,952,741 円	2,227,129,451 円
DC ダイワ・ターゲットイヤー 2060	-円	60,856 円
DC・ダイワ J-REIT オープン	5,475,869,799 円	5,459,557,070 円

区分	2022年9月7日現在	2023年9月7日現在
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	6,439,997円	7,534,331円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	5,780,467円	7,941,275円
ダイワ国内REITインデックス(投資一任専用)	760,588円	2,604,622円
ダイワ・ノーロードJ-REITファンド	95,858,215円	99,989,261円
ダイワファンドラップJ-REITインデックス	2,250,728,619円	2,752,044,919円
ダイワJ-REITインデックス(ダイワSMA専用)	321,441,449円	544,924,556円
ダイワファンドラップオンラインJ-REITインデックス	493,895,828円	475,111,433円
ダイワ・インデックスセレクトJ-REIT	934,317,551円	905,689,962円
計	145,851,213,788円	136,692,550,176円
2. 期末日における受益権の総数	145,851,213,788口	136,692,550,176口
3. ※2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 5,512,900,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 5,078,100,000円

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	自2022年9月8日 至2023年9月7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。

区分	自 2022 年 9 月 8 日 至 2023 年 9 月 7 日
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023 年 9 月 7 日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)
売買目的有価証券

種類	2022 年 9 月 7 日現在	2023 年 9 月 7 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	35,210,143,742	24,639,713,711
合計	35,210,143,742	24,639,713,711

(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	2022 年 9 月 7 日現在				2023 年 9 月 7 日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買建	11,266,080,000	-	11,256,000,000	△10,080,000	10,588,480,000	-	10,634,400,000	45,920,000
合計	11,266,080,000	-	11,256,000,000	△10,080,000	10,588,480,000	-	10,634,400,000	45,920,000

- (注)
1. 時価の算定方法
不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場
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)

	2022年9月7日現在	2023年9月7日現在
1口当たり純資産額	3.4507円	3.3961円
(1万口当たり純資産額)	(34,507円)	(33,961円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	8,510	1,006,733,000	
	サンケイリアルエステート	13,412	1,280,846,000	
	SOSILA 物流リート投	20,889	2,705,125,500	
	東海道リート投資法	6,230	774,389,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	14,456	9,338,576,000	
	森ヒルズリート	49,232	7,251,873,600	
	産業ファンド	63,880	9,332,868,000	
	アドバンス・レジデンス	39,768	13,719,960,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	30,736	7,023,176,000	
	A P I 投資法人	21,964	9,158,988,000	
	G L P 投資法人	141,422	19,586,947,000	
	コンフォリア・レジデンシャル	20,588	6,927,862,000	
	日本プロロジスリート	72,934	21,325,901,600	※
	星野リゾート・リート	7,724	4,981,980,000	
	O n e リート投資法人	7,303	1,907,543,600	
	イオンリート投資	51,356	7,646,908,400	
	ヒューリックリート投資法	39,171	6,431,878,200	
	日本リート投資法人	13,599	4,848,043,500	
	積水ハウス・リート投資	125,807	10,630,691,500	
	トーセイ・リート投資法人	8,816	1,248,345,600	
	ケネディクス商業リート	18,200	5,299,840,000	
	ヘルスケア&メディカル投資	10,322	1,548,300,000	
	サムティ・レジデンシャル	11,408	1,324,468,800	
	野村不動産マスターF	135,389	23,368,141,400	※
	いちごホテルリート投資	6,936	820,528,800	
	ラサールロジポート投資	53,518	7,931,367,600	
	スターアジア不動産投	64,523	3,716,524,800	
	マリモ地方創生リート	6,453	819,531,000	
	三井不ロジパーク	17,414	8,654,758,000	
	大江戸温泉リート	6,402	414,849,600	
	投資法人みらい	53,541	2,556,582,750	
	三菱地所物流 REIT	14,457	5,696,058,000	
	CRE ロジスティクスファンド	18,023	3,098,153,700	
ザイマックス・リート	6,791	796,584,300		
タカラレーベン不動産投	19,850	1,941,330,000		
アドバンス・ロジスティクス投資法人	18,345	2,403,195,000		
日本ビルファンド	48,841	30,574,466,000	※	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	ジャパンリアルエステイト	43,005	26,319,060,000	※
	日本都市ファンド投資法人	200,680	19,947,592,000	
	オリックス不動産投資	83,420	15,474,410,000	
	日本プライムリアルティ	28,632	10,779,948,000	
	NTT 都市開発リート投資法人	40,245	5,678,569,500	
	東急リアル・エステート	28,070	5,302,423,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	30,914	3,703,497,200	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	93,653	15,003,210,600	
	森トラストリート投資法人	80,699	6,060,494,900	
	インヴィンシブル投資法人	202,710	13,074,795,000	
	フロンティア不動産投資	15,534	7,347,582,000	
	平和不動産リート	31,281	4,601,435,100	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	26,818	8,166,081,000	
	福岡リート投資法人	21,653	3,559,753,200	
	ケネディクス・オフィス投資法人	24,361	8,501,989,000	
	いちごオフィスリート投資法人	34,306	3,104,693,000	
	大和証券オフィス投資法人	8,673	6,019,062,000	
	阪急阪神リート投資法人	19,961	2,898,337,200	
	スターツプロシード投資法人	7,257	1,605,248,400	
	大和ハウスリート投資法人	63,109	16,711,263,200	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	135,013	10,139,476,300	
	大和証券リビング投資法人	58,084	6,557,683,600	
	ジャパンエクセレント投資法人	36,385	4,941,083,000	
投資証券 合計			453,591,003,450	
合計			453,591,003,450	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年9月7日現在 金額(円)	2023年9月7日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	74,710,050	250,359,084
コール・ローン	391,063,474	487,859,580
投資信託受益証券	215,350,274	1,047,552,784
投資証券	28,450,235,525	31,650,575,286
派生商品評価勘定	26,940,392	17,584,050
未収入金	2,265,504	3,460,947
未収配当金	37,509,927	47,957,524
差入委託証拠金	153,269,526	177,365,646
流動資産合計	29,351,344,672	33,682,714,901
資産合計	29,351,344,672	33,682,714,901
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	18,933,792	10,282,510
未払金	23,905,272	110,892,421
未払解約金	10,693,400	12,189,000
流動負債合計	53,532,464	133,363,931
負債合計	53,532,464	133,363,931
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	8,693,888,748	10,116,723,115
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	20,603,923,460	23,432,627,855
元本等合計	29,297,812,208	33,549,350,970
純資産合計	29,297,812,208	33,549,350,970
負債純資産合計	29,351,344,672	33,682,714,901

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2022 年 9 月 8 日 至 2023 年 9 月 7 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、市場価格のない有価証券については投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。また、市場価格のある有価証券については、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>

区分	自 2022 年 9 月 8 日 至 2023 年 9 月 7 日
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2022 年 9 月 7 日現在	2023 年 9 月 7 日現在
1. ※1 期首	2021 年 9 月 8 日	2022 年 9 月 8 日
期首元本額	15,069,273,862 円	8,693,888,748 円
期中追加設定元本額	3,730,828,656 円	2,169,522,241 円
期中一部解約元本額	10,106,213,770 円	746,687,874 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワバランスファンド 2023-01 (適格機関投資家専用)	-円	93,059,749 円
ダイワファンドラップ 外国REIT インデックス (為替ヘッジなし)	1,176,483,696 円	1,565,308,473 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)	248,948,856 円	270,836,486 円
D-I's グローバルREIT インデックス	1,759,240 円	1,764,216 円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	11,103,225 円	16,424,213 円
iFree 外国REITインデ ックス	751,034,351 円	725,696,920 円
iFree 8資産バランス グローバル・リート・インデッ クスファンド (資産形成型)	1,670,709,367 円	2,247,903,767 円
グローバル・リート・インデッ クスファンド (毎月決算型)	297,799,642 円	377,923,581 円
グローバル・リート・インデッ クスファンド (毎月決算型)	169,492,850 円	247,997,588 円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2060	-円	711,792 円
DCダイワ・グローバルREIT インデックスファンド	3,881,909,848 円	3,992,230,488 円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	6,608,803 円	7,671,771 円

区分	2022年9月7日現在	2023年9月7日現在
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	5,880,786円	8,073,645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)	668,798円	2,409,588円
ダイワバランスファンド2021-02(適格機関投資家専用)	149,216,410円	144,489,423円
ダイワ・インデックスセレクトグローバルREIT	247,102,074円	250,279,709円
ダイワ・ノーロードグローバルREITファンド	71,228,327円	67,445,400円
ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	3,942,475円	3,800,200円
ダイワバランスファンド2023-08(適格機関投資家専用)	-円	92,696,106円
計	8,693,888,748円	10,116,723,115円
2. 期末日における受益権の総数	8,693,888,748口	10,116,723,115口

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	自2022年9月8日 至2023年9月7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。

区分	自 2022 年 9 月 8 日 至 2023 年 9 月 7 日
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023 年 9 月 7 日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)
売買目的有価証券

種類	2022 年 9 月 7 日現在	2023 年 9 月 7 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	△4,618,296	△23,714,486
投資証券	△4,775,509,350	△941,817,480
合計	△4,780,127,646	△965,531,966

(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	2022 年 9 月 7 日現在				2023 年 9 月 7 日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買建	637,488,489	-	636,360,256	△1,128,233	907,887,576	-	908,405,724	518,148

種類	2022年9月7日現在				2023年9月7日現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1年超				うち 1年超		
合計	637,488,489	-	636,360,256	△1,128,233	907,887,576	-	908,405,724	518,148

- (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	2022年9月7日現在				2023年9月7日現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1年超				うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買建	380,076,867	-	389,211,700	9,134,833	531,618,376	-	538,401,768	6,783,392
アメリカ・ド ル	319,999,460	-	328,371,000	8,371,540	457,691,465	-	464,116,435	6,424,970
ユーロ	60,077,407	-	60,840,700	763,293	73,926,911	-	74,285,333	358,422
合計	380,076,867	-	389,211,700	9,134,833	531,618,376	-	538,401,768	6,783,392

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

(1口当たり情報)

	2022年9月7日現在	2023年9月7日現在
1口当たり純資産額	3,369 円	3,316 円
(1万口当たり純資産額)	(33,699 円)	(33,162 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 ETF	87,000	7,080,930.000	
	アメリカ・ドル 小計			7,080,930.000 (1,047,552,784)	
投資信託受益証券 合計				1,047,552,784 [1,047,552,784]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	21,004	307,708.600	
		URBAN EDGE PROPERTIES	19,935	330,921.000	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	18,188	214,436.520	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	24,212	4,342,906.440	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	55,753	6,453,409.750	
		BOSTON PROPERTIES INC	24,335	1,608,786.850	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	25,200	191,520.000	
		VORNADO REALTY TRUST	27,331	676,988.870	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	15,836	208,718.480	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13,925	470,665.000	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	3,872	141,328.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	58,145	3,698,603.450	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	36,114	577,824.000	
		EPR PROPERTIES	12,765	564,978.900	
		CITY OFFICE REIT INC	6,000	29,220.000	
		GLOBAL NET LEASE INC	17,609	192,290.280	
		EQUINIX INC	15,946	12,245,092.860	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	14,757	360,218.370	
		CHATHAM LODGING TRUST	8,284	80,851.840	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	10,078	880,514.860	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	21,370	288,708.700	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	4,148	134,187.800	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	7,800	21,684.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	121,271	1,936,697.870	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	53,572	1,896,984.520	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	21,862	157,625.020	
		RLJ LODGING TRUST	26,986	270,669.580	
		FARMLAND PARTNERS INC	7,936	86,026.240	
PHYSICIANS REALTY TRUST	40,424	541,681.600			
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	11,520	129,830.400			

