

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12月3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12月2日に関東財務局長に提出しており、2024年12月3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12月3日から2025年6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ます。

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12)【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、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?

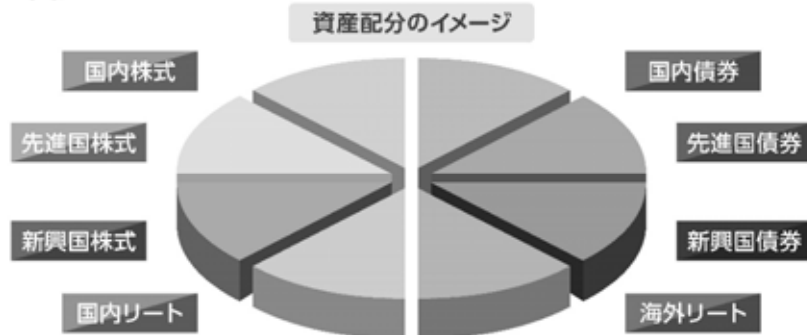
FREE & LOW
費用はどれくらいかかるのかな?

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



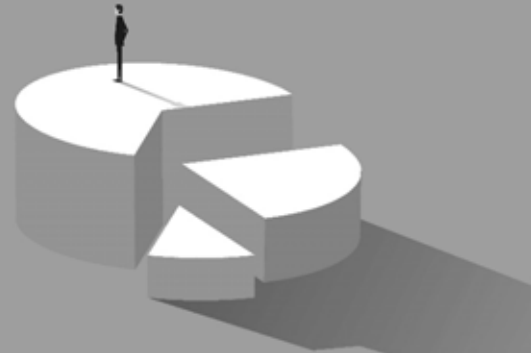
- 内外の株式、債券およびリート(不動産投資信託)に投資します。
- 各資産クラスにおける投資にあたっては、投資成果をそれぞれの対象インデックスに連動させることをめざして運用を行ないます。

※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。

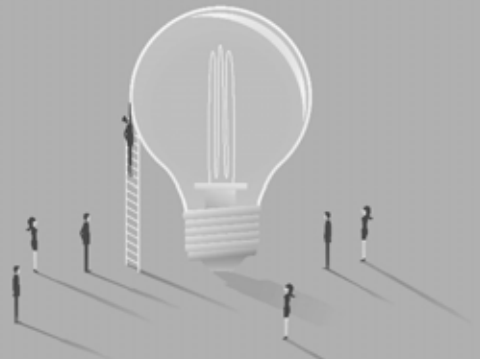
■ 対象インデックスについて

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



- 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9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】

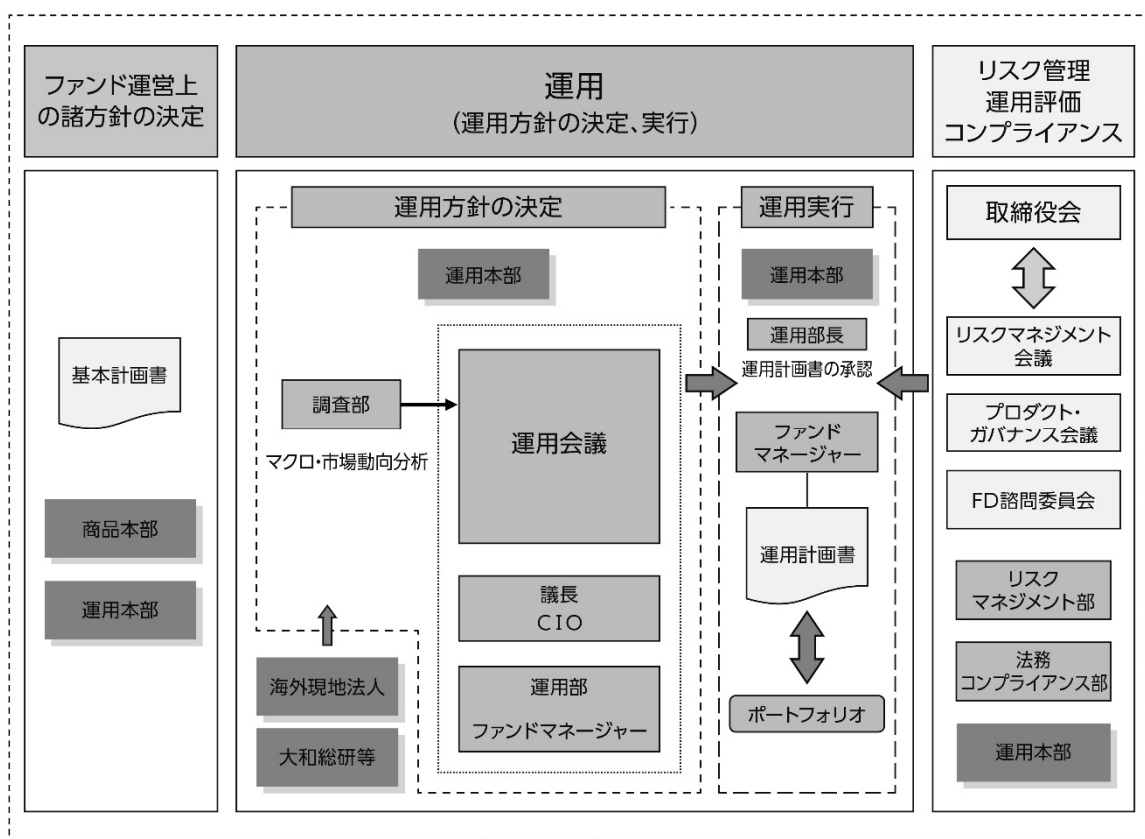
- ① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
 1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. 約束手形
 - ハ. 金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの
 2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形
- ② 委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の 1. から 8. までの掲げる親投資信託（以下総称して「マザーファンド」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（B P I）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-R E I Tマザーファンドの受益証券
 8. ダイワ・グローバル R E I Tインデックス・マザーファンドの受益証券
 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・ガバナンス会議およびFD諮問委員会

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

イ. リスクマネジメント会議

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

ロ. プロダクト・ガバナンス会議

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

ハ. FD諮問委員会

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

⑤ 受託会社に対する管理体制

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

※ 上記の運用体制は2024年9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券
 18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 19. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの
 なお、前1.の証券または証書、前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前13.の証券および前14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。
- 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いません。
 ※ 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ETF（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ETF（上場投資信託証券）の組入比率の合計は、通常の状態で信託財産

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、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、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。）

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。）
 17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 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。）
 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。

4. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)

(1) 投資方針

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、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ます。

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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. 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す。）

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

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

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券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す。）

13. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

14. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

15. 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つ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つ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ます。

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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。

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えます。

ハ. リートに関する法制度（税制、会計制度等）が変更となった場合、リー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、基準価額が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付を中止すること、すでに受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付けたものとして取扱います。

(3) その他の留意点

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

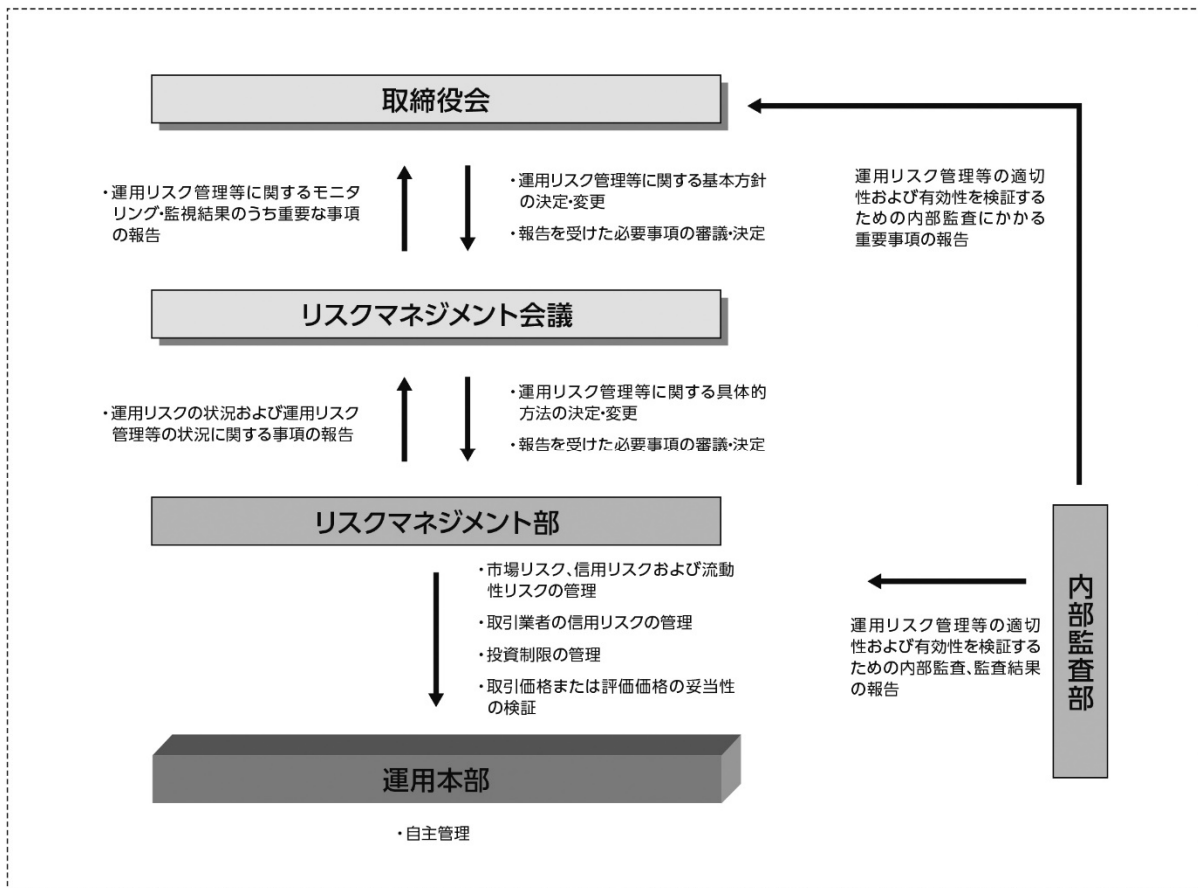
※ 流動性リスクに関する事項

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

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

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※ 流動性リスクに対する管理体制

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

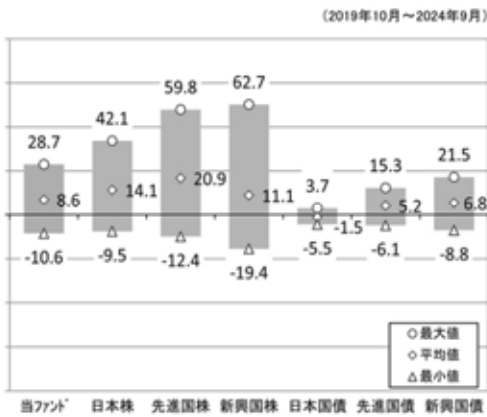
参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

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

※指数について

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

取得申込時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。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9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9月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	79,130,594,006	99.01
内 日本	79,130,594,006	99.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	795,227,033	0.99
純資産総額	79,925,821,039	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9月30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	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	3,790,272,387	2.4864 9,424,497,315	2.7676 10,489,957,858	13.12
2	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	2,473,064,144	3.9139 9,679,325,753	4.0375 9,984,996,481	12.49
3	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,527,364,848	6.0678 9,267,891,978	6.4310 9,822,483,337	12.29
4	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	5,055,644,316	1.8768 9,488,521,332	1.9424 9,820,083,519	12.29
5	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	8,121,781,889	1.2051 9,787,588,023	1.2073 9,805,427,274	12.27
6	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	5,239,283,262	1.8125 9,496,223,351	1.8699 9,796,935,771	12.26
7	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	3,035,489,065	3.2380 9,828,913,592	3.2184 9,769,418,006	12.22
8	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	2,696,261,469	3.5496 9,570,816,825	3.5758 9,641,291,760	12.06

(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
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
2023年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	—
4月末日	73,089,551,024	—	1.7944	—
5月末日	74,691,776,944	—	1.8031	—
6月末日	77,561,966,577	—	1.8462	—
7月末日	77,054,437,348	—	1.8056	—
8月末日	77,633,781,151	—	1.7907	—
第8計算期間末 (2024年9月9日)	76,283,161,440	76,283,161,440	1.7547	1.7547
9月末日	79,925,821,039	—	1.8135	—

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

	1口当たり分配金(円)
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000

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
第8計算期間	7.5

(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
第8計算期間	10,741,153,643	4,406,740,422

(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9月30日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		360,815,931,390	96.62
	内 日本	360,815,931,390	96.62
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		12,629,374,011	3.38
純資産総額		373,445,305,401	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)		12,099,075,000	3.24
	内 日本	12,099,075,000	3.24

(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9月30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	5,155,500	2,610.52 13,458,573,750	2,542.50 13,107,858,750	3.51
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	3,395,600	2,635.00 8,947,428,600	2,777.50 9,431,279,000	2.53
3	日立	日本	株式	電気機器	2,353,800	3,659.06 8,612,700,200	3,781.00 8,899,717,800	2.38
4	三菱 UFJ フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	5,816,800	1,443.00 8,393,650,400	1,453.50 8,454,718,800	2.26
5	キーエンス	日本	株式	電気機器	97,000	67,270.00 6,525,190,000	68,360.00 6,630,920,000	1.78
6	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	718,000	9,208.01 6,611,354,000	8,705.00 6,250,190,000	1.67
7	三井住友フィナンシャル G	日本	株式	銀行業	2,001,600	2,982.00 5,968,771,200	3,045.00 6,094,872,000	1.63
8	三菱商事	日本	株式	卸売業	1,970,300	2,883.53 5,681,419,600	2,952.50 5,817,310,750	1.56

	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	伊藤忠	日本	株式	卸売業	689,700	7,661.04 5,283,819,900	7,678.00 5,295,516,600	1.42
10	信越化学	日本	株式	化学	871,100	5,750.06 5,008,884,300	5,977.00 5,206,564,700	1.39
11	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	205,300	23,022.16 4,726,451,500	25,290.00 5,192,037,000	1.39
12	三井物産	日本	株式	卸売業	1,537,100	2,927.54 4,499,928,550	3,178.00 4,884,903,800	1.31
13	東京海上HD	日本	株式	保険業	932,600	5,188.04 4,838,367,400	5,231.00 4,878,430,600	1.31
14	任天堂	日本	株式	その他製品	612,300	7,673.06 4,698,215,400	7,636.00 4,675,522,800	1.25
15	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	28,932,400	150.19 4,345,644,120	146.80 4,247,276,320	1.14
16	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	479,800	8,405.14 4,032,787,800	8,427.00 4,043,274,600	1.08
17	第一三共	日本	株式	医薬品	847,300	4,949.99 4,194,126,700	4,709.00 3,989,935,700	1.07
18	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,289,300	2,829.49 3,648,070,900	2,936.00 3,785,384,800	1.01
19	HOYA	日本	株式	精密機器	190,900	19,195.00 3,664,325,500	19,785.00 3,776,956,500	1.01
20	三菱重工業	日本	株式	機械	1,712,900	1,856.05 3,179,243,800	2,117.50 3,627,065,750	0.97
21	武田薬品	日本	株式	医薬品	860,900	4,262.98 3,670,006,700	4,103.00 3,532,272,700	0.95
22	本田技研	日本	株式	輸送用機器	2,297,900	1,543.53 3,546,886,650	1,507.50 3,464,084,250	0.93
23	KDDI	日本	株式	情報・通信業	715,400	4,812.99 3,443,215,800	4,594.00 3,286,547,600	0.88
24	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	15,545,200	197.39 3,068,615,160	187.20 2,910,061,440	0.78
25	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	57,700	45,900.00 2,648,430,000	47,420.00 2,736,134,000	0.73
26	富士通	日本	株式	電気機器	901,300	2,922.51 2,634,059,400	2,935.50 2,645,766,150	0.71
27	三菱電機	日本	株式	電気機器	1,072,900	2,238.02 2,401,172,150	2,303.50 2,471,425,150	0.66
28	村田製作所	日本	株式	電気機器	866,300	2,665.57 2,309,185,150	2,806.50 2,431,270,950	0.65
29	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	580,300	4,093.03 2,375,190,000	4,179.00 2,425,073,700	0.65
30	ダイキン工業	日本	株式	機械	116,900	17,870.00 2,089,003,000	20,075.00 2,346,767,500	0.63

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	96.62%
合計	96.62%

(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	0.26%
建設業	2.15%
食料品	3.16%
繊維製品	0.39%
パルプ・紙	0.15%
化学	5.61%
医薬品	4.49%
石油・石炭製品	0.54%
ゴム製品	0.58%
ガラス・土石製品	0.66%
鉄鋼	0.83%
非鉄金属	0.78%
金属製品	0.50%
機械	5.36%
電気機器	17.09%
輸送用機器	6.98%
精密機器	2.35%
その他製品	2.43%
電気・ガス業	1.33%
陸運業	2.31%
海運業	0.78%
空運業	0.38%
倉庫・運輸関連業	0.15%
情報・通信業	7.29%
卸売業	7.13%
小売業	4.37%
銀行業	7.17%
証券、商品先物取引業	0.79%
保険業	2.94%
その他金融業	1.17%
不動産業	1.86%
サービス業	4.58%
合計	96.62%

(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 0612月	買建	457	12,246,625,350	12,099,075,000	3.24%

(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9月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	289,102,263,700	96.78
内 日本	289,102,263,700	96.78
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	9,616,248,094	3.22
純資産総額	298,718,511,794	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)	9,618,000,000	3.22
内 日本	9,618,000,000	3.22

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

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

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

(2) 投資資産 (2024年9月30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	168,734	135,199.40 22,812,736,498	131,800.00 22,239,141,200	7.44
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	29,715	591,992.83 17,591,067,131	571,000.00 16,967,265,000	5.68
3	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	145,737	101,295.71 14,762,533,402	96,600.00 14,078,194,200	4.71
4	野村不動産マスターF	日本	投資証券	92,600	151,297.91 14,010,186,568	142,900.00 13,232,540,000	4.43
5	GLP投資法人	日本	投資証券	97,168	135,201.37 13,137,247,483	132,700.00 12,894,193,600	4.32
6	日本プロロジスリート	日本	投資証券	50,394	268,082.25 13,509,737,339	246,200.00 12,407,002,800	4.15
7	KDX 不動産投資法人	日本	投資証券	80,931	154,601.54 12,512,057,389	151,200.00 12,236,767,200	4.10
8	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	43,384	235,203.23 10,204,057,304	235,500.00 10,216,932,000	3.42

	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	インヴェンシブル投資法人	日本	投資証券	159,382	58,003.71 9,244,748,613	62,100.00 9,897,622,200	3.31
10	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	28,430	336,500.94 9,566,721,878	336,500.00 9,566,695,000	3.20
11	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	64,710	140,301.54 9,078,913,197	138,100.00 8,936,451,000	2.99
12	オリックス不動産投資	日本	投資証券	57,639	155,401.07 8,957,162,329	153,600.00 8,853,350,400	2.96
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	106,274	68,603.01 7,290,716,848	71,500.00 7,598,591,000	2.54
14	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	19,783	353,004.92 6,983,496,427	348,500.00 6,894,375,500	2.31
15	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	86,926	80,398.76 6,988,742,854	76,000.00 6,606,376,000	2.21
16	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	9,989	658,986.96 6,582,620,768	638,000.00 6,372,982,000	2.13
17	産業ファンド	日本	投資証券	52,965	120,801.25 6,398,238,527	119,600.00 6,334,614,000	2.12
18	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	19,436	277,401.13 5,391,568,479	274,100.00 5,327,407,600	1.78
19	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	37,035	144,801.25 5,362,714,612	143,300.00 5,307,115,500	1.78
20	三井不ロジパーク	日本	投資証券	12,062	435,497.80 5,252,974,511	424,500.00 5,120,319,000	1.71
21	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	14,647	331,994.94 4,862,729,982	324,000.00 4,745,628,000	1.59
22	イオンリート投資	日本	投資証券	35,485	135,100.31 4,794,034,801	131,300.00 4,659,180,500	1.56
23	API投資法人	日本	投資証券	14,061	326,008.22 4,584,001,710	327,000.00 4,597,947,000	1.54
24	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	10,733	432,998.07 4,647,368,311	425,500.00 4,566,891,500	1.53
25	森ヒルズリート	日本	投資証券	34,017	127,202.17 4,327,036,394	127,300.00 4,330,364,100	1.45
26	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	42,725	102,098.89 4,362,175,157	97,100.00 4,148,597,500	1.39
27	三菱地所物流 REIT	日本	投資証券	9,989	374,502.30 3,740,903,516	369,000.00 3,685,941,000	1.23
28	森トラストリート投資法人	日本	投資証券	55,759	64,901.56 3,618,846,233	65,200.00 3,635,486,800	1.22
29	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	11,985	313,995.22 3,763,232,744	302,500.00 3,625,462,500	1.21
30	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	25,562	140,201.46 3,583,829,952	139,000.00 3,553,118,000	1.19

(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	96.78%
合計	96.78%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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 0612 月	買建	5,600	9,780,400,000	9,618,000,000	3.22%

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

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

ダイワ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9月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	81,706,897,900	82.63
内 日本	81,706,897,900	82.63
地方債証券	5,284,378,040	5.34
内 日本	5,284,378,040	5.34
特殊債券	4,400,054,719	4.45
内 日本	4,400,054,719	4.45
社債券	7,036,602,400	7.12
内 日本	7,036,602,400	7.12
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	456,700,675	0.46
純資産総額	98,884,633,734	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9月30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	99.27 2,362,768,800	0.005000 2026/09/20	2.39
2	154 5 年国債	日本	国債証券	2,180,000,000	99.56 2,170,540,400	99.16 2,161,753,400	0.100000 2027/09/20	2.19
3	455 2 年国債	日本	国債証券	1,800,000,000	99.73 1,795,222,000	99.69 1,794,438,000	0.005000 2025/12/01	1.81
4	158 5 年国債	日本	国債証券	1,680,000,000	99.25 1,667,437,600	98.95 1,662,477,600	0.100000 2028/03/20	1.68
5	153 5 年国債	日本	国債証券	1,600,000,000	99.26 1,588,167,000	98.99 1,583,856,000	0.005000 2027/06/20	1.60
6	148 5 年国債	日本	国債証券	1,500,000,000	99.69 1,495,448,200	99.40 1,491,030,000	0.005000 2026/06/20	1.51
7	163 5 年国債	日本	国債証券	1,400,000,000	100.24 1,403,441,100	99.86 1,398,082,000	0.400000 2028/09/20	1.41
8	362 10 年国債	日本	国債証券	1,430,000,000	96.37 1,378,185,650	97.19 1,389,817,000	0.100000 2031/03/20	1.41
9	150 5 年国債	日本	国債証券	1,350,000,000	99.56 1,344,184,000	99.18 1,338,997,500	0.005000 2026/12/20	1.35

	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	164 5 年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	99.22 1,190,739,600	98.96 1,187,568,000	0.200000 2028/12/20	1.20
11	373 10 年国債	日本	国債証券	1,130,000,000	98.46 1,112,603,900	98.28 1,110,586,600	0.600000 2033/12/20	1.12
12	369 10 年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	98.81 1,086,986,000	98.56 1,084,160,000	0.500000 2032/12/20	1.10
13	366 10 年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	96.97 1,066,706,000	97.00 1,067,033,000	0.200000 2032/03/20	1.08
14	370 10 年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	98.82 1,037,710,000	98.28 1,031,971,500	0.500000 2033/03/20	1.04
15	371 10 年国債	日本	国債証券	1,060,000,000	97.51 1,033,635,600	97.17 1,030,055,000	0.400000 2033/06/20	1.04
16	367 10 年国債	日本	国債証券	1,025,000,000	96.79 992,099,100	96.72 991,462,000	0.200000 2032/06/20	1.00
17	359 10 年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	98.07 980,760,000	97.72 977,220,000	0.100000 2030/06/20	0.99
18	360 10 年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	98.00 980,020,000	97.56 975,680,000	0.100000 2030/09/20	0.99
19	368 10 年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	96.57 965,752,000	96.44 964,440,000	0.200000 2032/09/20	0.98
20	372 10 年国債	日本	国債証券	950,000,000	100.73 956,941,400	100.33 953,182,500	0.800000 2033/09/20	0.96
21	358 10 年国債	日本	国債証券	920,000,000	98.09 902,446,400	97.84 900,174,000	0.100000 2030/03/20	0.91
22	361 10 年国債	日本	国債証券	900,000,000	97.77 879,952,640	97.38 876,429,000	0.100000 2030/12/20	0.89
23	120 住宅機構 RMBS	日本	特殊債券	915,082,000	94.62 865,942,096	94.70 866,674,162	0.400000 2052/05/10	0.88
24	365 10 年国債	日本	国債証券	880,000,000	96.70 851,003,900	96.50 849,252,800	0.100000 2031/12/20	0.86
25	364 10 年国債	日本	国債証券	850,000,000	97.05 824,925,000	96.75 822,392,000	0.100000 2031/09/20	0.83
26	363 10 年国債	日本	国債証券	830,000,000	97.13 806,249,800	96.99 805,017,000	0.100000 2031/06/20	0.81
27	147 5 年国債	日本	国債証券	800,000,000	99.91 799,352,000	99.53 796,264,000	0.005000 2026/03/20	0.81
28	458 2 年国債	日本	国債証券	780,000,000	99.82 778,600,200	99.83 778,681,800	0.200000 2026/03/01	0.79
29	16 40 年国債	日本	国債証券	1,030,000,000	84.56 870,983,500	74.63 768,781,700	1.300000 2063/03/20	0.78
30	374 10 年国債	日本	国債証券	750,000,000	97.86 733,956,000	99.78 748,350,000	0.800000 2034/03/20	0.76

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	82.63%
地方債証券	5.34%
特殊債券	4.45%
社債券	7.12%
合計	99.54%

(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9月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	33,984,869,994	85.09
内 中国	14,256,409,737	35.69
内 台湾	6,109,930,858	15.30
内 タイ	1,177,373,441	2.95
内 マレーシア	238,058,659	0.60
内 インドネシア	426,740,637	1.07
内 インド	4,121,224,926	10.32
内 サウジアラビア	768,135,624	1.92
内 トルコ	578,041,067	1.45
内 カナダ	20,540,702	0.05
内 メキシコ	679,297,476	1.70
内 チリ	108,688,067	0.27
内 ブラジル	4,043,027,337	10.12
内 南アフリカ	1,457,401,463	3.65
投資証券	4,168,281,150	10.44
内 アメリカ	4,110,476,274	10.29
内 メキシコ	19,005,516	0.05
内 南アフリカ	38,799,360	0.10
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,787,273,956	4.47
純資産総額	39,940,425,100	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)	1,574,797,182	3.94
内 アメリカ	1,574,797,182	3.94
為替予約取引(買建)	39,924,556	0.10
内 日本	39,924,556	0.10

(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9月30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	—	1,295,500	2,955.22 3,828,493,534	3,172.88 4,110,476,274	10.29
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技術	458,000	4,515.28 2,068,000,946	4,513.60 2,067,228,800	5.18
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	中国	株式	一般消費 財・サービ ス	893,000	1,365.68 1,219,565,392	1,882.92 1,681,452,025	4.21
4	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	株式	コミュニケ ーション・サ ービス	142,400	7,038.31 1,002,258,848	8,042.38 1,145,235,766	2.87
5	IND & COMM BK OF CHINA-H	中国	株式	金融	10,115,000	88.19 892,247,321	86.52 875,177,111	2.19
6	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	株式	金融	7,365,000	102.04 751,577,873	110.03 810,417,350	2.03
7	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	株式	金融	907,500	678.60 615,835,478	892.78 810,199,665	2.03
8	VALE SA	ブラジル	株式	素材	432,790	1,667.90 721,859,399	1,678.68 726,519,277	1.82
9	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	ブラジル	株式	エネルギー	751,800	979.26 736,218,566	947.73 712,510,518	1.78
10	BANK OF CHINA LTD-H	中国	株式	金融	8,821,000	70.66 623,442,122	68.52 604,415,802	1.51
11	JD.COM INC - CL A	中国	株式	一般消費 財・サービ ス	202,295	1,933.64 391,166,741	2,792.24 564,856,191	1.41
12	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	ブラジル	株式	エネルギー	497,200	1,041.67 517,921,194	1,037.23 515,714,718	1.29
13	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	476,902	956.97 456,382,721	862.09 411,136,070	1.03
14	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国	株式	エネルギー	4,283,800	98.51 422,055,010	89.27 382,449,953	0.96
15	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	株式	エネルギー	68,532	5,306.49 363,664,612	5,219.51 357,704,042	0.90
16	MEDIATEK INC	台湾	株式	情報技術	61,003	6,153.85 375,403,605	5,687.13 346,932,357	0.87
17	MEITUAN-CLASS B	中国	株式	一般消費 財・サービ ス	101,090	2,223.48 224,773,799	3,023.70 305,666,035	0.77
18	ITAU UNIBANCO HOLDING S- PREF	ブラジル	株式	金融	286,836	870.47 249,686,713	964.79 276,739,167	0.69
19	HDFC BANK LIMITED	インド	株式	金融	92,136	2,942.57 271,117,307	2,997.03 276,134,494	0.69

	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 (%)
20	XIAOMI CORP-CLASS B	中国	株式	情報技術	677,800	314.09 212,900,180	403.22 273,303,533	0.68
21	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	中国	株式	金融	3,698,000	64.09 237,036,591	69.07 255,425,298	0.64
22	CHINA MERCHANTS BANK-H	中国	株式	金融	335,500	628.80 210,968,097	701.73 235,431,757	0.59
23	PETROCHINA CO LTD-H	中国	株式	エネルギー	2,012,000	154.39 310,677,043	115.73 232,850,772	0.58
24	PTT PCL-NVDR	タイ	株式	エネルギー	1,524,400	144.53 220,335,539	148.83 226,887,885	0.57
25	INFOSYS LTD	インド	株式	情報技術	67,737	2,853.01 193,254,975	3,260.54 220,859,367	0.55
26	BAIDU INC-CLASS A	中国	株式	コミュニケーション・サービス	117,450	1,610.09 189,106,160	1,848.02 217,050,184	0.54
27	EVERGREEN MARINE CORP LTD	台湾	株式	資本財・サービス	221,800	851.44 188,851,163	956.88 212,236,694	0.53
28	BANCO BRADESCO SA-PREF	ブラジル	株式	金融	535,259	328.75 175,975,692	392.11 209,882,412	0.53
29	NASPERS LTD-N SHS	南アフリカ	株式	一般消費財・サービス	5,183	29,709.23 153,982,968	35,193.38 182,407,300	0.46
30	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	台湾	株式	情報技術	241,000	744.73 179,481,377	717.66 172,956,638	0.43

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

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	85.09%
投資証券	10.44%
合計	95.53%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	9.53%
素材	8.21%
資本財・サービス	3.79%
一般消費財・サービス	10.15%
生活必需品	2.86%
ヘルスケア	0.82%
金融	25.49%
情報技術	14.39%
コミュニケーション・サービス	6.12%
公益事業	2.46%

業種	投資比率
不動産	1.28%
合計	85.09%

(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) DEC 24	買建	185	1,459,525,936	1,574,797,182	3.94%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2024年10 月	買建	280,000	40,740,644	39,924,556	0.10%

(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9月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	572,391,395,467	95.35
内 香港	3,138,093,606	0.52
内 シンガポール	2,232,899,735	0.37
内 イスラエル	1,205,796,807	0.20
内 ノルウェー	925,666,405	0.15
内 スウェーデン	5,547,674,679	0.92
内 デンマーク	5,510,968,396	0.92
内 イギリス	22,322,374,814	3.72
内 アイルランド	700,182,504	0.12
内 オランダ	7,510,517,274	1.25
内 ベルギー	1,503,064,723	0.25
内 フランス	17,526,470,259	2.92
内 ドイツ	13,919,359,141	2.32
内 スイス	14,461,524,496	2.41
内 ポルトガル	297,540,886	0.05
内 スペイン	4,344,401,105	0.72
内 イタリア	4,278,468,836	0.71
内 フィンランド	1,575,987,857	0.26
内 オーストリア	285,605,766	0.05
内 カナダ	17,454,114,604	2.91
内 アメリカ	437,175,931,739	72.83
内 オーストラリア	10,186,946,286	1.70
内 ニュージーランド	287,805,549	0.05
投資証券	12,104,108,496	2.02
内 香港	168,082,378	0.03
内 シンガポール	167,607,128	0.03
内 イギリス	183,383,669	0.03
内 ベルギー	41,412,051	0.01
内 フランス	228,730,960	0.04
内 カナダ	27,404,283	0.00
内 アメリカ	10,257,388,121	1.71
内 オーストラリア	1,030,099,906	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)	15,793,523,717	2.63
純資産総額	600,289,027,680	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)	15,832,136,015	2.64
内 イギリス	1,200,050,460	0.20
内 ドイツ	3,554,541,533	0.59
内 カナダ	2,040,898,243	0.34
内 アメリカ	8,017,875,591	1.34
内 オーストラリア	1,018,770,188	0.17
為替予約取引(買建)	6,305,941,540	1.05
内 日本	6,305,941,540	1.05

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

(注2) 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9月30日現在)

① 投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	912,500	27,322.80 24,932,061,984	32,512.46 29,667,625,864	4.94
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	442,200	55,259.63 24,435,849,293	61,091.29 27,014,570,472	4.50
3	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	1,540,200	8,356.69 12,870,991,185	17,327.42 26,687,695,364	4.45
4	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービス	585,600	21,860.66 12,801,690,775	26,828.95 15,711,037,863	2.62
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	137,100	51,751.32 7,095,107,872	80,979.29 11,102,261,043	1.85
6	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケ ーション・サ ービス	367,300	19,863.59 7,295,922,416	23,400.58 8,595,034,320	1.43
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケ ーション・サ ービス	316,140	20,017.73 6,328,419,404	23,591.84 7,458,324,835	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	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	276,520	14,806.23 4,094,255,718	24,648.04 6,815,677,044	1.14
9	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	179,450	33,626.04 6,034,207,057	37,175.45 6,671,135,543	1.11
10	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	50,585	91,347.05 4,620,792,845	125,286.96 6,337,641,211	1.06
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	アメリカ	株式	金融	82,850	53,316.79 4,417,299,030	65,294.69 5,409,665,323	0.90
12	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	179,570	23,272.41 4,179,041,540	30,044.66 5,395,120,494	0.90
13	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	57,566	76,236.08 4,388,611,040	83,047.45 4,780,709,535	0.80
14	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	280,509	14,836.35 4,161,747,274	16,530.98 4,637,091,081	0.77
15	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	98,450	36,845.74 3,627,476,313	39,275.01 3,866,625,138	0.64
16	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	52,000	60,051.07 3,122,658,787	70,457.23 3,663,776,334	0.61
17	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需 品	147,667	21,964.57 3,243,450,288	24,770.79 3,657,828,468	0.61
18	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	株式	ヘルスケア	209,987	15,493.33 3,253,403,596	17,029.17 3,575,904,321	0.60
19	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	62,050	45,766.65 2,839,826,160	57,024.91 3,538,396,094	0.59
20	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需 品	27,760	90,076.76 2,500,531,630	126,404.54 3,508,990,103	0.58
21	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	150,500	21,841.97 3,287,235,611	23,036.62 3,467,011,611	0.58
22	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需 品	276,600	7,845.01 2,169,933,182	11,386.99 3,149,644,034	0.52
23	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	110,472	20,874.69 2,306,071,768	27,802.37 3,071,384,159	0.51
24	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	24,450	106,742.37 2,609,854,228	120,736.33 2,952,003,489	0.49
25	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニケ ーション・サ ービス	26,990	72,222.80 1,949,296,738	100,960.06 2,724,912,168	0.45
26	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需 品	255,950	8,482.72 2,171,180,000	10,246.58 2,622,613,866	0.44
27	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	158,421	15,038.74 2,382,466,820	16,226.97 2,570,693,401	0.43
28	ORACLE CORP	アメリカ	株式	情報技術	103,533	17,003.28 1,760,403,978	24,084.26 2,493,515,711	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 (%)
29	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	440,101	4,529.82 1,993,611,293	5,623.56 2,474,935,260	0.41
30	SALESFORCE.COM INC	アメリカ	株式	情報技術	60,666	34,008.13 2,063,143,609	39,484.82 2,395,386,527	0.40

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	95.35%
投資証券	2.02%
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
エネルギー	3.92%
素材	3.59%
資本財・サービス	10.09%
一般消費財・サービス	9.65%
生活必需品	6.34%
ヘルスケア	11.60%
金融	15.01%
情報技術	24.78%
コミュニケーション・サービス	7.37%
公益事業	2.71%
不動産	0.29%
合計	95.35%

(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 DEC 24	買建	194	7,918,288,931	8,017,875,591	1.34%
	イギリス	FTSE 100 INDEX DEC 24	買建	75	1,202,776,697	1,200,050,460	0.20%
	オーストラリア	SPI 200 DEC 24	買建	50	1,012,305,841	1,018,770,188	0.17%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX DEC 24	買建	67	2,023,572,464	2,040,898,243	0.34%
	ドイツ	SWISS MKT IX DEC 24	買建	70	1,437,626,563	1,457,995,581	0.24%

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
		EURO STOXX 50 DEC 24	買建	258	2,017,502,630	2,096,545,952	0.35%
為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2024年10月	買建	2,500,000	397,843,050	398,241,750	0.07%
		豪ドル買/円売 2024年10月	買建	4,000,000	389,518,640	394,525,200	0.07%
		英ポンド買/円売 2024年10月	買建	2,800,000	528,706,610	534,271,640	0.09%
		カナダ・ドル買/円売 2024年10月	買建	12,000,000	1,279,742,320	1,265,655,600	0.21%
		米ドル買/円売 2024年10月	買建	19,500,000	2,794,734,550	2,780,062,350	0.46%
		スイス・フラン買/円売 2024年10月	買建	5,500,000	938,402,520	933,185,000	0.16%

(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9月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	1,094,045,147	2.40
内 アメリカ	1,094,045,147	2.40
投資証券	42,975,111,673	94.37
内 ガーンジー	98,784,135	0.22
内 韓国	83,805,719	0.18
内 香港	412,494,952	0.91
内 シンガポール	1,464,725,589	3.22
内 イスラエル	40,123,486	0.09
内 イギリス	2,071,671,990	4.55
内 アイルランド	12,562,700	0.03
内 オランダ	54,668,330	0.12
内 ベルギー	366,636,558	0.81
内 フランス	700,545,952	1.54
内 ドイツ	12,705,002	0.03
内 スペイン	188,611,456	0.41
内 イタリア	2,833,940	0.01
内 カナダ	622,228,543	1.37
内 アメリカ	33,432,482,012	73.41
内 オーストラリア	3,371,491,046	7.40
内 ニューージーランド	38,740,263	0.09
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,470,467,580	3.23
純資産総額	45,539,624,400	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)	1,463,432,299	3.21
内 ドイツ	416,399,274	0.91
内 アメリカ	1,047,033,025	2.30
為替予約取引(買建)	262,478,212	0.58
内 日本	262,478,212	0.58

(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) 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9月30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	178,037	16,273.50 2,897,293,493	17,925.46 3,191,395,247	7.01
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	18,206	115,723.20 2,106,858,691	125,986.34 2,293,707,373	5.04
3	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	111,335	12,792.60 1,424,273,165	18,155.25 2,021,315,427	4.44
4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	30,203	37,330.60 1,127,498,390	50,903.22 1,537,430,171	3.38
5	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	167,416	7,685.01 1,286,611,496	8,953.45 1,498,951,271	3.29
6	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	59,030	17,771.59 1,049,066,119	23,937.24 1,413,015,767	3.10
7	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	59,204	19,824.34 1,173,682,144	23,002.36 1,361,832,124	2.99
8	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	355,543	2,399.33 853,082,604	3,547.36 1,261,242,181	2.77
9	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	79,300	12,736.08 1,009,978,162	13,796.28 1,094,045,147	2.40
10	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	40,721	18,845.21 767,398,324	25,296.03 1,030,079,959	2.26
11	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	201,400	4,236.51 853,250,080	4,727.21 952,061,625	2.09
12	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	56,413	9,413.04 531,018,293	16,660.87 939,889,823	2.06
13	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	27,297	24,793.05 676,777,062	32,147.07 877,518,785	1.93
14	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	79,445	6,596.69 524,082,176	9,111.88 723,893,561	1.59
15	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	65,557	8,189.99 536,914,089	10,557.73 692,133,637	1.52
16	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	109,525	4,729.78 518,043,254	4,995.55 547,137,614	1.20
17	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	12,267	30,936.87 379,503,628	42,048.25 515,805,981	1.13
18	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	29,860	15,719.28 469,381,857	17,273.18 515,777,292	1.13
19	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	22,391	17,911.47 401,056,921	22,518.51 504,212,004	1.11
20	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	265,575	1,586.31 421,291,667	1,681.82 446,651,503	0.98

	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	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	22,607	18,253.02 412,646,489	19,408.42 438,766,273	0.96
22	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	135,340	2,474.79 334,949,362	3,225.69 436,565,967	0.96
23	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	129,585	2,735.13 354,443,354	3,277.08 424,660,515	0.93
24	LINK REIT	香港	投資証券	524,300	712.00 373,308,547	732.04 383,810,931	0.84
25	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	1,057,133	265.68 280,952,862	362.33 383,040,620	0.84
26	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	アメリカ	投資証券	52,736	6,564.58 346,192,393	7,243.54 381,995,721	0.84
27	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	42,076	8,826.42 371,384,216	8,954.88 376,785,539	0.83
28	UDR INC	アメリカ	投資証券	57,660	4,829.41 278,470,395	6,421.42 370,259,233	0.81
29	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	35,866	9,963.55 357,352,857	10,099.57 362,231,350	0.80
30	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	20,468	13,057.08 267,252,505	17,657.12 361,406,102	0.79

(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	2.40%
投資証券	94.37%
合計	96.77%

(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 DEC 24	買建	188	1,068,046,135	1,047,033,025	2.30%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE DEC 24	買建	360	415,961,926	416,399,274	0.91%

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2024年10月	買建	1,030,000	163,999,104	164,092,699	0.36%
		米ドル買/円売 2024年10月	買建	690,000	100,396,587	98,385,513	0.22%

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

(注2) 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9月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	47,662,758,251	96.88
内 中国	4,632,522,820	9.42
内 タイ	4,649,045,372	9.45
内 マレーシア	4,852,628,013	9.86
内 インドネシア	4,769,400,213	9.69
内 インド	1,406,884,153	2.86
内 ポーランド	3,716,408,786	7.55
内 ハンガリー	1,339,040,468	2.72
内 セルビア	158,007,434	0.32
内 ルーマニア	1,821,754,054	3.70
内 トルコ	662,947,437	1.35
内 チェコ	2,673,311,873	5.43
内 メキシコ	4,734,880,814	9.62
内 ドミニカ共和国	116,355,497	0.24
内 コロンビア	1,905,585,285	3.87
内 ペルー	1,005,334,648	2.04
内 チリ	883,143,256	1.80
内 ブラジル	3,976,383,611	8.08
内 ウルグアイ	84,224,490	0.17
内 南アフリカ	4,274,900,027	8.69
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,535,443,388	3.12
純資産総額	49,198,201,639	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)	61,712,450	0.13
内 日本	61,712,450	0.13
為替予約取引(売建)	12,409,507	△0.03
内 日本	12,409,507	△0.03

(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9月30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	32,500,000	80.19 684,022,614	81.63 696,339,815	— 2026/07/01	1.42
2	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	28,200,000	84.91 628,480,095	86.51 640,327,258	— 2026/01/01	1.30
3	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	82,020,000	76.12 520,696,424	84.02 574,790,845	8.750000 2048/02/28	1.17
4	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	65,700,000	92.60 507,401,546	96.71 529,949,195	8.000000 2030/01/31	1.08
5	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	21,400,000	93.86 527,187,430	92.93 522,003,287	10.000000 2029/01/01	1.06
6	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	58,650,000	104.12 509,293,609	105.13 514,263,281	10.500000 2026/12/21	1.05
7	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	20,050,000	96.76 509,217,269	95.81 504,218,081	10.000000 2027/01/01	1.02
8	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	64,200,000	88.17 472,086,867	93.92 502,879,331	8.250000 2032/03/31	1.02
9	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	61,700,000	86.16 443,360,404	92.75 477,291,678	8.875000 2035/02/28	0.97
10	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	68,700,000	89.43 445,231,110	92.32 459,608,084	5.500000 2027/03/04	0.93
11	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	67,850,000	89.20 438,599,858	93.25 458,503,806	7.750000 2031/05/29	0.93
12	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	64,400,000	92.89 433,497,169	94.98 443,258,634	5.750000 2026/03/05	0.90
13	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	58,800,000	80.05 392,583,315	87.12 427,249,126	8.500000 2037/01/31	0.87
14	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	17,300,000	90.10 409,134,500	92.07 418,061,203	— 2025/07/01	0.85
15	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	57,530,000	93.35 389,193,442	96.28 401,392,560	7.500000 2027/06/03	0.82
16	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	9,900,000	101.83 375,812,533	105.91 390,854,334	6.000000 2033/10/25	0.79
17	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	54,730,000	94.28 373,924,562	97.69 387,432,735	8.500000 2029/05/31	0.79
18	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	9,400,000	106.96 374,782,855	109.35 383,181,831	7.500000 2028/07/25	0.78
19	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	62,620,000	80.52 365,398,200	84.25 382,331,886	7.750000 2042/11/13	0.78
20	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	10,850,000	87.27 352,963,793	90.61 366,480,368	2.750000 2029/10/25	0.74

	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 (%)
21	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	49,400,000	80.38 331,162,384	87.85 361,967,325	9.000000 2040/01/31	0.74
22	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	55,400,000	85.76 344,311,466	89.89 360,883,015	7.500000 2033/05/26	0.73
23	INDONESIA TREASURY BOND	インドネシア	国債証券	36,300,000,000	96.23 331,859,500	99.70 343,825,795	6.375000 2032/04/15	0.70
24	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	47,700,000	76.61 304,768,369	84.08 334,513,221	8.750000 2044/01/31	0.68
25	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	9,190,000	94.79 324,750,430	96.37 330,149,292	2.500000 2026/07/25	0.67
26	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	47,500,000	93.32 321,220,265	95.79 329,718,787	7.000000 2026/09/03	0.67
27	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	44,000,000	94.35 300,834,285	97.68 311,452,930	8.500000 2029/03/01	0.63
28	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	50,300,000	80.46 293,295,498	84.63 308,474,237	8.000000 2053/07/31	0.63
29	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	15,900,000	71.29 297,516,855	72.78 303,755,637	— 2027/07/01	0.62
30	Indonesia Treasury Bond	インドネシア	国債証券	26,920,000,000	109.07 278,935,618	113.20 289,497,680	8.375000 2034/03/15	0.59

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	96.88%
合計	96.88%

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

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	トルコ・リラ買/円売 2024年10月	買建	5,000,000	20,011,000	20,588,000	0.04%
		ハンガリー・フォリント 買/円売 2024年10月	買建	40,000,000	15,661,526	16,026,680	0.03%
		チェコ・コルナ買/円売 2024年10月	買建	2,000,000	12,509,560	12,662,000	0.03%

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
		米ドル買/円売 2024年10月	買建	87,140	12,409,507	12,435,770	0.03%
		コロンビア・ペソ売/円買 2024年10月	売建	363,499,435	12,409,507	12,409,507	△0.03%

(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9月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	313,396,162,743	97.74
内 ユーロ	95,690,794,711	29.84
内 中国	34,251,934,346	10.68
内 シンガポール	1,212,215,012	0.38
内 マレーシア	1,629,961,819	0.51
内 イスラエル	883,358,904	0.28
内 ノルウェー	449,262,775	0.14
内 スウェーデン	456,137,501	0.14
内 デンマーク	784,661,314	0.24
内 イギリス	17,031,879,915	5.31
内 ポーランド	1,482,112,179	0.46
内 カナダ	6,149,239,014	1.92
内 アメリカ	146,178,496,297	45.59
内 メキシコ	2,253,571,812	0.70
内 オーストラリア	4,123,237,241	1.29
内 ニュージーランド	819,299,903	0.26
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	7,246,899,914	2.26
純資産総額	320,643,062,657	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	1,680,359,544	0.52
内 日本	1,680,359,544	0.52
為替予約取引(売建)	50,346,030	△0.02
内 日本	50,346,030	△0.02

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

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

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

(2) 投資資産 (2024年9月30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	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	85,000,000	100.17 1,740,965,102	100.73 1,750,743,320	1.850000 2027/05/15	0.55
2	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	11,000,000	96.47 1,514,737,431	101.16 1,588,305,149	3.875000 2033/08/15	0.50
3	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	103.33 1,474,861,482	105.95 1,512,267,169	4.500000 2033/11/15	0.47
4	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	73,000,000	99.49 1,485,032,215	101.16 1,509,938,134	2.050000 2029/04/15	0.47
5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,700,000	98.77 1,367,493,418	103.20 1,428,895,150	4.125000 2032/11/15	0.45
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	81.06 1,238,079,413	86.29 1,317,922,004	1.125000 2031/02/15	0.41
7	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,500,000	101.33 1,229,418,014	105.08 1,274,896,474	4.375000 2034/05/15	0.40
8	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	88.86 1,204,978,756	93.76 1,271,365,334	2.750000 2032/08/15	0.40
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	80.39 1,181,858,066	85.69 1,259,759,672	1.250000 2031/08/15	0.39
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,300,000	90.04 1,195,194,329	94.84 1,258,988,644	2.875000 2032/05/15	0.39
11	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	60,000,000	99.79 1,224,289,216	101.80 1,248,896,652	2.390000 2026/11/15	0.39
12	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	80.62 1,150,732,079	85.95 1,226,878,534	1.375000 2031/11/15	0.38
13	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	58,000,000	100.69 1,194,151,999	102.57 1,216,433,926	2.370000 2029/01/15	0.38
14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,300,000	100.36 1,188,947,631	102.19 1,210,662,265	4.000000 2029/07/31	0.38
15	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,200,000	97.98 1,146,855,129	102.05 1,194,425,728	4.000000 2034/02/15	0.37
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	79.93 1,118,038,059	85.36 1,194,074,327	0.875000 2030/11/15	0.37
17	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	94.06 1,074,037,540	98.59 1,125,751,474	3.500000 2033/02/15	0.35
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,700,000	83.35 1,035,011,876	88.45 1,098,366,012	1.625000 2031/05/15	0.34
19	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	105.60 1,055,084,392	108.93 1,088,400,460	4.625000 2054/05/15	0.34
20	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,800,000	93.03 1,035,708,541	97.56 1,086,196,424	3.375000 2033/05/15	0.34
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	93.37 1,030,075,808	96.84 1,068,333,403	1.625000 2026/05/15	0.33
22	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	50,000,000	100.79 1,030,503,313	103.34 1,056,552,663	2.540000 2030/12/25	0.33

	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	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	43,000,000	111.78 982,871,073	115.59 1,016,339,336	3.000000 2053/10/15	0.32
24	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	99.90 998,180,827	100.70 1,006,173,707	3.750000 2027/08/15	0.31
25	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	100.49 1,004,030,030	100.57 1,004,884,855	4.250000 2025/12/31	0.31
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	78.86 900,512,116	84.55 965,494,230	0.625000 2030/08/15	0.30
27	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	91.11 910,339,076	95.16 950,753,076	1.125000 2026/10/31	0.30
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	94.06 899,487,314	97.70 934,363,247	2.875000 2028/08/15	0.29
29	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	45,000,000	100.07 920,761,938	100.44 924,241,796	1.670000 2026/06/15	0.29
30	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	45,000,000	99.86 918,902,394	100.08 920,929,398	1.620000 2027/08/15	0.29

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.74%
合計	97.74%

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

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	カナダ・ドル買/円売 2024年10月	買建	138,000	14,884,321	14,566,962	0.00%
		オフショア人民元買/円売 2024年10月	買建	24,881,000	509,776,295	508,293,949	0.16%
		デンマーク・クローネ買/ 円売 2024年10月	買建	89,000	1,917,798	1,902,108	0.00%
		英ポンド買/円売 2024年 10月	買建	359,000	69,022,499	68,559,308	0.02%
		シンガポール・ドル買/円 売 2024年10月	買建	120,000	13,368,888	13,371,276	0.00%
		ノルウェー・クローネ買/ 円売 2024年10月	買建	1,114,000	15,253,779	15,142,936	0.00%

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
		ユーロ買/円売 2024年10月	買建	2,455,000	394,191,550	391,307,198	0.12%
		イスラエル・シェケル買/円売 2024年10月	買建	1,622,000	64,850,317	62,050,583	0.02%
		ポーランド・ズロチ買/円売 2024年10月	買建	1,407,000	52,778,680	52,406,669	0.02%
		米ドル買/円売 2024年10月	買建	3,874,000	558,262,043	552,758,555	0.17%
		マレーシア・リンギット売/円買 2024年10月	売建	1,450,000	50,199,000	50,346,030	△0.02%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

●iFree 8資産バランス

2024年9月30日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	18,135円
純資産総額	799億円



基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	1.3%
3カ月間	-1.8%
6カ月間	2.2%
1年間	13.3%
3年間	26.2%
5年間	48.2%
設定来	81.4%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移 (10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8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	24年9月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円			

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

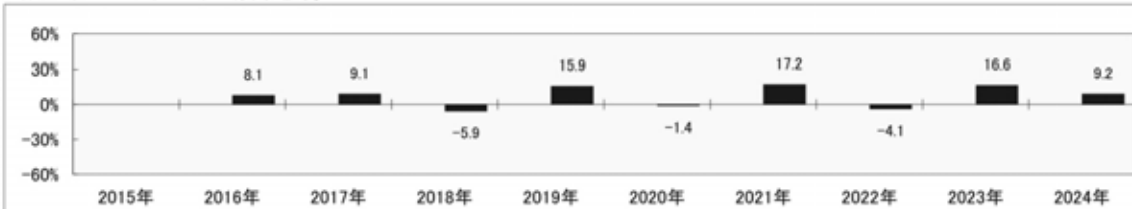
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
ダイワ新興国株式F・INDEX・MF	13.1%	外国株式・先物	1,581	23.7%	日本円	37.9%	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	アメリカ	1.4%
ダイワ・グローバルREIT INDEX MF	12.5%	外国債券	1,264	23.7%	米ドル	26.5%	日本ビルファンド	日本	0.9%
外国株式INDEXMF	12.3%	外国リート・先物	302	12.4%	ユーロ	5.2%	PROLOGIS INC	アメリカ	0.9%
トピックス・インデックス・MF	12.3%	国内株式・先物	2,106	12.3%	香港ドル	4.2%	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)	12.3%	国内リート・先物	59	12.2%	オフショア人民元	3.2%	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	0.7%
ダイワ新興国債券インデックス・MF	12.3%	国内債券	386	12.2%	ブラジル・レアル	2.4%	EQUINIX INC	アメリカ	0.6%
ダイワJ-REIT MF	12.2%	外国投資信託等	6	1.7%	台湾ドル	2.0%	APPLE INC	アメリカ	0.6%
外国債券INDEXMF	12.1%				インド・ルピー	1.8%	日本都市ファンド投資法人	日本	0.6%
					英ポンド	1.7%	WELLTOWER INC	アメリカ	0.6%
		コール・ローン、その他		3.8%	その他	15.1%	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.6%
合計	99.0%	合計	5,704	-	合計	100.0%	合計		7.5%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2016年は設定日(9月8日)から年末、2024年は9月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

(参考情報) ファンドの総経費率

	総経費率 (①+②)	運用管理費用の比率 ①	その他費用の比率 ②
iFree 8資産バランス	0.31%	0.24%	0.07%

※対象期間は2023年9月8日～2024年9月9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てします。

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

「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがった契約（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ないません。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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ます。

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

2【換金（解約）手続等】

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付けを行いません。

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付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・東京証券取引所上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・外国の株式：原則として金融商品取引所における計算時に知り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。）を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
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、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、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。
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、これを行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前 2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の 3 分の 2 以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前 2. から前 5. までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前 1. から前 6. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあつても、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なります。）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

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

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

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

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

<換金請求権>

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

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

独立監査人の監査報告書

2024年10月25日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 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2023年9月8日から2024年9月9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2024年9月9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7期 2023年9月7日現在 金額(円)	第8期 2024年9月9日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	727,156,324	886,721,793
親投資信託受益証券	60,020,072,805	75,510,651,169
流動資産合計	60,747,229,129	76,397,372,962
資産合計	60,747,229,129	76,397,372,962
負債の部		
流動負債		
未払解約金	54,702,668	21,413,270
未払受託者報酬	6,109,576	8,334,733
未払委託者報酬	61,096,073	83,347,852
その他未払費用	1,108,009	1,115,667
流動負債合計	123,016,326	114,211,522
負債合計	123,016,326	114,211,522
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	37,138,831,604	43,473,244,825
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	23,485,381,199	32,809,916,615
(分配準備積立金)	10,613,224,628	13,806,053,673
元本等合計	60,624,212,803	76,283,161,440
純資産合計	60,624,212,803	76,283,161,440
負債純資産合計	60,747,229,129	76,397,372,962

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第7期 自2022年9月8日 至2023年9月7日 金額(円)	第8期 自2023年9月8日 至2024年9月9日 金額(円)
営業収益		
受取利息	215	468,025
有価証券売買等損益	4,825,485,332	4,811,259,364
営業収益合計	4,825,485,547	4,811,727,389
営業費用		
支払利息	257,980	56,726
受託者報酬	11,247,319	15,285,162
委託者報酬	112,473,921	152,852,589
その他費用	2,199,910	2,210,929
営業費用合計	126,179,130	170,405,406
営業利益又は営業損失(△)	4,699,306,417	4,641,321,983
経常利益又は経常損失(△)	4,699,306,417	4,641,321,983
当期純利益又は当期純損失(△)	4,699,306,417	4,641,321,983
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(△)	47,652,338	334,562,436
期首剰余金又は期首欠損金(△)	15,326,332,462	23,485,381,199
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,925,817,537	7,825,989,829
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	4,925,817,537	7,825,989,829
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,418,422,879	2,808,213,960
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	1,418,422,879	2,808,213,960
分配金	※1	-
期末剰余金又は期末欠損金(△)	23,485,381,199	32,809,916,615

(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 8 期 自 2023 年 9 月 8 日 至 2024 年 9 月 9 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2024 年 9 月 7 日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を 2024 年 9 月 9 日としております。このため、当計算期間は 368 日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第 7 期 2023 年 9 月 7 日現在	第 8 期 2024 年 9 月 9 日現在
1. ※1 期首元本額	30,252,717,145 円	37,138,831,604 円
期中追加設定元本額	9,706,776,681 円	10,741,153,643 円
期中一部解約元本額	2,820,662,222 円	4,406,740,422 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	37,138,831,604 口	43,473,244,825 口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第 7 期 自 2022 年 9 月 8 日 至 2023 年 9 月 7 日	第 8 期 自 2023 年 9 月 8 日 至 2024 年 9 月 9 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 (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。	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 (397,360 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 (4,306,140,465 円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (19,003,862,942 円) 及び分配準備積立金 (9,499,515,848 円) より分配対象額は 32,809,916,615 円 (1 万口当たり 7,547.15 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8期 自2023年9月8日 至2024年9月9日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	第8期 2024年9月9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7期 2023年9月7日現在	第8期 2024年9月9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	4,794,063,610	4,736,207,037
合計	4,794,063,610	4,736,207,037

(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7期 2023年9月7日現在	第8期 2024年9月9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8期 自2023年9月8日 至2024年9月9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7期 2023年9月7日現在	第8期 2024年9月9日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6324円 (16,324円)	1.7547円 (17,547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	3,680,542,853	9,148,357,315	
	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	5,163,331,504	9,356,989,351	
	トピックス・インデックス・マザーファンド	4,923,229,766	9,237,948,332	
	外国株式インデックスマザーファンド	1,497,529,348	9,081,616,978	
	外国債券インデックスマザーファンド	2,647,928,780	9,398,028,825	
	ダイワJ-REITマザーファンド	3,035,489,065	9,828,913,592	
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	2,473,064,144	9,679,325,753	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	8,115,070,138	9,779,471,023	
親投資信託受益証券 合計			75,510,651,169	
合計			75,510,651,169	

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-REITマザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT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（BPI）」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

	2023年9月7日現在 金額(円)	2024年9月9日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,881,193,977	434,219,690
コール・ローン	1,074,957,158	641,660,171
株式	24,445,244,321	29,745,850,940
投資証券	2,670,661,404	3,756,297,672
未収入金	296,193	44,715
未収配当金	114,475,747	124,016,142
差入委託証拠金	459,963,654	627,842,549
流動資産合計	30,646,792,454	35,329,931,879
資産合計	30,646,792,454	35,329,931,879
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	106,175,058	39,295,440
未払解約金	14,702,700	10,873,400
その他未払費用	260,283	200,797
流動負債合計	121,138,041	50,369,637
負債合計	121,138,041	50,369,637
純資産の部		
元本等		
元本	※1 13,502,028,807	14,193,724,013
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	17,023,625,606	21,085,838,229
元本等合計	30,525,654,413	35,279,562,242
純資産合計	30,525,654,413	35,279,562,242
負債純資産合計	30,646,792,454	35,329,931,879

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023 年 9 月 7 日現在	2024 年 9 月 9 日現在
1. ※1 期首	2022 年 9 月 8 日	2023 年 9 月 8 日
期首元本額	11,245,719,039 円	13,502,028,807 円
期中追加設定元本額	2,831,987,995 円	2,907,302,409 円
期中一部解約元本額	575,678,227 円	2,215,607,203 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)	90,470,254 円	119,662,376 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)	400,976,697 円	476,159,782 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)	325,203,695 円	350,897,362 円
D-I's 新興国株式インデッ クス	133,069,415 円	123,581,490 円
i F r e e 新興国株式インデッ クス	5,560,118,546 円	7,328,195,695 円
i F r e e 8資産バランス	3,332,087,756 円	3,680,542,853 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)	7,044,784 円	8,958,674 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)	1,669,321,400 円	654,366 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	1,503,516,736 円	1,697,409,720 円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式	361,669,267 円	304,589,361 円

区分	2023年9月7日現在	2024年9月9日現在
ダイワ・ノーロード 新興国株式 ファンド	118,550,257 円	103,072,334 円
計	13,502,028,807 円	14,193,724,013 円
2. 期末日における受益権の総数	13,502,028,807 口	14,193,724,013 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 2023年9月8日 至 2024年9月9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	2024年9月9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	2024年9月9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	2023年9月7日現在	2024年9月9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	△216,143,582	△1,049,019,484
投資証券	△40,246,781	△121,652,687
合計	△256,390,363	△1,170,672,171

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

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

1. 株式関連

種類	2023年9月7日現在				2024年9月9日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超				1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買建	2,819,856,971	-	2,713,681,913	△106,175,058	1,475,213,668	-	1,436,845,112	△38,368,556
合計	2,819,856,971	-	2,713,681,913	△106,175,058	1,475,213,668	-	1,436,845,112	△38,368,556

- (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	2023年9月7日現在				2024年9月9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								

種類	2023年9月7日現在				2024年9月9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	-	-	-	-	40,740,644	-	39,813,760	△926,884
アメリカ・ドル	-	-	-	-	40,740,644	-	39,813,760	△926,884
合計	-	-	-	-	40,740,644	-	39,813,760	△926,884

(注) 1. 時価の算定方法

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

(1口当たり情報)