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		KIMCO REALTY CORP	105,695	1,968,040.900	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	10,445	99,018.600	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	64,573	1,097,741.000	
		WHITESTONE REIT	7,417	73,799.150	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	44,785	2,164,459.050	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	20,966	144,036.420	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	36,563	468,006.400	
		INVITATION HOMES INC	99,119	3,366,081.240	
		JBG SMITH PROPERTIES	16,440	264,026.400	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	12,309	214,792.050	
		CLIPPER REALTY INC	1,890	11,302.200	
		GLADSTONE LAND CORP	5,632	86,901.760	
		AMERICOLD REALTY TRUST	46,065	1,502,640.300	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	11,179	43,262.730	
		VICI PROPERTIES INC	171,228	5,309,780.280	
		BRT APARTMENTS CORP	2,049	37,271.310	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4,754	417,781.520	
		NECESSITY RETAIL REIT INC CLASS A	22,754	162,463.560	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	25,238	596,626.320	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	6,640	149,931.200	
		BROADSTONE NET LEASE INC	31,743	511,697.160	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	18,223	107,151.240	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,854	184,163.200	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	38,036	620,747.520	
		PARAMOUNT GROUP INC	26,339	135,909.240	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	22,164	197,037.960	
		NETSTREIT CORP	10,320	173,582.400	
		APARTMENT INCOME REIT CO	25,299	835,372.980	
		CTO REALTY GROWTH INC	3,211	55,068.650	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	34,263	1,788,528.600	
		STAG INDUSTRIAL INC	30,416	1,107,142.400	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	2,066	34,915.400	
		POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2,825	40,538.750	
		PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	19,890	693,763.200	
		ORION OFFICE REIT INC	9,048	48,859.200	
		DIGITAL CORE REIT UNITS	49,400	27,911.000	
		VENTAS INC	68,211	2,908,517.040	
		CARETRUST REIT INC	16,868	335,841.880	
		INVENTRUST PROPERTIES CORP	11,447	278,047.630	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	50,963	1,115,070.440	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,759	48,067.000	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	39,203	495,133.890	
		UMH PROPERTIES INC	9,575	142,763.250	
		CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	3,916	82,980.040	
		BLUEROCK HOMES TRUST INC CLASS A	487	6,676.770	
		NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C	5,547	51,642.570	
		STAR HOLDINGS SHARES OF BENEFICIAL	2,122	27,097.940	
		IRON MOUNTAIN INC	49,723	3,183,266.460	
		TERRENO REALTY CORP	12,565	756,413.000	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	23,959	906,848.150	
		SUN COMMUNITIES INC	21,212	2,535,258.240	
		ACADIA REALTY TRUST	16,145	244,596.750	
		ALEXANDER'S INC	343	66,168.130	
		PROLOGIS INC	157,456	19,112,009.280	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	26,845	3,112,677.750	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	29,151	147,212.550	
		SAUL CENTERS INC	2,061	76,112.730	
		VERIS RESIDENTIAL INC	13,525	243,585.250	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	18,204	1,907,051.040	
		COUSINS PROPERTIES INC	25,722	594,949.860	
		SITE CENTERS CORP	30,870	413,966.700	
		EASTGROUP PROPERTIES INC	7,572	1,339,941.120	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,943	2,587,034.630	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	22,424	1,142,278.560	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	12,440	1,209,665.600	
		GETTY REALTY CORP	7,637	230,026.440	
		WELLTOWER INC	84,747	6,947,559.060	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	93,266	1,903,559.060	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	17,882	428,452.720	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	28,054	223,590.380	
		EQUITY COMMONWEALTH	18,602	355,112.180	
		KILROY REALTY CORP	17,874	669,560.040	
		LTC PROPERTIES INC	7,019	224,397.430	
		LXP INDUSTRIAL TRUST	49,612	472,306.240	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,891	2,807,216.830	
		MACERICH CO/THE	36,473	432,569.780	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	29,845	1,964,099.450	
		NATL HEALTH INVESTORS INC	7,357	372,632.050	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	30,876	1,180,080.720	
		REALTY INCOME CORP	114,788	6,312,192.120	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	19,079	486,896.080	
		PUBLIC STORAGE	26,979	7,250,066.670	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		REGENCY CENTERS CORP	27,843	1,770,814.800	
		RPT REALTY	14,699	165,951.710	
		SAFEHOLD INC	6,831	130,813.650	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	17,835	414,307.050	
		SL GREEN REALTY CORP	10,916	423,759.120	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	40,867	98,489.470	
		UDR INC	52,758	2,061,255.060	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,029	91,974.570	
		WP CAREY INC	36,470	2,307,456.900	
		ELME	14,875	223,571.250	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4,700	13,019.000	
		AGREE REALTY CORP	15,803	953,078.930	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	39,738	1,250,157.480	
		CUBESMART	38,309	1,545,385.060	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	35,117	313,243.640	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	49,676	6,456,886.480	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	36,012	4,557,678.720	
		HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,643	55,583.550	
		CENTERSPACE	2,537	160,896.540	
		KITE REALTY GROUP TRUST	37,190	828,593.200	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,592	49,662.720	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6,328	81,821.040	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	35,573	282,805.350	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	101,451	711,171.510	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES C	13,105	24,768.450	
		DOUGLAS EMMETT INC	28,794	398,508.960	
		MANULIFE US REAL ESTATE INV	265,962	15,957.720	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	135,300	29,766.000	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	0.000	
		PRIME US REIT	92,200	12,447.000	
		アメリカ・ドル 小計		166,542,447.520 (24,638,289,686)	
	イギリス・ポンド	WAREHOUSE REIT PLC	70,605	59,378.800	
		EDISTON PROPERTY INVESTMENT COMPAN	31,488	22,041.600	
		HELICAL PLC	18,206	40,963.500	
		ASSURA PLC	515,500	234,449.400	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	101,879	89,449.760	
		ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITE	67,467	32,384.160	
		CLS HOLDINGS PLC	57,322	72,111.070	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	145,486	78,271.460	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	95,251	64,580.170	
		REGIONAL REIT LTD	71,837	31,895.620	
		NEWRIVER REIT PLC	51,721	41,635.400	
		SHAFTESBURY CAPITAL PLC	339,736	390,356.660	
		CUSTODIAN REIT PLC	76,682	61,959.050	
		PRS REIT PLC/THE	95,537	67,831.270	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	69,968	62,131.580	
		LXI REIT PLC	298,217	275,254.290	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	62,933	35,997.670	
		AEW UK REIT PLC	27,617	27,119.890	
		BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	134,976	95,832.960	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	216,272	163,501.630	
		URBAN LOGISTICS REIT PLC	78,434	89,885.360	
		HOME REIT PLC	117,587	44,741.850	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	130,685	764,768.620	
		SEGRO PLC	212,873	1,547,586.710	
		HAMMERSON PLC	696,079	170,817.780	
		UNITE GROUP PLC/THE	75,400	690,287.000	
		BRITISH LAND CO PLC	163,151	511,641.530	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	44,158	184,668.750	
		DERWENT LONDON PLC	19,532	366,029.680	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	232,471	217,011.670	
		WORKSPACE GROUP PLC	24,000	117,504.000	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	37,920	326,680.800	
		BIG YELLOW GROUP PLC	30,454	324,639.640	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	170,978	300,408.340	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	93,799	39,395.580	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	325,066	453,142.000	
		イギリス・ポンド 小計		8,096,355.250 (1,496,773,195)	
	イスラエル・シ ュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	105,526	161,560.300	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	37,152	285,698.880	
		REIT 1 LTD	33,128	530,048.000	
		イスラエル・シュケル 小計		977,307.180 (37,719,171)	
	オーストラリ ア・ドル	DEXUS/AU	194,449	1,473,923.420	
		HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	78,991	120,856.230	
		HMC CAPITAL LTD	42,695	232,260.800	
		RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY UN	53,900	40,155.500	
		ABACUS STORAGE KING STAPLED UNITS	70,207	86,003.570	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	57,979	161,761.410	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		CROMWELL PROPERTY GROUP	247,199	108,767.560	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	97,570	297,588.500	
		RURAL FUNDS GROUP	67,167	139,035.690	
		WAYPOINT REIT	117,959	290,179.140	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	117,631	419,942.670	
		CENTURIA OFFICE REIT	77,754	96,026.190	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	120,539	174,178.850	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	280,957	338,553.180	
		REGION GROUP	207,706	438,259.660	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	50,422	121,012.800	
		NATIONAL STORAGE REIT	221,832	503,558.640	
		DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	35,122	98,692.820	
		GDI PROPERTY GROUP	87,347	55,028.610	
		SCENTRE GROUP	938,357	2,514,796.760	
		ARENA REIT	60,571	222,901.280	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	35,127	106,786.080	
		BWP TRUST	84,216	308,230.560	
		GPT GROUP	346,313	1,444,125.210	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	90,423	309,246.660	
		MIRVAC GROUP	713,363	1,683,536.680	
		STOCKLAND	431,571	1,769,441.100	
		ABACUS GROUP UNIT	70,207	77,929.770	
		GOODMAN GROUP	309,369	7,143,330.210	
		VICINITY CENTRES	699,546	1,290,662.370	
		CHARTER HALL GROUP	85,512	901,296.480	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	66,317	274,552.380	
	オーストラリア・ドル	小計		23,242,620.780 (2,192,011,566)	
	カナダ・ドル	INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	2,300	7,544.000	
		BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	5,100	16,269.000	
		EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	6,200	15,314.000	
		NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	5,600	43,456.000	
		PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	8,541	116,584.650	
		PRO REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	4,400	21,252.000	
		BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST U	2,758	45,424.260	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,800	66,248.000	
		SLATE GROCERY REIT	4,700	59,972.000	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	10,400	190,944.000	
		SLATE OFFICE REIT	5,100	8,262.000	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	3,400	44,506.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	20,100	134,670.000	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	6,100	14,701.000	
		AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	3,500	36,330.000	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5,600	428,736.000	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	22,800	318,060.000	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,800	149,152.000	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	18,800	266,208.000	
		CHOICE PROPERTIES REIT	29,000	381,930.000	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	3,300	51,810.000	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	9,100	132,587.000	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,800	309,760.000	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,800	737,780.000	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	23,566	245,086.400	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	26,600	522,690.000	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,300	42,240.000	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,100	286,508.000	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	8,900	120,506.000	
		ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	11,300	233,119.000	
	カナダ・ドル	小計		5,047,649.310 (547,165,185)	
	シンガポール・ ドル	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	84,700	49,126.000	
		KEPPEL DC REIT	239,483	522,072.940	
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	210,276	51,517.620	
		AIMS APAC REIT	99,400	126,238.000	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERC	523,390	622,834.100	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	87,900	60,651.000	
		LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	327,840	180,312.000	
		EC WORLD REIT	36,500	10,220.000	
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	607,577	1,676,912.520	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	910,322	1,729,611.800	
		SUNTEC REIT	407,100	500,733.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	598,800	1,005,984.000	
		KEPPEL REIT	358,600	313,775.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	398,656	386,696.320	
		ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T	1,163,302	366,440.130	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	145,700	152,985.000	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	194,076	436,671.000	
		STARHILL GLOBAL REIT	247,600	121,324.000	
		CAPITALAND CHINA TRUST	211,842	192,776.220	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	70,000	264,600.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	361,869	835,917.390	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	416,484	620,561.160	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	185,700	119,776.500	
		PARAGON REIT	188,600	168,797.000	
		QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	412,463	96,928.800	
		シンガポール・ドル 小計		10,613,461.500 (1,150,605,360)	
	ニュージーランド・ドル	STRIDE PROPERTY GROUP	92,477	128,543.030	
		ARGOSY PROPERTY LTD	144,609	169,915.570	
		KIWI PROPERTY GROUP LTD	275,684	238,466.660	
		VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	80,882	176,322.760	
		GOODMAN PROPERTY TRUST	190,268	419,540.940	
		PRECINCT PROPERTIES GROUP	243,698	291,219.110	
		ニュージーランド・ドル 小計		1,424,008.070 (123,603,900)	
	ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	6,463	143,090.820	
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1,820	8,463.000	
		HAMBORNER REIT AG	10,717	69,874.840	
		WERELDHAVE NV	6,098	95,433.700	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	16,385	808,435.900	
		NSI NV	2,733	50,669.820	
		VASTNED RETAIL NV	2,739	55,053.900	
		ICADE	4,849	165,156.940	
		CARMILA	8,705	126,396.600	
		ALTAREA	710	64,184.000	
		GECINA SA	8,326	816,780.600	
		KLEPIERRE	29,854	726,347.820	
		COVIVIO	7,033	310,295.960	
		MERCIALYS	11,658	102,940.140	
		AEDIFICA	7,209	432,540.000	
		COFINIMMO	4,630	326,415.000	
		INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	3,984	57,847.680	
		RETAIL ESTATES	1,706	97,412.600	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	23,476	591,595.200	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		CARE PROPERTY INVEST	5,601	67,324.020	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	3,526	93,439.000	
		MONTEA NV	2,047	145,951.100	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,930	15,349.950	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	8,842	51,902.540	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	44,944	247,641.440	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	50,509	412,405.980	
		CROMWELL REIT EUR	54,520	79,054.000	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	64,959	63,464.940	
	ユーロ	小計		6,225,467.490 (987,296,889)	
	韓国・ウォン	SK REITS LTD	18,558	84,531,690.000	
		D&D PLATFORM REIT LTD	8,000	24,320,000.000	
		SHINHAN SEOBU T&D REIT LTD	3,930	13,008,300.000	
		NH ALL ONE REIT LTD	6,454	20,878,690.000	
		E KOCREF CR	3,584	17,902,080.000	
		SK REITS LTD	4,276	98,348.000	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	12,235	76,713,450.000	
		LOTTE REIT CO LTD	20,132	68,851,440.000	
		MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	15,855	64,450,575.000	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	9,300	39,897,000.000	
		JR REIT XXVII	25,282	102,897,740.000	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	5,990	33,304,400.000	
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	27,294	109,176,000.000	
	韓国・ウォン	小計		656,029,713.000 (72,688,092)	
	香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	437,000	646,760.000	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	181,000	490,510.000	
		FORTUNE REIT	254,000	1,247,140.000	
		PROSPERITY REIT	205,000	307,500.000	
		LINK REIT	461,700	17,890,875.000	
		CHAMPION REIT	331,000	860,600.000	
	香港・ドル	小計		21,443,385.000 (404,422,242)	
投資証券	合計			31,650,575,286 [31,650,575,286]	
合計				32,698,128,070 [32,698,128,070]	

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	4.1%	78.6%
	投資証券	142 銘柄		
イギリス・ポンド	投資証券	36 銘柄	-%	4.6%
イスラエル・シケル	投資証券	3 銘柄	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券	32 銘柄	-%	6.7%
カナダ・ドル	投資証券	30 銘柄	-%	1.7%
シンガポール・ドル	投資証券	25 銘柄	-%	3.5%
ニュージーランド・ドル	投資証券	6 銘柄	-%	0.4%
ユーロ	投資証券	28 銘柄	-%	3.0%
韓国・ウォン	投資証券	13 銘柄	-%	0.2%
香港・ドル	投資証券	6 銘柄	-%	1.2%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2022年9月7日現在 金額（円）	2023年9月7日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	164,605,297	409,520,505
国債証券	37,201,380,950	42,976,991,250
地方債証券	1,548,421,000	2,874,383,510
特殊債券	726,038,000	1,123,402,600
社債券	1,303,681,800	3,067,239,100
未収利息	83,832,759	102,169,203
前払費用	3,727,566	8,978,554
流動資産合計	41,031,687,372	50,562,684,722
資産合計	41,031,687,372	50,562,684,722
負債の部		
流動負債		
未払金	-	148,459,600
未払解約金	9,035,925	8,592,465
流動負債合計	9,035,925	157,052,065
負債合計	9,035,925	157,052,065
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	32,762,371,290	41,118,291,684
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	8,260,280,157	9,287,340,973
元本等合計	41,022,651,447	50,405,632,657
純資産合計	41,022,651,447	50,405,632,657
負債純資産合計	41,031,687,372	50,562,684,722

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2022 年 9 月 8 日 至 2023 年 9 月 7 日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2022 年 9 月 7 日現在	2023 年 9 月 7 日現在
1. ※1 期首	2021 年 9 月 8 日	2022 年 9 月 8 日
期首元本額	25,844,711,462 円	32,762,371,290 円
期中追加設定元本額	7,633,598,641 円	9,116,937,425 円
期中一部解約元本額	715,938,813 円	761,017,031 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
日本債券インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)	1,292,691,182 円	2,416,626,707 円
i F r e e 日本債券インデックス	3,747,353,142 円	3,448,681,548 円
i F r e e 8 資産バランス	4,429,046,104 円	6,035,357,926 円
ダイワ・ライフ・バランス 30	9,585,582,965 円	11,318,715,322 円
ダイワ・ライフ・バランス 50	6,689,354,190 円	8,455,895,963 円
ダイワ・ライフ・バランス 70	2,215,298,175 円	3,321,939,241 円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	1,593,229,026 円	1,865,214,837 円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	1,261,226,070 円	1,467,743,209 円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	481,374,711 円	585,459,112 円
ダイワつみたてインデックス日本債券	1,117,014,257 円	1,880,061,805 円
ダイワつみたてインデックスバランス 30	36,029,294 円	48,091,318 円
ダイワつみたてインデックスバランス 50	14,606,942 円	18,387,687 円
ダイワつみたてインデックスバランス 70	12,321,449 円	16,363,752 円

区分	2022年9月7日現在	2023年9月7日現在
ダイワ世界バランスファンド4 O V A	214,981,632 円	194,853,512 円
ダイワ世界バランスファンド6 O V A	72,262,151 円	44,899,745 円
計	32,762,371,290 円	41,118,291,684 円
2. 期末日における受益権の総数	32,762,371,290 口	41,118,291,684 口

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2022年9月8日 至 2023年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年9月7日現在	2023年9月7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	△1,335,017,330	△660,695,950

種類	2022年9月7日現在	2023年9月7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）
地方債証券	△19,831,000	△15,731,358
特殊債券	△9,283,700	△7,754,000
社債券	△22,741,500	△29,829,700
合計	△1,386,873,530	△714,011,008

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2022年9月7日現在	2023年9月7日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2022年9月7日現在	2023年9月7日現在
1口当たり純資産額	1.2521円	1.2259円
（1万口当たり純資産額）	（12,521円）	（12,259円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
国債証券	4 4 1 2年国債	150,000,000	150,151,500	
	4 4 2 2年国債	200,000,000	200,206,000	
	4 4 4 2年国債	170,000,000	170,156,400	
	4 4 5 2年国債	110,000,000	110,092,400	
	4 4 6 2年国債	300,000,000	300,219,000	
	4 4 7 2年国債	90,000,000	90,055,800	
	4 4 8 2年国債	70,000,000	70,034,300	
	4 4 9 2年国債	230,000,000	230,078,200	
	1 4 2 5年国債	320,000,000	320,675,200	
	1 4 3 5年国債	900,000,000	901,926,000	
	1 4 4 5年国債	650,000,000	651,326,000	
	1 4 5 5年国債	930,000,000	931,887,900	
	1 4 6 5年国債	520,000,000	520,946,400	
	1 4 7 5年国債	720,000,000	719,539,200	
	1 4 8 5年国債	500,000,000	499,440,000	
	1 4 9 5年国債	600,000,000	599,088,000	
	1 5 0 5年国債	420,000,000	419,105,400	
	1 5 1 5年国債	450,000,000	448,654,500	
	1 5 2 5年国債	150,000,000	150,052,500	
	1 5 3 5年国債	270,000,000	268,879,500	
	1 5 4 5年国債	520,000,000	519,266,800	
	1 5 5 5年国債	90,000,000	90,554,400	
	1 5 6 5年国債	600,000,000	601,146,000	
	1 5 7 5年国債	60,000,000	60,040,200	
	1 5 8 5年国債	280,000,000	278,930,400	
	1 5 9 5年国債	200,000,000	198,958,000	
	1 4 0年国債	30,000,000	35,607,600	
	2 4 0年国債	48,000,000	54,912,000	
	3 4 0年国債	19,000,000	21,709,210	
	4 4 0年国債	54,000,000	61,664,760	
	5 4 0年国債	61,000,000	66,959,700	
	6 4 0年国債	68,000,000	73,117,000	
	7 4 0年国債	41,000,000	42,143,080	
	8 4 0年国債	40,000,000	38,084,000	
	9 4 0年国債	40,000,000	27,853,600	
	1 0 4 0年国債	240,000,000	195,859,200	
1 1 4 0年国債	85,000,000	66,616,200		
1 2 4 0年国債	99,000,000	68,871,330		
1 3 4 0年国債	252,000,000	173,124,000		