	2023年9月7日現在	2024年9月9日現在
1口当たり純資産額	2.2608円	2.4856円
(1万口当たり純資産額)	(22,608円)	(24,856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	22,800	12.480	284,544.000	
	CANADIAN SOLAR INC	7,400	11.910	88,134.000	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	15,000	10.180	152,700.000	
	PINDUODUO INC-ADR	2,700	93.300	251,910.000	
	KE HOLDINGS INC-ADR	18,100	14.610	264,441.000	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	73,275	2.260	165,601.500	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	9,100	15.190	138,229.000	
	SBERBANK ROSSII	698,708	0.000	0.000	
	JINKOSOLAR HOLDING ADR REP LTD	8,800	17.630	155,144.000	
	BANK VTB	76,486	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	182,900	0.000	0.000	
	NOVATEK	26,980	0.000	0.000	
	360 DIGITECH ADR INC	11,200	24.460	273,952.000	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	7,290	0.000	0.000	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	3	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		
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	80,700	1.899	153,249.300		
AEROFLOT PJSC	164,910	0.000	0.000		
アメリカ・ドル 小計				1,927,904.800 (275,266,248)	
インド・ルピー	BHARTI AIRTEL PARTLY PAID LTD	5,260	1,134.700	5,968,522.000	
	JIO FINANCIAL SERVICES LTD	63,151	336.850	21,272,414.350	
	TATA STEEL LTD	570,842	151.220	86,322,727.240	
	AXIS BANK LTD	55,359	1,158.750	64,147,241.250	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,411	12,186.150	29,380,807.650	
	TATA POWER CO LTD	36,125	417.000	15,064,125.000	
	BANK OF BARODA	54,322	235.850	12,811,843.700	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	12,473	2,838.950	35,410,223.350	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	104,174	434.400	45,253,185.600	
	STATE BANK OF INDIA	68,487	782.500	53,591,077.500	
	NTPC LTD	191,399	394.800	75,564,325.200	
	POWER FINANCE CORPORATION	74,273	545.300	40,501,066.900	
	JSW STEEL LTD	30,279	932.800	28,244,251.200	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	149,911	329.800	49,440,647.800	
	INDIAN OIL CORP LTD	350,071	176.640	61,836,541.440	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	183,388	352.150	64,580,084.200	
	PUNJAB NATIONAL BANK	108,672	110.000	11,953,920.000	
	STEEL AUTHORITY OF INDIA	135,361	129.380	17,513,006.180	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	15,980	953.950	15,244,121.000	
	CANARA BANK	108,890	103.380	11,257,048.200	
	UNION BANK OF INDIA	85,577	121.200	10,371,932.400	
	ULTRATECH CEMENT LTD	2,001	11,432.850	22,877,132.850	
	PETRONET LNG LTD	47,678	354.000	16,878,012.000	
	SHRIRAM FINANCE LTD	7,946	3,235.650	25,710,474.900	
	TECH MAHINDRA LTD	19,954	1,623.250	32,390,330.500	
	YES BANK LTD	601,287	23.140	13,913,781.180	
	REC LTD	50,216	607.450	30,503,709.200	
	COAL INDIA LTD	98,401	488.550	48,073,808.550	
	BAJAJ FINANCE LTD	2,352	7,317.150	17,209,936.800	
	SAMMAAN CAPITAL LTD	78,558	161.830	12,713,041.140	
	GAIL INDIA LTD	140,939	222.820	31,404,027.980	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	97,596	667.100	65,106,291.600	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	13,748	2,692.850	37,021,301.800	
	WIPRO LTD	25,324	520.600	13,183,674.400	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	19,398	4,456.750	86,452,036.500	
	INFOSYS LTD	67,737	1,901.850	128,825,613.450	
	LARSEN & TOUBRO LTD	13,598	3,574.750	48,609,450.500	
	TATA MOTORS LTD	63,047	1,049.350	66,158,369.450	
	DR. REDDY'S LABORATORIES	2,024	6,667.150	13,494,311.600	
	HDFC BANK LIMITED	92,136	1,636.950	150,822,025.200	
	ICICI BANK LTD	27,126	1,208.150	32,772,276.900	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	68,532	2,929.650	200,774,773.800	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	328,705	308.800	101,504,104.000	
	ITC LTD	72,364	501.700	36,305,018.800	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	23,003	2,698.100	62,064,394.300	
	HERO MOTOCORP LTD	3,643	5,743.750	20,924,481.250	
	BHARTI AIRTEL LTD	35,737	1,539.250	55,008,177.250	
	UPL LTD	39,665	609.800	24,187,717.000	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	11,876	1,824.550	21,668,355.800	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	24,412	1,756.100	42,869,913.200	
	VEDANTA LTD	188,303	459.800	86,581,719.400	
インド・ルピー	小計			2,301,737,373.460 (3,935,970,908)	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
インドネシア・ルピア	GOTO GOJEK TOKOPEDIA	31,666,600	53.000	1,678,329,800.000	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	886,300	5,050.000	4,475,815,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,433,000	3,040.000	4,356,320,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	672,700	5,650.000	3,800,755,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	932,400	10,300.000	9,603,720,000.000	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	1,260,100	7,250.000	9,135,725,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,932,800	5,225.000	10,098,880,000.000	
インドネシア・ルピア 小計				43,149,544,800.000 (401,290,767)	
オフショア・人民元	CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	281,200	2.060	579,272.000	
	INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	203,800	16.390	3,340,282.000	
	BANK OF BEIJING CO LTD -A	216,300	5.220	1,129,086.000	
	PING AN INSURANCE GROUP CO-A	104,400	43.250	4,515,300.000	
	IND & COMM BK OF CHINA-A	634,700	5.640	3,579,708.000	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	23,800	19.250	458,150.000	
	KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	1,400	1,398.000	1,957,200.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	53,300	20.790	1,108,107.000	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	117,100	7.690	900,499.000	
	SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	415,300	8.430	3,500,979.000	
	CITIC SECURITIES CO-A	35,000	19.060	667,100.000	
	CHINA MERCHANTS BANK-A	141,300	31.250	4,415,625.000	
	PING AN BANK CO LTD-A	184,100	10.080	1,855,728.000	
	CHINA STATE CONSTRUCTION -A	744,100	5.020	3,735,382.000	
	HAIER SMART HOME CO LTD-A	29,900	25.050	748,995.000	
	SAIC MOTOR CORP LTD-A	94,200	12.280	1,156,776.000	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	35,600	22.800	811,680.000	
	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	43,900	5.080	223,012.000	
	POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	200,400	4.570	915,828.000	
	CHINA COAL ENERGY CO-A	44,000	13.250	583,000.000	
	COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	161,160	11.850	1,909,746.000	
	METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	201,300	2.740	551,562.000	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	97,200	6.460	627,912.000	
	JIANGXI COPPER CO LTD-A	34,300	18.980	651,014.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP LTD A	26,650	13.890	370,168.500	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-A	46,600	7.180	334,588.000	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	848,000	4.510	3,824,480.000	
	BANK OF CHINA LTD-A	313,400	4.720	1,479,248.000	
	PETROCHINA CO LTD-A	230,600	8.040	1,854,024.000	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	491,200	6.600	3,241,920.000	
	CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	46,800	29.100	1,361,880.000	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	465,300	6.800	3,164,040.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	40,600	38.040	1,544,424.000		
CHINA VANKE CO LTD -A	215,200	6.470	1,392,344.000		
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	59,600	30.990	1,847,004.000		
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	142,000	5.910	839,220.000		

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	CHINA MINSHENG BANKING-A	697,000	3.410	2,376,770.000	
	PICC HOLDING CO-A	135,700	6.120	830,484.000	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	589,200	3.080	1,814,736.000	
	CRRC CORP LTD-A	160,100	6.830	1,093,483.000	
	CHINA UNITED NETWORK-A	260,900	4.610	1,202,749.000	
	CGN POWER CO LTD-A	65,500	4.240	277,720.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD-A	30,500	12.850	391,925.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD-A	62,800	8.770	550,756.000	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	367,100	5.250	1,927,275.000	
	BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	155,300	7.100	1,102,630.000	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	168,200	5.810	977,242.000	
	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	29,700	33.180	985,446.000	
	HUAXIA BANK CO LTD-A	215,000	6.520	1,401,800.000	
	BYD CO LTD -A	3,200	251.600	805,120.000	
	WEICHAI POWER CO LTD-A	47,000	12.500	587,500.000	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	66,700	14.760	984,492.000	
	HUANENG POWER INTL INC-A	38,900	6.670	259,463.000	
	POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	219,800	4.730	1,039,654.000	
	オフショア・人民元 小計			79,784,528.500 (1,602,974,898)	
サウジアラビア・リアル	SAUDI ARABIAN MINING	21,837	40.500	884,398.500	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS	8,017	115.200	923,558.400	
	SAUDI AWWAL BANK	17,818	35.200	627,193.600	
	ARAB NATIONAL BANK	30,158	18.960	571,795.680	
	BANQUE SAUDI FRANSI	14,001	34.000	476,034.000	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL	23,258	28.450	661,690.100	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	19,764	73.900	1,460,559.600	
	SAUDI TELECOM CO	59,605	42.200	2,515,331.000	
	AL RAJHI BANK	34,954	87.000	3,040,998.000	
	RIYAD BANK	33,095	25.900	857,160.500	
	ETIHAD ETISALAT CO	12,521	49.650	621,667.650	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	16,308	39.850	649,873.800	
	ALINMA BANK	24,331	30.450	740,878.950	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	89,143	34.600	3,084,347.800	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	99,991	27.300	2,729,754.300	
	サウジアラビア・リアル 小計			19,845,241.880 (755,905,263)	
タイ・パーツ	SCB X PUBLIC COMPANY LIMITED NON-V	171,200	113.500	19,431,200.000	
	TRUE CORPORATION NON-VOTING DR PCL	776,900	10.700	8,312,830.000	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	53,500	249.000	13,321,500.000	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	38,500	152.500	5,871,250.000	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	201,200	152.500	30,683,000.000	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	3,096,100	1.960	6,068,356.000	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	269,100	20.800	5,597,280.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	50,700	269.000	13,638,300.000	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	710,300	20.200	14,348,060.000	
	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	1,658,500	6.000	9,951,000.000	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	263,000	29.000	7,627,000.000	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	98,000	141.500	13,867,000.000	
	BANGCHAK CORP PCL-NVDR	147,600	38.250	5,645,700.000	
	PTT PCL-NVDR	1,475,000	34.750	51,256,250.000	
	THAI OIL PCL-NVDR	142,100	54.500	7,744,450.000	
	CP ALL PCL-NVDR	300,500	65.250	19,607,625.000	
	BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	76,200	150.500	11,468,100.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	440,600	24.500	10,794,700.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	291,000	28.000	8,148,000.000	
タイ・パーツ 小計				263,381,601.000 (1,114,104,172)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	3,770,621	47.180	177,897,898.780	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	8,171	32,480.000	265,394,080.000	
	BANCO DE CHILE	1,564,088	114.500	179,088,076.000	
チリ・ペソ 小計				622,380,054.780 (93,945,779)	
トルコ・リラ	AKBANK T. A. S.	306,764	58.950	18,083,737.800	
	TURKIYE IS BANKASI-C	760,930	13.240	10,074,713.200	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	90,688	96.600	8,760,460.800	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	56,258	161.200	9,068,789.600	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	276,715	47.000	13,005,605.000	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	173,502	92.600	16,066,285.200	
	YAPI VE KREDI BANKASI	364,490	30.780	11,219,002.200	
	KOC HOLDING AS	80,155	184.800	14,812,644.000	
	TURK HAVA YOLLARI AO	46,397	293.250	13,605,920.250	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	76,021	41.740	3,173,116.540	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	19,714	542.000	10,684,988.000	
トルコ・リラ 小計				128,555,262.590 (541,551,899)	
ブラジル・リアル	EQUATORIAL ENERGIA RIGHTS SA	2,430	2.750	6,682.500	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	64,800	9.650	625,320.000	
	ENERGISA SA-UNITS	14,800	48.100	711,880.000	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	27,400	34.990	958,726.000	
	VIBRA ENERGIA SA	145,700	25.910	3,775,087.000	
	NATURA &CO HOLDING SA	63,200	13.600	859,520.000	
	TIM SA	47,426	18.410	873,112.660	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	91,900	9.450	868,455.000	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	281,600	4.480	1,261,568.000	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	717,900	37.550	26,957,145.000	
	USINAS SIDER MINAS GER-PF A	51,600	5.990	309,084.000	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	535,259	15.700	8,403,566.300	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	286,836	36.950	10,598,590.200	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	69,500	11.600	806,200.000		

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	VALE SA	421,290	56.680	23,878,717.200	
	GERDAU SA-PREF	170,692	18.170	3,101,473.640	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	477,200	41.130	19,627,236.000	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	137,474	11.840	1,627,692.160	
	ITAUSA SA	138,409	11.120	1,539,108.080	
	BRASKEM SA-PREF A	48,400	18.900	914,760.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	13,700	46.430	636,091.000	
	BANCO DO BRASIL S. A.	156,500	28.770	4,502,505.000	
	COSAN SA	60,000	12.890	773,400.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	68,600	41.750	2,864,050.000	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	90,500	10.830	980,115.000	
	EMBRAER SA	31,400	47.830	1,501,862.000	
	METALURGICA GERDAU SA-PREF	147,400	10.480	1,544,752.000	
	CCR SA	75,500	13.490	1,018,495.000	
	BRF SA	75,900	25.210	1,913,439.000	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	13,000	94.750	1,231,750.000	
	LOJAS RENNER S. A.	59,175	17.720	1,048,581.000	
	JBS SA	134,000	34.340	4,601,560.000	
	USINAS SIDERURGICAS DE MINAS	17,800	5.870	104,486.000	
	SUZANO SA	35,645	54.370	1,938,018.650	
	LOCALIZA RENT A CAR	17,000	42.020	714,340.000	
	MARFRIG GLOBAL FOODS SA	114,700	14.480	1,660,856.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	169,800	12.230	2,076,654.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	36,900	34.800	1,284,120.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GER	15,609	14.810	231,169.290	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	43,400	31.260	1,356,684.000	
	TELEFONICA BRASIL S. A.	30,300	54.960	1,665,288.000	
	KLABIN SA - UNIT	50,290	21.720	1,092,298.800	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	67,300	23.020	1,549,246.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	40,900	32.370	1,323,933.000	
	BANCO BRADESCO S. A.	180,721	14.170	2,560,816.570	
	AMBEV SA	206,000	12.990	2,675,940.000	
	ブラジル・リアル 小計			150,554,374.050 (3,837,405,163)	
マレーシア・リングgit	MALAYAN BANKING BHD	133,800	10.800	1,445,040.000	
	PUBLIC BANK BERHAD	230,800	4.750	1,096,300.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	796,900	0.940	749,086.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	294,400	8.160	2,402,304.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	65,700	14.720	967,104.000	
	マレーシア・リングgit 小計			6,659,834.000 (218,453,210)	
メキシコ・ペソ	AMERICA MOVIL L	1,349,000	16.180	21,826,820.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	18,915	171.310	3,240,328.650	
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	281,600	7.300	2,055,680.000	
	CEMEX SAB-CPO	909,419	11.360	10,330,999.840	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	61,900	203.420	12,591,698.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	15,800	179.080	2,829,464.000	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	33,500	69.240	2,319,540.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	101,500	99.630	10,112,445.000	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	152,500	59.690	9,102,725.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	98,200	136.690	13,422,958.000	
メキシコ・ペソ 小計				87,832,658.490 (628,556,853)	
香港・ドル	TRIP.COM GROUP LTD	12,300	373.600	4,595,280.000	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	12,850	266.400	3,423,240.000	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	914,000	3.240	2,961,360.000	
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	453,000	8.920	4,040,760.000	
	CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	381,000	3.560	1,356,360.000	
	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	40,500	23.900	967,950.000	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	213,000	12.360	2,632,680.000	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	4,143,800	4.650	19,268,670.000	
	TENCENT HOLDINGS LTD	137,900	373.400	51,491,860.000	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	174,000	20.600	3,584,400.000	
	PETROCHINA CO LTD-H	2,012,000	6.320	12,715,840.000	
	HUANENG POWER INTL INC-H	386,000	4.430	1,709,980.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	191,500	16.880	3,232,520.000	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	7,135,000	5.360	38,243,600.000	
	CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	1,300,000	4.470	5,811,000.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	83,400	8.400	700,560.000	
	POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,092,000	4.040	4,411,680.000	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	200,000	31.550	6,310,000.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	343,120	4.770	1,636,682.400	
	SINOPHARM GROUP CO-H	86,000	16.820	1,446,520.000	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	160,000	21.000	3,360,000.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LTD	243,500	9.780	2,381,430.000	
	SINO BIOPHARMACEUTICAL	504,500	3.170	1,599,265.000	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	66,500	29.450	1,958,425.000	
	BYD CO LTD-H	18,500	237.200	4,388,200.000	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,628,000	3.480	12,625,440.000	
	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	93,900	16.720	1,570,008.000	
	PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	900,000	3.060	2,754,000.000	
	CITIC LTD	189,000	7.440	1,406,160.000	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	338,500	10.000	3,385,000.000	
	IND & COMM BK OF CHINA-H	9,725,000	4.210	40,942,250.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	91,500	11.060	1,011,990.000	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	245,000	4.380	1,073,100.000	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	1,964,000	0.990	1,944,360.000	
XIAOMI CORP-CLASS B	651,200	18.540	12,073,248.000		
MEITUAN-CLASS B	96,890	119.300	11,558,977.000		
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	868,000	79.800	69,266,400.000		
CHINA ENERGY ENGINEERING C-H	708,000	0.800	566,400.000		

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	246,000	4.490	1,104,540.000	
	JD.COM INC - CL A	194,495	104.300	20,285,828.500	
	NETEASE INC	34,500	123.100	4,246,950.000	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	22,700	47.700	1,082,790.000	
	METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	616,000	1.270	782,320.000	
	HAIER SMART HOME CO LTD-H	108,400	24.400	2,644,960.000	
	KUAISHOU TECHNOLOGY	43,300	40.100	1,736,330.000	
	BAIDU INC-CLASS A	112,750	79.750	8,991,812.500	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	259,000	11.800	3,056,200.000	
	CRRC CORP LTD - H	337,000	4.590	1,546,830.000	
	CGN POWER CO LTD-H	586,000	2.950	1,728,700.000	
	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	876,500	35.600	31,203,400.000	
	CHINA COAL ENERGY CO-H	164,000	9.030	1,480,920.000	
	COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	498,050	10.120	5,040,266.000	
	CHINA MINSHENG BANKING COR-H	1,546,080	2.760	4,267,180.800	
	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	2,784,000	0.485	1,350,240.000	
	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	25,400	75.500	1,917,700.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	649,900	4.070	2,645,093.000	
	SHENZHO INTERNATIONAL GROUP	23,500	62.350	1,465,225.000	
	CHINA MENGNIU DAIRY CO	183,000	12.920	2,364,360.000	
	PICC PROPERTY & CASUALTY-H	464,000	10.660	4,946,240.000	
	LI NING CO LTD	81,500	14.220	1,158,930.000	
	WEICHAI POWER CO LTD-H	140,000	11.560	1,618,400.000	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	506,000	3.450	1,745,700.000	
	SUNNY OPTICAL TECH	29,000	47.900	1,389,100.000	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	372,000	4.640	1,726,080.000	
	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	260,200	20.750	5,399,150.000	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	96,500	10.520	1,015,180.000	
	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	391,000	11.500	4,496,500.000	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	51,400	48.250	2,480,050.000	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	154,000	7.570	1,165,780.000	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	172,000	14.340	2,466,480.000	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,077,100	5.350	5,762,485.000	
	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	385,000	3.800	1,463,000.000	
	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,598,000	1.170	1,869,660.000	
	CHINA MERCHANTS BANK-H	323,500	30.300	9,802,050.000	
	BANK OF CHINA LTD-H	8,501,000	3.390	28,818,390.000	
	CITIC SECURITIES CO LTD-H	103,500	11.640	1,204,740.000	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	620,000	2.310	1,432,200.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	268,000	3.660	980,880.000	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	279,000	8.590	2,396,610.000	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	280,000	3.100	868,000.000	
香港・ドル 小計				527,552,846.200 (9,659,492,613)	
台湾・ドル	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTUR	196,000	20.300	3,978,800.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	WT MICROELECTRONICS LTD	27,000	105.500	2,848,500.000	
	CHAILEASE HOLDING LTD	773	0.000	0.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	37,000	172.500	6,382,500.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	12,000	454.500	5,454,000.000	
	SINO-AMERICAN SILICON PRODUC	31,000	189.000	5,859,000.000	
	TAIWAN CEMENT	266,247	31.750	8,453,342.250	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	233,000	141.500	32,969,500.000	
	WIWYNN CORP	2,000	1,715.000	3,430,000.000	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	110,112	83.600	9,205,363.200	
	FORMOSA PLASTICS CORP	97,600	46.250	4,514,000.000	
	NAN YA PLASTICS CORP	82,140	40.050	3,289,707.000	
	WALSIN LIHWA CORP	179,000	32.750	5,862,250.000	
	CHINA STEEL CORP	401,686	21.050	8,455,490.300	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	87,000	50.100	4,358,700.000	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	95,616	102.000	9,752,832.000	
	DELTA ELECTRONICS INC	68,000	375.500	25,534,000.000	
	YAGEO CORPORATION	23,578	607.000	14,311,846.000	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	178,287	21.400	3,815,341.800	
	QISDA CORP	98,000	36.150	3,542,700.000	
	ACER INC	194,000	42.100	8,167,400.000	
	INVENTEC CORP	188,000	43.300	8,140,400.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	20,000	504.000	10,080,000.000	
	QUANTA COMPUTER INC	114,000	256.500	29,241,000.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	33,000	158.000	5,214,000.000	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	75,000	46.450	3,483,750.000	
	AUO CORP	760,600	15.650	11,903,390.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	117,400	124.000	14,557,600.000	
	MEDIATEK INC	58,003	1,145.000	66,413,435.000	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	30,000	240.500	7,215,000.000	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	213,800	180.000	38,484,000.000	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	430,000	62.100	26,703,000.000	
	CHINA AIRLINES LTD	202,000	20.200	4,080,400.000	
	WAN HAI LINES LTD	135,000	78.200	10,557,000.000	
	EVA AIRWAYS CORP	163,000	35.250	5,745,750.000	
	FUBON FINANCIAL HOLDING CO	185,462	92.500	17,155,235.000	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	244,838	63.500	15,547,213.000	
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	497,000	16.200	8,051,400.000	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	243,429	27.500	6,694,297.500	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	244,399	30.750	7,515,269.250	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	236,718	38.900	9,208,330.200	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	246,884	23.500	5,801,774.000	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	644,028	32.900	21,188,521.200	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	158,781	27.050	4,295,026.050	
	LARGAN PRECISION CO LTD	4,000	2,740.000	10,960,000.000	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	24,000	526.000	12,624,000.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	37,000	142.500	5,272,500.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	TRIPOD TECHNOLOGY CORP	24,000	196.500	4,716,000.000	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	43,000	115.000	4,945,000.000	
	WISTRON CORP	205,110	98.000	20,100,780.000	
	INNOLUX CORP	849,029	14.200	12,056,211.800	
	WPG HOLDINGS LTD	114,000	76.300	8,698,200.000	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	54,000	91.900	4,962,600.000	
	PEGATRON CORP	123,000	100.000	12,300,000.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	58,000	125.500	7,279,000.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	59,787	143.500	8,579,434.500	
	SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	15,000	363.500	5,452,500.000	
	RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	34,000	195.000	6,630,000.000	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	48,000	137.500	6,600,000.000	
	COMPAL ELECTRONICS	721,000	32.750	23,612,750.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	444,000	918.000	407,592,000.000	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	458,902	176.500	80,996,203.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	51,760	527.000	27,277,520.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	664,000	54.500	36,188,000.000	
台湾・ドル 小計				1,214,303,763.050 (5,429,759,277)	
南アフリカ・ランド	AngloGold Ashanti Plc	20,038	512.160	10,262,662.080	
	NEPI ROCKCASTLE NV	24,615	147.160	3,622,343.400	
	NORTHAM PLATINUM HLDGS LTD	27,487	93.500	2,570,034.500	
	GOLD FIELDS LTD	27,147	239.040	6,489,218.880	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,955	2,876.660	5,623,870.300	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	18,676	299.950	5,601,866.200	
	NEDBANK GROUP LTD	18,816	283.000	5,324,928.000	
	BIDVEST GROUP LTD	16,104	280.190	4,512,179.760	
	BID CORP LTD	12,707	446.640	5,675,454.480	
	STANDARD BANK GROUP LTD	43,951	233.610	10,267,393.110	
	SASOL LTD	57,388	126.840	7,279,093.920	
	REMGRO LTD	15,693	144.400	2,266,069.200	
	DISCOVERY LTD	21,708	150.520	3,267,488.160	
	SANLAM LTD	64,981	84.230	5,473,349.630	
	FIRSTRAND LTD	228,073	84.800	19,340,590.400	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	49,725	64.130	3,188,864.250	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	26,721	140.050	3,742,276.050	
	ABSA GROUP LTD	42,792	171.380	7,333,692.960	
	NASPERS LTD-N SHS	4,983	3,536.120	17,620,485.960	
	MTN GROUP LTD	83,802	91.920	7,703,079.840	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	89,011	74.730	6,651,792.030		
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,457	594.050	3,241,730.850		
SIBANYE STILLWATER LTD	576,483	15.860	9,143,020.380		
南アフリカ・ランド 小計				156,201,484.340 (1,251,173,890)	
合計				29,745,850,940 [29,745,850,940]	

(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	1,295,500	25,935,910.000	
	アメリカ・ドル 小計			25,935,910.000 (3,703,129,229)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	113,100	2,558,322.000	
	メキシコ・ペソ 小計			2,558,322.000 (18,308,120)	
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	301,810	4,352,100.200	
	南アフリカ・ランド 小計			4,352,100.200 (34,860,323)	
投資証券 合計				3,756,297,672 [3,756,297,672]	
合計				3,756,297,672 [3,756,297,672]	

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 31 銘柄 投資証券 1 銘柄	6.9%	93.1%	11.9%
インド・ルピー	株式 51 銘柄	100%	-%	11.7%
インドネシア・ルピア	株式 7 銘柄	100%	-%	1.2%
オフショア・人民元	株式 54 銘柄	100%	-%	4.8%
サウジアラビア・リアル	株式 15 銘柄	100%	-%	2.3%
タイ・バーツ	株式 19 銘柄	100%	-%	3.3%
チリ・ペソ	株式 3 銘柄	100%	-%	0.3%
トルコ・リラ	株式 11 銘柄	100%	-%	1.6%
ブラジル・レアル	株式 46 銘柄	100%	-%	11.5%
マレーシア・リングgit	株式 5 銘柄	100%	-%	0.7%
メキシコ・ペソ	投資証券 1 銘柄 株式 10 銘柄	97.2%	2.8%	1.9%
香港・ドル	株式 80 銘柄	100%	-%	28.8%
台湾・ドル	株式 64 銘柄	100%	-%	16.2%
南アフリカ・ランド	投資証券 1 銘柄 株式 23 銘柄	97.3%	2.7%	3.8%

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

	2023年9月7日現在 金額(円)	2024年9月9日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	497,034,953	402,347,563
コール・ローン	367,334,024	181,704,602
国債証券	36,861,021,593	46,275,157,938
派生商品評価勘定	316,616	555,644
未収入金	-	929,548
未収利息	525,751,454	664,771,077
前払費用	54,669,698	78,092,215
流動資産合計	38,306,128,338	47,603,558,587
資産合計	38,306,128,338	47,603,558,587
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	793,388	319,125
未払金	419,216,339	253,331,118
未払解約金	-	5,352,249
流動負債合計	420,009,727	259,002,492
負債合計	420,009,727	259,002,492
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	22,164,970,341	26,125,724,702
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	15,721,148,270	21,218,831,393
元本等合計	37,886,118,611	47,344,556,095
純資産合計	37,886,118,611	47,344,556,095
負債純資産合計	38,306,128,338	47,603,558,587

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 9 月 9 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	2023 年 9 月 7 日現在	2024 年 9 月 9 日現在
1. ※1 期首	2022 年 9 月 8 日	2023 年 9 月 8 日
期首元本額	18,186,563,538 円	22,164,970,341 円
期中追加設定元本額	4,664,924,600 円	4,942,482,106 円
期中一部解約元本額	686,517,797 円	981,727,745 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)	402,473,784 円	597,816,178 円

区分	2023年9月7日現在	2024年9月9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)	393,920,951 円	475,166,876 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)	414,654,320 円	553,350,187 円
D-I's 新興国債券インデッ クス	65,606,912 円	79,021,792 円
iFree 新興国債券インデッ クス	7,236,364,923 円	9,353,736,063 円
iFree 8資産バランス	4,306,987,128 円	5,163,331,504 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)	3,201,403 円	5,542,444 円
DCダイワ新興国債券インデッ クスファンド	9,164,725,815 円	9,734,438,864 円
スタイル9 (8資産分散・保守 型)	-円	50,457 円
スタイル9 (8資産分散・バラ ンス型)	-円	1,083,643 円
スタイル9 (8資産分散・積極 型)	-円	1,286,308 円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券	138,758,177 円	121,925,339 円
ダイワ・ノーロード 新興国債券 ファンド	38,276,928 円	38,975,047 円
計	22,164,970,341 円	26,125,724,702 円
2. 期末日における受益権の総数	22,164,970,341 口	26,125,724,702 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 2023年9月8日 至 2024年9月9日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。

区分	自 2023 年 9 月 8 日 至 2024 年 9 月 9 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	2024 年 9 月 9 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	2023 年 9 月 7 日現在	2024 年 9 月 9 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	△339,490,920	927,023,685
合計	△339,490,920	927,023,685

(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	2023 年 9 月 7 日現在				2024 年 9 月 9 日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								

種類	2023年9月7日現在				2024年9月9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)
売建	-	-	-	-	44,055,000	-	44,044,000	11,000
南アフリカ・ ランド	-	-	-	-	44,055,000	-	44,044,000	11,000
買建	179,974,919	-	179,498,147	△476,772	162,537,050	-	162,762,569	225,519
アメリカ・ド ル	16,245,460	-	16,270,804	25,344	86,775,600	-	87,169,644	394,044
オフショア・ 人民元	-	-	-	-	14,071,400	-	14,063,350	△8,050
チェコ・コ ロナ	78,152,481	-	77,898,000	△254,481	-	-	-	-
トルコ・リ ラ	21,252,328	-	21,543,600	291,272	20,795,000	-	20,942,000	147,000
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	-	-	-	-	28,021,450	-	27,710,375	△311,075
メキシコ・ ペソ	33,072,000	-	32,776,380	△295,620	12,873,600	-	12,877,200	3,600
合計	179,974,919	-	179,498,147	△476,772	206,592,050	-	206,806,569	236,519

(注) 1. 時価の算定方法

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

(1口当たり情報)

	2023年9月7日現在	2024年9月9日現在
1口当たり純資産額	1.7093円	1.8122円
(1万口当たり純資産額)	(17,093円)	(18,122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・ルピー	5.85% India Government Bond 20301201	34,000,000.000	32,420,700.000	
		7.26% INDIA GOVERNMENT BOND 20320822	43,000,000.000	44,132,190.000	
		7.18% INDIA GOVERNMENT BOND 20330814	50,000,000.000	50,984,500.000	
		7.26% INDIA GOVERNMENT BOND 20290114	34,000,000.000	34,731,340.000	
		7.72% INDIA GOVERNMENT BOND 20490615	17,000,000.000	18,604,630.000	
		6.45% INDIA GOVERNMENT BOND 20291007	20,000,000.000	19,780,000.000	
		7.16% INDIA GOVERNMENT BOND 20500920	29,000,000.000	29,792,570.000	
		5.79% INDIA GOVERNMENT BOND 20300511	20,000,000.000	19,106,400.000	
		5.77% INDIA GOVERNMENT BOND 20300803	34,000,000.000	32,370,380.000	
		6.67% INDIA GOVERNMENT BOND 20501217	27,000,000.000	26,169,750.000	
		6.1% INDIA GOVERNMENT BOND 20310712	38,000,000.000	36,622,500.000	
		6.99% INDIA GOVERNMENT BOND 20511215	38,000,000.000	38,206,720.000	
		6.54% INDIA GOVERNMENT BOND 20320117	25,000,000.000	24,631,250.000	
		7.1% INDIA GOVERNMENT BOND 20290418	25,000,000.000	25,323,500.000	
		7.54% INDIA GOVERNMENT BOND 20360523	48,000,000.000	50,364,480.000	
		7.38% INDIA GOVERNMENT BOND 20270620	18,000,000.000	18,348,120.000	
		7.36% INDIA GOVERNMENT BOND 20520912	29,000,000.000	30,341,540.000	
		7.41% INDIA GOVERNMENT BOND 20361219	18,000,000.000	18,725,040.000	
		7.26% INDIA GOVERNMENT BOND 20330206	25,000,000.000	25,668,750.000	
		7.06% INDIA GOVERNMENT BOND 20280410	28,000,000.000	28,343,280.000	
		7.17% INDIA GOVERNMENT BOND 20300417	29,000,000.000	29,468,350.000	
		7.3% INDIA GOVERNMENT BOND 20530619	50,000,000.000	52,242,000.000	
		7.18% INDIA GOVERNMENT BOND 20370724	47,000,000.000	48,208,370.000	
7.37% INDIA GOVERNMENT BOND 20281023	13,000,000.000	13,284,310.000			