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	1 4 40年国債	273,000,000	200,351,970	
	1 5 40年国債	250,000,000	201,517,500	
	1 6 40年国債	300,000,000	264,438,000	
	3 3 7 10年国債	550,000,000	552,574,000	
	3 3 8 10年国債	80,000,000	80,538,400	
	3 3 9 10年国債	165,000,000	166,219,350	
	3 4 0 10年国債	190,000,000	191,544,700	
	3 4 1 10年国債	15,000,000	15,095,700	
	3 4 2 10年国債	140,000,000	140,246,400	
	3 4 3 10年国債	270,000,000	270,410,400	
	3 4 4 10年国債	90,000,000	90,122,400	
	3 4 5 10年国債	410,000,000	410,401,800	
	3 4 6 10年国債	250,000,000	250,087,500	
	3 4 7 10年国債	690,000,000	689,606,700	
	3 4 8 10年国債	430,000,000	429,393,700	
	3 4 9 10年国債	500,000,000	498,830,000	
	3 5 0 10年国債	400,000,000	398,472,000	
	3 5 1 10年国債	120,000,000	119,374,800	
	3 5 2 10年国債	500,000,000	496,765,000	
	3 5 3 10年国債	520,000,000	515,928,400	
	3 5 4 10年国債	280,000,000	277,404,400	
	3 5 5 10年国債	290,000,000	286,865,100	
	3 5 6 10年国債	440,000,000	434,526,400	
	3 5 7 10年国債	420,000,000	413,926,800	
	3 5 8 10年国債	480,000,000	472,036,800	
	3 5 9 10年国債	240,000,000	235,557,600	
	3 6 0 10年国債	460,000,000	450,404,400	
	3 6 1 10年国債	480,000,000	468,480,000	
	3 6 2 10年国債	520,000,000	506,006,800	
	3 6 3 10年国債	380,000,000	368,615,200	
	3 6 4 10年国債	430,000,000	416,072,300	
	3 6 5 10年国債	380,000,000	366,741,800	
	3 6 6 10年国債	420,000,000	407,689,800	
	3 6 7 10年国債	280,000,000	271,222,000	
	3 6 8 10年国債	400,000,000	386,452,000	
	3 6 9 10年国債	550,000,000	544,681,500	
	3 7 0 10年国債	430,000,000	424,973,300	
	3 7 1 10年国債	450,000,000	439,452,000	
	2 30年国債	9,000,000	10,176,930	
	3 30年国債	4,000,000	4,508,840	
	4 30年国債	8,000,000	9,406,240	
	5 30年国債	8,000,000	9,037,920	
	6 30年国債	9,000,000	10,350,990	
	7 30年国債	12,000,000	13,765,560	
	10 30年国債	25,000,000	26,091,250	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	1 1 3 0年国債	9,000,000	9,896,310	
	1 2 3 0年国債	11,000,000	12,525,810	
	1 3 3 0年国債	11,000,000	12,431,210	
	1 4 3 0年国債	22,000,000	25,768,380	
	1 5 3 0年国債	21,000,000	24,838,800	
	1 6 3 0年国債	26,000,000	30,793,100	
	1 7 3 0年国債	17,000,000	19,980,100	
	1 8 3 0年国債	20,000,000	23,314,200	
	1 9 3 0年国債	15,000,000	17,507,100	
	2 0 3 0年国債	16,000,000	19,048,160	
	2 1 3 0年国債	16,000,000	18,694,400	
	2 2 3 0年国債	17,000,000	20,279,300	
	2 3 3 0年国債	16,000,000	19,109,440	
	2 4 3 0年国債	15,000,000	17,924,850	
	2 5 3 0年国債	17,000,000	19,906,150	
	2 6 3 0年国債	32,000,000	37,903,040	
	2 7 3 0年国債	32,000,000	38,331,200	
	2 8 3 0年国債	34,000,000	40,753,760	
	2 9 3 0年国債	43,000,000	51,000,150	
	3 0 3 0年国債	56,000,000	65,564,800	
	3 1 3 0年国債	76,000,000	87,812,680	
	3 2 3 0年国債	45,000,000	52,625,700	
	3 3 3 0年国債	95,000,000	106,576,700	
	3 4 3 0年国債	110,000,000	126,663,900	
	3 5 3 0年国債	120,000,000	134,230,800	
	3 6 3 0年国債	138,000,000	154,150,140	
	3 7 3 0年国債	165,000,000	181,071,000	
	3 8 3 0年国債	250,000,000	269,467,500	
	3 9 3 0年国債	105,000,000	114,821,700	
	4 0 3 0年国債	80,000,000	86,015,200	
	4 1 3 0年国債	80,000,000	84,524,800	
	4 2 3 0年国債	100,000,000	105,625,000	
	4 3 3 0年国債	95,000,000	100,314,300	
	4 4 3 0年国債	105,000,000	110,747,700	
	4 5 3 0年国債	105,000,000	106,809,150	
	4 6 3 0年国債	170,000,000	172,811,800	
	4 7 3 0年国債	125,000,000	129,280,000	
	4 8 3 0年国債	145,000,000	144,391,000	
	4 9 3 0年国債	120,000,000	119,391,600	
	5 0 3 0年国債	120,000,000	105,411,600	
	5 1 3 0年国債	155,000,000	120,752,750	
	5 2 3 0年国債	150,000,000	122,229,000	
	5 3 3 0年国債	130,000,000	108,130,100	
	5 4 3 0年国債	140,000,000	121,686,600	
	5 5 3 0年国債	140,000,000	121,332,400	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	5 6 3 0年国債	120,000,000	103,695,600	
	5 7 3 0年国債	115,000,000	99,084,000	
	5 8 3 0年国債	180,000,000	154,632,600	
	5 9 3 0年国債	110,000,000	92,023,800	
	6 0 3 0年国債	150,000,000	131,232,000	
	6 1 3 0年国債	110,000,000	91,356,100	
	6 2 3 0年国債	135,000,000	106,064,100	
	6 3 3 0年国債	110,000,000	83,692,400	
	6 4 3 0年国債	120,000,000	90,944,400	
	6 5 3 0年国債	125,000,000	94,450,000	
	6 6 3 0年国債	175,000,000	131,600,000	
	6 7 3 0年国債	140,000,000	110,843,600	
	6 8 3 0年国債	140,000,000	110,453,000	
	6 9 3 0年国債	131,000,000	105,990,790	
	7 0 3 0年国債	166,000,000	133,990,220	
	7 1 3 0年国債	100,000,000	80,522,000	
	7 2 3 0年国債	203,000,000	163,220,120	
	7 3 3 0年国債	120,000,000	96,253,200	
	7 4 3 0年国債	155,000,000	134,671,750	
	7 5 3 0年国債	160,000,000	149,801,600	
	7 6 3 0年国債	120,000,000	115,128,000	
	7 7 3 0年国債	195,000,000	195,975,000	
	7 8 3 0年国債	120,000,000	114,956,400	
	7 9 3 0年国債	95,000,000	86,463,300	
	7 5 2 0年国債	14,000,000	14,458,220	
	7 6 2 0年国債	25,000,000	25,741,750	
	7 8 2 0年国債	17,000,000	17,579,870	
	7 9 2 0年国債	14,000,000	14,502,460	
	8 1 2 0年国債	65,000,000	67,642,250	
	8 2 2 0年国債	28,000,000	29,195,320	
	8 5 2 0年国債	31,000,000	32,621,300	
	8 6 2 0年国債	6,000,000	6,344,100	
	8 7 2 0年国債	35,000,000	36,919,050	
	8 8 2 0年国債	33,000,000	35,066,460	
	8 9 2 0年国債	15,000,000	15,897,750	
	9 2 2 0年国債	60,000,000	63,988,200	
	9 3 2 0年国債	18,000,000	19,212,660	
	9 4 2 0年国債	45,000,000	48,190,050	
	9 5 2 0年国債	30,000,000	32,473,500	
	9 6 2 0年国債	63,000,000	67,719,960	
	9 7 2 0年国債	25,000,000	27,076,000	
	9 8 2 0年国債	64,000,000	69,057,920	
	9 9 2 0年国債	53,000,000	57,396,880	
	1 0 0 2 0年国債	35,000,000	38,175,900	
	1 0 1 2 0年国債	18,000,000	19,794,960	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	1 0 2 2 0年国債	10,000,000	11,041,800	
	1 0 3 2 0年国債	21,000,000	23,088,240	
	1 0 4 2 0年国債	64,000,000	69,758,080	
	1 0 5 2 0年国債	38,000,000	41,556,040	
	1 0 6 2 0年国債	16,000,000	17,576,800	
	1 0 7 2 0年国債	40,000,000	43,880,400	
	1 0 8 2 0年国債	68,000,000	73,887,440	
	1 0 9 2 0年国債	60,000,000	65,362,800	
	1 1 0 2 0年国債	27,000,000	29,707,560	
	1 1 1 2 0年国債	35,000,000	38,833,550	
	1 1 2 2 0年国債	40,000,000	44,153,600	
	1 1 3 2 0年国債	70,000,000	77,488,600	
	1 1 4 2 0年国債	45,000,000	49,948,200	
	1 1 5 2 0年国債	42,000,000	46,877,040	
	1 1 6 2 0年国債	27,000,000	30,207,330	
	1 1 7 2 0年国債	77,000,000	85,655,570	
	1 1 8 2 0年国債	13,000,000	14,411,150	
	1 1 9 2 0年国債	23,000,000	25,192,130	
	1 2 0 2 0年国債	98,000,000	106,008,560	
	1 2 3 2 0年国債	42,000,000	47,002,200	
	1 2 4 2 0年国債	100,000,000	111,203,000	
	1 2 5 2 0年国債	25,000,000	28,206,250	
	1 2 6 2 0年国債	21,000,000	23,378,670	
	1 2 7 2 0年国債	110,000,000	121,658,900	
	1 2 8 2 0年国債	32,000,000	35,448,000	
	1 2 9 2 0年国債	95,000,000	104,522,800	
	1 3 0 2 0年国債	110,000,000	121,136,400	
	1 3 1 2 0年国債	150,000,000	164,026,500	
	1 3 2 2 0年国債	25,000,000	27,364,000	
	1 3 3 2 0年国債	150,000,000	165,376,500	
	1 3 4 2 0年国債	15,000,000	16,561,200	
	1 3 5 2 0年国債	20,000,000	21,909,400	
	1 3 6 2 0年国債	180,000,000	195,715,800	
	1 3 7 2 0年国債	18,000,000	19,742,040	
	1 3 9 2 0年国債	250,000,000	272,100,000	
	1 4 0 2 0年国債	100,000,000	109,801,000	
	1 4 1 2 0年国債	140,000,000	153,742,400	
	1 4 2 2 0年国債	210,000,000	232,564,500	
	1 4 3 2 0年国債	100,000,000	109,013,000	
	1 4 4 2 0年国債	50,000,000	54,031,500	
	1 4 5 2 0年国債	40,000,000	43,983,600	
	1 4 6 2 0年国債	160,000,000	175,988,800	
	1 4 7 2 0年国債	240,000,000	261,722,400	
	1 4 8 2 0年国債	240,000,000	259,207,200	
	1 4 9 2 0年国債	310,000,000	334,691,500	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	1 5 0 20年国債	280,000,000	299,154,800	
	1 5 1 20年国債	280,000,000	292,952,800	
	1 5 2 20年国債	235,000,000	245,567,950	
	1 5 3 20年国債	275,000,000	290,114,000	
	1 5 4 20年国債	305,000,000	317,864,900	
	1 5 5 20年国債	250,000,000	254,310,000	
	1 5 6 20年国債	220,000,000	207,730,600	
	1 5 7 20年国債	310,000,000	284,310,300	
	1 5 8 20年国債	255,000,000	242,252,550	
	1 5 9 20年国債	300,000,000	287,784,000	
	1 6 0 20年国債	260,000,000	251,903,600	
	1 6 1 20年国債	200,000,000	190,540,000	
	1 6 2 20年国債	270,000,000	256,392,000	
	1 6 3 20年国債	180,000,000	170,362,800	
	1 6 4 20年国債	280,000,000	260,257,200	
	1 6 5 20年国債	220,000,000	203,735,400	
	1 6 6 20年国債	320,000,000	304,073,600	
	1 6 7 20年国債	160,000,000	146,958,400	
	1 6 8 20年国債	250,000,000	225,145,000	
	1 6 9 20年国債	155,000,000	136,671,250	
	1 7 0 20年国債	255,000,000	223,839,000	
	1 7 1 20年国債	150,000,000	131,076,000	
	1 7 2 20年国債	275,000,000	243,311,750	
	1 7 3 20年国債	200,000,000	176,052,000	
	1 7 4 20年国債	290,000,000	254,132,800	
	1 7 5 20年国債	195,000,000	173,228,250	
	1 7 6 20年国債	185,000,000	163,638,050	
	1 7 7 20年国債	180,000,000	155,703,600	
	1 7 8 20年国債	335,000,000	293,915,600	
	1 7 9 20年国債	190,000,000	166,075,200	
	1 8 0 20年国債	250,000,000	229,960,000	
	1 8 1 20年国債	185,000,000	172,654,950	
	1 8 2 20年国債	200,000,000	192,720,000	
	1 8 3 20年国債	190,000,000	192,186,900	
	1 8 4 20年国債	170,000,000	162,802,200	
	1 8 5 20年国債	190,000,000	181,450,000	
	1 フイリピン共和国	100,000,000	98,593,100	
国債証券	合計		42,976,991,250	
地方債証券	7 5 1 東京都公債	100,000,000	100,532,300	
	7 9 7 東京都公債	100,000,000	97,625,200	
	3 2 東京都5年	100,000,000	99,859,300	
	2 7 - 1 5 北海道公債	100,000,000	100,162,400	
	3 - 5 北海道公債	100,000,000	96,123,100	
	2 2 2 神奈川県公債	100,000,000	99,701,000	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	4 0 1 大阪府公債	100,000,000	100,730,600	
	4 5 7 大阪府公債	100,000,000	97,111,700	
	3 兵庫県公債12年	100,000,000	100,749,200	
	1 1 兵庫県公債20年	100,000,000	108,775,800	
	2 8 - 1 静岡県公債	100,000,000	99,833,700	
	2 4 - 1 広島県20年	100,000,000	108,542,500	
	1 埼玉県15年	100,000,000	102,961,900	
	9 埼玉県20年	100,000,000	110,812,100	
	2 2 - 1 福岡県15年	100,000,000	103,389,000	
	2 9 - 6 千葉県公債	100,000,000	99,857,000	
	3 0 - 3 新潟県公債	134,160,000	132,398,210	
	3 - 1 茨城県公債	100,000,000	96,230,300	
	1 5 1 共同発行地方	100,000,000	100,721,800	
	1 6 8 共同発行地方	100,000,000	100,009,500	
	2 4 4 共同発行地方	100,000,000	98,223,800	
	3 - 3 堺市公債	100,000,000	95,598,600	
	4 - 3 長崎県公債	100,000,000	97,012,700	
	2 7 - 1 滋賀県公債	100,000,000	100,762,100	
	2 - 1 静岡市公債	100,000,000	96,970,800	
	1 1 名古屋市20年	100,000,000	110,244,800	
	1 0 京都市20年	100,000,000	109,024,300	
	6 札幌市20年	100,000,000	110,419,800	
地方債証券	合計		2,874,383,510	
特殊債券	4 7 日本政策投資CO	100,000,000	103,439,000	
	1 7 4 日本政策投資	100,000,000	98,499,900	
	8 1 政保道路機構	100,000,000	109,846,700	
	2 4 1 政保道路機構	100,000,000	100,648,500	
	2 6 1 政保道路機構	100,000,000	100,650,500	
	3 地方公共団15年	100,000,000	104,178,900	
	F 2 3 1 地方公共団体	100,000,000	104,326,700	
	6 5 地方公共団体	100,000,000	100,527,200	
	1 2 9 地方公共団体	100,000,000	97,434,700	
	1 2 7 都市再生	100,000,000	99,632,500	
	8 0 住宅支援機構	100,000,000	104,218,000	
特殊債券	合計		1,123,402,600	
社債券	2 0 成田国際空港	100,000,000	99,612,800	
	2 5 西日本高速道	100,000,000	100,562,100	
	3 2 大和ハウス工業	100,000,000	100,002,900	
	2 2 積水ハウス	100,000,000	99,376,900	
	1 1 サントリーホールディング	100,000,000	99,490,800	
	1 1 ヒューリック	100,000,000	99,831,800	
	2 9 東急不動産HD	100,000,000	99,232,200	
	1 4 セブンアンドアイ	100,000,000	99,682,800	
	3 2 住友電工	100,000,000	99,103,000	
	1 6 クボタ	100,000,000	99,861,500	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	1 7 パナソニック	100,000,000	100,080,700	
	3 1 トヨタ自動車	100,000,000	97,197,300	
	6 楽天カード	100,000,000	87,992,400	
	2 6 りそなホールデイン	100,000,000	99,590,500	
	3 6 芙蓉総合リース	100,000,000	99,484,800	
	5 NTTファイナンス	100,000,000	95,560,800	
	8 1 ホンダファイナンス	100,000,000	99,254,200	
	4 2 リコーリース	100,000,000	99,324,100	
	2 1 4 オリックス	100,000,000	94,788,500	
	1 SOMPOHD	100,000,000	100,035,800	
	7 三井住友海上	100,000,000	99,602,500	
	8 2 三井不動産	100,000,000	99,299,000	
	8 0 三菱地所	100,000,000	106,814,500	
	1 4 3 三菱地所	100,000,000	99,059,800	
	9 ソフトバンク	100,000,000	98,217,500	
	4 9 7 関西電力	100,000,000	101,317,200	
	4 4 8 中国電力	100,000,000	98,981,600	
	4 8 9 九州電力	100,000,000	98,063,500	
	1 6 J E R A	100,000,000	100,266,000	
	6 5 東京瓦斯	100,000,000	96,203,300	
	5 0 大阪瓦斯	100,000,000	99,348,300	
社債券	合計		3,067,239,100	
合計			50,042,016,460	