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		7.32% INDIA GOVERNMENT BOND 20301113	13,000,000.000	13,368,550.000	
		7.37% INDIA GOVERNMENT BOND 20540123	8,000,000.000	8,435,600.000	
		7.1% INDIA GOVERNMENT BOND 20340408	22,000,000.000	22,375,760.000	
		7.04% INDIA GOVERNMENT BOND 20290603	20,000,000.000	20,230,800.000	
		7.02% INDIA GOVERNMENT BOND 20310618	5,000,000.000	5,051,900.000	
	インド・ルピー	小計		817,333,280.000 (1,397,639,908)	
	インドネシア・ ルピア	8.25% Indonesia Treasury Bond 20360515	15,250,000,000.000	17,122,242,500.000	
		8.75% Indonesia Treasury Bond 20310515	10,000,000,000.000	11,135,800,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20320815	7,000,000,000.000	7,348,390,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20380515	9,000,000,000.000	9,574,020,000.000	
		8.375% Indonesia Treasury Bond 20390415	7,700,000,000.000	8,795,710,000.000	
		8.25% Indonesia Treasury Bond 20290515	17,000,000,000.000	18,159,570,000.000	
		7% Indonesia Treasury Bond 20300915	24,300,000,000.000	24,840,675,000.000	
		6.5% Indonesia Treasury Bond 20250615	6,700,000,000.000	6,701,809,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20350615	22,000,000,000.000	23,346,400,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20400415	19,000,000,000.000	20,172,110,000.000	
		5.5% Indonesia Treasury Bond 20260415	20,600,000,000.000	20,305,420,000.000	
		6.5% Indonesia Treasury Bond 20310215	26,300,000,000.000	26,199,271,000.000	
		6.25% Indonesia Treasury Bond 20360615	7,300,000,000.000	7,078,883,000.000	
		6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20320415	36,300,000,000.000	35,784,540,000.000	
		5.125% INDONESIA TREASURY BOND 20270415	15,700,000,000.000	15,232,611,000.000	
		7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20420615	15,000,000,000.000	15,461,850,000.000	
		6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20370715	2,700,000,000.000	2,633,715,000.000	
		7% INDONESIA TREASURY BOND 20330215	19,800,000,000.000	20,280,546,000.000	
		6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20280815	16,100,000,000.000	16,091,145,000.000	
		7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20430615	11,300,000,000.000	11,668,945,000.000	
		7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20380615	13,000,000,000.000	13,499,590,000.000	
		6.625% INDONESIA TREASURY BOND 20340215	17,500,000,000.000	17,531,150,000.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		6.875% INDONESIA TREASURY BOND 20290415	16,500,000,000.000	16,755,420,000.000	
		6.75% INDONESIA TREASURY BOND 20350715	500,000,000.000	505,880,000.000	
		11% Indonesia Treasury Bond 20250915	2,900,000,000.000	3,030,210,000.000	
		10.5% Indonesia Treasury Bond 20300815	3,480,000,000.000	4,123,521,600.000	
		9.5% Indonesia Treasury Bond 20310715	2,970,000,000.000	3,428,122,500.000	
		8.375% Indonesia Treasury Bond 20260915	20,024,000,000.000	20,768,292,080.000	
		8.25% Indonesia Treasury Bond 20320615	4,750,000,000.000	5,196,072,500.000	
		7% Indonesia Treasury Bond 20270515	16,030,000,000.000	16,256,343,600.000	
		6.125% Indonesia Treasury Bond 20280515	16,450,000,000.000	16,273,656,000.000	
		6.625% Indonesia Treasury Bond 20330515	14,075,000,000.000	14,067,681,000.000	
		8.375% Indonesia Treasury Bond 20340315	26,920,000,000.000	30,158,476,000.000	
		9% Indonesia Treasury Bond 20290315	13,020,000,000.000	14,262,498,600.000	
		インドネシア・ルピア 小計		493,790,566,380.000 (4,592,252,267)	
	ウルグアイ・ペソ	8.5% Uruguay Government International Bond 20280315	2,800,000.000	2,746,604.000	
		8.25% Uruguay Government International Bond 20310521	12,000,000.000	11,256,720.000	
		9.75% URUGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 20330720	11,000,000.000	11,132,000.000	
		ウルグアイ・ペソ 小計		25,135,324.000 (88,886,046)	
	オフショア・人民元	3.22% China Government Bond 20251206	3,700,000.000	3,783,990.000	
		3.25% China Government Bond 20281122	4,800,000.000	5,103,840.000	
		3.29% China Government Bond 20290523	5,900,000.000	6,324,977.000	
		3.25% China Government Bond 20260606	4,800,000.000	4,951,008.000	
		3.12% China Government Bond 20261205	4,200,000.000	4,347,840.000	
		3.13% China Government Bond 20291121	5,700,000.000	6,081,330.000	
		2.85% China Government Bond 20270604	4,800,000.000	4,965,072.000	
		2.68% China Government Bond 20300521	4,000,000.000	4,162,640.000	
		1.99% China Government Bond 20250409	2,500,000.000	2,507,400.000	
		3.02% China Government Bond 20251022	7,000,000.000	7,127,260.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.28% China Government Bond 20271203	5,000,000.000	5,269,000.000	
		3.27% China Government Bond 20301119	6,300,000.000	6,814,395.000	
		3.03% China Government Bond 20260311	3,900,000.000	3,990,870.000	
		3.81% China Government Bond 20500914	5,800,000.000	7,474,576.000	
		3.01% China Government Bond 20280513	5,000,000.000	5,233,050.000	
		3.72% China Government Bond 20510412	2,000,000.000	2,551,980.000	
		3.02% China Government Bond 20310527	7,000,000.000	7,471,450.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,601,610.000	
		2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	1,800,000.000	1,882,440.000	
		3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	2,000,000.000	2,483,480.000	
		2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	3,500,000.000	3,700,970.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	2,800,000.000	2,853,816.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	3,000,000.000	3,147,120.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	3,500,000.000	3,655,960.000	
		2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	2,200,000.000	2,251,502.000	
		3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	2,000,000.000	2,404,540.000	
		2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	2,500,000.000	2,624,775.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	3,600,000.000	3,756,528.000	
		2.5% CHINA GOVERNMENT BOND 20270725	3,700,000.000	3,796,607.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	3,000,000.000	3,135,240.000	
		2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20250825	3,900,000.000	3,927,690.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	1,600,000.000	1,661,712.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	3,300,000.000	3,425,301.000	
		2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	3,200,000.000	3,278,464.000	
		3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	1,200,000.000	1,396,668.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	3,700,000.000	3,901,798.000	
		2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20251125	3,000,000.000	3,028,650.000	
		2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	3,000,000.000	3,142,170.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	3,200,000.000	3,300,032.000	
		2.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20260215	2,600,000.000	2,634,086.000	
		2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	2,500,000.000	2,657,425.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	3,700,000.000	3,874,603.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	3,300,000.000	3,406,887.000	
		3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	2,200,000.000	2,596,748.000	
		2.3% CHINA GOVERNMENT BOND 20260515	2,000,000.000	2,026,940.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	3,200,000.000	3,341,952.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	3,000,000.000	3,111,930.000	
		2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	3,000,000.000	3,071,010.000	
		2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	1,000,000.000	1,032,080.000	
		2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	4,500,000.000	4,557,600.000	
		2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925	1,200,000.000	1,234,008.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	4,700,000.000	4,872,161.000	
		3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	2,000,000.000	2,288,020.000	
		2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	4,000,000.000	4,126,120.000	
		2.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20261115	3,000,000.000	3,055,290.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	2,400,000.000	2,507,544.000	
		2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225	4,300,000.000	4,446,587.000	
		2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20270225	4,000,000.000	4,047,040.000	
		2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225	5,500,000.000	5,605,985.000	
		2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325	800,000.000	814,688.000	
		1.85% CHINA GOVERNMENT BOND 20270515	1,500,000.000	1,511,775.000	
		2.49% CHINA GOVERNMENT BOND 20440525	1,700,000.000	1,751,833.000	
		2.27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525	1,300,000.000	1,314,391.000	
		2.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20310625	600,000.000	604,722.000	
		2.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20540520	2,300,000.000	2,457,734.000	
		2.47% CHINA GOVERNMENT BOND 20540725	1,700,000.000	1,756,967.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20270815	1,000,000.000	1,002,410.000	
		2.11% CHINA GOVERNMENT BOND 20340825	500,000.000	499,205.000	
		2.33% CHINA GOVERNMENT BOND 20440815	500,000.000	502,075.000	
		オフショア・人民元 小計		232,227,567.000 (4,665,753,717)	
	コロンビア・ペソ	6% Colombian TES 20280428	6,320,000,000.000	5,731,608,000.000	
		7.5% Colombian TES 20260826	5,410,000,000.000	5,322,358,000.000	
		7.75% Colombian TES 20300918	4,900,000,000.000	4,530,834,000.000	
		7% Colombian TES 20320630	5,300,000,000.000	4,511,466,000.000	
		6.25% Colombian TES 20251126	600,000,000.000	595,524,000.000	
		7.25% Colombian TES 20341018	5,900,000,000.000	4,871,630,000.000	
		5.75% Colombian TES 20271103	4,400,000,000.000	4,028,640,000.000	
		7.25% Colombian TES 20501026	6,410,000,000.000	4,426,361,400.000	
		6.25% Colombian TES 20360709	3,000,000,000.000	2,182,140,000.000	
		7% COLOMBIAN TES 20310326	5,400,000,000.000	4,752,540,000.000	
		9.25% COLOMBIAN TES 20420528	9,300,000,000.000	8,212,551,000.000	
		13.25% COLOMBIAN TES 20330209	5,200,000,000.000	6,148,324,000.000	
		コロンビア・ペソ 小計		55,313,976,400.000 (1,891,903,935)	
	セルビア・ディナール	4.5% Serbia Treasury Bonds 20260111	24,000,000.000	24,002,400.000	
		5.875% Serbia Treasury Bonds 20280208	25,000,000.000	26,265,000.000	
		4.5% Serbia Treasury Bonds 20320820	35,000,000.000	33,749,100.000	
		7% SERBIA TREASURY BONDS 20311026	29,000,000.000	32,290,920.000	
		セルビア・ディナール 小計		116,307,420.000 (157,285,781)	
	タイ・バーツ	4.875% Thailand Government Bond 20290622	48,050,000.000	53,664,162.000	
		3.85% Thailand Government Bond 20251212	37,610,000.000	38,358,815.100	
		3.65% Thailand Government Bond 20310620	39,200,000.000	42,202,720.000	
		3.4% Thailand Government Bond 20360617	34,600,000.000	37,242,402.000	
		2.125% Thailand Government Bond 20261217	48,400,000.000	48,336,596.000	
		3.775% Thailand Government Bond 20320625	48,500,000.000	52,884,400.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.875% Thailand Government Bond 20460617	34,900,000.000	33,420,240.000	
		2.875% Thailand Government Bond 20281217	44,500,000.000	45,599,150.000	
		3.3% Thailand Government Bond 20380617	49,500,000.000	52,718,985.000	
		1.6% Thailand Government Bond 20291217	38,500,000.000	37,178,295.000	
		1.6% Thailand Government Bond 20350617	20,500,000.000	18,593,500.000	
		0.95% Thailand Government Bond 20250617	32,000,000.000	31,684,160.000	
		1.585% Thailand Government Bond 20351217	40,900,000.000	37,034,950.000	
		2% Thailand Government Bond 20311217	66,500,000.000	64,624,035.000	
		2% Thailand Government Bond 20420617	29,000,000.000	25,543,200.000	
		1% THAILAND GOVERNMENT BOND 20270617	61,000,000.000	59,055,320.000	
		2.65% THAILAND GOVERNMENT BOND 20280617	56,000,000.000	56,822,640.000	
		3.39% THAILAND GOVERNMENT BOND 20370617	48,500,000.000	52,306,280.000	
		2.35% THAILAND GOVERNMENT BOND 20260617	43,500,000.000	43,625,280.000	
		3.45% THAILAND GOVERNMENT BOND 20430617	47,000,000.000	50,258,980.000	
		3.35% THAILAND GOVERNMENT BOND 20330617	49,000,000.000	52,158,050.000	
		2.25% THAILAND GOVERNMENT BOND 20270317	50,000,000.000	50,088,000.000	
		2.4% THAILAND GOVERNMENT BOND 20290317	37,000,000.000	37,190,180.000	
		2.8% THAILAND GOVERNMENT BOND 20340617	21,000,000.000	21,477,540.000	
		2.4% THAILAND GOVERNMENT BOND 20271117	10,000,000.000	10,068,500.000	
		2.5% THAILAND GOVERNMENT BOND 20291117	1,000,000.000	1,010,850.000	
		タイ・パーツ 小計		1,053,147,230.100 (4,454,812,784)	
	チェコ・コロナ	2.5% Czech Republic Government Bond 20280825	26,600,000.000	25,672,458.000	
		2.4% Czech Republic Government Bond 20250917	16,100,000.000	15,937,390.000	
		1% Czech Republic Government Bond 20260626	27,400,000.000	26,243,172.000	
		0.95% Czech Republic Government Bond 20300515	27,500,000.000	23,916,475.000	
		0.25% Czech Republic Government Bond 20270210	30,500,000.000	28,261,300.000	
		2.75% Czech Republic Government Bond 20290723	29,500,000.000	28,568,685.000	
		2% Czech Republic Government Bond 20331013	29,500,000.000	25,738,160.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.2% Czech Republic Government Bond 20310313	28,700,000.000	24,841,285.000	
		0.05% Czech Republic Government Bond 20291129	15,500,000.000	13,019,535.000	
		4.2% Czech Republic Government Bond 20361204	15,300,000.000	15,866,100.000	
		1.75% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20320623	29,500,000.000	25,846,425.000	
		1.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20400424	16,500,000.000	11,886,105.000	
		3.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20350530	15,700,000.000	15,345,023.000	
		6% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20260226	19,500,000.000	20,230,080.000	
		5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20300930	26,000,000.000	28,104,700.000	
		5.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20281212	20,500,000.000	22,171,980.000	
		1.95% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20370730	14,000,000.000	11,292,540.000	
		4.9% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20340414	16,000,000.000	17,531,040.000	
		5.75% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20290329	14,000,000.000	15,348,200.000	
		6.2% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20310616	8,000,000.000	9,282,160.000	
		4.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20321111	14,300,000.000	15,165,150.000	
		チェコ・コロナ 小計		420,267,963.000 (2,656,597,848)	
	チリ・ペソ	4.5% BONOS TESORERIA PESOS 20260301	500,000,000.000	495,575,000.000	
		5% BONOS TESORERIA PESOS 20350301	970,000,000.000	941,404,400.000	
		6% BONOS TESORERIA PESOS 20430101	630,000,000.000	682,712,100.000	
		4.7% BONOS TESORERIA PESOS 20300901	1,035,000,000.000	1,001,755,800.000	
		5% BONOS TESORERIA PESOS 20281001	720,000,000.000	713,138,400.000	
		7% BONOS TESORERIA PESOS 20340501	220,000,000.000	245,795,000.000	
		6% BONOS TESORERIA PESOS 20330401	850,000,000.000	883,073,500.000	
		6.2% BONOS TESORERIA PESOS 20401001	200,000,000.000	218,284,000.000	
		5.8% BONOS TESORERIA PESOS 20291001	280,000,000.000	286,930,000.000	
		チリ・ペソ 小計		5,468,668,200.000 (825,473,590)	
	ドミニカ・ペソ	13.625% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20330203	11,400,000.000	13,666,662.000	
		11.25% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20350915	12,500,000.000	13,513,875.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		10.75% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20360601	20,000,000.000	20,970,000.000	
	ドミニカ・ペソ 小計			48,150,537.000 (114,786,065)	
	トルコ・リラ	10.6% Turkey Government Bond 20260211	5,570,000.000	3,954,978.500	
		11% Turkey Government Bond 20270224	2,970,000.000	1,986,365.700	
		10.5% Turkey Government Bond 20270811	9,000,000.000	5,653,980.000	
		12.4% Turkey Government Bond 20280308	20,500,000.000	13,372,150.000	
		12.6% Turkey Government Bond 20251001	9,100,000.000	7,045,584.000	
		11.7% Turkey Government Bond 20301113	13,900,000.000	8,138,450.000	
		16.9% TURKEY GOVERNMENT BOND 20260902	8,500,000.000	6,385,455.000	
		17.8% TURKEY GOVERNMENT BOND 20330713	11,500,000.000	8,013,430.000	
		17.3% TURKEY GOVERNMENT BOND 20280719	23,000,000.000	16,547,120.000	
		26.2% TURKEY GOVERNMENT BOND 20331005	47,100,000.000	45,804,750.000	
		31.08% TURKEY GOVERNMENT BOND 20281108	39,500,000.000	39,782,425.000	
		トルコ・リラ 小計			156,684,688.200 (660,049,918)
	ハンガリー・フォリント	3% Hungary Government Bond 20271027	270,000,000.000	249,058,800.000	
		2.75% Hungary Government Bond 20261222	130,000,000.000	121,696,900.000	
		6.75% Hungary Government Bond 20281022	443,000,000.000	458,354,380.000	
		3% Hungary Government Bond 20300821	225,000,000.000	194,179,500.000	
		3.25% Hungary Government Bond 20311022	272,000,000.000	230,957,920.000	
		1% Hungary Government Bond 20251126	270,000,000.000	255,592,800.000	
		3% Hungary Government Bond 20381027	202,000,000.000	141,090,940.000	
		1.5% Hungary Government Bond 20260422	224,000,000.000	209,534,080.000	
		2% Hungary Government Bond 20290523	135,000,000.000	114,632,550.000	
		2.25% Hungary Government Bond 20330420	315,000,000.000	237,327,300.000	
		1.5% Hungary Government Bond 20260826	100,000,000.000	92,233,000.000	
		3% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20410425	240,000,000.000	159,218,400.000	
		2.25% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20340622	75,000,000.000	54,276,750.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4. 5% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20280323	100,000,000.000	96,085,000.000	
		4. 75% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20321124	235,000,000.000	216,174,150.000	
		9. 5% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20261021	110,000,000.000	117,822,100.000	
		7% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20351024	90,000,000.000	95,720,400.000	
		5. 5% Hungary Government Bond 20250624	282,500,000.000	282,500,000.000	
	ハンガリー・フォリント 小計			3,326,454,970.000 (1,336,868,988)	
	ブラジル・リアル	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20270101	20,050,000.000	19,397,172.000	
		10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20290101	21,400,000.000	20,170,784.000	
		10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20310101	11,100,000.000	10,232,202.000	
		10% BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F 20330101	10,400,000.000	9,460,048.000	
		10% BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F 20350101	3,600,000.000	3,235,176.000	
		BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20250701	17,300,000.000	15,861,159.000	
		BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20260101	28,000,000.000	24,208,520.000	
		BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20260701	32,500,000.000	26,605,150.000	
		BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20270701	15,900,000.000	11,662,173.000	
		BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20300101	6,500,000.000	3,580,005.000	
		BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20280101	10,600,000.000	7,336,472.000	
	ブラジル・リアル 小計			151,748,861.000 (3,867,850,843)	
	ペルー・ソル	6. 35% Peru Government Bond 20280812	1,270,000.000	1,334,223.900	
		6. 15% Peru Government Bond 20320812	3,350,000.000	3,362,261.000	
		5. 94% Peru Government Bond 20290212	2,300,000.000	2,375,509.000	
		5. 4% Peru Government Bond 20340812	2,850,000.000	2,623,197.000	
		5. 35% Peru Government Bond 20400812	2,100,000.000	1,789,221.000	
		7. 3% PERU GOVERNMENT BOND 20330812	3,900,000.000	4,154,592.000	
		7. 6% PERU GOVERNMENT BOND 20390812	600,000.000	638,550.000	
		8. 2% Peru Government Bond 20260812	175,000.000	186,221.000	
		6. 9% Peru Government Bond 20370812	4,465,000.000	4,489,289.600	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		6.95% Peru Government Bond 20310812	3,370,000.000	3,588,173.800	
		ペルー・ソル 小計		24,541,238.300 (921,992,236)	
	ポーランド・ズ ロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	9,190,000.000	8,836,644.500	
		2.5% Poland Government Bond 20270725	6,540,000.000	6,148,646.400	
		2.75% Poland Government Bond 20291025	10,850,000.000	9,770,099.500	
		0.75% Poland Government Bond 20250425	5,000,000.000	4,908,350.000	
		1.25% Poland Government Bond 20301025	9,400,000.000	7,547,730.000	
		0.25% Poland Government Bond 20261025	6,300,000.000	5,743,899.000	
		1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	8,150,000.000	6,440,537.500	
		3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	6,150,000.000	5,989,423.500	
		7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	9,400,000.000	10,232,840.000	
		POLAND GOVERNMENT BOND 20251025	4,350,000.000	4,156,860.000	
		6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	9,900,000.000	10,471,725.000	
		4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725	4,300,000.000	4,252,442.000	
		5% POLAND GOVERNMENT BOND 20341025	1,600,000.000	1,567,168.000	
		2.75% Poland Government Bond 20280425	6,950,000.000	6,473,994.500	
		3.25% Poland Government Bond 20250725	6,550,000.000	6,521,114.500	
		ポーランド・ズロチ 小計		99,061,474.400 (3,661,292,282)	
	マレーシア・リ ンギット	4.07% Malaysia Government Investment Issue 20260930	4,650,000.000	4,719,471.000	
		4.258% Malaysia Government Investment Issue 20270726	1,800,000.000	1,842,264.000	
		4.369% Malaysia Government Investment Issue 20281031	4,400,000.000	4,548,236.000	
		4.13% Malaysia Government Investment Issue 20290709	3,700,000.000	3,800,603.000	
		3.726% Malaysia Government Investment Issue 20260331	4,200,000.000	4,228,266.000	
		3.465% Malaysia Government Investment Issue 20301015	5,100,000.000	5,047,929.000	
		3.422% Malaysia Government Investment Issue 20270930	4,450,000.000	4,451,958.000	
		3.447% Malaysia Government Investment Issue 20360715	3,700,000.000	3,548,633.000	
		4.417% MALAYSIA T-BILL 20410930	3,300,000.000	3,460,017.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.99% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20251015	3,800,000.000	3,831,654.000	
		3.804% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20311008	500,000.000	503,445.000	
		3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	3,650,000.000	3,664,417.500	
		3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	3,850,000.000	3,887,614.500	
		3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	2,350,000.000	2,368,870.500	
		4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	3,100,000.000	3,220,435.000	
		3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	4,300,000.000	4,358,824.000	
		3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	3,820,000.000	3,880,623.400	
		4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	4,300,000.000	4,666,360.000	
		4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	4,200,000.000	4,487,742.000	
		4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	4,450,000.000	4,902,031.000	
		3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	3,500,000.000	3,540,880.000	
		3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	4,350,000.000	4,426,647.000	
		4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	2,750,000.000	3,071,475.000	
		3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	3,000,000.000	3,022,020.000	
		3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	4,400,000.000	4,288,064.000	
		4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	4,300,000.000	4,237,822.000	
		2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	4,400,000.000	4,131,336.000	
		3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	3,100,000.000	3,067,078.000	
		4.193% MALAYSIAN GOVERNMENT 20321007	3,400,000.000	3,497,206.000	
		4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	4,100,000.000	4,451,042.000	
		4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	1,000,000.000	1,043,570.000	
		3.599% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280731	3,900,000.000	3,915,951.000	
		4.291% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430814	3,500,000.000	3,599,540.000	
		4.662% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380331	1,400,000.000	1,509,116.000	
		4.245% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300930	3,600,000.000	3,716,604.000	
		4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	2,650,000.000	2,769,382.500	
		3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	2,300,000.000	2,306,371.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4.467% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390915	4,900,000.000	5,197,626.000	
		4.054% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390418	500,000.000	508,770.000	
		4.18% MALAYSIAN GOVERNMENT 20440516	700,000.000	711,984.000	
		4.119% MALAYSIAN GOVERNMENT 20341130	1,800,000.000	1,851,552.000	
	マレーシア・リンギット 小計			140,283,430.400 (4,601,520,971)	
	メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	59,400,000.000	55,951,830.000	
		8% Mexican Bonos 20471107	43,700,000.000	36,283,236.000	
		5.5% MEXICAN BONOS 20270304	68,700,000.000	62,789,739.000	
		8% MEXICAN BONOS 20530731	49,300,000.000	40,548,757.000	
		7.5% MEXICAN BONOS 20330526	55,400,000.000	48,960,304.000	
		7% MEXICAN BONOS 20260903	47,500,000.000	45,162,050.000	
		8.5% MEXICAN BONOS 20290301	44,000,000.000	42,470,560.000	
		7.5% Mexican Bonos 20270603	57,530,000.000	54,875,565.800	
		10% Mexican Bonos 20361120	16,890,000.000	17,521,179.300	
		8.5% Mexican Bonos 20290531	54,730,000.000	52,823,754.100	
		8.5% Mexican Bonos 20381118	35,600,000.000	32,364,672.000	
		7.75% Mexican Bonos 20310529	67,850,000.000	62,270,016.000	
		7.75% Mexican Bonos 20421113	61,120,000.000	50,150,793.600	
		7.75% Mexican Bonos 20341123	36,830,000.000	32,780,909.800	
	メキシコ・ペソ 小計			634,953,366.600 (4,543,916,777)	
	ルーマニア・レイ	5.8% Romania Government Bond 20270726	2,800,000.000	2,774,716.000	
		5% Romania Government Bond 20290212	2,600,000.000	2,469,922.000	
		4.85% Romania Government Bond 20260422	2,500,000.000	2,457,650.000	
		3.65% Romania Government Bond 20310924	2,900,000.000	2,431,360.000	
		3.65% Romania Government Bond 20250728	2,300,000.000	2,258,876.000	
		4.15% Romania Government Bond 20280126	2,600,000.000	2,441,660.000	
		3.25% Romania Government Bond 20260624	2,750,000.000	2,627,157.500	
		4.15% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20301024	2,500,000.000	2,206,175.000	
		4.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20341011	2,700,000.000	2,327,157.000	
		2.5% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20271025	2,300,000.000	2,067,102.000	
		4.85% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20290725	2,300,000.000	2,158,711.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		6.7% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20320225	3,000,000.000	3,005,280.000	
		4.25% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20360428	2,300,000.000	1,849,108.000	
		3.5% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20251125	2,000,000.000	1,948,220.000	
		8.25% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20320929	3,100,000.000	3,395,337.000	
		8.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20281030	2,700,000.000	2,931,741.000	
		8% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20300429	2,700,000.000	2,878,038.000	
		7.9% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20380224	2,600,000.000	2,859,818.000	
		7.2% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20261028	1,400,000.000	1,429,582.000	
		7.2% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20331030	2,700,000.000	2,805,894.000	
		7.35% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20310428	2,500,000.000	2,611,900.000	
		7.2% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20270531	1,800,000.000	1,843,038.000	
		7.1% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20340731	1,400,000.000	1,440,194.000	
		6.3% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20290425	1,500,000.000	1,498,050.000	
		ルーマニア・レイ 小計		56,716,686.500 (1,804,804,367)	
	南アフリカ・ランド	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	58,650,000.000	61,683,964.500	
		6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	17,720,000.000	12,712,328.000	
		6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	16,280,000.000	10,930,392.000	
		7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	35,040,000.000	31,085,736.000	
		8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	82,020,000.000	67,500,819.600	
		8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	58,800,000.000	49,805,364.000	
		8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	65,700,000.000	63,119,304.000	
		8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	47,700,000.000	39,082,041.000	
		8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	64,200,000.000	59,410,680.000	
		8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	61,700,000.000	55,753,354.000	
		9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	49,400,000.000	42,168,828.000	
		11.625% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20530331	9,500,000.000	10,051,760.000	
		南アフリカ・ランド 小計		503,304,571.100 (4,031,469,615)	
国債証券	合計			46,275,157,938	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
				[46,275,157,938]	
合計				46,275,157,938 [46,275,157,938]	

- (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・ルピー	国債証券 29 銘柄	100%	3.0%
インドネシア・ルピア	国債証券 34 銘柄	100%	9.9%
ウルグアイ・ペソ	国債証券 3 銘柄	100%	0.2%
オフショア・人民元	国債証券 69 銘柄	100%	10.3%
コロンビア・ペソ	国債証券 12 銘柄	100%	4.1%
セルビア・ディナール	国債証券 4 銘柄	100%	0.3%
タイ・バーツ	国債証券 26 銘柄	100%	9.6%
チェコ・コルナ	国債証券 21 銘柄	100%	5.7%
チリ・ペソ	国債証券 9 銘柄	100%	1.8%
ドミニカ・ペソ	国債証券 3 銘柄	100%	0.2%
トルコ・リラ	国債証券 11 銘柄	100%	1.4%
ハンガリー・フォリント	国債証券 18 銘柄	100%	2.9%
ブラジル・リアル	国債証券 11 銘柄	100%	8.4%
ペルー・ソル	国債証券 10 銘柄	100%	2.0%
ポーランド・ズロチ	国債証券 15 銘柄	100%	7.9%
マレーシア・リンギット	国債証券 41 銘柄	100%	9.9%
メキシコ・ペソ	国債証券 14 銘柄	100%	9.8%
ルーマニア・レイ	国債証券 24 銘柄	100%	3.9%
南アフリカ・ランド	国債証券 12 銘柄	100%	8.7%

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。

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年9月7日現在 金額(円)	2024年9月9日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,271,683,142	27,438,981,412
株式 ※2※3	270,705,844,599	351,881,446,280
派生商品評価勘定	18,822,950	622,850
未収配当金	147,738,931	177,546,647
未収利息	445,513	-
前払金	-	201,845,000
その他未収収益 ※4	5,133,170	8,382,924
差入委託証拠金	-	62,898,786
流動資産合計	279,149,668,305	379,771,723,899
資産合計	279,149,668,305	379,771,723,899
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,611,000	209,781,350
前受金	29,830,000	-
未払金	-	7,880,295,743
未払解約金	199,745,260	236,715,530
未払利息	-	3,140,364
受入担保金	4,731,746,627	15,430,748,673
流動負債合計	4,962,932,887	23,760,681,660
負債合計	4,962,932,887	23,760,681,660
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	161,837,366,239	189,731,081,337
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	112,349,369,179	166,279,960,902
元本等合計	274,186,735,418	356,011,042,239
純資産合計	274,186,735,418	356,011,042,239
負債純資産合計	279,149,668,305	379,771,723,899

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023 年 9 月 7 日現在	2024 年 9 月 9 日現在
1. ※1 期首	2022 年 9 月 8 日	2023 年 9 月 8 日
期首元本額	145,845,153,885 円	161,837,366,239 円
期中追加設定元本額	30,026,484,362 円	45,131,685,403 円
期中一部解約元本額	14,034,272,008 円	17,237,970,305 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	2,793,318,390 円	2,796,289,328 円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA	4,449,282,916 円	3,855,336,127 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	912,820 円	906,394 円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	15,316,355 円	9,102,808 円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	211,418,762 円	139,731,414 円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	13,274,124 円	11,345,216 円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	431,729,482 円	326,312,724 円

区分	2023年9月7日現在	2024年9月9日現在
国内株式ファンド（適格機関投資家専用）	-円	1,210,358,757円
日本株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	622,737,314円	806,501,924円
アセット・アロケーションファンド（リスク判断付き）2023-07（適格機関投資家専用）	-円	1,139,715,535円
D-I's TOPIXインデックス	13,698,264円	12,940,316円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	240,356,411円	244,560,257円
iFree TOPIXインデックス	6,920,808,054円	8,736,405,174円
iFree 8資産バランス	4,560,584,662円	4,923,229,766円
iFree 年金バランス	935,557,156円	1,164,622,244円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	773,520円	4,217,861円
DCダイワ日本株式インデックス	70,174,462,134円	71,512,201,743円
ダイワ・ライフ・バランス30	3,127,446,388円	2,976,357,767円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,821,354,951円	5,065,079,023円
ダイワ・ライフ・バランス70	5,432,843,858円	6,061,926,904円
年金ダイワ日本株式インデックス	7,258,940,422円	7,869,642,736円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	52,401,134円	48,273,526円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	74,035,108円	75,818,829円
ダイワつみたてインデックス日本株式	4,235,923,782円	6,239,751,271円
ダイワつみたてインデックスバランス30	13,296,558円	12,225,840円
ダイワつみたてインデックスバランス50	10,469,291円	13,614,963円
ダイワつみたてインデックスバランス70	27,950,303円	34,614,877円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	8,828,703,798円	20,766,034,706円
ダイワ世界バランスファンド40VA	57,636,044円	46,891,177円
ダイワ世界バランスファンド60VA	22,132,245円	19,720,730円
ダイワ・バランスファンド35VA	4,030,569,248円	3,083,043,311円
ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	393,692,268円	302,012,383円
ダイワ国内バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	58,225,411円	40,356,490円

区分	2023年9月7日現在	2024年9月9日現在
ダイワ国内バランスファンド3 O V A (適格機関投資家専用)	77,438,203 円	57,882,863 円
ダイワ・ノーロード T O P I X ファンド	210,811,908 円	252,298,401 円
ダイワファンドラップ T O P I Xインデックス	12,158,605,124 円	14,290,905,074 円
ダイワT O P I Xインデックス (ダイワSMA専用)	5,648,467,601 円	12,373,133,432 円
ダイワファンドラップオンライ ン T O P I Xインデックス	3,440,682,772 円	3,448,211,798 円
スタイル9 (4資産分散・保守 型)	-円	550,348 円
スタイル9 (4資産分散・バラ ンス型)	-円	4,363,232 円
スタイル9 (4資産分散・積極 型)	-円	6,118,317 円
スタイル9 (6資産分散・保守 型)	-円	273,622 円
スタイル9 (6資産分散・バラ ンス型)	-円	7,841,413 円
スタイル9 (6資産分散・積極 型)	-円	9,101,329 円
スタイル9 (8資産分散・保守 型)	-円	435,270 円
スタイル9 (8資産分散・バラ ンス型)	-円	6,346,993 円
スタイル9 (8資産分散・積極 型)	-円	19,070,869 円
ダイワ・インデックスセレクト T O P I X	1,174,081,455 円	1,027,576,483 円
ダイワライフスタイル25	113,164,999 円	94,085,020 円
ダイワライフスタイル50	500,033,785 円	430,730,614 円
ダイワライフスタイル75	413,530,274 円	380,782,713 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)	8,270,698,945 円	7,772,231,425 円
計	161,837,366,239 円	189,731,081,337 円
2. 期末日における受益権の総数	161,837,366,239 口	189,731,081,337 口
3. ※2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以 下のとおり有価証券の貸付を 行っております。 株式 4,468,010,220 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 14,570,847,450 円
4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 株式 1,155,240,000 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 679,700,000 円