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、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年9月8日から2024年3月7日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

2024年4月19日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 秋山 範之
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 竹内 知明
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている i F r e e 8 資産バランスの2023年9月8日から2024年3月7日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、i F r e e 8 資産バランスの2024年3月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年9月8日から2024年3月7日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

i F r e e 8 資産バランス

(1) 【中間貸借対照表】

		当中間計算期間末 2024年3月7日現在 金額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		860,547,779
親投資信託受益証券		68,103,465,438
未収入金		29,931,000
流動資産合計		68,993,944,217
資産合計		68,993,944,217
負債の部		
流動負債		
未払解約金		124,005,187
未払受託者報酬		6,950,429
未払委託者報酬		69,504,737
その他未払費用		1,095,262
流動負債合計		201,555,615
負債合計		201,555,615
純資産の部		
元本等		
元本	※1	39,728,890,938
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 (△)		29,063,497,664
(分配準備積立金)		9,922,627,555
元本等合計		68,792,388,602
純資産合計		68,792,388,602
負債純資産合計		68,993,944,217

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

	当中間計算期間 自 2023 年 9 月 8 日 至 2024 年 3 月 7 日 金 額 (円)
営業収益	
有価証券売買等損益	3,967,675,633
営業収益合計	3,967,675,633
営業費用	
支払利息	54,722
受託者報酬	6,950,429
委託者報酬	69,504,737
その他費用	1,095,262
営業費用合計	77,605,150
営業利益又は営業損失 (△)	3,890,070,483
経常利益又は経常損失 (△)	3,890,070,483
中間純利益又は中間純損失 (△)	3,890,070,483
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 (△)	73,500,583
期首剰余金又は期首欠損金 (△)	23,485,381,199
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,408,755,882
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	3,408,755,882
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,647,209,317
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	1,647,209,317
中間剰余金又は中間欠損金 (△)	29,063,497,664

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自 2023 年 9 月 8 日 至 2024 年 3 月 7 日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2024 年 3 月 7 日現在
1. ※1 期首元本額	37,138,831,604 円
期中追加設定元本額	5,194,761,200 円
期中一部解約元本額	2,604,701,866 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	39,728,890,938 口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自 2023 年 9 月 8 日 至 2024 年 3 月 7 日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2024 年 3 月 7 日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2024 年 3 月 7 日現在
該当事項はありません。

(1 口当たり情報)

	当中間計算期間末 2024年3月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7315円 (17,315円)

(参考)

当ファンドは、「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」受益証券、「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」受益証券、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「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、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）」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。

「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・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3月7日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,109,773,011
コール・ローン	725,930,323
株式	27,133,800,668
投資証券	1,726,907,839
派生商品評価勘定	78,245,931
未収配当金	86,593,335
差入委託証拠金	354,439,259
流動資産合計	31,215,690,366
資産合計	31,215,690,366
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,237,760
未払解約金	52,792,400
流動負債合計	54,030,160
負債合計	54,030,160
純資産の部	
元本等	
元本	※1 12,709,389,700
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金(△)	18,452,270,506
元本等合計	31,161,660,206
純資産合計	31,161,660,206
負債純資産合計	31,215,690,366

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2023 年 9 月 8 日 至 2024 年 3 月 7 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>

区分	自 2023 年 9 月 8 日 至 2024 年 3 月 7 日
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024 年 3 月 7 日現在
1. ※1 期首	2023 年 9 月 8 日
期首元本額	13,502,028,807 円
期中追加設定元本額	1,180,391,077 円
期中一部解約元本額	1,973,030,184 円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
新興国株式インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)	106,290,233 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)	448,853,900 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)	325,365,081 円
D-I's 新興国株式インデックス	120,528,387 円
iFree 新興国株式インデックス	6,144,152,266 円
iFree 8資産バランス	3,530,809,416 円
ダイワ新興国株式インデックス (為替ヘッジな し) (投資一任専用)	8,052,034 円
新興国株式ファンダメンタル・インデックスフ ァンド (為替ヘッジなし/適格機関投資家専 用)	656,796 円
DCダイワ新興国株式ファンダメンタル・イン デックスファンド	1,592,775,956 円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式	325,849,916 円
ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド	106,055,715 円
計	12,709,389,700 円
2. 期末日における受益権の総数	12,709,389,700 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	2024年3月7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	2024年3月7日現在				
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超			
市場取引					
株価指数 先物取引					
買建	2,069,392,308		-	2,147,638,239	78,245,931
合計	2,069,392,308		-	2,147,638,239	78,245,931

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

2. 通貨関連

種類	2024年3月7日現在				
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超			
市場取引以外の取引					

種類	2024年3月7日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
為替予約取引				
買建	191,136,512	-	189,898,752	△1,237,760
アメリカ・ドル	191,136,512	-	189,898,752	△1,237,760
合計	191,136,512	-	189,898,752	△1,237,760

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2024年3月7日現在
1口当たり純資産額	2.4519円
(1万口当たり純資産額)	(24,519円)

「ダイワ新興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3月7日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	685,048,780
コール・ローン	256,926,541
国債証券	42,727,689,088
派生商品評価勘定	213,093
未収利息	616,424,819
前払費用	65,622,873
流動資産合計	44,351,925,194
資産合計	44,351,925,194
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,680,022
未払金	271,769,327
未払解約金	72,354,124
流動負債合計	349,803,473
負債合計	349,803,473
純資産の部	
元本等	
元本	※1 24,025,558,067
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金(△)	19,976,563,654
元本等合計	44,002,121,721
純資産合計	44,002,121,721
負債純資産合計	44,351,925,194

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2023 年 9 月 8 日 至 2024 年 3 月 7 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024 年 3 月 7 日現在
1. ※1 期首	2023 年 9 月 8 日
期首元本額	22,164,970,341 円
期中追加設定元本額	2,278,558,756 円
期中一部解約元本額	417,971,030 円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
新興国債券インデックスファンド (FOFs 用)	510,956,906 円
(適格機関投資家専用)	

区分	2024年3月7日現在
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)	396,119,412 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)	410,230,486 円
D-I's 新興国債券インデックス	59,320,083 円
iFree 新興国債券インデックス	8,389,311,391 円
iFree 8資産バランス	4,564,441,689 円
ダイワ新興国債券インデックス (為替ヘッジな し) (投資一任専用)	4,356,489 円
DCダイワ新興国債券インデックスファンド スタイル9 (8資産分散・保守型)	9,522,372,654 円 16,803 円
スタイル9 (8資産分散・バランス型)	233,501 円
スタイル9 (8資産分散・積極型)	279,120 円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券	127,497,998 円
ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド	40,421,535 円
計	24,025,558,067 円
2. 期末日における受益権の総数	24,025,558,067 口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年3月7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ありま 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	2024年3月7日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				

種類	2024年3月7日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価	評価損益
			(円)	(円)
売建	260,704,744	-	260,704,744	-
エジプト・ポンド	260,704,744	-	260,704,744	-
買建	549,901,127	-	544,434,198	△5,466,929
アメリカ・ドル	260,704,744	-	257,449,111	△3,255,633
チェコ・コルナ	88,294,327	-	88,105,162	△189,165
トルコ・リラ	22,855,330	-	21,954,918	△900,412
ハンガリー・フォリント	68,645,688	-	68,351,114	△294,574
ルーマニア・レイ	109,401,038	-	108,573,893	△827,145
合計	810,605,871	-	805,138,942	△5,466,929

(注) 1. 時価の算定方法

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

(1口当たり情報)

	2024年3月7日現在
1口当たり純資産額	1.8315円
(1万口当たり純資産額)	(18,315円)

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年3月7日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,833,651,390
株式 ※2※3	330,290,443,790
派生商品評価勘定	987,500
未収入金	75,920,000
未収配当金	476,163,901
未収利息	830,016
その他未収収益 ※4	12,173,001
流動資産合計	342,690,169,598
資産合計	342,690,169,598
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	271,650
前受金	10,590,000
未払解約金	294,324,570
受入担保金	8,071,436,351
流動負債合計	8,376,622,571
負債合計	8,376,622,571
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	171,096,655,533
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金(△)	163,216,891,494
元本等合計	334,313,547,027
純資産合計	334,313,547,027
負債純資産合計	342,690,169,598

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2023 年 9 月 8 日 至 2024 年 3 月 7 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 3 月 7 日現在
1. ※1 期首	2023 年 9 月 8 日
期首元本額	161,837,366,239 円
期中追加設定元本額	17,669,444,359 円
期中一部解約元本額	8,410,155,065 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	2,780,283,996 円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A	4,245,473,200 円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドVA2	909,626 円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	11,494,528 円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	151,871,960 円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	12,849,175 円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	371,094,323 円
国内株式ファンド(適格機関投資家専用)	726,618,124 円

区分	2024年3月7日現在
日本株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	695,322,713円
D-I's TOPIXインデックス	13,667,885円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	240,805,898円
iFree TOPIXインデックス	7,585,017,204円
iFree 8資産バランス	4,603,694,419円
iFree 年金バランス	1,010,956,398円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	2,044,264円
DCダイワ日本株式インデックス	71,473,779,569円
ダイワ・ライフ・バランス30	3,069,706,986円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,955,749,760円
ダイワ・ライフ・バランス70	5,792,519,089円
年金ダイワ日本株式インデックス	7,503,683,653円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	49,432,221円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	74,062,221円
ダイワつみたてインデックス日本株式	5,214,433,061円
ダイワつみたてインデックスバランス30	12,570,720円
ダイワつみたてインデックスバランス50	12,241,401円
ダイワつみたてインデックスバランス70	30,690,843円
ダイワ国内株式インデックス (ラップ専用)	14,251,662,259円
ダイワ世界バランスファンド40VA	49,260,698円
ダイワ世界バランスファンド60VA	19,683,241円
ダイワ・バランスファンド35VA	3,435,891,740円
ダイワ・バランスファンド25VA (適格機関投資家専用)	335,464,120円
ダイワ国内バランスファンド25VA (適格機関投資家専用)	51,746,439円
ダイワ国内バランスファンド30VA (適格機関投資家専用)	61,809,730円
ダイワ・ノーロード TOPIXファンド	224,563,326円
ダイワファンドラップ TOPIXインデックス	11,999,786,890円
ダイワTOPIXインデックス (ダイワSMA専用)	6,759,657,880円
ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス	3,204,746,037円
スタイル9 (4資産分散・保守型)	148,535円
スタイル9 (4資産分散・バランス型)	966,855円
スタイル9 (4資産分散・積極型)	1,371,032円
スタイル9 (6資産分散・保守型)	110,245円
スタイル9 (6資産分散・バランス型)	1,694,690円
スタイル9 (6資産分散・積極型)	2,090,384円
スタイル9 (8資産分散・保守型)	135,545円
スタイル9 (8資産分散・バランス型)	1,341,273円
スタイル9 (8資産分散・積極型)	3,946,594円
ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,090,993,427円
ダイワライフスタイル25	99,766,533円
ダイワライフスタイル50	463,444,913円
ダイワライフスタイル75	389,645,095円
DC・ダイワ・トピックス・インデックス (確定拠出年金専用ファンド)	8,005,754,815円

区分	2024年3月7日現在
計	171,096,655,533 円
2. 期末日における受益権の総数	171,096,655,533 口
3. ※2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 7,678,285,730 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 745,840,000 円
5. ※4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年3月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種類	2024年3月7日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超		
市場取引				
株価指数 先物取引				
買建	4,129,435,000	-	4,130,235,000	800,000
合計	4,129,435,000	-	4,130,235,000	800,000

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

(1口当たり情報)

	2024年3月7日現在
1口当たり純資産額	1.9539円
(1万口当たり純資産額)	(19,539円)

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

貸借対照表

	2024年3月7日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,479,750,656
コール・ローン	5,568,481,343
株式	454,344,057,020
投資証券	9,480,803,885
派生商品評価勘定	892,208,529
未収入金	300,804
未収配当金	545,878,034
差入委託証拠金	10,263,182,990
流動資産合計	485,574,663,261
資産合計	485,574,663,261
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,768,526
未払金	5,384,392
未払解約金	440,441,200
流動負債合計	468,594,118
負債合計	468,594,118
純資産の部	
元本等	
元本	※1 81,346,244,579
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金(△)	403,759,824,564
元本等合計	485,106,069,143
純資産合計	485,106,069,143
負債純資産合計	485,574,663,261

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2023 年 9 月 8 日 至 2024 年 3 月 7 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>

区分	自 2023 年 9 月 8 日 至 2024 年 3 月 7 日
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024 年 3 月 7 日現在
1. ※1 期首	2023 年 9 月 8 日
期首元本額	76,227,957,902 円
期中追加設定元本額	7,145,452,589 円
期中一部解約元本額	2,027,165,912 円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国株式インデックスVA	239,628,177 円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	1,832,831 円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	21,180,681 円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	4,097,965 円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	119,852,211 円
外国株式インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	104,051,558 円
ダイワバランスファンド2023-01(適格機関投資家専用)	81,610,632 円
外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	9,064,927 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)	733,118,242 円
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)	4,842,195,913 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)	531,666,389 円
D-I's 外国株式インデックス	18,247,309 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	51,241,820 円
i F r e e 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)	8,018,973,377 円
i F r e e 8資産バランス	1,472,345,859 円

区分	2024年3月7日現在
i F r e e 年金バランス	325,845,989円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	9,880,806円
DCダイワ外国株式インデックス	49,177,556,625円
ダイワ・ライフ・バランス30	491,601,000円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,056,045,151円
ダイワ・ライフ・バランス70	1,036,590,105円
大和DC海外株式インデックスファンド	2,061,082,152円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	11,256,987円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	12,680,092円
ダイワつみたてインデックス外国株式	2,303,416,019円
ダイワつみたてインデックスバランス30	2,010,054円
ダイワつみたてインデックスバランス50	2,600,973円
ダイワつみたてインデックスバランス70	5,491,228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）	12,039,434円
ダイワ世界バランスファンド40VA	47,560,126円
ダイワ世界バランスファンド60VA	31,675,416円
ダイワ・バランスファンド35VA	829,334,073円
ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	45,862,957円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	127,189,928円
スタイル9（4資産分散・保守型）	63,411円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	418,856円
スタイル9（4資産分散・積極型）	602,905円
スタイル9（6資産分散・保守型）	46,855円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	733,032円
スタイル9（6資産分散・積極型）	917,537円
スタイル9（8資産分散・保守型）	51,099円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	508,815円
スタイル9（8資産分散・積極型）	1,573,423円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,329,492,405円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	416,449,642円
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）	2,409,669,208円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,110,447,720円
ダイワライフスタイル25	8,036,086円
ダイワライフスタイル50	37,096,962円
ダイワライフスタイル75	31,292,973円
ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	81,305,208円
ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	78,711,436円
計	81,346,244,579円
2. 期末日における受益権の総数	81,346,244,579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	2024年3月7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	2024年3月7日現在				
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超			
市場取引					
株価指数 先物取引					
買建	20,473,414,722		-	21,362,296,675	888,881,953
合計	20,473,414,722		-	21,362,296,675	888,881,953

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

2. 通貨関連

種類	2024年3月7日現在				
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超			
市場取引以外の取引					

種類	2024年3月7日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価	評価損益
			(円)	(円)
為替予約取引				
買建	5,264,659,180	-	5,245,217,230	△19,441,950
アメリカ・ドル	1,793,824,800	-	1,780,300,800	△13,524,000
イギリス・ポンド	207,653,600	-	207,871,840	218,240
オーストラリア・ドル	457,531,840	-	458,605,320	1,073,480
カナダ・ドル	892,445,040	-	889,427,790	△3,017,250
スイス・フラン	780,555,600	-	775,814,380	△4,741,220
ユーロ	1,132,648,300	-	1,133,197,100	548,800
合計	5,264,659,180	-	5,245,217,230	△19,441,950

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2024年3月7日現在
1口当たり純資産額	5.9635円
(1万口当たり純資産額)	(59,635円)

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年3月7日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	3,196,396,677
コール・ローン	2,865,244,315
国債証券	289,801,523,792
派生商品評価勘定	3,519,498
未収入金	29,240
未収利息	2,114,711,313
前払費用	98,445,593
流動資産合計	298,079,870,428
資産合計	298,079,870,428
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,817,060
未払解約金	227,809,761
流動負債合計	235,626,821
負債合計	235,626,821
純資産の部	
元本等	
元本	※1 83,961,869,683
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金(△)	213,882,373,924
元本等合計	297,844,243,607
純資産合計	297,844,243,607
負債純資産合計	298,079,870,428

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2023 年 9 月 8 日 至 2024 年 3 月 7 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024 年 3 月 7 日現在
1. ※1 期首	2023 年 9 月 8 日
期首元本額	81,490,428,967 円
期中追加設定元本額	5,419,456,164 円
期中一部解約元本額	2,948,015,448 円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国債券インデックスVA	367,789,847 円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	5,975,681 円

区分	2024年3月7日現在
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	35,804,383円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	15,003,665円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	199,641,525円
外国債券インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	668,174,473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)	11,378,572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)	823,863,406円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)	3,992,358,912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)	853,183,416円
D-I's 外国債券インデックス	1,747,751円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	21,013,173円
iFree 外国債券インデックス	2,121,499,087円
iFree 8資産バランス	2,373,330,287円
iFree 年金バランス	550,810,906円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	1,112,497円
DCダイワ外国債券インデックス	51,500,648,535円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,170,361,709円
ダイワ・ライフ・バランス50	846,719,605円
ダイワ・ライフ・バランス70	700,051,636円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	706,918,628円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	563,051,644円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	226,692,958円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	36,391,802円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	20,200,629円
ダイワつみたてインデックス外国債券	2,130,245,946円
ダイワつみたてインデックスバランス30	4,810,287円
ダイワつみたてインデックスバランス50	2,147,681円
ダイワつみたてインデックスバランス70	3,707,598円
ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ラップ専用)	1,393,009,398円
ダイワ世界バランスファンド40VA	93,618,555円
ダイワ世界バランスファンド60VA	26,719,162円
ダイワ・バランスファンド35VA	2,756,517,844円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	173,032,486円
スタイル9(4資産分散・保守型)	36,051円
スタイル9(4資産分散・バランス型)	360,209円
スタイル9(4資産分散・積極型)	377,340円
スタイル9(6資産分散・保守型)	14,856円

区分	2024年3月7日現在
スタイル9 (6資産分散・バランス型)	255,075 円
スタイル9 (6資産分散・積極型)	101,130 円
スタイル9 (8資産分散・保守型)	17,686 円
スタイル9 (8資産分散・バランス型)	229,094 円
スタイル9 (8資産分散・積極型)	277,999 円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	142,991,650 円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	70,619,311 円
ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジなし) (ダイワSMA専用)	3,456,913,444 円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,787,910,600 円
ダイワライフスタイル25	26,763,490 円
ダイワライフスタイル50	59,974,508 円
ダイワライフスタイル75	17,493,556 円
計	83,961,869,683 円
2. 期末日における受益権の総数	83,961,869,683 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	2024年3月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	2024年3月7日現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	2,637,169,586	-	2,632,872,024	△4,297,562

種類	2024年3月7日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価	評価損益
			(円)	(円)
アメリカ・ドル	270,508,707	-	269,028,974	△1,479,733
イギリス・ポンド	132,056,983	-	132,338,874	281,891
イスラエル・シケル	102,502,633	-	101,803,901	△698,732
オーストラリア・ドル	36,306,087	-	36,497,725	191,638
オフショア・人民元	1,147,712,607	-	1,142,461,681	△5,250,926
カナダ・ドル	89,102,694	-	89,065,073	△37,621
ポーランド・ズロチ	69,697,910	-	70,154,392	456,482
メキシコ・ペソ	133,719,043	-	134,754,192	1,035,149
ユーロ	655,562,922	-	656,767,212	1,204,290
合計	2,637,169,586	-	2,632,872,024	△4,297,562

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2024年3月7日現在
1口当たり純資産額	3.5474円
(1万口当たり純資産額)	(35,474円)

「ダイワJ-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3月7日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,401,440,078
投資証券 ※2	342,656,693,800
未収入金	415,432,789
未収配当金	5,791,217,881
前払金	35,560,000
差入委託証拠金	517,636,470
流動資産合計	353,817,981,018
資産合計	353,817,981,018
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	156,576,000
未払解約金	1,656,460,000
流動負債合計	1,813,036,000
負債合計	1,813,036,000
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	115,030,593,752
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金(△)	236,974,351,266
元本等合計	352,004,945,018
純資産合計	352,004,945,018
負債純資産合計	353,817,981,018

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2023 年 9 月 8 日 至 2024 年 3 月 7 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 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。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024 年 3 月 7 日現在
1. ※1 期首	2023 年 9 月 8 日
期首元本額	136,692,550,176 円
期中追加設定元本額	3,848,055,921 円
期中一部解約元本額	25,510,012,345 円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ J-REIT オープン	3,789,009,541 円
ダイワ J-REIT オープン (毎月分配型)	96,835,694,583 円
ダイワ J-REIT オープン (年 1 回決算型)	513,491,627 円
DC ダイワ・ターゲットイヤー2050	24,010,160 円
iFree J-REIT インデックス	722,185,211 円
iFree 8 資産バランス	2,631,950,433 円
ダイワ J-REIT オープン (奇数月決算型)	38,216,182 円
DC ダイワ・ターゲットイヤー2060	204,247 円
DC・ダイワ J-REIT オープン	5,334,965,625 円
DC ダイワ・ターゲットイヤー2030	9,050,987 円
DC ダイワ・ターゲットイヤー2040	10,044,577 円
ダイワ国内 REIT インデックス (投資一任専用)	3,922,110 円
ダイワ・ノーロード J-REIT ファンド	96,869,894 円

区分	2024年3月7日現在
ダイワファンドラップ J-REITインデックス	3,223,835,553 円
ダイワ J-REITインデックス (ダイワ SMA 専用)	462,065,649 円
ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス	548,552,218 円
スタイル9 (6資産分散・保守型)	22,049 円
スタイル9 (6資産分散・バランス型)	420,782 円
スタイル9 (6資産分散・積極型)	239,442 円
スタイル9 (8資産分散・保守型)	23,672 円
スタイル9 (8資産分散・バランス型)	297,827 円
スタイル9 (8資産分散・積極型)	179,903 円
ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	785,341,480 円
計	115,030,593,752 円
2. 期末日における受益権の総数	115,030,593,752 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 1,468,150,000 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	2024年3月7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	2024年3月7日現在			
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)
		1年超		
市場取引				

種類	2024年3月7日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
不動産投信 指数先物取引 買建	9,507,960,000	-	9,352,000,000	△155,960,000
合計	9,507,960,000	-	9,352,000,000	△155,960,000

- (注)
1. 時価の算定方法
不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場
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3月7日現在
1口当たり純資産額	3.0601円
(1万口当たり純資産額)	(30,601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

	2024年3月7日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	526,266,943
コール・ローン	238,856,220
投資信託受益証券	1,403,924,871
投資証券	35,482,385,715
派生商品評価勘定	27,456,558
未収入金	2,375,994
未収配当金	70,360,968
差入委託証拠金	303,676,387
流動資産合計	38,055,303,656
資産合計	38,055,303,656
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	15,481,115
未払金	51,715,901
未払解約金	39,350,600
流動負債合計	106,547,616
負債合計	106,547,616
純資産の部	
元本等	
元本	※1 10,496,591,059
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金(△)	27,452,164,981
元本等合計	37,948,756,040
純資産合計	37,948,756,040
負債純資産合計	38,055,303,656

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2023 年 9 月 8 日 至 2024 年 3 月 7 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、市場価格のない有価証券については投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。また、市場価格のある有価証券については、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>