区分	2023年9月7日現在	2024年9月9日現在
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 2023年9月8日 至 2024年9月9日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年9月9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	2023年9月7日現在	2024年9月9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	46,580,138,955	15,818,431,709
合計	46,580,138,955	15,818,431,709

(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	2023年9月7日現在				2024年9月9日現在			
	契約額等 (円)	時価	評価損益 (円)	契約額等 (円)	時価	評価損益 (円)	契約額等 (円)	
		(円)			(円)			(円)
市場取引								
株価指数 先物取引								
買建	3,553,855,000	-	3,571,150,000	17,295,000	4,603,565,000	-	4,394,500,000	△209,065,000
合計	3,553,855,000	-	3,571,150,000	17,295,000	4,603,565,000	-	4,394,500,000	△209,065,000

(注)

1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2023年9月7日現在	2024年9月9日現在
1口当たり純資産額	1.6942円	1.8764円
(1万口当たり純資産額)	(16,942円)	(18,764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	5,600	4,075.00	22,820,000	
ニッスイ	135,900	927.50	126,047,250	
マルハニチロ	20,100	2,982.50	59,948,250	
雪国まいたけ	11,500	1,000.00	11,500,000	
カネコ種苗	3,800	1,362.00	5,175,600	
サカタのタネ	15,200	3,370.00	51,224,000	貸付株式数 6,000株
ホクト	10,800	1,825.00	19,710,000	
ホクリヨウ	500	983.00	491,500	貸付株式数 200株
ショーボンドHD	18,500	5,616.00	103,896,000	
ミライト・ワン	41,100	2,050.00	84,255,000	
タマホーム	8,500	3,945.00	33,532,500	貸付株式数 3,300株
サンヨーホームズ	300	701.00	210,300	貸付株式数 100株 (100株)
日本アクア	1,500	840.00	1,260,000	
ファーストコーポレーション	800	756.00	604,800	貸付株式数 400株
ベステラ	700	946.00	662,200	貸付株式数 300株 (300株)
キャンディル	700	603.00	422,100	貸付株式数 200株
住石ホールディングス	19,200	931.00	17,875,200	貸付株式数 7,500株
日鉄鉱業	5,400	4,125.00	22,275,000	貸付株式数 2,100株
三井松島 HLDGS	8,100	4,410.00	35,721,000	貸付株式数 3,100株
I N P E X	411,000	1,951.50	802,066,500	
石油資源開発	15,800	5,290.00	83,582,000	
K&O エナジーグループ	6,200	3,215.00	19,933,000	貸付株式数 2,400株
リョーサン菱洋HD	19,300	2,664.00	51,415,200	
ダイセキ環境ソリューション	600	1,023.00	613,800	貸付株式数 300株
第一カッター興業	3,900	1,492.00	5,818,800	
明豊ファシリティワークス	1,100	843.00	927,300	
安藤・間	78,900	1,127.00	88,920,300	
東急建設	42,700	722.00	30,829,400	
コムシスホールディングス	43,400	3,190.00	138,446,000	
ビーアールホールディングス	20,300	356.00	7,226,800	貸付株式数 7,700株
高松コンストラクションGP	10,100	2,939.00	29,683,900	貸付株式数 3,900株
東建コーポレーション	3,400	10,910.00	37,094,000	貸付株式数 300株
ソネック	400	929.00	371,600	貸付株式数 100株
ヤマウラ	6,800	1,113.00	7,568,400	貸付株式数 2,300株
オリエンタル白石	50,300	380.00	19,114,000	
大成建設	87,100	6,575.00	572,682,500	
大 林 組	340,100	1,870.00	635,987,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
清水建設	269,600	1,002.50	270,274,000	
飛島建設	9,800	1,425.00	13,965,000	
長谷工コーポレーション	87,100	1,856.50	161,701,150	
松井建設	8,900	764.00	6,799,600	貸付株式数 3,400 株
銭高組	300	3,525.00	1,057,500	
鹿島建設	210,900	2,603.50	549,078,150	
不動産トラ	6,600	2,315.00	15,279,000	
大末建設	900	1,632.00	1,468,800	
鉄建建設	6,800	2,396.00	16,292,800	
西松建設	18,100	5,200.00	94,120,000	
三井住友建設	70,900	378.00	26,800,200	
大豊建設	3,300	3,500.00	11,550,000	
佐田建設	1,300	869.00	1,129,700	
ナカノフドー建設	1,500	474.00	711,000	
奥村組	15,400	4,415.00	67,991,000	
東鉄工業	11,800	3,440.00	40,592,000	
イチケン	500	2,546.00	1,273,000	
富士ピー・エス	1,100	438.00	481,800	貸付株式数 500 株
浅沼組	35,200	696.00	24,499,200	貸付株式数 13,600 株
戸田建設	128,500	983.90	126,431,150	
熊谷組	15,700	3,460.00	54,322,000	
北野建設	400	3,790.00	1,516,000	
植木組	600	1,618.00	970,800	
矢作建設	12,900	1,620.00	20,898,000	
ピーエス・コンストラクション	12,100	987.00	11,942,700	
日本ハウス HLDGS	20,200	358.00	7,231,600	貸付株式数 6,500 株
大東建託	35,000	17,750.00	621,250,000	
新日本建設	13,300	1,600.00	21,280,000	
サムティホールディングス	18,500	2,615.00	48,377,500	
東亜道路	18,300	1,312.00	24,009,600	
日本道路	11,200	1,682.00	18,838,400	貸付株式数 2,400 株
東亜建設	28,700	907.00	26,030,900	
日本国土開発	26,900	486.00	13,073,400	貸付株式数 200 株
若築建設	3,300	3,310.00	10,923,000	
東洋建設	24,000	1,370.00	32,880,000	
五洋建設	134,900	614.60	82,909,540	
世紀東急	12,200	1,609.00	19,629,800	貸付株式数 4,700 株
福田組	3,600	5,300.00	19,080,000	
日本ドライケミカル	500	3,100.00	1,550,000	貸付株式数 100 株
住友林業	82,200	6,047.00	497,063,400	
日本基礎技術	1,300	697.00	906,100	
巴コーポレーション	2,600	971.00	2,524,600	
大和ハウス	263,000	4,550.00	1,196,650,000	
ライト工業	17,600	2,136.00	37,593,600	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
積水ハウス	288,300	3,848.00	1,109,378,400	
日特建設	9,200	1,015.00	9,338,000	貸付株式数 3,500 株
北陸電気工事	6,600	1,186.00	7,827,600	
ユアテック	21,000	1,535.00	32,235,000	
日本リーテック	7,400	1,069.00	7,910,600	
四電工	4,000	3,830.00	15,320,000	
中電工	14,800	3,275.00	48,470,000	貸付株式数 5,700 株
関電工	59,600	2,188.00	130,404,800	
きんでん	66,100	3,257.00	215,287,700	
東京エネシス	8,800	1,123.00	9,882,400	
トーエネック	3,200	4,910.00	15,712,000	
住友電設	9,100	3,565.00	32,441,500	
日本電設工業	17,900	1,789.00	32,023,100	
エクシオグループ	93,000	1,582.50	147,172,500	
新日本空調	6,200	3,325.00	20,615,000	
九電工	20,600	6,542.00	134,765,200	
三機工業	20,600	2,188.00	45,072,800	
日揮ホールディングス	94,100	1,217.00	114,519,700	
中外炉工業	3,100	2,665.00	8,261,500	
ヤマト	1,800	961.00	1,729,800	
太平電業	6,000	5,310.00	31,860,000	
高砂熱学	25,500	5,010.00	127,755,000	貸付株式数 9,900 株
三晃金属	300	3,990.00	1,197,000	
NEC ネットエスアイ	37,900	2,640.00	100,056,000	
朝日工業社	8,900	1,316.00	11,712,400	
明星工業	18,500	1,195.00	22,107,500	
大気社	11,000	4,725.00	51,975,000	
ダイダン	12,500	2,840.00	35,500,000	
日比谷総合設備	6,900	3,350.00	23,115,000	貸付株式数 2,500 株
ニッポン	28,500	2,259.00	64,381,500	貸付株式数 10,800 株
日清製粉G本社	88,300	1,890.50	166,931,150	
日東富士製粉	1,700	7,060.00	12,002,000	貸付株式数 600 株
昭和産業	8,900	2,921.00	25,996,900	
鳥越製粉	1,900	677.00	1,286,300	
中部飼料	13,200	1,505.00	19,866,000	
フィード・ワン	13,900	836.00	11,620,400	
東洋精糖	400	1,433.00	573,200	
日本甜菜糖	5,500	2,673.00	14,701,500	貸付株式数 2,100 株
DM 三井製糖ホールディ	9,400	3,300.00	31,020,000	
塩水港精糖	2,700	264.00	712,800	貸付株式数 200 株
ウエルネオシュガー	4,700	2,195.00	10,316,500	
L I F U L L	24,200	139.00	3,363,800	貸付株式数 9,500 株
M I X I	21,400	2,836.00	60,690,400	
ジェイエイシーリクルート メント	36,100	790.00	28,519,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
日本 M&A センターホールディングス	158,900	641.80	101,982,020	貸付株式数 62,100 株
メンバーズ	3,400	883.00	3,002,200	
中広	400	520.00	208,000	
UTグループ	13,000	2,678.00	34,814,000	
アイティメディア	3,800	1,656.00	6,292,800	貸付株式数 100 株
ケアネット	20,400	630.00	12,852,000	貸付株式数 200 株
E・Jホールディングス	5,800	1,744.00	10,115,200	
オープンアップグループ	30,000	2,028.00	60,840,000	
コシダカホールディングス	29,900	965.00	28,853,500	貸付株式数 11,600 株
アルトナー	900	1,752.00	1,576,800	貸付株式数 400 株
パソナグループ	12,100	2,207.00	26,704,700	
CDS	700	1,836.00	1,285,200	
リンクアンドモチベーション	24,600	576.00	14,169,600	
エス・エム・エス	34,900	2,144.50	74,843,050	
サニーサイドアップG	800	521.00	416,800	貸付株式数 200 株
パーソルホールディングス	1,014,700	282.00	286,145,400	
リニカル	1,500	403.00	604,500	
クックパッド	27,200	192.00	5,222,400	貸付株式数 10,100 株
エスクリ	900	241.00	216,900	貸付株式数 400 株
アイ・ケイ・ケイホールディング	1,600	764.00	1,222,400	貸付株式数 500 株 (400 株)
森永製菓	39,900	2,908.50	116,049,150	
中村屋	2,300	3,210.00	7,383,000	貸付株式数 600 株
江崎グリコ	27,300	4,250.00	116,025,000	
名糖産業	3,700	1,863.00	6,893,100	貸付株式数 1,400 株
井村屋グループ	5,600	2,480.00	13,888,000	
不二家	6,500	2,647.00	17,205,500	貸付株式数 2,500 株
山崎製パン	63,900	2,810.00	179,559,000	
第一屋製パン	400	617.00	246,800	貸付株式数 200 株
モロゾフ	3,100	4,610.00	14,291,000	貸付株式数 1,000 株
亀田製菓	5,500	4,655.00	25,602,500	
寿スピリッツ	45,200	1,750.50	79,122,600	貸付株式数 17,600 株
カルビー	43,700	3,430.00	149,891,000	貸付株式数 3,000 株
森永乳業	33,300	3,446.00	114,751,800	
六甲バター	6,900	1,435.00	9,901,500	貸付株式数 200 株
ヤクルト	136,400	3,135.00	427,614,000	
明治ホールディングス	117,000	3,680.00	430,560,000	
雪印メグミルク	23,000	2,689.00	61,847,000	
プリマハム	12,800	2,382.00	30,489,600	
日本ハム	41,000	5,511.00	225,951,000	
林兼産業	800	477.00	381,600	貸付株式数 300 株
丸大食品	9,500	1,736.00	16,492,000	貸付株式数 3,700 株
S F o o d s	10,500	2,667.00	28,003,500	貸付株式数 4,100 株
柿安本店	3,700	2,580.00	9,546,000	貸付株式数 1,400 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考	
		単価	金額		
伊藤ハム米久 HLDGS	14,600	3,885.00	56,721,000	貸付株式数	2,200株
学情	5,100	1,676.00	8,547,600	貸付株式数	2,000株
スタジオアリス	5,000	2,052.00	10,260,000	貸付株式数	1,800株 (800株)
クロスキャット	6,200	1,129.00	6,999,800	貸付株式数	2,400株
エプコ	600	798.00	478,800		
システナ	147,100	384.00	56,486,400		
N J S	2,500	3,535.00	8,837,500	貸付株式数	900株
デジタルアーツ	6,200	4,310.00	26,722,000	貸付株式数	1,000株
日鉄ソリューションズ	33,200	3,585.00	119,022,000	貸付株式数	300株
総合警備保障	166,400	1,039.50	172,972,800		
キューブシステム	5,100	1,061.00	5,411,100	貸付株式数	1,900株
いちご	97,000	355.00	34,435,000		
日本駐車場開発	113,400	216.00	24,494,400		
コア	4,300	1,746.00	7,507,800		
カカクコム	64,700	2,499.50	161,717,650		
アイロムグループ	4,000	2,770.00	11,080,000		
セントケア・ホールディング	7,300	747.00	5,453,100	貸付株式数	2,000株
サイネックス	400	708.00	283,200	貸付株式数	100株
ルネサンス	7,800	1,051.00	8,197,800	貸付株式数	3,000株
ディップ	15,300	2,858.00	43,727,400	貸付株式数	5,900株
SBS ホールディングス	8,600	2,458.00	21,138,800	貸付株式数	3,300株
デジタルホールディングス	5,100	956.00	4,875,600		
新日本科学	9,100	1,138.00	10,355,800	貸付株式数	3,300株
キャリアデザインセンター	400	1,924.00	769,600	貸付株式数	200株
エムスリー	197,000	1,366.50	269,200,500		
ツカダ・グローバル HOLD	1,800	390.00	702,000	貸付株式数	600株
プラス	300	570.00	171,000	貸付株式数	100株
ウェルネット	2,000	800.00	1,600,000		
ワールドホールディングス	3,900	1,921.00	7,491,900	貸付株式数	400株
ディー・エヌ・エー	35,500	1,659.00	58,894,500		
博報堂D Y HLDGS	127,200	1,216.50	154,738,800		
ぐるなび	18,700	373.00	6,975,100	貸付株式数	6,800株
タカミヤ	13,500	462.00	6,237,000		
ファンコミュニケーションズ	14,200	400.00	5,680,000	貸付株式数	3,700株
ライク	3,700	1,421.00	5,257,700	貸付株式数	1,400株 (1,200株)
A o b a - B B T	1,000	320.00	320,000	貸付株式数	400株
エスプール	31,500	357.00	11,245,500	貸付株式数	12,300株
WDB ホールディングス	5,100	1,713.00	8,736,300	貸付株式数	1,800株
手間いらず	1,600	3,300.00	5,280,000	貸付株式数	500株
ティア	1,500	452.00	678,000	貸付株式数	200株
CDG	200	1,677.00	335,400		
アドウェイズ	12,300	354.00	4,354,200		

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
バリューコマース	8,800	1,083.00	9,530,400	
インフォマート	94,100	322.00	30,300,200	貸付株式数 36,800株
サッポロホールディングス	31,400	7,538.00	236,693,200	
アサヒグループホールディングン	239,000	5,585.00	1,334,815,000	
麒麟HD	397,700	2,246.00	893,234,200	
宝ホールディングス	64,400	1,152.00	74,188,800	
オエノンホールディングス	30,700	387.00	11,880,900	貸付株式数 1,600株
養命酒	3,100	2,286.00	7,086,600	貸付株式数 1,100株
コカ・コーラボトラーズJHD	67,300	2,133.50	143,584,550	
サントリー食品インター	67,200	5,426.00	364,627,200	
ダイドーグループHD	10,800	2,878.00	31,082,400	貸付株式数 4,200株
伊藤園	32,000	3,334.00	106,688,000	貸付株式数 200株
キーコーヒー	10,700	2,052.00	21,956,400	貸付株式数 4,100株
ユニカフェ	700	917.00	641,900	貸付株式数 400株
日清オイリオグループ	13,400	5,240.00	70,216,000	
不二製油グループ	22,200	3,336.00	74,059,200	
かどや製油	200	3,640.00	728,000	
J-オイルミルズ	10,900	1,940.00	21,146,000	
サンエー	15,700	2,576.00	40,443,200	貸付株式数 2,600株
カワチ薬品	8,000	2,694.00	21,552,000	
エービーシー・マート	44,900	3,073.00	137,977,700	
ハードオフコーポレーション	4,600	1,888.00	8,684,800	
高千穂交易	4,100	3,845.00	15,764,500	貸付株式数 1,500株
アスクル	24,800	2,058.00	51,038,400	貸付株式数 9,600株
ゲオホールディングス	11,500	1,575.00	18,112,500	
アダストリア	12,400	3,500.00	43,400,000	
ジーフット	1,800	285.00	513,000	貸付株式数 1,000株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	300	551.00	165,300	貸付株式数 100株
オルバヘルスケア HLDGS	400	1,866.00	746,400	
伊藤忠食品	2,300	7,240.00	16,652,000	
くら寿司	12,000	3,625.00	43,500,000	貸付株式数 4,700株
キャンドゥ	3,700	3,310.00	12,247,000	貸付株式数 1,400株
エレマテック	9,200	1,749.00	16,090,800	
IKホールディングス	700	358.00	250,600	貸付株式数 400株
パルグループ HLDGS	20,100	2,386.00	47,958,600	
エディオン	40,600	1,854.00	75,272,400	
あらた	15,700	3,640.00	57,148,000	
サーラコーポレーション	21,600	834.00	18,014,400	
ワッツ	1,000	830.00	830,000	貸付株式数 500株
トーマンデバイス	1,500	5,550.00	8,325,000	貸付株式数 500株
ハローズ	4,700	4,065.00	19,105,500	
JPホールディングス	25,500	709.00	18,079,500	貸付株式数 1,200株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考	
		単価	金額		
フジオフードG 本社	11,600	1,316.00	15,265,600	貸付株式数	4,500株 (300株)
あみやき亭	2,500	5,720.00	14,300,000	貸付株式数	800株
東京エレクトロニクス	10,200	3,525.00	35,955,000	貸付株式数	4,000株
ひらまつ	5,400	189.00	1,020,600	貸付株式数	2,000株
円谷フィールズホールディ	16,600	1,956.00	32,469,600	貸付株式数	6,400株
双日	114,300	3,259.00	372,503,700		
アルフレッサホールディン グス	103,000	2,419.50	249,208,500		
大黒天物産	3,200	11,370.00	36,384,000	貸付株式数	1,200株
ハニーズホールディングス	9,100	1,599.00	14,550,900	貸付株式数	3,400株
ファーマライズHD	600	609.00	365,400	貸付株式数	100株
キッコーマン	316,400	1,608.00	508,771,200		
味の素	224,400	5,473.00	1,228,141,200		
ブルドックソース	5,000	1,815.00	9,075,000		
キューピー	51,300	3,669.00	188,219,700	貸付株式数	20,000株
ハウス食品G 本社	32,200	2,985.50	96,133,100		
カゴメ	40,800	3,152.00	128,601,600	貸付株式数	8,200株
アリアケジャパン	9,500	4,735.00	44,982,500	貸付株式数	2,300株
ピエトロ	300	1,761.00	528,300	貸付株式数	100株
エバラ食品工業	2,300	2,775.00	6,382,500		
やまみ	300	4,930.00	1,479,000	貸付株式数	100株
ニチレイ	43,700	4,377.00	191,274,900		
横浜冷凍	25,700	990.00	25,443,000		
東洋水産	48,200	8,967.00	432,209,400		
イトアンド HLDGS	4,500	2,027.00	9,121,500	貸付株式数	1,700株
大冷	300	1,970.00	591,000		
ヨシムラ・フード・HLDGS	4,400	1,668.00	7,339,200	貸付株式数	1,600株
日清食品HD	100,700	3,875.00	390,212,500		
一正蒲鉾	900	738.00	664,200	貸付株式数	200株 (200株)
フジッコ	9,700	1,722.00	16,703,400	貸付株式数	300株
ロックフィールド	11,600	1,469.00	17,040,400	貸付株式数	4,500株
日本たばこ産業	580,200	4,206.00	2,440,321,200	貸付株式数	226,800株
ケンコーマヨネーズ	6,600	2,217.00	14,632,200		
わらべや日洋HD	6,400	2,283.00	14,611,200	貸付株式数	2,500株
なとり	5,900	2,065.00	12,183,500		
イフジ産業	400	1,421.00	568,400	貸付株式数	200株
ファーマフーズ	12,600	953.00	12,007,800	貸付株式数	4,900株
北の達人コーポ	41,100	166.00	6,822,600	貸付株式数	16,100株 (1,300株)
ユーグレナ	59,300	477.00	28,286,100	貸付株式数	23,200株 (600株)
紀文食品	8,200	1,190.00	9,758,000	貸付株式数	3,000株
ピクルスホールディング ス	5,500	1,002.00	5,511,000	貸付株式数	1,900株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
スター・マイカ・HLDGS	9,600	612.00	5,875,200	
SRE ホールディングス	4,100	4,465.00	18,306,500	貸付株式数 1,600 株
AD ワークスグループ	5,100	201.00	1,025,100	貸付株式数 100 株
片倉工業	8,900	1,988.00	17,693,200	
グンゼ	6,900	5,600.00	38,640,000	
ヒューリック	222,400	1,468.00	326,483,200	貸付株式数 87,100 株
神栄	300	1,684.00	505,200	
ラサ商事	5,200	1,469.00	7,638,800	貸付株式数 900 株
アルペン	8,400	2,119.00	17,799,600	貸付株式数 3,100 株
ハブ	800	761.00	608,800	貸付株式数 300 株
ラクーンホールディングス	7,300	710.00	5,183,000	貸付株式数 2,800 株
クオールホールディングス	14,100	1,430.00	20,163,000	
アルコニックス	13,600	1,360.00	18,496,000	
神戸物産	79,400	4,408.00	349,995,200	貸付株式数 31,000 株
ソリトンシステムズ	5,000	1,076.00	5,380,000	
ジンズホールディングス	7,800	5,230.00	40,794,000	貸付株式数 2,900 株
ビックカメラ	61,400	1,567.00	96,213,800	貸付株式数 19,600 株
DCM ホールディングス	53,100	1,458.00	77,419,800	
ペッパーフードサービス	30,200	160.00	4,832,000	
ハイパー	500	321.00	160,500	貸付株式数 200 株
MonotaRO	145,400	2,461.00	357,829,400	貸付株式数 56,800 株
東京一番フーズ	900	511.00	459,900	
DDグループ	1,500	1,272.00	1,908,000	貸付株式数 800 株
あいホールディングス	17,100	2,371.00	40,544,100	
ディービーエックス	600	953.00	571,800	
きちりホールディングス	600	843.00	505,800	貸付株式数 300 株
J. フロントリテイリング	117,700	1,475.00	173,607,500	貸付株式数 46,000 株
ドトール・日レスHD	18,200	2,272.00	41,350,400	
マツキヨココカラ&カンパニー	186,600	2,235.50	417,144,300	
ブロンコビリー	6,000	3,640.00	21,840,000	貸付株式数 2,300 株
ZOZO	65,400	4,671.00	305,483,400	
トレジャー・ファクトリー	7,100	1,775.00	12,602,500	
物語コーポレーション	17,100	3,440.00	58,824,000	貸付株式数 6,700 株
三越伊勢丹HD	169,800	2,169.00	368,296,200	
東洋紡	42,000	991.00	41,622,000	
ユニチカ	31,300	296.00	9,264,800	貸付株式数 12,200 株
富士紡ホールディングス	4,200	4,195.00	17,619,000	
日清紡ホールディングス	73,200	925.60	67,753,920	貸付株式数 28,700 株
倉敷紡績	6,900	4,665.00	32,188,500	
ダイワボウHD	45,400	2,732.50	124,055,500	
シキボウ	6,800	1,043.00	7,092,400	貸付株式数 1,800 株
日東紡績	12,300	5,220.00	64,206,000	
トヨタ紡織	40,500	1,853.50	75,066,750	
マクニカホールディングス	24,300	5,641.00	137,076,300	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
H a m e e	4,100	1,103.00	4,522,300	貸付株式数 1,600株
マーケットエンタープライズ	200	835.00	167,000	
ラクト・ジャパン	4,400	2,970.00	13,068,000	貸付株式数 1,600株
ウエルシアHD	53,200	1,969.00	104,750,800	
クリエイトSDH	14,600	3,145.00	45,917,000	貸付株式数 5,100株
グリムス	4,300	2,492.00	10,715,600	貸付株式数 1,500株
バイタルKSKHD	15,500	1,230.00	19,065,000	貸付株式数 6,000株
八洲電機	8,300	1,558.00	12,931,400	貸付株式数 3,200株
メディアスホールディングス	5,800	765.00	4,437,000	貸付株式数 2,300株
レスター	8,700	2,651.00	23,063,700	
ジオリーブグループ	600	1,130.00	678,000	
丸善CHI HD	2,800	324.00	907,200	貸付株式数 1,400株 (1,400株)
大光	1,100	605.00	665,500	貸付株式数 600株
OCHI ホールディングス	500	1,390.00	695,000	
TOKAI ホールディングス	55,700	992.00	55,254,400	貸付株式数 16,800株
黒谷	600	600.00	360,000	
ミサワ	400	617.00	246,800	
ティーライフ	300	1,142.00	342,600	貸付株式数 100株
C o m i n i x	400	888.00	355,200	
エー・ピーホールディングス	600	990.00	594,000	貸付株式数 200株
三洋貿易	10,600	1,445.00	15,317,000	
チムニー	700	1,325.00	927,500	貸付株式数 300株
シュッピン	9,300	1,175.00	10,927,500	
ビューティガレージ	3,200	1,447.00	4,630,400	貸付株式数 1,200株
オイシックス・ラ・大地	13,800	1,332.00	18,381,600	貸付株式数 5,400株
ウイン・パートナーズ	6,400	1,151.00	7,366,400	貸付株式数 2,300株
ネクステージ	23,400	1,754.00	41,043,600	貸付株式数 8,000株
ジョイフル本田	28,500	2,129.00	60,676,500	貸付株式数 11,100株
エターナルホスピタリティ グル	3,800	3,060.00	11,628,000	
ホットランド	7,900	2,205.00	17,419,500	貸付株式数 3,000株 (200株)
すかいらく HD	140,200	2,313.00	324,282,600	貸付株式数 54,800株
SFP ホールディングス	5,000	1,966.00	9,830,000	貸付株式数 1,900株
綿半ホールディングス	7,900	1,718.00	13,572,200	貸付株式数 1,300株
日本毛織	24,900	1,307.00	32,544,300	
ダイトウボウ	3,300	101.00	333,300	貸付株式数 1,800株
トーア紡コーポレーション	900	403.00	362,700	貸付株式数 100株
ダイドーリミテッド	2,700	930.00	2,511,000	貸付株式数 1,400株
ヨシックスホールディング ス	2,600	3,205.00	8,333,000	貸付株式数 1,000株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ユナイテッド・スーパーマ ーケ	28,600	835.00	23,881,000	貸付株式数 11,200株 (300株)
野村不動産 HLDGS	53,100	4,069.00	216,063,900	
三重交通グループ HD	20,200	496.00	10,019,200	貸付株式数 7,800株
地主	8,400	1,981.00	16,640,400	貸付株式数 200株
プレサンスコーポレーショ ン	12,500	1,894.00	23,675,000	貸付株式数 4,900株
フィル・カンパニー	1,900	615.00	1,168,500	
ハウスコム	300	1,013.00	303,900	貸付株式数 100株
J PMC	5,400	1,145.00	6,183,000	
サンセイランディック	700	960.00	672,000	貸付株式数 300株
エストラスト	200	690.00	138,000	
フージャース HD	14,400	1,039.00	14,961,600	
オープンハウスグループ	35,000	5,679.00	198,765,000	
東急不動産HD	286,900	995.70	285,666,330	
飯田GHD	91,400	2,265.50	207,066,700	
イーランド	300	1,468.00	440,400	貸付株式数 100株
帝国繊維	11,000	2,717.00	29,887,000	貸付株式数 4,200株
日本コークス工業	98,400	98.00	9,643,200	貸付株式数 38,700株
ゴルフダイジェスト・オン	5,900	385.00	2,271,500	貸付株式数 2,300株
ミタチ産業	600	1,085.00	651,000	貸付株式数 300株
BEENOS	6,100	2,457.00	14,987,700	
あさひ	9,500	1,569.00	14,905,500	
日本調剤	6,800	1,257.00	8,547,600	貸付株式数 2,600株
コスモス薬品	17,400	7,256.00	126,254,400	
シップヘルスケア HD	36,800	2,161.00	79,524,800	
トーエル	1,000	822.00	822,000	貸付株式数 300株
ソフトクリエイト HD	8,000	1,697.00	13,576,000	
セブン&アイ・HLDGS	1,038,900	2,185.00	2,269,996,500	
クリエイト・レストラン ツ・ホール	69,400	1,025.00	71,135,000	貸付株式数 27,100株
明治電機工業	3,800	1,451.00	5,513,800	
ツルハホールディングス	21,600	8,804.00	190,166,400	
デリカフーズ HLDGS	900	568.00	511,200	
スターティアホールディン グス	600	2,031.00	1,218,600	貸付株式数 300株
サンマルクホールディン グス	8,300	2,080.00	17,264,000	
フェリシモ	500	905.00	452,500	
トリドールホールディン グス	28,800	3,534.00	101,779,200	貸付株式数 11,200株
帝人	93,300	1,353.50	126,281,550	
東レ	650,700	763.00	496,484,100	
クラレ	141,600	1,826.50	258,632,400	
旭化成	657,000	1,037.50	681,637,500	
TOKYO BASE	10,900	238.00	2,594,200	貸付株式数 4,200株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
稲葉製作所	5,600	1,709.00	9,570,400	貸付株式数 2,100株
宮地エンジニアリングG	5,000	4,175.00	20,875,000	
トーカロ	28,800	1,701.00	48,988,800	貸付株式数 10,900株
アルファCO	800	1,200.00	960,000	
SUMCO	190,500	1,486.00	283,083,000	貸付株式数 74,400株
川田テクノロジーズ	7,100	2,525.00	17,927,500	
RS TECHNOLOGIES	7,700	3,220.00	24,794,000	貸付株式数 3,000株
ジェイテックコーポレーション	400	1,529.00	611,600	貸付株式数 200株
信和	1,500	768.00	1,152,000	貸付株式数 700株
ビーロット	1,300	970.00	1,261,000	貸付株式数 700株
ファーストブラザーズ	500	1,107.00	553,500	
AND DO ホールディングス	5,700	1,019.00	5,808,300	貸付株式数 2,000株
シーアールイー	4,200	1,374.00	5,770,800	貸付株式数 1,600株
ケイアイスター不動産	4,600	3,820.00	17,572,000	貸付株式数 1,800株
アグレ都市デザイン	400	1,487.00	594,800	貸付株式数 200株
ジェイ・エス・ビー	3,900	2,857.00	11,142,300	貸付株式数 1,500株
ロードスターキャピタル	5,400	2,277.00	12,295,800	
テンポイノベーション	600	919.00	551,400	貸付株式数 200株
グローバルリンクマネジメント	400	2,106.00	842,400	貸付株式数 200株
フェイスネットワーク	600	1,539.00	923,400	貸付株式数 300株
霞ヶ関キャピタル	3,900	13,080.00	51,012,000	貸付株式数 800株
住江織物	400	2,069.00	827,600	貸付株式数 200株 (200株)
日本フェルト	1,300	489.00	635,700	
イチカワ	300	1,620.00	486,000	
エコナックホールディングス	1,800	113.00	203,400	貸付株式数 1,000株
日東製網	200	1,454.00	290,800	貸付株式数 100株
芦森工業	400	2,190.00	876,000	
アツギ	1,500	748.00	1,122,000	
ウイルプラス HLDGS	400	1,157.00	462,800	
JM ホールディングス	7,700	3,030.00	23,331,000	
コメダホールディングス	25,200	2,698.00	67,989,600	貸付株式数 300株
サツドラホールディングス	900	795.00	715,500	貸付株式数 500株
アレンザホールディングス	7,600	1,048.00	7,964,800	貸付株式数 2,900株
串カツ田中 HLDGS	3,100	1,443.00	4,473,300	貸付株式数 1,200株 (300株)
バロックジャパン	8,100	763.00	6,180,300	貸付株式数 3,100株
クスリのアオキ HLDGS	30,900	3,361.00	103,854,900	貸付株式数 12,000株
ダイニック	700	775.00	542,500	
共和レザー	1,200	681.00	817,200	
ピーバンドットコム	300	365.00	109,500	貸付株式数 100株
力の源 HD	6,600	1,143.00	7,543,800	貸付株式数 2,600株
FOOD&LIFE COMPAN	54,700	2,615.00	143,040,500	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
アセンテック	3,900	536.00	2,090,400	
セーレン	18,600	2,503.00	46,555,800	貸付株式数 7,300 株
ソトー	700	706.00	494,200	貸付株式数 300 株
東海染工	300	774.00	232,200	
小松マテーレ	14,100	738.00	10,405,800	貸付株式数 2,200 株
ワコールホールディングス	18,100	4,379.00	79,259,900	
ホギメディカル	12,500	4,335.00	54,187,500	貸付株式数 5,000 株
クラウドディア HLDGS	500	352.00	176,000	貸付株式数 300 株
T S I ホールディングス	29,100	914.00	26,597,400	貸付株式数 400 株
マツオカコーポレーション	700	1,739.00	1,217,300	
ワールド	13,700	1,906.00	26,112,200	
T I S	102,800	3,545.00	364,426,000	
テクミラホールディングス	900	339.00	305,100	貸付株式数 500 株
グリー	32,700	450.00	14,715,000	
GMOペパボ	1,200	1,356.00	1,627,200	貸付株式数 200 株
コーエーテクモHD	61,000	1,593.50	97,203,500	貸付株式数 15,500 株
三菱総合研究所	4,800	4,080.00	19,584,000	
ボルテージ	900	230.00	207,000	貸付株式数 300 株
電算	200	1,396.00	279,200	
AGS	900	853.00	767,700	貸付株式数 400 株
ファインデックス	7,700	871.00	6,706,700	貸付株式数 3,000 株
ブレインパッド	8,100	850.00	6,885,000	
KL a b	23,700	193.00	4,574,100	貸付株式数 6,100 株
ポールトゥウィンホールディングン	16,700	409.00	6,830,300	
ネクソン	213,500	2,728.50	582,534,750	
アイスタイル	32,500	519.00	16,867,500	
エムアップホールディングス	11,900	1,248.00	14,851,200	
エイチーム	6,500	654.00	4,251,000	貸付株式数 2,400 株
エニグモ	12,300	332.00	4,083,600	貸付株式数 4,800 株
テクノスジャパン	1,900	669.00	1,271,100	
e n i s h	2,900	181.00	524,900	貸付株式数 900 株
コロプラ	33,100	562.00	18,602,200	貸付株式数 12,900 株
オルトプラス	2,400	101.00	242,400	貸付株式数 900 株
ブロードリーフ	39,000	682.00	26,598,000	
クロス・マーケティングG	1,000	679.00	679,000	貸付株式数 500 株
デジタルハーツ HLDGS	6,100	812.00	4,953,200	貸付株式数 2,300 株
メディアドゥ	4,400	1,396.00	6,142,400	貸付株式数 1,500 株
じげん	28,400	565.00	16,046,000	貸付株式数 9,700 株
ブイキューブ	13,300	207.00	2,753,100	貸付株式数 5,200 株
エンカレッジ・テクノロジー	500	595.00	297,500	貸付株式数 200 株
サイバーリンクス	800	750.00	600,000	貸付株式数 400 株
ディー・エル・イー	4,300	121.00	520,300	
フィックスターズ	9,800	1,458.00	14,288,400	貸付株式数 3,800 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考	
		単価	金額		
CARTA HOLDINGS	5,500	1,335.00	7,342,500	貸付株式数	1,600株
オプティム	10,000	614.00	6,140,000	貸付株式数	3,900株
セレス	4,400	1,227.00	5,398,800	貸付株式数	1,700株
S H I F T	6,500	11,825.00	76,862,500	貸付株式数	2,500株
特種東海製紙	5,200	3,665.00	19,058,000	貸付株式数	2,000株
ティーガイア	10,200	3,790.00	38,658,000	貸付株式数	3,800株
セック	1,500	4,205.00	6,307,500		
テクマトリックス	17,800	2,309.00	41,100,200	貸付株式数	3,300株
プロシップ	4,700	1,396.00	6,561,200	貸付株式数	700株
ガンホー・オンライン・エンター	24,100	3,070.00	73,987,000	貸付株式数	6,100株
GMO ペイメントゲートウェイ	22,200	8,725.00	193,695,000		
ザッパラス	500	358.00	179,000	貸付株式数	100株
システムリサーチ	6,700	1,431.00	9,587,700	貸付株式数	2,600株
インターネットイニシアティブ	46,500	2,883.50	134,082,750		
さくらインターネット	12,200	3,815.00	46,543,000	貸付株式数	4,700株
GMO グローバルサインHD	3,000	2,735.00	8,205,000	貸付株式数	1,100株
SRA ホールディングス	5,000	4,300.00	21,500,000		
システムインテグレータ	600	316.00	189,600	貸付株式数	200株
朝日ネット	10,400	658.00	6,843,200		
e B A S E	13,700	602.00	8,247,400	貸付株式数	4,800株
アバントグループ	12,300	2,013.00	24,759,900		
アドソル日進	4,100	1,728.00	7,084,800		
ODK ソリューションズ	400	584.00	233,600	貸付株式数	200株
フリービット	4,200	1,196.00	5,023,200		
コムチュア	14,000	1,554.00	21,756,000		
アステリア	7,600	534.00	4,058,400	貸付株式数	2,700株
アイル	5,400	2,950.00	15,930,000	貸付株式数	1,900株
王子ホールディングス	404,600	577.80	233,777,880		
日本製紙	54,900	914.00	50,178,600	貸付株式数	21,400株
三菱製紙	2,900	542.00	1,571,800	貸付株式数	1,500株
北越コーポレーション	47,700	1,396.00	66,589,200	貸付株式数	18,600株
中越パルプ	800	1,313.00	1,050,400	貸付株式数	300株
巴川コーポレーション	600	768.00	460,800	貸付株式数	300株
大王製紙	42,900	849.00	36,422,100		
阿波製紙	600	462.00	277,200	貸付株式数	300株
マークライonz	5,800	3,060.00	17,748,000		
メディカル・データ・ビジ	11,500	515.00	5,922,500	貸付株式数	4,500株
g u m i	15,700	305.00	4,788,500	貸付株式数	6,200株
ショーケース	500	258.00	129,000	貸付株式数	200株
モバイルファクトリー	400	783.00	313,200	貸付株式数	200株
テラスカイ	4,200	2,206.00	9,265,200	貸付株式数	1,600株
デジタル・インフォメーション	5,100	1,927.00	9,827,700		