区分	自 2023 年 9 月 8 日 至 2024 年 3 月 7 日
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024 年 3 月 7 日現在
1. ※1 期首	2023 年 9 月 8 日
期首元本額	10,116,723,115 円
期中追加設定元本額	997,777,667 円
期中一部解約元本額	617,909,723 円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワバランスファンド 2023-01 (適格機関投資家専用)	89,113,817 円
ダイワファンドラップ 外国 R E I T インデックス (為替ヘッジなし)	1,766,479,242 円
ダイワファンドラップオンライン 外国 R E I T インデックス (為替ヘッジなし)	270,195,430 円
D-I's グローバル R E I T インデックス	1,453,374 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	17,608,256 円
i F r e e 外国 R E I T インデックス	672,484,935 円
i F r e e 8資産バランス	2,357,825,925 円
グローバル・リート・インデックスファンド (資産形成型)	366,389,986 円
グローバル・リート・インデックスファンド (毎月決算型)	246,764,072 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	2,017,553 円
DCダイワ・グローバル R E I T インデックスファンド	4,083,638,977 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	7,803,784 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	8,728,497 円
ダイワ海外 R E I T インデックス (為替ヘッジなし) (投資一任専用)	3,453,177 円
ダイワバランスファンド 2021-02 (適格機関投資家専用)	138,883,701 円
スタイル 9 (6資産分散・保守型)	15,232 円
スタイル 9 (6資産分散・バランス型)	287,284 円
スタイル 9 (6資産分散・積極型)	247,086 円

区分	2024年3月7日現在
スタイル9 (8資産分散・保守型)	16,265円
スタイル9 (8資産分散・バランス型)	203,512円
スタイル9 (8資産分散・積極型)	177,243円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	212,890,651円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファン ド	62,472,726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)	14,218,168円
ダイワバランスファンド 2023-08 (適格機関投資 家専用)	88,790,418円
ダイワバランスファンド 2024-01 (適格機関投資 家専用)	84,431,748円
計	10,496,591,059円
2. 期末日における受益権の総数	10,496,591,059口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年3月7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ありま 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あります。 (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	2024年3月7日現在				
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超			
市場取引					
不動産投信 指数先物取引					
買建	1,078,461,078		-	1,091,222,354	12,761,276

種類	2024年3月7日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超		
合計	1,078,461,078	-	1,091,222,354	12,761,276

- (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3月7日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	228,382,744	-	227,596,911	△785,833
アメリカ・ドル	152,333,501	-	151,510,820	△822,681
ユーロ	76,049,243	-	76,086,091	36,848
合計	228,382,744	-	227,596,911	△785,833

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

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2024年3月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.6153円 (36,153円)

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」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3月7日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	9,550,734,896
国債証券	64,237,132,660
地方債証券	4,098,426,728
特殊債券	2,552,261,674
社債券	4,767,658,000
未収利息	117,335,160
前払費用	26,366,228
流動資産合計	85,349,915,346
資産合計	85,349,915,346
負債の部	
流動負債	
未払金	9,238,945,400
未払解約金	9,043,719
流動負債合計	9,247,989,119
負債合計	9,247,989,119
純資産の部	
元本等	
元本	※1 62,273,757,083
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	13,828,169,144
元本等合計	76,101,926,227
純資産合計	76,101,926,227
負債純資産合計	85,349,915,346

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2023 年 9 月 8 日 至 2024 年 3 月 7 日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024 年 3 月 7 日現在
1. ※1 期首	2023 年 9 月 8 日
期首元本額	41,118,291,684 円
期中追加設定元本額	21,627,164,926 円
期中一部解約元本額	471,699,527 円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
日本債券インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)	3,121,320,010 円
日本債券インデックスファンド VA (適格機関投資家専用)	16,350,455,790 円
i F r e e 日本債券インデックス	3,170,916,399 円
i F r e e 8資産バランス	6,802,695,669 円
ダイワ・ライフ・バランス 30	12,222,371,347 円
ダイワ・ライフ・バランス 50	9,666,218,341 円
ダイワ・ライフ・バランス 70	4,053,303,583 円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	2,025,964,586 円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	1,607,163,318 円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	647,204,896 円
ダイワつみたてインデックス日本債券	2,269,536,236 円
ダイワつみたてインデックスバランス 30	50,428,032 円
ダイワつみたてインデックスバランス 50	24,733,228 円
ダイワつみたてインデックスバランス 70	21,464,632 円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	193,572,006 円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	46,409,010 円
計	62,273,757,083 円

区分	2024年3月7日現在
2. 期末日における受益権の総数	62,273,757,083口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年3月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2024年3月7日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2024年3月7日現在
1口当たり純資産額	1.2221円
(1万口当たり純資産額)	(12,221円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2024年3月29日

I 資産総額	71,353,540,272 円
II 負債総額	47,147,502 円
III 純資産総額 (I - II)	71,306,392,770 円
IV 発行済数量	40,186,570,759 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.7744 円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2024年3月29日

I 資産総額	351,996,267,769 円
II 負債総額	6,868,591,146 円
III 純資産総額 (I - II)	345,127,676,623 円
IV 発行済数量	171,840,632,066 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	2.0084 円

(参考) ダイワ J-REIT マザーファンド

純資産額計算書

2024年3月29日

I 資産総額	368,739,197,082 円
II 負債総額	1,273,005,900 円
III 純資産総額 (I - II)	367,466,191,182 円
IV 発行済数量	112,334,945,316 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	3.2712 円

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)

純資産額計算書

2024年3月29日

I 資産総額	90,919,993,938 円
II 負債総額	221,535,899 円
III 純資産総額 (I - II)	90,698,458,039 円
IV 発行済数量	74,249,074,853 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.2215 円

(参考) ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2024年3月29日

I 資産総額	32,364,054,295 円
II 負債総額	524,915,732 円
III 純資産総額 (I - II)	31,839,138,563 円
IV 発行済数量	12,801,204,632 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	2.4872 円

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年3月29日

I 資産総額	517,366,607,498 円
II 負債総額	203,154,573 円
III 純資産総額 (I - II)	517,163,452,925 円
IV 発行済数量	83,093,949,096 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	6.2238 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

2024年3月29日

I 資産総額	39,680,757,541 円
II 負債総額	294,149,644 円
III 純資産総額 (I - II)	39,386,607,897 円
IV 発行済数量	10,573,693,770 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	3.7250 円

(参考) ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2024年3月29日

I 資産総額	45,347,176,299 円
II 負債総額	644,252,265 円
III 純資産総額 (I - II)	44,702,924,034 円
IV 発行済数量	24,249,193,199 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.8435 円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年3月29日

I 資産総額	309,309,675,902 円
II 負債総額	4,668,358,029 円
III 純資産総額 (I - II)	304,641,317,873 円
IV 発行済数量	84,984,162,352 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	3.5847 円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2024年3月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

① 会社の意思決定機構

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

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

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

② 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. 商品会議

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

ロ. 商品担当役員

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ. リスクマネジメント会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2024年3月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	87	291,304
追加型株式投資信託	798	29,461,519
株式投資信託 合計	885	29,752,823
単位型公社債投資信託	98	178,379
追加型公社債投資信託	14	1,544,340
公社債投資信託 合計	112	1,722,719
総合計	997	31,475,542

3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第64期事業年度（2022年4月1日から2023年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第65期事業年度に係る中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

3. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

独立監査人の監査報告書

2023年5月26日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第64期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRL データは監査の対象には含まれていません。

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

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

(単位:百万円)

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

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

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

(単位:百万円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

(単位：百万円)

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

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	15～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 収益及び費用の計上基準

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

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

(重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

(会計方針の変更に関する注記)

(時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用)

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

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

(貸借対照表関係)

※1 有形固定資産の減価償却累計額

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

※2 関係会社項目

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

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

3 保証債務

前事業年度(2022年3月31日)

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

当事業年度(2023年3月31日)

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額 (百万円)	1株当たり配当額 (円)	基準日	効力発生日
2021年6月22日 定時株主総会	普通株式	9,388	3,599	2021年 3月31日	2021年 6月23日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
2022年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

(i) 為替変動リスクの管理

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

(ii) 価格変動リスクの管理

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

②信用リスクの管理

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

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

前事業年度（2022年3月31日）

（1）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券及び投資有価証券	66	—	—	66
資産合計	66	—	—	66

当事業年度（2023年3月31日）

（1）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

（2）時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

（注1）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

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

(単位：百万円)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度 (2022年3月31日)

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

当事業年度 (2023年3月31日)

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

2. その他有価証券

前事業年度 (2022年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	66	55	11
(2) その他	6,755	4,917	1,838
小計	6,822	4,972	1,850
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,753	4,208	△454
小計	3,753	4,208	△454
合計	10,575	9,180	1,395

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

当事業年度（2023年3月31日）

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

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
（１）株式	-	-	-
（２）その他 証券投資信託	1,719	327	59
合計	1,719	327	59

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、証券投資信託について331百万円の減損処理を行っております。

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(注) その他には、臨時に支払った割増退職金等を含んでおります。

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度189百万円、当事業年度184百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

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

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

前事業年度（2022年3月31日）

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

当事業年度（2023年3月31日）

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

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

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

(収益認識関係)

(1) 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

(2) 収益を理解するための基礎となる情報

(重要な会計方針)の4.収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取 (注)	19,000 0	関係会社短期貸付金 受取利息関係会社	24,900 0

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁 (MAS) に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行

行、及びMASへの全ての損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定めるとおりに決定しております。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
- (注2) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。
- (注3) 差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し交渉の上、決定しております。
- (注4) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

2. 親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,078.50円	1株当たり純資産額	14,983.42円
1株当たり当期純利益	4,883.43円	1株当たり当期純利益	3,955.35円

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

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年11月27日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 間瀬 友未

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 渡部 啓太

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第65期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRL データは監査の対象には含まれていません。

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

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

(単位:百万円)

当中間会計期間
(2023年9月30日)

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

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	11,505	11,879	38,549
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△10,316	△10,316	△10,316
中間純利益	-	-	-	5,405	5,405	5,405
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	△4,910	△4,910	△4,910
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,594	6,594	33,638

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	534	534	39,084
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△10,316
中間純利益	-	-	5,405
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	438	438	438
当中間期変動額合計	438	438	△4,472
当中間期末残高	973	973	34,612

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 収益及び費用の計上基準

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

であります。

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

5. グループ通算制度の適用

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

(中間貸借対照表関係)

※1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2023年9月30日現在)
有形固定資産	340百万円

※2 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

3 保証債務

当中間会計期間 (2023年9月30日現在)

子会社であるDaiwa Asset Management (Singapore) Ltd. の債務2,299百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

※1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
有形固定資産	10百万円
無形固定資産	230百万円

※2 営業外収益の主要項目

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

※3 営業外費用の主要項目

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

※4 特別損失の項目

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位: 千株)

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

2. 配当に関する事項

配当金支払額

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

(金融商品関係)

当中間会計期間 (2023年9月30日)

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

(1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位: 百万円)

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

(2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

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

(単位：百万円)

区分	当中間会計期間
非上場株式	666
子会社株式	1,448
関連会社株式	2,027

(有価証券関係)

当中間会計期間 (2023年9月30日)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

	中間貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	111	55	56
(2) その他	5,511	3,839	1,672
小計	5,623	3,894	1,728
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,297	2,623	△325
小計	2,297	2,623	△325
合計	7,921	6,518	1,403

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

(収益認識関係)

(1) 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が 36,557 百万円、その他 322 百万円であります。

(2) 収益を理解するための基礎となる情報

(重要な会計方針) の 4. 収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

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

[関連情報]

当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
1株当たり純資産額	13,268.89円
1株当たり中間純利益	2,072.34円

(注1) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
中間純利益(百万円)	5,405
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,405
普通株主に帰属しない金額(百万円)	—
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

5 【その他】

- a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項
提出日前1年以内において、定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項に該当する事実はありません。
- b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実
訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

追加型証券投資信託

(i F r e e 8 資産バランス)

約 款

大和アセットマネジメント株式会社

運用の基本方針

約款第18条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

2. 運用方法

(1) 投資対象

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。

※ 各マザーファンドは、それぞれかつこ内に掲げる指数に採用されている資産に投資を行ない、投資成果を当該指数の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

イ. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券

（東証株価指数（配当込み））

ロ. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券

（MSCI コクサイ指数（配当込み、円ベース））

ハ. ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの受益証券

（FTSE RAFI エマージング インデックス（円換算））

ニ. 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

（NOMURA-BPI 総合指数）

ホ. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

（FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））

ヘ. ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券

（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（円換算））

ト. ダイワJ-REITマザーファンドの受益証券

（東証REIT指数（配当込み））

チ. 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

（S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース））

(2) 投資態度

① 主として、マザーファンドの受益証券を通じて、次の資産クラスに投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