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
PCI ホールディングス	800	1,102.00	881,600	
アイビーシー	300	525.00	157,500	
ネオジャパン	3,100	1,778.00	5,511,800	
P R T I M E S	1,900	1,699.00	3,228,100	貸付株式数 500 株
ラクス	46,000	2,309.00	106,214,000	
ランドコンピュータ	1,000	752.00	752,000	
ダブルスタンダード	2,900	1,502.00	4,355,800	貸付株式数 1,000 株
オープンドア	5,700	700.00	3,990,000	貸付株式数 2,200 株
マイネット	700	352.00	246,400	貸付株式数 100 株
アカツキ	4,700	2,018.00	9,484,600	
ベネフィットジャパン	100	1,109.00	110,900	
UBICOM ホールディングス	3,100	1,328.00	4,116,800	貸付株式数 1,200 株
カナミックネットワーク	12,200	542.00	6,612,400	
ノムラシステムコーポレーション	2,500	113.00	282,500	貸付株式数 1,200 株
レンゴー	88,400	995.40	87,993,360	
トーモク	5,600	2,372.00	13,283,200	
ザ・パック	7,200	3,765.00	27,108,000	
チェンジホールディングス	21,400	1,250.00	26,750,000	
シンクロ・フード	1,400	500.00	700,000	
オークネット	4,500	2,255.00	10,147,500	
キャピタル・アセット・プラン	400	818.00	327,200	
セグエグループ	2,000	649.00	1,298,000	貸付株式数 1,000 株
エイトレッド	300	1,559.00	467,700	
マクロミル	19,100	761.00	14,535,100	
ビーグリー	400	1,300.00	520,000	
オロ	4,100	2,370.00	9,717,000	貸付株式数 1,100 株
ユーザーローカル	4,100	1,876.00	7,691,600	貸付株式数 1,600 株
テモナ	500	205.00	102,500	貸付株式数 200 株
ニーズウェル	2,300	311.00	715,300	
マネーフォワード	23,800	5,513.00	131,209,400	貸付株式数 9,200 株
サインポスト	800	514.00	411,200	貸付株式数 400 株
レゾナック・ホールディング	87,100	3,157.00	274,974,700	
住友化学	720,600	391.40	282,042,840	
住友精化	4,600	5,160.00	23,736,000	
日産化学	45,300	4,990.00	226,047,000	
ラサ工業	3,700	2,477.00	9,164,900	
クレハ	20,100	2,695.00	54,169,500	貸付株式数 7,300 株
多木化学	3,800	3,795.00	14,421,000	貸付株式数 1,100 株
テイカ	8,000	1,635.00	13,080,000	貸付株式数 2,100 株
石原産業	16,100	1,468.00	23,634,800	
片倉コープアグリ	500	1,008.00	504,000	貸付株式数 200 株
日本曹達	11,300	4,955.00	55,991,500	
東ソー	129,700	1,844.00	239,166,800	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
トクヤマ	31,400	2,582.50	81,090,500	
セントラル硝子	10,400	3,395.00	35,308,000	
東亜合成	46,700	1,576.00	73,599,200	貸付株式数 2,300 株
大阪ソーダ	6,800	8,520.00	57,936,000	
関東電化	18,800	908.00	17,070,400	貸付株式数 7,300 株
SUN ASTERISK	6,900	548.00	3,781,200	貸付株式数 2,700 株
デンカ	35,300	2,195.00	77,483,500	
イビデン	51,100	4,168.00	212,984,800	
信越化学	871,000	5,607.00	4,883,697,000	
日本カーバイド	5,100	1,677.00	8,552,700	
電算システムHD	4,300	2,661.00	11,442,300	貸付株式数 1,600 株
堺化学	7,400	2,559.00	18,936,600	
第一稀元素化学工	10,600	815.00	8,639,000	貸付株式数 4,100 株
エア・ウォーター	91,500	1,993.50	182,405,250	
日本酸素 HLDGS	94,200	5,064.00	477,028,800	
日本化学工業	3,500	2,686.00	9,401,000	
東邦アセチレン	2,200	344.00	756,800	
日本パーカライズン	43,300	1,182.00	51,180,600	
高压ガス	14,000	872.00	12,208,000	貸付株式数 3,300 株
チタン工業	300	860.00	258,000	貸付株式数 100 株
四国化成ホールディング	11,000	1,939.00	21,329,000	貸付株式数 4,200 株
戸田工業	2,200	1,760.00	3,872,000	貸付株式数 600 株
ステラ ケミフア	5,300	3,960.00	20,988,000	
保土谷化学	3,100	4,525.00	14,027,500	
日本触媒	56,500	1,671.50	94,439,750	
大日精化	6,700	2,956.00	19,805,200	
カネカ	23,900	3,731.00	89,170,900	
協和キリン	117,500	3,256.00	382,580,000	
APPIER GROUP	29,600	1,638.00	48,484,800	貸付株式数 11,500 株
三菱瓦斯化学	70,900	2,573.50	182,461,150	
三井化学	80,100	3,807.00	304,940,700	
東京応化工業	46,300	3,180.00	147,234,000	
大阪有機化学	8,100	2,883.00	23,352,300	貸付株式数 3,200 株
三菱ケミカルグループ	710,000	901.10	639,781,000	
KHネオケム	17,500	2,024.00	35,420,000	
ビジョナル	11,500	9,170.00	105,455,000	
ダイセル	120,500	1,268.00	152,794,000	
住友ベークライト	27,200	3,645.00	99,144,000	
積水化学	193,300	2,219.00	428,932,700	
日本ゼオン	66,600	1,246.00	82,983,600	
アイカ工業	24,500	3,252.00	79,674,000	
UBE	46,200	2,548.00	117,717,600	
積水樹脂	14,500	2,296.00	33,292,000	貸付株式数 5,600 株
タキロンシーアイ	24,100	869.00	20,942,900	
旭有機材	6,500	3,810.00	24,765,000	貸付株式数 2,500 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ニチバン	5,300	1,947.00	10,319,100	貸付株式数 2,000株
リケンテクノス	18,200	964.00	17,544,800	
大倉工業	4,400	2,554.00	11,237,600	貸付株式数 100株
積水化成	13,500	403.00	5,440,500	
群栄化学	2,300	2,700.00	6,210,000	
タイガース ポリマー	1,000	788.00	788,000	
ミライアル	800	1,354.00	1,083,200	貸付株式数 300株
ダイキアクシス	900	711.00	639,900	貸付株式数 300株 (300株)
ダイキョーニシカワ	21,400	655.00	14,017,000	
竹本容器	800	826.00	660,800	
森六ホールディングス	5,000	2,253.00	11,265,000	
恵和	6,300	1,051.00	6,621,300	
日本化薬	74,000	1,285.00	95,090,000	
カーリット	10,400	1,033.00	10,743,200	
ソルクシーズ	1,700	292.00	496,400	貸付株式数 600株
CLホールディングス	2,300	927.00	2,132,100	貸付株式数 900株
プレステージ・インター	46,700	734.00	34,277,800	貸付株式数 8,000株
フェイス	600	397.00	238,200	貸付株式数 300株
プロトコーポレーション	10,500	1,411.00	14,815,500	
ハイマックス	3,000	1,284.00	3,852,000	
アミューズ	6,100	1,415.00	8,631,500	貸付株式数 1,100株
野村総合研究所	210,600	5,222.00	1,099,753,200	
ドリームインキュベータ	3,100	2,260.00	7,006,000	貸付株式数 1,200株
クイック	7,000	2,065.00	14,455,000	
TAC	1,700	165.00	280,500	貸付株式数 300株
CEホールディングス	1,000	478.00	478,000	
日本システム技術	9,000	1,900.00	17,100,000	
電通グループ	107,800	4,287.00	462,138,600	
インテージホールディングス	11,000	1,539.00	16,929,000	
テイクアンドギヴニーズ	4,800	845.00	4,056,000	貸付株式数 800株
東邦システムサイエンス	4,500	1,462.00	6,579,000	貸付株式数 1,700株
びあ	3,400	3,030.00	10,302,000	貸付株式数 1,300株
イオンファンタジー	3,600	2,267.00	8,161,200	貸付株式数 1,400株
ソースネクスト	44,400	199.00	8,835,600	貸付株式数 17,300株
シーティーエス	12,300	825.00	10,147,500	貸付株式数 4,700株
NEXYZ. GROUP	700	730.00	511,000	貸付株式数 400株
メディカルシステムネットワーク	11,000	443.00	4,873,000	
日本精化	6,500	2,262.00	14,703,000	貸付株式数 1,600株
扶桑化学工業	10,300	3,660.00	37,698,000	
トリケミカル	11,800	3,210.00	37,878,000	貸付株式数 4,600株
シンプレクスHD	14,800	2,413.00	35,712,400	
HEROZ	3,800	1,042.00	3,959,600	貸付株式数 1,400株
ラクスル	23,500	1,196.00	28,106,000	貸付株式数 9,200株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
メルカリ	47,500	2,496.00	118,560,000	貸付株式数 14,700株
I P S	2,800	2,186.00	6,120,800	
F I G	2,600	362.00	941,200	貸付株式数 1,300株
システムサポート	3,800	2,033.00	7,725,400	
A D E K A	33,900	2,907.50	98,564,250	
日油	88,000	2,210.00	194,480,000	
ミヨシ油脂	800	1,532.00	1,225,600	
新日本理化	3,000	187.00	561,000	貸付株式数 1,500株
ハリマ化成グループ	7,600	858.00	6,520,800	
イーソル	6,500	722.00	4,693,000	貸付株式数 2,100株
東海ソフト	400	1,215.00	486,000	貸付株式数 200株
ウイングアーク 1ST	10,100	2,891.00	29,199,100	
ヒト・コミュニケーションズHD	3,200	859.00	2,748,800	貸付株式数 1,200株
サーバーワークス	2,000	2,811.00	5,622,000	貸付株式数 300株
東名	400	1,397.00	558,800	
ヴィッツ	200	784.00	156,800	貸付株式数 100株
トビラシステムズ	600	751.00	450,600	貸付株式数 100株
S a n s a n	32,000	2,333.00	74,656,000	貸付株式数 12,400株
LINK-U グループ	400	492.00	196,800	
ギフトィ	8,500	1,189.00	10,106,500	貸付株式数 3,300株
花王	236,500	7,189.00	1,700,198,500	
第一工業製薬	3,900	2,963.00	11,555,700	
石原ケミカル	4,400	2,212.00	9,732,800	貸付株式数 1,600株
日華化学	800	1,240.00	992,000	
ニイタカ	400	1,839.00	735,600	貸付株式数 100株
三洋化成	6,000	4,065.00	24,390,000	
メドレー	10,700	3,440.00	36,808,000	貸付株式数 2,800株
ベース	4,800	3,200.00	15,360,000	貸付株式数 1,000株
J M D C	16,600	4,583.00	76,077,800	貸付株式数 6,400株
武田薬品	860,800	4,263.00	3,669,590,400	
アステラス製薬	853,100	1,815.00	1,548,376,500	
住友ファーマ	72,200	571.00	41,226,200	
塩野義製薬	118,300	6,564.00	776,521,200	
わかもと製薬	2,200	248.00	545,600	貸付株式数 100株
日本新薬	25,500	3,466.00	88,383,000	
中外製薬	304,400	6,547.00	1,992,906,800	
科研製薬	16,700	4,045.00	67,551,500	貸付株式数 6,500株
エーザイ	118,300	5,724.00	677,149,200	
理研ビタミン	8,300	2,603.00	21,604,900	
ロート製薬	94,200	3,587.00	337,895,400	
小野薬品	199,000	1,985.00	395,015,000	
久光製薬	21,600	4,037.00	87,199,200	貸付株式数 8,400株
有機合成薬品	1,700	265.00	450,500	
持田製薬	10,900	3,300.00	35,970,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
参天製薬	171,600	1,815.50	311,539,800	
扶桑薬品	3,400	2,208.00	7,507,200	
日本ケミファ	200	1,613.00	322,600	
ツムラ	30,600	3,940.00	120,564,000	
テルモ	540,500	2,683.00	1,450,161,500	
HUグループHD	29,200	2,619.50	76,489,400	貸付株式数 10,800株
キッセイ薬品工業	16,100	3,540.00	56,994,000	
生化学工業	16,600	827.00	13,728,200	
栄研化学	16,800	2,323.00	39,026,400	
鳥居薬品	5,200	3,700.00	19,240,000	
JCRファーマ	32,900	652.00	21,450,800	
東和薬品	14,900	2,921.00	43,522,900	
富士製薬工業	7,200	1,280.00	9,216,000	貸付株式数 1,900株
ゼリア新薬工業	13,500	2,265.00	30,577,500	
ネクセラファーマ	45,700	1,282.00	58,587,400	貸付株式数 17,800株
第一三共	847,200	5,774.00	4,891,732,800	
杏林製薬	21,100	1,553.00	32,768,300	
大幸薬品	22,000	404.00	8,888,000	貸付株式数 8,500株
ダイト	7,200	2,310.00	16,632,000	貸付株式数 2,800株
大塚ホールディングス	242,700	8,108.00	1,967,811,600	
ペプチドリーム	47,100	2,509.50	118,197,450	貸付株式数 17,900株
大日本塗料	10,700	1,100.00	11,770,000	
日本ペイント HOLD	429,800	885.10	380,415,980	貸付株式数 168,000株
関西ペイント	83,900	2,679.00	224,768,100	貸付株式数 32,800株
神東塗料	2,100	128.00	268,800	貸付株式数 900株
中国塗料	20,000	1,965.00	39,300,000	貸付株式数 7,800株
日本特殊塗料	1,500	1,196.00	1,794,000	
藤倉化成	11,100	462.00	5,128,200	
太陽ホールディングス	16,900	3,530.00	59,657,000	
DIC	34,500	3,115.00	107,467,500	
サカタインクス	21,600	1,548.00	33,436,800	
ARTIENCE	17,400	3,780.00	65,772,000	貸付株式数 1,300株
アルプス技研	8,700	2,699.00	23,481,300	貸付株式数 3,400株
サニックス	15,800	262.00	4,139,600	
日本空調サービス	10,700	1,078.00	11,534,600	貸付株式数 4,200株
オリエンタルランド	527,500	3,896.00	2,055,140,000	貸付株式数 192,400株
フォーカスシステムズ	6,500	1,128.00	7,332,000	
ダスキン	21,800	3,897.00	84,954,600	
パーク24	74,400	1,743.50	129,716,400	貸付株式数 29,100株
明光ネットワークジャパン	12,300	685.00	8,425,500	貸付株式数 4,600株
ファルコホールディングス	4,400	2,322.00	10,216,800	
クレスコ	16,000	1,226.00	19,616,000	
フジ・メディア・HD	93,400	1,745.00	162,983,000	
秀英予備校	900	271.00	243,900	
田谷	700	355.00	248,500	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ラウンドワン	94,000	950.00	89,300,000	
リゾートトラスト	43,300	2,832.50	122,647,250	
オービック	32,500	25,485.00	828,262,500	
ジャストシステム	14,000	3,410.00	47,740,000	
TDCソフト	18,200	1,169.00	21,275,800	貸付株式数 4,900 株
LINEヤフー	1,384,600	397.10	549,824,660	貸付株式数 541,500 株
ビー・エム・エル	12,300	2,700.00	33,210,000	
トレンドマイクロ	51,100	8,645.00	441,759,500	
IDホールディングス	6,600	1,367.00	9,022,200	貸付株式数 900 株
リソー教育	51,300	246.00	12,619,800	
日本オラクル	18,600	13,255.00	246,543,000	
早稲田アカデミー	5,600	1,560.00	8,736,000	貸付株式数 2,100 株 (200 株)
アルファシステムズ	2,500	2,839.00	7,097,500	
フューチャー	24,200	1,803.00	43,632,600	
CAC HOLDINGS	6,000	1,734.00	10,404,000	
トーセ	600	630.00	378,000	貸付株式数 200 株
ユー・エス・エス	223,600	1,378.50	308,232,600	
オービックビジネスC	13,700	7,220.00	98,914,000	
アイティフォー	12,500	1,320.00	16,500,000	
東京個別指導学院	12,000	399.00	4,788,000	貸付株式数 4,200 株
東計電算	2,700	4,500.00	12,150,000	
サイバーエージェント	220,300	1,021.50	225,036,450	
楽天グループ	701,400	956.50	670,889,100	貸付株式数 297,500 株
エクスネット	300	1,454.00	436,200	貸付株式数 100 株
クリーク・アンド・リバー社	5,000	1,446.00	7,230,000	
SBI グローバルアセット	19,500	594.00	11,583,000	
テー・オー・ダブリュー	19,900	316.00	6,288,400	
大塚商会	110,200	3,525.00	388,455,000	貸付株式数 43,000 株
サイボウズ	13,400	1,598.00	21,413,200	
山田コンサルティング GP	4,400	2,355.00	10,362,000	
セントラルスポーツ	3,800	2,489.00	9,458,200	貸付株式数 1,300 株
バラカ	3,000	1,826.00	5,478,000	
電通総研	9,500	5,730.00	54,435,000	
ACCESS	10,100	1,569.00	15,846,900	貸付株式数 3,900 株
デジタルガレージ	15,500	2,811.00	43,570,500	
イーエムシステムズ	16,200	530.00	8,586,000	
ウェザーニューズ	3,000	5,640.00	16,920,000	貸付株式数 1,100 株
C I J	24,200	424.00	10,260,800	貸付株式数 7,500 株
ビジネスエンジニアリング	2,300	4,195.00	9,648,500	
日本エンタープライズ	2,100	115.00	241,500	
WOWOW	7,300	1,065.00	7,774,500	貸付株式数 2,800 株
スカラ	8,900	473.00	4,209,700	貸付株式数 3,400 株
インテリジェント ウェイブ	1,200	905.00	1,086,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
フルキャストホールディングス	8,200	1,548.00	12,693,600	
エン・ジャパン	16,200	2,488.00	40,305,600	
セルソース	6,500	1,417.00	9,210,500	貸付株式数 2,500株
あすか製薬HD	10,000	2,227.00	22,270,000	
サワイグループHD	22,200	6,146.00	136,441,200	
富士フイルムHLDGS	541,200	3,840.00	2,078,208,000	
コニカミノルタ	218,700	421.30	92,138,310	
資生堂	203,100	3,206.00	651,138,600	
ライオン	123,800	1,535.00	190,033,000	貸付株式数 48,400株
高砂香料	7,300	4,955.00	36,171,500	
マンダム	21,000	1,229.00	25,809,000	
ミルボン	15,600	3,062.00	47,767,200	貸付株式数 800株
ファンケル	39,600	2,796.00	110,721,600	
コーセー	19,800	8,603.00	170,339,400	貸付株式数 3,900株
コタ	9,900	1,628.00	16,117,200	
シーボン	300	1,304.00	391,200	貸付株式数 100株
ポーラ・オルビスHD	49,900	1,419.00	70,808,100	貸付株式数 19,500株
ノエビアホールディングス	8,700	5,480.00	47,676,000	
アジュバンホールディング	600	831.00	498,600	貸付株式数 200株 (200株)
新日本製薬	5,500	1,822.00	10,021,000	貸付株式数 2,100株
アクシージア	6,500	730.00	4,745,000	貸付株式数 1,700株
エステー	7,500	1,521.00	11,407,500	貸付株式数 2,900株
アグロカネショウ	3,400	1,303.00	4,430,200	貸付株式数 200株
コニシ	28,100	1,241.00	34,872,100	貸付株式数 6,200株
長谷川香料	18,600	2,998.00	55,762,800	貸付株式数 7,200株
小林製薬	25,500	5,526.00	140,913,000	貸付株式数 9,900株
荒川化学工業	8,200	1,205.00	9,881,000	
メック	8,000	3,445.00	27,560,000	
日本高純度化学	2,200	3,145.00	6,919,000	
タカラバイオ	26,200	991.00	25,964,200	貸付株式数 10,200株
JCU	10,800	3,350.00	36,180,000	
新田ゼラチン	1,500	848.00	1,272,000	貸付株式数 700株
OATアグリオ	4,000	1,967.00	7,868,000	貸付株式数 1,200株
デクセリアルズ	24,000	5,906.00	141,744,000	
アース製薬	8,900	5,290.00	47,081,000	貸付株式数 3,400株
北興化学	8,700	1,265.00	11,005,500	貸付株式数 2,000株
大成ラミック	2,800	2,678.00	7,498,400	
クミアイ化学	38,800	795.00	30,846,000	貸付株式数 15,100株
日本農薬	17,900	593.00	10,614,700	貸付株式数 2,700株
富士興産	600	1,509.00	905,400	
ニチレキ	12,700	2,485.00	31,559,500	貸付株式数 2,900株
ユシロ化学	5,000	1,576.00	7,880,000	
ビーピー・カストロール	1,000	876.00	876,000	貸付株式数 400株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
富士石油	28,400	364.00	10,337,600	
MORESCO	800	1,224.00	979,200	
出光興産	505,000	1,005.50	507,777,500	
ENEOS ホールディングス	1,539,500	745.60	1,147,851,200	
コスモエネルギーHLDGS	28,800	7,399.00	213,091,200	
テスホールディングス	20,500	278.00	5,699,000	貸付株式数 8,000 株
インプロニアHD	109,600	1,195.50	131,026,800	
横浜ゴム	49,100	3,133.00	153,830,300	
TOYO TIRE	55,700	2,042.00	113,739,400	貸付株式数 21,800 株
ブリヂストン	284,500	5,441.00	1,547,964,500	
住友ゴム	95,000	1,496.50	142,167,500	貸付株式数 37,300 株
藤倉コンポジット	9,400	1,195.00	11,233,000	
オカモト	4,500	5,220.00	23,490,000	
アキレス	6,100	1,532.00	9,345,200	貸付株式数 1,100 株
フコク	5,000	1,713.00	8,565,000	
ニッタ	9,900	3,715.00	36,778,500	貸付株式数 3,800 株
クリエートメディック	700	949.00	664,300	
住友理工	15,100	1,492.00	22,529,200	貸付株式数 5,800 株
三ツ星ベルト	11,300	4,015.00	45,369,500	貸付株式数 4,400 株
バンドー化学	14,400	1,786.00	25,718,400	貸付株式数 2,600 株
AGC	94,600	4,424.00	418,510,400	貸付株式数 37,000 株
日本板硝子	46,400	340.00	15,776,000	貸付株式数 18,100 株
石塚硝子	400	2,496.00	998,400	貸付株式数 200 株
有沢製作所	17,000	1,459.00	24,803,000	
日本山村硝子	800	1,511.00	1,208,800	貸付株式数 400 株
日本電気硝子	36,100	3,250.00	117,325,000	
オハラ	4,600	1,363.00	6,269,800	貸付株式数 1,800 株
住友大阪セメント	16,100	3,745.00	60,294,500	
太平洋セメント	55,700	3,037.00	169,160,900	
リソルホールディングス	200	4,565.00	913,000	
日本ヒューム	8,500	1,290.00	10,965,000	貸付株式数 3,200 株
日本コンクリート	18,800	340.00	6,392,000	貸付株式数 7,400 株
三谷セキサン	4,100	5,640.00	23,124,000	貸付株式数 900 株
アジアパイルHD	13,800	818.00	11,288,400	
東海カーボン	89,700	843.70	75,679,890	貸付株式数 35,000 株
日本カーボン	5,600	4,280.00	23,968,000	
東洋炭素	6,900	5,060.00	34,914,000	貸付株式数 2,600 株
ノリタケ	10,700	3,785.00	40,499,500	貸付株式数 300 株
TOTO	64,200	4,789.00	307,453,800	
日本碍子	113,200	1,856.50	210,155,800	
日本特殊陶業	81,400	4,014.00	326,739,600	
ダントーホールディングス	700	409.00	286,300	貸付株式数 200 株
MARUWA	3,600	34,700.00	124,920,000	
品川リフラクトリーズ	12,000	1,702.00	20,424,000	貸付株式数 4,600 株
黒崎播磨	7,900	2,087.00	16,487,300	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ヨータイ	5,700	1,739.00	9,912,300	貸付株式数 1,800株
東京窯業	2,300	415.00	954,500	
ニッカトー	900	517.00	465,300	
フジミインコーポレーテッド	26,200	2,212.00	57,954,400	貸付株式数 10,200株
クニミネ工業	600	1,067.00	640,200	貸付株式数 300株
エーアンドエーマテリアル	400	1,194.00	477,600	
ニチアス	24,600	5,120.00	125,952,000	貸付株式数 3,800株
日本製鉄	465,800	3,067.00	1,428,608,600	
神戸製鋼所	201,200	1,676.00	337,211,200	貸付株式数 78,600株
中山製鋼所	22,800	789.00	17,989,200	貸付株式数 8,900株
合同製鐵	5,600	4,255.00	23,828,000	貸付株式数 2,200株
JFEホールディングス	278,200	1,905.00	529,971,000	
東京製鐵	28,100	1,872.00	52,603,200	
共英製鋼	11,400	1,677.00	19,117,800	貸付株式数 700株
大和工業	18,900	7,020.00	132,678,000	
東京鐵鋼	4,400	5,020.00	22,088,000	
大阪製鐵	4,600	3,325.00	15,295,000	貸付株式数 1,800株
淀川製鋼所	10,400	5,480.00	56,992,000	
中部鋼鈹	6,600	2,274.00	15,008,400	貸付株式数 700株
丸一鋼管	30,500	3,387.00	103,303,500	
モリ工業	2,500	5,190.00	12,975,000	
大同特殊鋼	62,900	1,349.00	84,852,100	貸付株式数 24,600株
日本高周波	800	400.00	320,000	貸付株式数 400株
日本冶金工	7,300	4,355.00	31,791,500	
山陽特殊製鋼	9,900	1,858.00	18,394,200	
愛知製鋼	5,700	3,295.00	18,781,500	
日本金属	600	639.00	383,400	貸付株式数 300株
ミガロホールディングス	600	2,209.00	1,325,400	貸付株式数 300株
大平洋金属	8,500	1,329.00	11,296,500	貸付株式数 1,100株
新日本電工	59,600	283.00	16,866,800	
栗本鉄工所	4,600	4,210.00	19,366,000	
虹 技	300	1,029.00	308,700	貸付株式数 100株
日本鑄鉄管	200	1,204.00	240,800	貸付株式数 100株
日本製鋼所	27,000	4,187.00	113,049,000	
三菱製鋼	7,400	1,328.00	9,827,200	
日亜鋼業	2,100	292.00	613,200	
日本精線	7,900	1,074.00	8,484,600	貸付株式数 500株
エンビプロHD	9,800	502.00	4,919,600	貸付株式数 3,200株
大紀アルミニウム	12,700	1,062.00	13,487,400	貸付株式数 4,900株
日本軽金属HD	29,200	1,547.00	45,172,400	
三井金属	29,100	4,358.00	126,817,800	
東邦亜鉛	6,400	891.00	5,702,400	貸付株式数 2,500株
三菱マテリアル	71,500	2,382.00	170,313,000	
住友鋁山	116,000	3,605.00	418,180,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
DOWA ホールディングス	24,700	4,765.00	117,695,500	
古河機金	13,200	1,583.00	20,895,600	
エス・サイエンス	12,700	24.00	304,800	貸付株式数 7,100 株
大阪チタニウム	17,400	2,415.00	42,021,000	貸付株式数 6,800 株
東邦チタニウム	20,700	1,070.00	22,149,000	貸付株式数 8,000 株
UACJ	14,000	5,020.00	70,280,000	
CKサンエツ	2,400	3,380.00	8,112,000	
古河電工	33,300	3,139.00	104,528,700	
住友電工	374,100	2,306.00	862,674,600	
フジクラ	118,000	3,846.00	453,828,000	
SWCC	11,200	5,100.00	57,120,000	
タツタ電線	16,400	777.00	12,742,800	
カナレ電気	400	1,403.00	561,200	
平河ヒューテック	6,300	1,426.00	8,983,800	貸付株式数 1,500 株
いよぎんホールディング	113,600	1,332.00	151,315,200	貸付株式数 11,800 株
しずおかフィナンシャル	210,400	1,264.50	266,050,800	
ちゅうぎんフィナンシャ	80,400	1,468.50	118,067,400	
楽天銀行	44,300	3,150.00	139,545,000	貸付株式数 3,700 株
京都フィナンシャルG	120,200	2,183.00	262,396,600	
リョービ	10,600	1,929.00	20,447,400	
アーレステイ	2,400	583.00	1,399,200	貸付株式数 900 株
ARE ホールディングス	37,600	1,839.00	69,146,400	
東洋製罐グループHD	57,400	2,241.50	128,662,100	
ホッカンホールディングス	4,800	1,659.00	7,963,200	
コロナ	5,600	927.00	5,191,200	貸付株式数 1,600 株
横河ブリッジHLDGS	15,700	2,606.00	40,914,200	
駒井ハルテック	400	1,652.00	660,800	貸付株式数 100 株
高田機工	200	3,575.00	715,000	
三和ホールディングス	99,700	3,365.00	335,490,500	
文化シヤッター	26,200	1,669.00	43,727,800	
三協立山	12,600	718.00	9,046,800	貸付株式数 4,900 株
アルインコ	7,500	988.00	7,410,000	貸付株式数 1,100 株
東洋シヤッター	500	849.00	424,500	
LIXIL	156,200	1,721.50	268,898,300	
日本フィルコン	1,400	513.00	718,200	貸付株式数 700 株
ノーリツ	14,100	1,938.00	27,325,800	
長府製作所	11,200	2,010.00	22,512,000	
リンナイ	47,900	3,410.00	163,339,000	
ユニプレス	17,200	1,132.00	19,470,400	貸付株式数 6,800 株
ダイニチ工業	1,100	624.00	686,400	
日東精工	14,500	552.00	8,004,000	
三洋工業	200	3,230.00	646,000	
岡部	17,800	742.00	13,207,600	
ジーテクト	12,500	1,610.00	20,125,000	
東プレ	17,500	1,788.00	31,290,000	貸付株式数 2,200 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
高周波熱錬	15,000	1,011.00	15,165,000	貸付株式数 2,600株
東京製綱	6,400	1,071.00	6,854,400	
サンコール	10,900	379.00	4,131,100	
モリテックスチル	1,900	188.00	357,200	貸付株式数 100株
パイオラックス	11,900	2,307.00	27,453,300	
エイチワン	10,200	886.00	9,037,200	
日本発条	88,400	1,635.50	144,578,200	
中央発條	7,400	1,154.00	8,539,600	貸付株式数 2,800株
アドバネクス	300	957.00	287,100	貸付株式数 100株
三浦工業	40,900	3,237.00	132,393,300	
タクマ	33,100	1,541.00	51,007,100	
テクノプロ・ホールディング	57,900	2,902.50	168,054,750	貸付株式数 22,600株
アトラグループ	900	135.00	121,500	貸付株式数 300株
アイ・アールジャパンHD	5,200	925.00	4,810,000	貸付株式数 1,800株
Keepertech 技研	6,200	4,060.00	25,172,000	貸付株式数 2,400株
ファーストロジック	700	604.00	422,800	貸付株式数 300株
三機サービス	400	991.00	396,400	貸付株式数 200株
Gunosy	7,900	877.00	6,928,300	貸付株式数 2,800株
デザインワン・ジャパン	600	126.00	75,600	貸付株式数 100株
イー・ガーディアン	4,800	1,854.00	8,899,200	
リブセンス	1,200	174.00	208,800	貸付株式数 500株
ジャパンマテリアル	30,500	1,659.00	50,599,500	
ベクトル	11,900	890.00	10,591,000	貸付株式数 4,200株
ウチヤマホールディングス	900	330.00	297,000	貸付株式数 500株 (400株)
チャームケアコーポレーション	8,300	1,394.00	11,570,200	
キャリアリンク	3,700	2,527.00	9,349,900	貸付株式数 1,400株
I B J	7,600	674.00	5,122,400	貸付株式数 3,000株
アサンテ	5,000	1,664.00	8,320,000	貸付株式数 1,800株
バリューHR	9,000	1,617.00	14,553,000	貸付株式数 3,400株 (400株)
M&A キャピタルパートナー	8,100	2,230.00	18,063,000	
ライドオンエクスプレスHD	4,000	1,002.00	4,008,000	
ERI ホールディングス	600	2,007.00	1,204,200	貸付株式数 300株
アビスト	400	3,495.00	1,398,000	貸付株式数 100株
シグママクス・ホールディング	13,100	1,418.00	18,575,800	
ウィルグループ	8,300	921.00	7,644,300	
エスクローAJ	2,500	136.00	340,000	
メドピア	8,000	590.00	4,720,000	貸付株式数 2,800株
レアジョブ	400	387.00	154,800	
リクルートホールディングス	717,900	8,420.00	6,044,718,000	
エラン	13,200	826.00	10,903,200	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ツガミ	20,900	1,459.00	30,493,100	
オークマ	8,600	5,586.00	48,039,600	貸付株式数 3,300株
芝浦機械	9,200	3,580.00	32,936,000	
アマダ	148,500	1,460.00	216,810,000	
アイダエンジニア	22,000	777.00	17,094,000	
FUJ I	46,100	2,248.00	103,632,800	
牧野フライス	10,800	5,490.00	59,292,000	
オーエスジー	43,100	1,957.50	84,368,250	貸付株式数 16,800株
ダイジェット	200	737.00	147,400	貸付株式数 100株
旭ダイヤモンド	22,600	836.00	18,893,600	
DMG 森精機	61,800	3,119.00	192,754,200	
ソデイツク	25,700	746.00	19,172,200	
ディスコ	47,200	33,570.00	1,584,504,000	
日東工器	4,500	2,476.00	11,142,000	貸付株式数 1,700株
日進工具	9,000	747.00	6,723,000	貸付株式数 3,500株
パンチ工業	2,100	421.00	884,100	貸付株式数 1,100株
富士ダイス	7,200	762.00	5,486,400	貸付株式数 2,000株
土木管理総合試験	1,000	309.00	309,000	
日本郵政	1,041,900	1,406.50	1,465,432,350	
ベルシステム 24HLDGS	10,700	1,542.00	16,499,400	
鎌倉新書	8,500	397.00	3,374,500	貸付株式数 3,300株 (1,700株)
SMN	400	302.00	120,800	
一蔵	300	541.00	162,300	貸付株式数 100株
グローバルキッズCOMP	400	746.00	298,400	
エアトリ	7,300	1,185.00	8,650,500	貸付株式数 2,800株
アトラエ	7,300	800.00	5,840,000	貸付株式数 2,800株
ストライク	4,900	4,530.00	22,197,000	
ソラスト	27,500	557.00	15,317,500	
セラク	3,000	1,396.00	4,188,000	貸付株式数 900株
インソース	21,600	1,064.00	22,982,400	
豊田自動織機	82,700	10,685.00	883,649,500	
豊和工業	1,200	789.00	946,800	貸付株式数 600株
石川製作所	500	1,337.00	668,500	貸付株式数 300株
リケンNPR	10,500	2,324.00	24,402,000	貸付株式数 4,000株
東洋機械金属	1,800	650.00	1,170,000	
津田駒工業	500	369.00	184,500	貸付株式数 200株
エンシュウ	500	622.00	311,000	貸付株式数 200株
島精機製作所	15,600	1,324.00	20,654,400	貸付株式数 6,000株
オプトラン	16,100	1,664.00	26,790,400	
イワキポンプ	6,500	2,599.00	16,893,500	貸付株式数 2,000株
フリーー	9,200	1,038.00	9,549,600	貸付株式数 3,600株
ヤマシンフィルタ	23,300	429.00	9,995,700	貸付株式数 9,000株
日阪製作所	10,700	1,077.00	11,523,900	
やまびこ	16,000	2,242.00	35,872,000	貸付株式数 5,500株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考	
		単価	金額		
野村マイクロ・サイエンス	13,300	2,349.00	31,241,700	貸付株式数	5,200株 (100株)
平田機工	4,700	4,700.00	22,090,000	貸付株式数	1,800株
PEGASUS	10,800	488.00	5,270,400		
マルマエ	4,200	1,433.00	6,018,600	貸付株式数	1,600株
タツモ	7,000	2,795.00	19,565,000	貸付株式数	2,700株
ナブテスコ	61,400	2,309.50	141,803,300		
三井海洋開発	12,400	2,684.00	33,281,600	貸付株式数	4,800株
レオン自動機	11,400	1,341.00	15,287,400		
SMC	29,300	60,000.00	1,758,000,000		
ホソカワミクロン	6,900	4,120.00	28,428,000		
ユニオンツール	4,300	5,620.00	24,166,000		
瑞光	7,100	1,172.00	8,321,200	貸付株式数	2,700株
オイレス工業	13,300	2,073.00	27,570,900	貸付株式数	5,200株
日精エーエスビー	3,300	4,695.00	15,493,500		
サトーホールディングス	13,400	1,955.00	26,197,000		
技研製作所	9,200	1,744.00	16,044,800	貸付株式数	2,700株
日本エアージェット	4,500	1,133.00	5,098,500		
カワタ	700	864.00	604,800		
日精樹脂工業	7,300	931.00	6,796,300	貸付株式数	2,700株
オカダアイヨン	700	2,068.00	1,447,600		
ワイエイシイホールディングス	4,600	2,016.00	9,273,600	貸付株式数	1,800株
小松製作所	459,100	3,664.00	1,682,142,400		
住友重機械	57,900	3,267.00	189,159,300		
日立建機	39,100	3,395.00	132,744,500		
日工	14,500	685.00	9,932,500		
巴工業	3,800	3,975.00	15,105,000	貸付株式数	1,400株
井関農機	9,100	983.00	8,945,300	貸付株式数	3,500株
TOWA	10,900	5,950.00	64,855,000	貸付株式数	4,200株
丸山製作所	400	2,482.00	992,800		
北川鉄工所	3,800	1,246.00	4,734,800		
シンニッタン	2,700	213.00	575,100		
ローツェ	51,200	1,786.00	91,443,200		
タカキタ	700	442.00	309,400	貸付株式数	100株
クボタ	512,000	2,033.50	1,041,152,000	貸付株式数	75,500株
荏原実業	4,700	3,670.00	17,249,000		
東洋エンジニア	14,000	679.00	9,506,000		
三菱化工機	3,400	3,315.00	11,271,000		
月島ホールディングス	13,300	1,286.00	17,103,800	貸付株式数	3,900株
帝国電機製作所	6,700	2,530.00	16,951,000		
東京機械	500	360.00	180,000		
新東工業	19,800	994.00	19,681,200	貸付株式数	3,700株
渋谷工業	9,200	3,420.00	31,464,000		
アイチコーポレーション	13,500	1,140.00	15,390,000		

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
小森コーポレーション	24,200	1,107.00	26,789,400	
鶴見製作所	7,500	3,640.00	27,300,000	
日本ギア工業	800	439.00	351,200	貸付株式数 300株
酒井重工業	1,900	4,455.00	8,464,500	
荏原製作所	201,000	1,695.50	340,795,500	
石井鉄工所	200	8,340.00	1,668,000	
西島製作所	8,500	2,610.00	22,185,000	貸付株式数 3,200株
北越工業	9,900	1,838.00	18,196,200	貸付株式数 3,800株
ダイキン工業	116,900	17,180.00	2,008,342,000	
オルガノ	11,800	6,080.00	71,744,000	
トーヨーカネツ	3,300	3,960.00	13,068,000	
栗田工業	54,800	5,406.00	296,248,800	
椿本チエイン	13,400	5,590.00	74,906,000	
大同工業	900	755.00	679,500	
日機装	25,000	983.00	24,575,000	
木村化工機	7,500	698.00	5,235,000	
レイズネクスト	13,700	1,624.00	22,248,800	
アネスト岩田	15,200	1,256.00	19,091,200	
ダイフク	165,300	2,540.50	419,944,650	
サムコ	2,300	3,475.00	7,992,500	貸付株式数 900株
加藤製作所	1,100	1,204.00	1,324,400	
油研工業	400	2,214.00	885,600	
タダノ	56,400	928.00	52,339,200	貸付株式数 22,000株
フジテック	22,900	4,657.00	106,645,300	
CKD	27,100	2,599.00	70,432,900	
平和	29,000	2,105.00	61,045,000	貸付株式数 5,100株
理想科学工業	7,800	3,480.00	27,144,000	
SANKYO	94,300	2,072.00	195,389,600	
日本金銭機械	11,900	952.00	11,328,800	貸付株式数 4,600株
マースグループHLDGS	4,900	3,580.00	17,542,000	貸付株式数 1,900株
フクシマガリレイ	6,400	5,130.00	32,832,000	
オーイズミ	800	373.00	298,400	貸付株式数 100株
ダイコク電機	4,800	3,365.00	16,152,000	貸付株式数 1,800株
竹内製作所	17,800	4,125.00	73,425,000	
アマノ	27,800	4,181.00	116,231,800	貸付株式数 10,700株
JUKI	15,100	390.00	5,889,000	貸付株式数 5,900株
サンデン	3,900	145.00	565,500	貸付株式数 1,700株
ジャノメ	10,000	830.00	8,300,000	
ブラザー工業	130,800	2,765.50	361,727,400	
マックス	13,800	3,530.00	48,714,000	貸付株式数 1,000株
モリタホールディングス	17,000	1,940.00	32,980,000	
グローリー	23,500	2,603.50	61,182,250	貸付株式数 9,200株
新晃工業	9,900	4,550.00	45,045,000	
大和冷機工業	15,000	1,495.00	22,425,000	貸付株式数 4,800株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
セガサミーホールディングス	87,500	2,848.50	249,243,750	
T P R	12,200	2,252.00	27,474,400	貸付株式数 1,000 株
ツバキ・ナカシマ	24,200	675.00	16,335,000	貸付株式数 9,400 株
ホシザキ	63,100	4,550.00	287,105,000	
大豊工業	8,400	610.00	5,124,000	貸付株式数 3,300 株
日本精工	180,800	720.90	130,338,720	
N T N	212,500	255.50	54,293,750	
ジェイテクト	87,100	1,082.50	94,285,750	
不二越	7,200	3,055.00	21,996,000	貸付株式数 2,800 株
ミネベアミツミ	170,300	2,718.50	462,960,550	
日本トムソン	26,900	480.00	12,912,000	
T H K	56,500	2,487.00	140,515,500	貸付株式数 5,400 株
ユーシン精機	7,900	625.00	4,937,500	
前澤給装工業	7,000	1,291.00	9,037,000	
イーグル工業	10,700	2,042.00	21,849,400	貸付株式数 2,400 株
前澤工業	1,400	1,277.00	1,787,800	貸付株式数 500 株
P I L L A R	9,100	4,070.00	37,037,000	貸付株式数 3,500 株
キッツ	32,800	981.00	32,176,800	
日立	2,353,400	3,253.00	7,655,610,200	
三菱電機	1,072,800	2,262.00	2,426,673,600	
富士電機	59,600	7,534.00	449,026,400	
東洋電機製造	800	1,058.00	846,400	
安川電機	106,400	4,411.00	469,330,400	貸付株式数 41,600 株
シンフォニア テクノロジー	10,800	4,340.00	46,872,000	
明電舎	18,200	3,045.00	55,419,000	
オリジン	500	1,198.00	599,000	
山洋電気	4,200	9,500.00	39,900,000	貸付株式数 800 株
デンヨー	7,500	2,446.00	18,345,000	貸付株式数 2,200 株
PHC ホールディングス	18,300	1,123.00	20,550,900	貸付株式数 7,100 株
KOKUSAI ELECTRIC	51,200	3,145.00	161,024,000	貸付株式数 20,000 株
ソシオネクスト	71,500	2,727.50	195,016,250	
ベイカレント	73,300	4,866.00	356,677,800	
ORCHESTRA HLDGS	2,200	859.00	1,889,800	
アイモバイル	12,700	458.00	5,816,600	貸付株式数 4,900 株
キャリアインデックス	700	178.00	124,600	貸付株式数 400 株
MS - J a p a n	4,500	1,008.00	4,536,000	貸付株式数 1,700 株
船場	500	1,175.00	587,500	
ジャパンエレベーターSHD	32,300	2,774.00	89,600,200	
フルテック	300	1,127.00	338,100	貸付株式数 100 株
グリーンズ	800	1,660.00	1,328,000	
ツナググループ HLDGS	600	675.00	405,000	貸付株式数 200 株
GAMEWITH	900	203.00	182,700	貸付株式数 400 株
MS&CONSULTING	400	525.00	210,000	貸付株式数 100 株
エル・ティール・エス	1,300	1,648.00	2,142,400	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考	
		単価	金額		
ミダックホールディングス	6,000	1,698.00	10,188,000	貸付株式数	2,300株
キュービーネットHLDGS	5,700	1,088.00	6,201,600	貸付株式数	2,200株
オープングループ	13,500	206.00	2,781,000	貸付株式数	5,200株
三桜工業	14,500	746.00	10,817,000		
マキタ	111,700	4,681.00	522,867,700		
東芝テック	12,600	3,345.00	42,147,000		
芝浦メカトロニクス	5,600	7,400.00	41,440,000		
マブチモーター	42,900	2,144.00	91,977,600		
ニデック	216,200	5,722.00	1,237,096,400		
ユーエムシーエレクトロニクス	6,000	375.00	2,250,000	貸付株式数	2,400株
トレックス・セミコンダクター	5,000	1,519.00	7,595,000	貸付株式数	1,900株
東光高岳	5,900	1,789.00	10,555,100		
ダブル・スコープ	28,000	405.00	11,340,000	貸付株式数	10,600株
宮越ホールディングス	4,300	1,927.00	8,286,100	貸付株式数	1,600株
ダイヘン	9,300	6,090.00	56,637,000		
ヤーマン	19,000	823.00	15,637,000	貸付株式数	7,400株 (200株)
JVCケンウッド	77,300	1,284.00	99,253,200		
ミマキエンジニアリング	9,300	1,532.00	14,247,600		
IPEX	5,400	1,550.00	8,370,000		
大崎電気	21,000	708.00	14,868,000		
オムロン	74,800	5,901.00	441,394,800		
日東工業	13,200	3,115.00	41,118,000	貸付株式数	1,500株
IDEC	14,400	2,526.00	36,374,400	貸付株式数	5,600株
正興電機製作所	700	1,245.00	871,500		
不二電機工業	400	1,051.00	420,400	貸付株式数	200株
ジーエス・ユアサコーポ	38,100	2,860.00	108,966,000		
サクサ	500	2,352.00	1,176,000		
メルコホールディングス	3,100	3,695.00	11,454,500		
テクノメディカ	2,300	1,923.00	4,422,900	貸付株式数	900株
ダイヤモンドエレクトリクHD	3,500	603.00	2,110,500	貸付株式数	1,400株
日本電気	128,600	12,330.00	1,585,638,000		
富士通	901,200	2,816.00	2,537,779,200		
沖電気	44,300	963.00	42,660,900	貸付株式数	9,100株
電気興業	3,900	2,019.00	7,874,100		
サンケン電気	9,100	6,363.00	57,903,300	貸付株式数	3,400株
ナカヨ	300	1,136.00	340,800		
アイホン	5,300	2,869.00	15,205,700		
ルネサスエレクトロニクス	746,100	2,089.50	1,558,975,950		
セイコーエプソン	125,600	2,604.50	327,125,200		
ワコム	68,900	654.00	45,060,600		
アルバック	21,500	7,170.00	154,155,000		
アクセル	4,900	1,268.00	6,213,200		