イ. 国内株式

ロ. 先進国株式

ハ. 新興国株式

ニ. 国内債券

ホ. 先進国債券

ヘ. 新興国債券

ト. 国内リート

チ. 海外リート

② 各資産クラスの配分比率については、均等とすることを目標とします。

③ 各資産クラスの配分比率の合計は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

④ 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

⑤ 安定した収益の確保および効率的な運用を行なうためのものとして定める次の目的により投資する場合を除き、法人税法第61条の5第1項に規定するデリバティブ取引にかかる権利に対する投資として運用を行ないません。

イ. 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的

ロ. 信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスク（為替相場の変動、市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいいます。）を減じる目的

ハ. 法人税法施行規則第27条の7第1項第6号に規定する先物外国為替取引により、信託財産の資産または負債について為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的

- ⑥ 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想される
とき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれな
いことがあります。

(3) 投資制限

- ① 株式への投資制限
株式への直接投資は、行ないません。
- ② 外貨建資産への投資制限
外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

3. 収益分配方針

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

追加型証券投資信託
(i F r e e 8 資産バランス)
約 款

(信託の種類、委託者および受託者、信託事務の委託)

第 1 条 この信託は、証券投資信託であり、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者とします。

- ② この信託は、信託法(平成18年法律第108号)(以下「信託法」といいます。)の適用を受けます。
- ③ 受託者は、信託法第28条第1号に基づく信託事務の委託として、信託事務の処理の一部について、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第1条第1項の規定による信託業務の兼営の認可を受けた一の金融機関(受託者の利害関係人(金融機関の信託業務の兼営等に関する法律第2条第1項にて準用する信託業法第29条第2項第1号に規定する利害関係人をいいます。以下本条、第17条第1項、同条第2項および第22条において同じ。)を含みます。)と信託契約を締結し、これを委託することができます。
- ④ 前項における利害関係人に対する業務の委託については、受益者の保護に支障を生じることがない場合に行なうものとします。

(信託の目的および金額)

第 2 条 委託者は、金1,000万円を受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

(信託金の限度額)

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

- ② 委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第 4 条 この信託の期間は、信託契約締結日から第40条第1項、第41条第1項、第42条第1項および第44条第2項の規定による信託終了日までとします。

(受益権の取得申込の勧誘の種類)

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

(当初の受益者)

第 6 条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第7条の規定により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

(受益権の分割および再分割)

第 7 条 委託者は、第2条の規定による受益権については1,000万口に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第8条第1項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

- ② 委託者は、受託者と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律(以下「社振法」といいます。)に定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。
- ③ 前項の規定により受益権の再分割を行なうにあたり、各受益者が保有する受益権口数に1口未満の端数が生じることとなる場合には、当該端数を切り捨てるものとし、当該端数処理は口座管理機関ごとに行ないます。また、各受益者が保有することとなる受益権口数の合計数と、受益権の再分割の比率に基づき委託者が計算する受益権口数の合計数との間に差が生じることとなる場合には、委託者が計算する受益権口数を当該差分減らし、当該口数にかかる金額については益金として計上することとします。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算方法)

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

- ② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額(以下「純資産総額」といいます。)を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。
- ③ 外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。)、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。
- ④ 第20条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相

場の仲値によるものとします。

(信託日時の異なる受益権の内容)

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

(受益権の帰属と受益証券の不発行)

第10条 この信託のすべての受益権は、社振法の規定の適用を受け、受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。

- ② 委託者は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。
- ③ 委託者は、第7条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定に従い、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。

(受益権の設定にかかる受託者の通知)

第11条 受託者は、信託契約締結日に生じた受益権については信託契約締結時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないます。

(受益権の申込単位および価額)

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

- ② 委託者の指定する第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者をいいます。）および登録金融機関（金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。）（以下総称して「指定販売会社」といいます。）は、第7条第1項の規定により分割される受益権の取得申込者に対し、最低単位を1円単位または1口単位として指定販売会社が定める単位をもって取得の申込に応じることができます。ただし、指定販売会社と別に定める積立投資約款に従い積立投資契約を結んだ取得申込者に限り、1口の整数倍をもって取得の申込に応じることができるものとします。
- ③ 前項の取得申込者は指定販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、指定販売会社は、当該取得申込の代金（第5項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行なうことができます。
- ④ 第1項および第2項の規定にかかわらず、委託者および指定販売会社は、別に定める取引所または銀行のいずれかの休業日と同じ日付の日を取得申込受付日とする受益権の取得申込の受付を行ないません。
- ⑤ 第1項および第2項の受益権の価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、委託者または指定販売会社が別に定める手数料ならびに当該手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込にかかる受益権の価額は、1口につき1円に、委託者または指定販売会社が別に定める手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を加算した価額とします。
- ⑥ 前項の規定にかかわらず、受益者が積立投資契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、第30条に規定する各計算期間終了日の基準価額とします。
- ⑦ 前各項の規定にかかわらず、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいい、単に「取引所」といいます。）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（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規

制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等)による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等)が発生し、委託者が追加設定を制限する措置をとった場合には、指定販売会社は、取得申込の受付を中止することができるほか、すでに受け付けた取得申込を取消することができるものとします。

(受益権の譲渡にかかる記載または記録)

第13条 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前項の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等(当該他の振替機関等の上位機関を含みます。)に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

③ 委託者は、第1項に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(受益権の譲渡の対抗要件)

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

(投資の対象とする資産の種類)

第15条 この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

(有価証券および金融商品の指図範囲等)

第16条 委託者は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の第1号から第8号までに掲げる親投資信託(以下総称して「マザーファンド」といいます。)の受益証券、ならびに次の第9号から第12号までに掲げる有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができます。

1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
 2. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
 3. ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの受益証券
 4. 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
 5. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
 6. ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券
 7. ダイワJ-REITマザーファンドの受益証券
 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
 9. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
 10. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券の性質を有するもの
 11. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 12. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- ② 委託者は、信託金を、前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。
1. 預金
 2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

- ③ 第1項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を、前項に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。

(利害関係人等との取引等)

第17条 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者（第三者との間において信託財産のためにする取引その他の行為であって、受託者が当該第三者の代理人となつて行なうものを含みます。）および受託者の利害関係人、第22条第1項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、第15条、第16条第1項および同条第2項に掲げる資産への投資等ならびに第20条、第25条から第27条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行なうことができます。

- ② 受託者は、受託者がこの信託の受託者としての権限に基づいて信託事務の処理として行なうことができる取引その他の行為について、受託者または受託者の利害関係人の計算で行なうことができるものとします。なお、受託者の利害関係人が当該利害関係人の計算で行なう場合も同様とします。

- ③ 委託者は、金融商品取引法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、信託財産と、委託者、その取締役、執行役および委託者の利害関係人等（金融商品取引法第31条の4第3項および同条第4項に規定する親法人等または子法人等をいいます。）または委託者が運用の指図を行なう他の信託財産との間で、第15条、第16条第1項および同条第2項に掲げる資産への投資等ならびに第20条、第25条から第27条までに掲げる取引その他これらに類する行為を行なうことの指図をすることができ、受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行なうことができます。

- ④ 前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行ないません。

(運用の基本方針)

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

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第19条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

(外国為替予約取引の指図)

第20条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

(信用リスク集中回避のための投資制限)

第21条 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

(信託業務の委託等)

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

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行なう体制が整備されていること
4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

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

（混蔵寄託）

第23条 金融機関または第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者の名義で混蔵寄託できるものとします。

（信託財産の登記等および記載等の留保等）

第24条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

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

（一部解約の請求および有価証券売却等の指図）

第25条 委託者は、信託財産に属するマザーファンドの受益証券にかかる信託契約の一部解約の請求および信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

（再投資の指図）

第26条 委託者は、前条の規定による一部解約代金および売却代金、有価証券にかかる償還金等、有価証券等にかかる利子等およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

（資金の借入れ）

第27条 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

- ② 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- ③ 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ④ 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

（損益の帰属）

第28条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

（受託者による資金の立替え）

第29条 信託財産に属する有価証券について、借替がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

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

(信託の計算期間)

第30条 この信託の計算期間は、毎年9月8日から翌年9月7日までとします。

- ② 前項の規定にかかわらず、前項の規定により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日から次の計算期間が開始されるものとします。

(信託財産に関する報告等)

第31条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

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

(信託事務の諸費用および監査報酬)

第32条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託者の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

- ② 信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。

(信託報酬等の額および支弁の方法)

第33条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第30条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の22の率を乗じて得た額とし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

- ② 前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の6カ月終了日（6カ月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。
- ③ 第1項の信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

(収益の分配方式)

第34条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

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

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第35条 収益分配金は、毎計算期間終了日後1カ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払います。

- ② 前項の規定にかかわらず、積立投資契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が指定販売会社に支払われます。この場合、指定販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込に応じるものとします。当該取得申込により増加した受益権は、第10条第3項の規定に従い、振替口座簿に記載または記録されます。
- ③ 償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）は、信託終了日後1カ月以内の委託者の指定する日から、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として支払います。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。
- ④ 一部解約金は、一部解約請求受付日から起算して、原則として、5営業日目から受益者に支払います。
- ⑤ 前各項（第2項を除きます。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行なうものとします。ただし、委託者の自らの募集にかかる受益権に帰属する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、委託者において行なうものとします。
- ⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

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

第36条 受託者は、収益分配金については原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金については前条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金については前条第4項に規定する支払開始日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

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

（収益分配金および償還金の時効）

第37条 受益者が、収益分配金については第35条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないときならびに信託終了による償還金については第35条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

（信託契約の一部解約）

第38条 受益者は、自己に帰属する受益権につき、最低単位を1口単位として委託者または指定販売会社が定める単位（積立投資契約にかかる受益権については、1口の整数倍とします。）をもって、委託者に一部解約請求をすることができます。

- ② 委託者は、前項の一部解約請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。ただし、委託者は、別に定める取引所または銀行のいずれかの休業日と同じ日付の日を一部解約請求受付日とする一部解約請求の受付を行ないません。なお、前項の一部解約請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。
- ③ 前項の一部解約の価額は、一部解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- ④ 受益者が第1項の一部解約請求をするときは、委託者または指定販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。
- ⑤ 委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生した場合には、第1項による一部解約請求の受付を中止することができます。
- ⑥ 前項により一部解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約請求を撤回しな

い場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約請求を受け付けたものとして、第3項の規定に準じて算出した価額とします。

(質権口記載または記録の受益権の取扱い)

第39条 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

(信託契約の解約)

第40条 委託者は、信託期間中において、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくはこの信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- ② 委託者は、前項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由等の事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、この信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ④ 第2項の書面決議は議決権を行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せん。
- ⑤ 第2項から前項までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第2項から前項までの手続を行なうことが困難な場合も同じとします。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第41条 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い、信託契約を解約し信託を終了させます。

- ② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第45条の規定に従います。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第42条 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

- ② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第45条の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第43条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

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

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第44条 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第45条の規定に従い、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行なう場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。

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

(信託約款の変更等)

第45条 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」）をいいます。

以下同じ。)を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとし、

- ② 委託者は、前項の事項（前項の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前項の併合事項にあっては、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、書面決議を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由等の事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- ③ 前項の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託者を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、この信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ④ 第2項の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
- ⑤ 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- ⑥ 第2項から前項までの規定は、委託者が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- ⑦ 前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。

（反対受益者の受益権買取請求の不適用）

第46条 この信託は、受益者が第38条の規定による一部解約請求を行なったときは、委託者が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、第40条に規定する信託契約の解約または前条に規定する重大な信託約款の変更等を行なう場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

（他の受益者の氏名等の開示の請求の制限）

第47条 この信託の受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行なうことはできません。

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

（運用報告書に記載すべき事項の提供）

第48条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

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

（公告）

第49条 委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。

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

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

（信託約款に関する疑義の取扱い）

第50条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

（付 則）

第 1条 この約款において「積立投資約款」とは、この信託について受益権取得申込者と指定販売会社が締結する「積立投資約款」と別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を含むものとし、この場合、「積立投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとし、

第 2条 第35条第6項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者ごとの信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

2016年 9月 8日

委託者 大和アセットマネジメント株式会社

受託者 三井住友信託銀行株式会社

I 別に定める取引所または銀行

約款第12条および第38条の「別に定める取引所または銀行」とは、次のものをいいます。

ニューヨーク証券取引所
ロンドン証券取引所
ニューヨークの銀行
ロンドンの銀行