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
E I Z O	7,200	4,450.00	32,040,000	
ジャパンディスプレイ	61,700	22.00	1,357,400	
日本信号	22,300	948.00	21,140,400	
京三製作所	20,600	492.00	10,135,200	
能美防災	13,300	2,638.00	35,085,400	
ホーチキ	7,300	1,807.00	13,191,100	貸付株式数 1,400 株
星和電機	900	521.00	468,900	
エレコム	23,400	1,434.00	33,555,600	
パナソニック ホールディング	1,157,000	1,226.00	1,418,482,000	
シャープ	165,100	906.00	149,580,600	貸付株式数 64,500 株
アンリツ	69,000	1,095.00	75,555,000	貸付株式数 26,900 株
富士通ゼネラル	27,800	1,942.00	53,987,600	
ソニーグループ	679,100	13,000.00	8,828,300,000	※
T D K	155,100	9,134.00	1,416,683,400	
帝国通信工業	4,300	2,431.00	10,453,300	
タムラ製作所	38,800	600.00	23,280,000	貸付株式数 15,200 株
アルプスアルパイン	87,500	1,495.50	130,856,250	
池上通信機	700	674.00	471,800	
日本電波工業	11,700	1,046.00	12,238,200	貸付株式数 200 株
鈴木	5,200	1,616.00	8,403,200	
メイコー	9,700	5,630.00	54,611,000	
日本トリム	2,200	3,550.00	7,810,000	
フオスター電機	7,200	1,583.00	11,397,600	
S M K	2,500	2,252.00	5,630,000	
ヨコオ	8,600	1,561.00	13,424,600	
ティアック	3,400	86.00	292,400	貸付株式数 1,900 株
ホシデン	22,200	2,115.00	46,953,000	
ヒロセ電機	14,200	18,710.00	265,682,000	
日本航空電子	23,400	2,460.00	57,564,000	
T O A	11,100	938.00	10,411,800	
マクセル	21,600	1,862.00	40,219,200	
古野電気	12,700	1,656.00	21,031,200	
スミダコーポレーション	13,100	905.00	11,855,500	
アイコム	3,800	2,733.00	10,385,400	貸付株式数 400 株
リオン	4,000	2,025.00	8,100,000	
横河電機	107,100	3,630.00	388,773,000	
新電元工業	3,700	2,399.00	8,876,300	貸付株式数 1,400 株
アズビル	66,700	4,711.00	314,223,700	
東亜ディーケーケー	1,000	850.00	850,000	
日本光電工業	81,300	1,939.00	157,640,700	
チノール	4,000	2,164.00	8,656,000	貸付株式数 1,300 株
共和電業	2,100	428.00	898,800	
日本電子材料	6,000	2,265.00	13,590,000	
堀場製作所	18,400	8,558.00	157,467,200	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
アドバンテスト	277,800	5,830.00	1,619,574,000	
小野測器	900	570.00	513,000	貸付株式数 300株
エスペック	7,700	2,412.00	18,572,400	
キーエンス	97,000	64,370.00	6,243,890,000	
日置電機	5,100	8,150.00	41,565,000	貸付株式数 2,000株
シスメックス	251,000	2,691.00	675,441,000	
日本マイクロニクス	16,000	3,695.00	59,120,000	
メガチップス	7,500	5,070.00	38,025,000	
OBARA GROUP	6,100	3,905.00	23,820,500	貸付株式数 2,300株
IMAGICA GROUP	9,700	476.00	4,617,200	貸付株式数 3,500株
澤藤電機	200	1,053.00	210,600	
デンソー	799,600	2,042.00	1,632,783,200	
原田工業	900	546.00	491,400	貸付株式数 500株
コーセル	10,300	1,180.00	12,154,000	
イリソ電子工業	8,900	2,510.00	22,339,000	貸付株式数 3,400株
オプテックスグループ	17,800	1,682.00	29,939,600	貸付株式数 4,100株
千代田インテグレ	3,400	3,550.00	12,070,000	
レーザーテック	44,400	22,195.00	985,458,000	
スタンレー電気	61,900	2,793.00	172,886,700	
ウシオ電機	42,800	2,026.50	86,734,200	
岡谷電機	1,600	236.00	377,600	貸付株式数 800株
ヘリオステクノH	2,900	896.00	2,598,400	
エノモト	600	1,407.00	844,200	
日本セラミック	8,800	2,464.00	21,683,200	
遠藤照明	1,000	1,221.00	1,221,000	
古河電池	7,100	1,382.00	9,812,200	貸付株式数 2,400株
山一電機	8,700	2,457.00	21,375,900	
図研	8,100	3,320.00	26,892,000	
日本電子	24,300	5,539.00	134,597,700	
カシオ	70,100	1,161.50	81,421,150	
ファナック	469,200	3,828.00	1,796,097,600	
日本シイエムケイ	22,500	390.00	8,775,000	
エンプラス	2,800	6,010.00	16,828,000	貸付株式数 1,100株 (100株)
大真空	14,300	599.00	8,565,700	貸付株式数 2,100株
ローム	175,700	1,575.00	276,727,500	貸付株式数 68,700株
浜松ホトニクス	77,800	3,380.00	262,964,000	
三井ハイテック	42,900	918.00	39,382,200	貸付株式数 16,800株
新光電気工業	33,500	5,505.00	184,417,500	
京セラ	602,400	1,722.00	1,037,332,800	
協栄産業	200	2,307.00	461,400	
太陽誘電	47,200	3,112.00	146,886,400	
村田製作所	866,100	2,786.50	2,413,387,650	
双葉電子工業	18,300	501.00	9,168,300	
日東電工	61,500	11,235.00	690,952,500	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
北陸電気工業	800	1,334.00	1,067,200	
東海理化電機	27,100	1,942.00	52,628,200	
ニチコン	25,400	961.00	24,409,400	貸付株式数 9,900 株
日本ケミコン	10,300	1,078.00	11,103,400	
K O A	14,600	1,200.00	17,520,000	貸付株式数 5,700 株
三井E&S	48,600	1,157.00	56,230,200	貸付株式数 19,000 株
日立造船	86,400	944.00	81,561,600	
三菱重工業	1,712,600	1,672.50	2,864,323,500	
川崎重工業	79,100	4,576.00	361,961,600	貸付株式数 15,700 株
I H I	72,900	6,245.00	455,260,500	
名村造船所	30,200	1,432.00	43,246,400	貸付株式数 11,800 株
サノヤスホールディングス	3,000	164.00	492,000	貸付株式数 1,700 株
スプリックス	700	783.00	548,100	
マネジメントソリューションズ	4,900	1,209.00	5,924,100	貸付株式数 1,900 株
プロレド・パートナーズ	2,400	533.00	1,279,200	
AND FACTORY	700	272.00	190,400	貸付株式数 300 株
テノ.ホールディングス	300	442.00	132,600	貸付株式数 100 株
フロンティア・マネジメント	3,000	1,127.00	3,381,000	
ピアラ	400	276.00	110,400	
コプロ・ホールディングス	700	1,514.00	1,059,800	貸付株式数 200 株
ギークス	300	421.00	126,300	
アンビスホールディングス	21,400	1,873.00	40,082,200	貸付株式数 8,300 株
カーブスホールディングス	27,300	771.00	21,048,300	貸付株式数 10,600 株
フォーラムエンジニアリング	13,600	986.00	13,409,600	
FAST FITNESS JAP	3,400	1,248.00	4,243,200	貸付株式数 1,300 株
日本車輛	3,200	2,102.00	6,726,400	
三菱ロジスネクスト	15,500	1,223.00	18,956,500	貸付株式数 5,500 株
近畿車輛	300	1,402.00	420,600	
一家ホールディングス	700	699.00	489,300	貸付株式数 100 株
フルサト・マルカHD	8,200	2,227.00	18,261,400	
ヤマエグループHD	9,000	1,987.00	17,883,000	貸付株式数 3,300 株
ジャパクラフトホールディング	1,700	140.00	238,000	貸付株式数 900 株
F P G	34,100	2,181.00	74,372,100	貸付株式数 12,400 株
島根銀行	600	504.00	302,400	貸付株式数 300 株
じもとホールディングス	1,800	295.00	531,000	貸付株式数 1,000 株
全国保証	25,000	5,705.00	142,625,000	
めぶきフィナンシャルG	442,500	555.70	245,897,250	
ジャパンインベストメントA	15,500	1,100.00	17,050,000	貸付株式数 6,000 株
東京きらぼしFG	12,200	4,230.00	51,606,000	
九州フィナンシャルG	184,800	674.80	124,703,040	
かんぽ生命保険	97,200	2,661.50	258,697,800	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ゆうちょ銀行	1,049,300	1,366.50	1,433,868,450	貸付株式数 317,600 株
あんしん保証	1,400	187.00	261,800	貸付株式数 100 株
富山第一銀行	30,300	1,087.00	32,936,100	貸付株式数 11,800 株
コンコルディア・フィナンシャル	508,000	794.70	403,707,600	
ジェイリース	7,200	1,298.00	9,345,600	
西日本フィナンシャルHD	53,400	1,617.00	86,347,800	
イントラスト	1,000	708.00	708,000	
日本モーゲージサービス	1,400	405.00	567,000	貸付株式数 100 株
C a s a	1,000	809.00	809,000	貸付株式数 400 株
S B I アルヒ	9,300	834.00	7,756,200	貸付株式数 3,600 株
プレミアグループ	16,200	2,076.00	33,631,200	貸付株式数 3,900 株
日産自動車	1,275,200	408.10	520,409,120	
いすゞ自動車	272,100	2,050.50	557,941,050	
トヨタ自動車	5,154,500	2,500.00	12,886,250,000	※
日野自動車	145,300	418.90	60,866,170	
三菱自動車工業	377,900	403.10	152,331,490	貸付株式数 147,900 株
エフテック	1,400	517.00	723,800	貸付株式数 800 株
レシップホールディングス	1,000	590.00	590,000	
GMB	400	1,143.00	457,200	貸付株式数 200 株
ファルテック	400	462.00	184,800	
武蔵精密工業	23,600	1,939.00	45,760,400	
日産車体	9,700	956.00	9,273,200	
新明和工業	27,900	1,271.00	35,460,900	
極東開発工業	16,000	2,608.00	41,728,000	
トピー工業	7,700	1,970.00	15,169,000	貸付株式数 3,000 株
ティラド	2,100	3,610.00	7,581,000	
タチエス	17,700	1,913.00	33,860,100	
N O K	37,600	2,359.00	88,698,400	
フタバ産業	25,500	675.00	17,212,500	
カヤバ	9,100	4,515.00	41,086,500	
市光工業	17,100	423.00	7,233,300	
大同メタル工業	18,700	493.00	9,219,100	
プレス工業	38,000	585.00	22,230,000	貸付株式数 6,800 株
ミクニ	2,600	348.00	904,800	
太平洋工業	21,800	1,371.00	29,887,800	貸付株式数 8,700 株
河西工業	3,300	152.00	501,600	貸付株式数 1,800 株
アイシン	73,200	4,915.00	359,778,000	
マツダ	320,500	1,108.50	355,274,250	
今仙電機製作所	1,300	567.00	737,100	貸付株式数 700 株
本田技研	2,296,900	1,509.00	3,466,022,100	
スズキ	712,200	1,545.00	1,100,349,000	
SUBARU	300,500	2,543.00	764,171,500	
安永	900	583.00	524,700	貸付株式数 500 株
ヤマハ発動機	419,100	1,218.00	510,463,800	貸付株式数 43,100 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
小糸製作所	100,300	2,004.00	201,001,200	
T B K	2,200	291.00	640,200	
エクセディ	15,700	3,035.00	47,649,500	
ミツバ	18,100	926.00	16,760,600	
豊田合成	27,500	2,451.50	67,416,250	
愛三工業	15,900	1,424.00	22,641,600	
盟和産業	300	1,122.00	336,600	
日本プラスト	1,700	368.00	625,600	貸付株式数 600株
ヨロズ	8,800	1,072.00	9,433,600	貸付株式数 3,500株
エフ・シー・シー	16,800	2,374.00	39,883,200	
新家工業	500	4,900.00	2,450,000	
シマノ	42,300	25,500.00	1,078,650,000	貸付株式数 16,500株
テイ・エス テック	34,200	1,806.50	61,782,300	
33FG	8,600	1,708.00	14,688,800	
第四北越フィナンシャルG	15,000	4,915.00	73,725,000	
ひろぎんHLDGS	136,000	1,089.00	148,104,000	貸付株式数 53,100株
マーキュリアホールディングス	1,000	855.00	855,000	
おきなわFG	8,100	2,371.00	19,205,100	
ダイレクトマーケティングミクス	12,000	252.00	3,024,000	貸付株式数 4,800株
ポピンズ	1,900	1,473.00	2,798,700	
LITALICO	7,800	1,236.00	9,640,800	貸付株式数 3,000株
コンフィデンス・インターワーク	200	1,730.00	346,000	貸付株式数 100株
十六FG	12,400	4,025.00	49,910,000	
北國FHD	9,300	4,560.00	42,408,000	
ネットプロHD	31,800	289.00	9,190,200	
プロクレアホールディングス	10,900	1,810.00	19,729,000	貸付株式数 2,700株
あいちフィナンシャルグル	19,600	2,369.00	46,432,400	貸付株式数 7,600株
ジャムコ	5,900	1,272.00	7,504,800	貸付株式数 2,200株
小野建	10,300	1,487.00	15,316,100	
はるやまHLDGS	1,100	574.00	631,400	貸付株式数 400株
南陽	900	1,060.00	954,000	
ノジマ	29,700	1,808.00	53,697,600	
佐鳥電機	7,200	1,887.00	13,586,400	貸付株式数 300株
カップ・クリエイト	16,100	1,733.00	27,901,300	貸付株式数 6,100株
エコートレーディング	500	907.00	453,500	貸付株式数 100株
伯東	5,900	4,740.00	27,966,000	貸付株式数 2,200株
コンドーテック	7,900	1,212.00	9,574,800	貸付株式数 2,000株
中山福	1,200	374.00	448,800	
ライトオン	1,800	351.00	631,800	貸付株式数 900株
ナガイレーベン	13,000	2,517.00	32,721,000	貸付株式数 5,000株
三菱食品	9,500	5,080.00	48,260,000	
良品計画	122,200	2,681.50	327,679,300	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
パリミキホールディングス	2,700	353.00	953,100	貸付株式数 1,000株
松田産業	7,800	3,110.00	24,258,000	
第一興商	39,700	1,671.50	66,358,550	貸付株式数 10,200株
メディパルHD	104,300	2,655.00	276,916,500	
アドヴァングループ	8,800	913.00	8,034,400	貸付株式数 100株
S P K	4,400	2,026.00	8,914,400	
萩原電気HLDGS	4,400	3,505.00	15,422,000	
アルビス	3,300	2,725.00	8,992,500	貸付株式数 1,300株
アズワン	31,800	2,778.50	88,356,300	
スズデン	3,600	1,874.00	6,746,400	貸付株式数 1,400株
尾家産業	500	2,007.00	1,003,500	
シモジマ	6,900	1,293.00	8,921,700	
ドウシシャ	9,500	2,163.00	20,548,500	
小津産業	500	1,648.00	824,000	貸付株式数 200株
コナカ	2,900	242.00	701,800	
高速	6,100	2,379.00	14,511,900	
ハウス ローゼ	300	1,493.00	447,900	貸付株式数 100株
G-7ホールディングス	11,200	1,575.00	17,640,000	
たけびし	3,900	2,356.00	9,188,400	貸付株式数 1,400株
イオン北海道	30,400	912.00	27,724,800	貸付株式数 1,400株
コジマ	19,800	934.00	18,493,200	貸付株式数 7,700株 (1,700株)
ヒマラヤ	900	890.00	801,000	貸付株式数 400株
コーナン商事	12,600	3,730.00	46,998,000	
ネットワンシステムズ	37,900	3,585.00	135,871,500	
エコス	3,800	2,052.00	7,797,600	貸付株式数 1,400株
ワタミ	10,900	856.00	9,330,400	貸付株式数 4,200株
マルシェ	1,100	204.00	224,400	貸付株式数 400株
リックス	2,600	2,850.00	7,410,000	貸付株式数 500株
システムソフト	33,700	61.00	2,055,700	貸付株式数 12,500株
パンパシフィックHD	207,200	3,687.00	763,946,400	貸付株式数 81,000株
丸文	9,100	1,033.00	9,400,300	
西松屋チェーン	20,200	2,497.00	50,439,400	貸付株式数 7,800株
ゼンショーホールディングス	52,300	7,478.00	391,099,400	貸付株式数 18,600株
ハピネット	8,700	4,075.00	35,452,500	
幸楽苑ホールディングス	7,600	1,213.00	9,218,800	貸付株式数 2,800株
ハークスレイ	700	736.00	515,200	
橋本総業HLDGS	4,100	1,185.00	4,858,500	貸付株式数 1,500株
日本ライフライン	27,300	1,177.00	32,132,100	
サイゼリヤ	15,200	5,020.00	76,304,000	貸付株式数 5,900株
タカショー	8,900	470.00	4,183,000	貸付株式数 3,500株
V Tホールディングス	39,000	483.00	18,837,000	
アルゴグラフィックス	8,900	5,110.00	45,479,000	
魚力	3,600	2,447.00	8,809,200	貸付株式数 1,300株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
I D O M	27,000	1,061.00	28,647,000	
日本エム・ディ・エム	7,500	724.00	5,430,000	
ポプラ	600	206.00	123,600	貸付株式数 300株 (100株)
フジ・コーポレーション	4,900	2,226.00	10,907,400	貸付株式数 1,900株
ユナイテッドアローズ	12,100	2,218.00	26,837,800	
進和	6,300	2,538.00	15,989,400	貸付株式数 2,300株
エスケイジャパン	600	726.00	435,600	
ダイトロン	4,400	2,628.00	11,563,200	
ハイデイ日高	15,200	2,644.00	40,188,800	貸付株式数 5,900株
シークス	14,500	1,060.00	15,370,000	
京都きもの友禅HD	1,600	94.00	150,400	貸付株式数 800株
コロワイド	44,100	1,684.50	74,286,450	貸付株式数 17,200株
田中商事	600	679.00	407,400	
オーハシテクニカ	5,200	1,796.00	9,339,200	貸付株式数 2,000株
老番屋	40,500	1,008.00	40,824,000	
白銅	2,900	2,441.00	7,078,900	貸付株式数 1,100株
トップカルチャー	1,000	148.00	148,000	貸付株式数 200株
P L A N T	500	1,576.00	788,000	貸付株式数 200株
スギホールディングス	62,000	2,574.50	159,619,000	
ダイコー通産	200	1,149.00	229,800	貸付株式数 100株
薬王堂ホールディングス	5,000	2,515.00	12,575,000	
島津製作所	128,800	4,653.00	599,306,400	
J M S	8,700	497.00	4,323,900	
クボテック	600	200.00	120,000	貸付株式数 300株
長野計器	7,000	2,446.00	17,122,000	貸付株式数 1,600株
ブイ・テクノロジー	5,100	2,567.00	13,091,700	
スター精密	16,500	1,905.00	31,432,500	
東京計器	7,400	2,584.00	19,121,600	貸付株式数 1,400株
愛知時計	4,200	2,004.00	8,416,800	貸付株式数 1,600株
インターアクション	5,900	1,201.00	7,085,900	貸付株式数 1,200株
オーバル	1,800	378.00	680,400	貸付株式数 1,000株
東京精密	19,900	6,807.00	135,459,300	
マニー	38,700	1,863.00	72,098,100	
ニコン	140,200	1,453.50	203,780,700	
トプコン	47,100	1,435.50	67,612,050	貸付株式数 14,700株
オリンパス	555,100	2,556.50	1,419,113,150	
理研計器	13,700	3,815.00	52,265,500	貸付株式数 2,700株
SCREEN ホールディングス	33,200	9,569.00	317,690,800	
キヤノン電子	9,100	2,210.00	20,111,000	
タムロン	13,300	4,440.00	59,052,000	貸付株式数 5,200株
HOYA	190,900	19,270.00	3,678,643,000	
シード	1,200	507.00	608,400	貸付株式数 400株
ノーリツ鋼機	9,200	4,235.00	38,962,000	貸付株式数 900株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
A&D ホロンホールディングス	14,100	2,201.00	31,034,100	
朝日インテック	118,200	2,766.00	326,941,200	
キヤノン	483,600	4,840.00	2,340,624,000	貸付株式数 189,100 株
リコー	243,100	1,520.50	369,633,550	
シチズン時計	89,300	917.00	81,888,100	
リズム	500	4,225.00	2,112,500	貸付株式数 200 株
大研医器	1,800	528.00	950,400	
メニコン	33,400	1,308.00	43,687,200	貸付株式数 13,000 株
シンシア	200	401.00	80,200	
KYORITSU	3,100	160.00	496,000	貸付株式数 1,200 株
中本パックス	700	1,598.00	1,118,600	
パラマウントベッドHD	20,100	2,486.00	49,968,600	
トランザクション	6,400	2,033.00	13,011,200	貸付株式数 2,500 株
粧美堂	600	557.00	334,200	貸付株式数 200 株
ニホンフラッシュ	9,200	910.00	8,372,000	貸付株式数 3,400 株
前田工織	17,300	1,670.00	28,891,000	
永大産業	2,400	222.00	532,800	
アートネイチャー	9,000	804.00	7,236,000	
フルヤ金属	9,200	3,860.00	35,512,000	
バンダイナムコHLDGS	263,300	3,192.00	840,453,600	
アイフィスジャパン	600	566.00	339,600	
SHOEI	27,300	2,257.00	61,616,100	貸付株式数 10,600 株
フランスベッドHLDGS	12,500	1,207.00	15,087,500	貸付株式数 4,700 株
マーベラス	15,800	595.00	9,401,000	
パイロットコーポレーション	15,200	4,222.00	64,174,400	
萩原工業	6,500	1,507.00	9,795,500	貸付株式数 2,500 株
エイベックス	16,600	1,435.00	23,821,000	貸付株式数 4,500 株
フジシールインターナショナル	19,600	2,244.00	43,982,400	
タカラトミー	44,100	3,573.00	157,569,300	
広済堂ホールディングス	31,400	490.00	15,386,000	貸付株式数 12,200 株
エステールホールディングス	600	630.00	378,000	
レック	12,400	1,226.00	15,202,400	貸付株式数 4,800 株
タカノ	800	854.00	683,200	貸付株式数 300 株
三光合成	12,200	548.00	6,685,600	
プロネクス	10,000	1,240.00	12,400,000	
ホクシン	1,500	105.00	157,500	
ウッドワン	800	778.00	622,400	貸付株式数 300 株
きもと	3,400	239.00	812,600	
TOPPAN ホールディングス	115,600	4,261.00	492,571,600	
大日本印刷	100,500	5,215.00	524,107,500	
共同印刷	2,700	3,315.00	8,950,500	貸付株式数 1,000 株
NISSHA	16,600	1,975.00	32,785,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
光村印刷	200	1,521.00	304,200	
藤森工業	7,700	4,280.00	32,956,000	
ヴィア・ホールディングス	3,400	107.00	363,800	貸付株式数 300株
TAKARA & COMPANY	5,700	2,747.00	15,657,900	
前澤化成工業	6,300	1,781.00	11,220,300	貸付株式数 2,400株
未来工業	3,500	3,335.00	11,672,500	貸付株式数 1,300株
アシックス	358,000	2,659.00	951,922,000	貸付株式数 140,000株
ツ ツ ミ	2,300	2,161.00	4,970,300	
ウェーブロック HLDGS	800	614.00	491,200	貸付株式数 300株
ジェイ エス ピー	6,900	1,945.00	13,420,500	貸付株式数 2,300株
ニチハ	12,200	3,500.00	42,700,000	貸付株式数 4,300株
ローランド	7,200	3,790.00	27,288,000	貸付株式数 2,800株
エフピコ	18,400	2,866.50	52,743,600	貸付株式数 1,800株
小松ウオール工業	4,000	3,005.00	12,020,000	
ヤマハ	59,100	3,511.00	207,500,100	
河合楽器	3,000	2,664.00	7,992,000	貸付株式数 1,100株
クリナップ	9,400	725.00	6,815,000	
ピジョン	61,800	1,564.50	96,686,100	
天馬	6,500	2,551.00	16,581,500	
キングジム	8,600	854.00	7,344,400	貸付株式数 3,300株 (200株)
象印マホービン	29,000	1,673.00	48,517,000	貸付株式数 5,600株
リンテック	19,500	3,115.00	60,742,500	
信越ポリマー	20,900	1,511.00	31,579,900	
東リ	4,600	368.00	1,692,800	
イトーキ	19,400	1,402.00	27,198,800	貸付株式数 7,500株
任天堂	612,200	7,745.00	4,741,489,000	
三菱鉛筆	13,400	2,351.00	31,503,400	貸付株式数 5,200株
松風	4,400	4,750.00	20,900,000	
タカラスタANDARD	19,900	1,554.00	30,924,600	
コクヨ	48,500	2,496.00	121,056,000	
ナカバヤシ	10,300	525.00	5,407,500	貸付株式数 4,100株
ニフコ	29,100	3,543.00	103,101,300	
立川ブラインド	4,500	1,264.00	5,688,000	
グローブライド	8,700	1,831.00	15,929,700	貸付株式数 3,000株
オカムラ	29,200	1,988.00	58,049,600	
バルカー	8,100	3,370.00	27,297,000	貸付株式数 3,100株
MUTOH ホールディングス	300	2,358.00	707,400	
伊藤忠	689,600	7,541.00	5,200,273,600	
丸紅	851,000	2,301.50	1,958,576,500	
スクロール	15,300	955.00	14,611,500	
高島	1,500	1,285.00	1,927,500	
ヨンドシーホールディングス	9,700	1,855.00	17,993,500	貸付株式数 3,200株
三陽商会	4,600	2,355.00	10,833,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
長瀬産業	45,800	3,115.00	142,667,000	
ナイガイ	900	232.00	208,800	貸付株式数 300株
蝶理	6,500	3,490.00	22,685,000	貸付株式数 2,500株
豊田通商	269,500	2,582.50	695,983,750	
オンワードホールディングス	57,300	539.00	30,884,700	
三共生興	14,300	584.00	8,351,200	
兼松	42,900	2,430.00	104,247,000	
美津濃	9,600	9,100.00	87,360,000	
ツカモトコーポレーション	300	1,200.00	360,000	
ルックホールディングス	3,100	2,605.00	8,075,500	
三井物産	1,536,900	2,847.00	4,375,554,300	
日本紙パルプ	4,900	6,430.00	31,507,000	
東京エレクトロン	205,200	21,500.00	4,411,800,000	
カメイ	10,900	1,982.00	21,603,800	貸付株式数 4,200株
東都水産	100	6,560.00	656,000	
OUGホールディングス	300	2,599.00	779,700	貸付株式数 100株
スターゼン	7,000	2,823.00	19,761,000	
セイコーグループ	13,500	3,730.00	50,355,000	
山善	31,100	1,366.00	42,482,600	貸付株式数 12,100株
椿本興業	6,400	1,742.00	11,148,800	貸付株式数 2,400株
住友商事	620,900	3,207.00	1,991,226,300	
BIPROGY	31,800	4,832.00	153,657,600	
内田洋行	4,200	6,700.00	28,140,000	
三菱商事	1,970,000	2,852.50	5,619,425,000	
第一実業	9,700	2,382.00	23,105,400	
キャノンマーケティングJPN	23,800	4,780.00	113,764,000	貸付株式数 1,100株
西華産業	4,000	3,860.00	15,440,000	
佐藤商事	7,100	1,397.00	9,918,700	貸付株式数 200株
東京産業	9,400	704.00	6,617,600	貸付株式数 3,200株
ユアサ商事	8,000	5,120.00	40,960,000	
神鋼商事	2,600	7,000.00	18,200,000	
トルク	1,600	210.00	336,000	
阪和興業	18,400	4,820.00	88,688,000	
正栄食品	6,800	4,565.00	31,042,000	貸付株式数 2,600株
カナデン	7,700	1,407.00	10,833,900	貸付株式数 3,000株
RYODEN	8,300	2,500.00	20,750,000	貸付株式数 1,000株
ニプロ	80,700	1,336.00	107,815,200	貸付株式数 3,300株
岩谷産業	23,400	8,213.00	192,184,200	
ナイス	2,500	1,887.00	4,717,500	
ニチモウ	700	1,854.00	1,297,800	
極東貿易	6,200	1,516.00	9,399,200	貸付株式数 2,400株
アステナホールディングス	19,100	502.00	9,588,200	
三愛オブリ	23,900	1,989.00	47,537,100	貸付株式数 9,300株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
稲畑産業	19,900	3,255.00	64,774,500	
G S I クレオス	5,500	1,954.00	10,747,000	貸付株式数 2,100 株
明和産業	12,200	645.00	7,869,000	
クワザワホールディングス	800	661.00	528,800	貸付株式数 400 株
ゴールドウイン	17,200	8,110.00	139,492,000	
ユニ・チャーム	202,600	5,134.00	1,040,148,400	
デサント	16,700	4,340.00	72,478,000	
キング	800	727.00	581,600	貸付株式数 300 株
ワキタ	16,900	1,601.00	27,056,900	
ヤマトインターナショナル	1,700	329.00	559,300	
東邦ホールディングス	27,700	4,860.00	134,622,000	貸付株式数 10,800 株
サンゲツ	23,600	2,841.00	67,047,600	
ミツウロコグループ	13,100	1,649.00	21,601,900	貸付株式数 4,700 株
シナネンホールディングス	2,800	5,700.00	15,960,000	貸付株式数 1,000 株
伊藤忠エネクス	25,400	1,600.00	40,640,000	貸付株式数 9,900 株
サンリオ	83,300	3,903.00	325,119,900	貸付株式数 25,200 株
サンワテクノス	5,200	1,980.00	10,296,000	
新光商事	13,700	912.00	12,494,400	貸付株式数 4,800 株
トーホー	4,000	2,671.00	10,684,000	
三信電気	4,100	1,986.00	8,142,600	
東陽テクニカ	9,300	1,593.00	14,814,900	
モスフード サービス	15,100	3,410.00	51,491,000	貸付株式数 5,800 株
加賀電子	9,300	5,290.00	49,197,000	
都築電気	5,100	2,295.00	11,704,500	貸付株式数 1,900 株
ソーダニツカ	10,800	1,149.00	12,409,200	貸付株式数 4,200 株
立花エレクトック	6,800	2,625.00	17,850,000	
木曽路	15,500	2,428.00	37,634,000	貸付株式数 6,000 株
SRS ホールディングス	17,000	1,247.00	21,199,000	貸付株式数 6,600 株
千趣会	20,800	296.00	6,156,800	貸付株式数 6,000 株
タカキユー	1,500	118.00	177,000	貸付株式数 700 株
リテールパートナーズ	15,200	1,358.00	20,641,600	貸付株式数 5,900 株
上新電機	10,100	2,739.00	27,663,900	貸付株式数 3,600 株
日本瓦斯	53,200	2,315.00	123,158,000	
ロイヤルホールディングス	18,100	2,380.00	43,078,000	貸付株式数 7,000 株
東天紅	200	803.00	160,600	
いなげや	10,000	1,194.00	11,940,000	
チヨダ	9,800	924.00	9,055,200	
ライフコーポレーション	10,700	3,590.00	38,413,000	
リンガーハット	13,200	2,164.00	28,564,800	貸付株式数 5,100 株
MrMaxHD	12,800	692.00	8,857,600	
テンアライド	3,400	299.00	1,016,600	貸付株式数 1,600 株
AOKI ホールディングス	22,000	1,211.00	26,642,000	貸付株式数 8,600 株
オークワ	14,700	924.00	13,582,800	貸付株式数 5,800 株
コメリ	15,800	3,740.00	59,092,000	
青山商事	21,900	1,348.00	29,521,200	貸付株式数 8,600 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
しまむら	24,100	7,784.00	187,594,400	
はせがわ	1,000	334.00	334,000	
高島屋	130,700	1,115.50	145,795,850	貸付株式数 25,500株
松屋	17,400	878.00	15,277,200	貸付株式数 4,600株
エイチ・ツー・オーテイ リング	52,300	2,156.00	112,758,800	貸付株式数 16,500株
近鉄百貨店	4,400	2,068.00	9,099,200	貸付株式数 1,700株
丸井グループ	68,200	2,510.50	171,216,100	
クレディセゾン	60,500	3,334.00	201,707,000	貸付株式数 4,800株
アクシアル リテイリング	28,000	951.00	26,628,000	
井筒屋	1,100	424.00	466,400	貸付株式数 500株
イオン	347,800	3,858.00	1,341,812,400	貸付株式数 136,000株
イズミ	18,200	3,562.00	64,828,400	貸付株式数 7,100株
フオーバル	4,000	1,386.00	5,544,000	貸付株式数 1,000株
平和堂	17,100	2,450.00	41,895,000	貸付株式数 6,700株
フジ	15,700	1,993.00	31,290,100	貸付株式数 5,700株
ヤオコー	12,200	9,972.00	121,658,400	貸付株式数 3,800株
ゼビオホールディングス	13,900	1,255.00	17,444,500	
ケーズホールディングス	68,900	1,566.50	107,931,850	貸付株式数 26,900株
PALTAC	13,700	4,457.00	61,060,900	
三谷産業	17,900	322.00	5,763,800	
OLYMPIC グループ	1,000	500.00	500,000	貸付株式数 500株
日産東京販売HD	3,400	441.00	1,499,400	
あおぞら銀行	68,600	2,534.00	173,832,400	貸付株式数 3,800株
三菱UFJ フィナンシャルG	5,815,800	1,443.00	8,392,199,400	
りそなホールディングス	1,095,200	1,059.50	1,160,364,400	
三井住友トラストHD	340,000	3,472.00	1,180,480,000	
三井住友フィナンシャルG	668,800	8,990.00	6,012,512,000	※
千葉銀行	266,200	1,153.00	306,928,600	
群馬銀行	185,300	933.80	173,033,140	貸付株式数 11,800株
武蔵野銀行	13,300	2,740.00	36,442,000	貸付株式数 2,000株
千葉興業銀行	22,600	949.00	21,447,400	貸付株式数 3,800株
筑波銀行	41,800	240.00	10,032,000	
七十七銀行	27,800	3,950.00	109,810,000	
秋田銀行	6,400	2,187.00	13,996,800	貸付株式数 2,100株
山形銀行	10,600	1,055.00	11,183,000	
岩手銀行	6,000	2,395.00	14,370,000	貸付株式数 300株
東邦銀行	75,500	250.00	18,875,000	貸付株式数 19,300株
東北銀行	1,000	1,173.00	1,173,000	
ふくおかフィナンシャルG	83,200	3,696.00	307,507,200	
スルガ銀行	63,000	1,155.00	72,765,000	
八十二銀行	205,000	835.00	171,175,000	
山梨中央銀行	10,700	1,628.00	17,419,600	
大垣共立銀行	18,200	1,863.00	33,906,600	
福井銀行	8,500	1,865.00	15,852,500	貸付株式数 3,300株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
清水銀行	3,800	1,473.00	5,597,400	
富山銀行	400	1,633.00	653,200	貸付株式数 200株
滋賀銀行	15,900	3,240.00	51,516,000	
南都銀行	14,400	3,085.00	44,424,000	
百五銀行	90,000	543.00	48,870,000	
紀陽銀行	34,200	1,787.00	61,115,400	
ほくほくフィナンシャルG	59,100	1,615.00	95,446,500	
山陰合同銀行	59,800	1,239.00	74,092,200	貸付株式数 3,300株
鳥取銀行	700	1,268.00	887,600	
百十四銀行	9,400	2,586.00	24,308,400	
四国銀行	14,000	993.00	13,902,000	
阿波銀行	13,400	2,477.00	33,191,800	
大分銀行	5,800	3,170.00	18,386,000	
宮崎銀行	5,800	2,762.00	16,019,600	
佐賀銀行	5,600	2,095.00	11,732,000	
琉球銀行	20,400	1,026.00	20,930,400	貸付株式数 600株
セブン銀行	299,400	284.60	85,209,240	貸付株式数 117,100株
みずほフィナンシャルG	1,289,000	2,838.50	3,658,826,500	
高知銀行	700	811.00	567,700	貸付株式数 200株
山口フィナンシャルG	93,600	1,570.50	146,998,800	
芙蓉総合リース	8,800	11,040.00	97,152,000	
みずほリース	80,200	1,010.00	81,002,000	
東京センチュリー	71,400	1,739.50	124,200,300	貸付株式数 27,900株
SBI ホールディングス	153,500	3,266.00	501,331,000	
日本証券金融	35,100	1,877.00	65,882,700	
アイフル	140,800	322.00	45,337,600	
日本アジア投資	1,800	214.00	385,200	貸付株式数 600株
名古屋銀行	6,100	6,370.00	38,857,000	
北洋銀行	144,700	395.00	57,156,500	
大光銀行	700	1,438.00	1,006,600	貸付株式数 200株
愛媛銀行	12,900	1,173.00	15,131,700	貸付株式数 100株
トマト銀行	800	1,179.00	943,200	
京葉銀行	39,200	731.00	28,655,200	
栃木銀行	47,600	269.00	12,804,400	
北日本銀行	3,100	2,465.00	7,641,500	
東和銀行	17,500	592.00	10,360,000	
福島銀行	2,100	242.00	508,200	貸付株式数 1,200株
大東銀行	900	657.00	591,300	貸付株式数 100株
リコーリース	9,100	5,050.00	45,955,000	貸付株式数 3,500株
イオンフィナンシャルサー ビス	54,800	1,263.50	69,239,800	貸付株式数 9,200株
アコム	170,800	365.90	62,495,720	
ジャックス	10,200	3,850.00	39,270,000	
オリコ	31,300	935.00	29,265,500	
オリックス	572,700	3,425.00	1,961,497,500	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
三菱HC キャピタル	425,600	1,046.50	445,390,400	
ジャフコ グループ	28,500	2,001.50	57,042,750	貸付株式数 10,800 株
九州 リースサービス	900	1,028.00	925,200	貸付株式数 400 株
トモニホールディングス	90,400	390.00	35,256,000	
大和証券G 本社	739,900	1,019.50	754,328,050	
野村ホールディングス	1,606,100	787.00	1,264,000,700	
岡三証券グループ	83,900	627.00	52,605,300	貸付株式数 5,200 株
丸三証券	31,800	966.00	30,718,800	貸付株式数 12,400 株
東洋証券	25,400	406.00	10,312,400	貸付株式数 9,900 株
東海東京HD	113,600	496.00	56,345,600	
光世証券	500	430.00	215,000	貸付株式数 200 株
水戸証券	26,300	421.00	11,072,300	
いちよし証券	17,900	701.00	12,547,900	
松井証券	47,200	798.00	37,665,600	
SOMPO ホールディングス	431,000	3,262.00	1,405,922,000	
日本取引所グループ	246,200	3,292.00	810,490,400	
マネックスG	93,500	620.00	57,970,000	
極東証券	13,100	1,479.00	19,374,900	貸付株式数 5,000 株
岩井コスモホールディング	10,900	2,006.00	21,865,400	
アイザワ証券グループ	13,800	1,841.00	25,405,800	貸付株式数 5,400 株
フィデアホール	9,900	1,468.00	14,533,200	
池田泉州HD	132,500	328.00	43,460,000	
アニコム ホールディングス	32,400	632.00	20,476,800	
MS & AD	641,400	3,217.00	2,063,383,800	
マネーパートナーズ GP	2,500	212.00	530,000	
スパークス・グループ	10,700	1,333.00	14,263,100	
小林洋行	900	266.00	239,400	貸付株式数 100 株
第一生命 HLDGS	449,100	3,844.00	1,726,340,400	
東京海上HD	932,400	5,111.00	4,765,496,400	
アドバンテッジリスクマネ	1,100	532.00	585,200	
イー・ギャランティ	15,600	1,401.00	21,855,600	
アサックス	1,200	744.00	892,800	貸付株式数 500 株
NEC キャピタルソリューション	4,700	3,805.00	17,883,500	貸付株式数 1,800 株
T&D ホールディングス	256,400	2,313.00	593,053,200	
アドバンスクリエイト	7,400	1,009.00	7,466,600	貸付株式数 2,800 株
三井不動産	1,324,500	1,440.00	1,907,280,000	
三菱地所	599,100	2,341.00	1,402,493,100	
平和不動産	15,400	3,990.00	61,446,000	貸付株式数 6,000 株
東京建物	83,200	2,315.50	192,649,600	
京阪神ビルディング	17,800	1,545.00	27,501,000	
住友不動産	138,000	4,734.00	653,292,000	
太平洋興発	800	734.00	587,200	貸付株式数 200 株
テーオーシー	16,800	617.00	10,365,600	
スターツコーポレーション	13,600	3,305.00	44,948,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
フジ住宅	11,700	683.00	7,991,100	
空港施設	13,100	578.00	7,571,800	
明和地所	6,700	965.00	6,465,500	貸付株式数 2,600 株
ゴールドクレスト	7,700	3,145.00	24,216,500	貸付株式数 3,000 株
リログループ	49,900	1,870.50	93,337,950	
エスリード	4,500	4,565.00	20,542,500	貸付株式数 1,500 株
日神グループ HLDGS	15,000	490.00	7,350,000	貸付株式数 5,200 株
日本エスコン	17,600	1,001.00	17,617,600	
MIRARTH ホールディング	49,300	504.00	24,847,200	
A V A N T I A	1,100	771.00	848,100	貸付株式数 600 株
イオンモール	49,300	2,067.00	101,903,100	
毎日コムネット	700	714.00	499,800	貸付株式数 100 株
ファースト住建	800	1,094.00	875,200	貸付株式数 400 株
ランド	539,600	8.00	4,316,800	貸付株式数 209,700 株
カチタス	25,600	1,779.00	45,542,400	貸付株式数 3,400 株
東祥	6,900	681.00	4,698,900	貸付株式数 2,400 株
トーセイ	15,800	2,262.00	35,739,600	
穴吹興産	500	2,008.00	1,004,000	貸付株式数 200 株
サンフロンティア不動産	14,000	1,724.00	24,136,000	
インテリックス	500	663.00	331,500	
ランドビジネス	800	201.00	160,800	貸付株式数 400 株
サンネクスタグループ	700	1,004.00	702,800	貸付株式数 100 株
グランディハウス	8,500	568.00	4,828,000	貸付株式数 3,200 株
東武鉄道	106,500	2,564.50	273,119,250	
相鉄ホールディングス	34,700	2,408.00	83,557,600	貸付株式数 13,500 株
東急	271,800	1,861.50	505,955,700	
京浜急行	119,900	1,164.50	139,623,550	貸付株式数 20,700 株
小田急電鉄	160,300	1,720.00	275,716,000	
京王電鉄	46,600	3,575.00	166,595,000	
京成電鉄	62,500	4,444.00	277,750,000	
富士急行	12,000	2,485.00	29,820,000	貸付株式数 4,600 株
東日本旅客鉄道	534,300	2,831.00	1,512,603,300	
西日本旅客鉄道	230,000	2,716.00	624,680,000	
東海旅客鉄道	373,500	3,310.00	1,236,285,000	
西武ホールディングス	117,300	3,373.00	395,652,900	
鴻池運輸	16,500	2,394.00	39,501,000	
西日本鉄道	25,900	2,326.50	60,256,350	
ハマキョウレックス	8,300	4,905.00	40,711,500	
サカイ引越センター	10,800	2,467.00	26,643,600	
近鉄グループ HLDGS	96,800	3,425.00	331,540,000	
阪急阪神 HLDGS	129,100	4,510.00	582,241,000	
南海電鉄	43,200	2,317.50	100,116,000	貸付株式数 16,800 株
京阪ホールディングス	53,300	2,967.00	158,141,100	
神戸電鉄	2,600	2,617.00	6,804,200	貸付株式数 1,000 株
名古屋鉄道	99,800	1,710.00	170,658,000	貸付株式数 33,000 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
山陽電鉄	7,300	2,011.00	14,680,300	貸付株式数 2,800株
アルプス物流	7,500	5,770.00	43,275,000	貸付株式数 800株
トランコム	2,800	7,040.00	19,712,000	
ヤマトホールディングス	117,600	1,613.00	189,688,800	
山九	23,400	4,741.00	110,939,400	
日新	7,400	4,165.00	30,821,000	貸付株式数 2,800株
丸運	1,200	555.00	666,000	貸付株式数 600株
丸全昭和運輸	6,000	4,880.00	29,280,000	
センコーグループ HLDGS	51,200	1,208.00	61,849,600	
トナミホールディングス	2,100	5,980.00	12,558,000	貸付株式数 800株
ニッコンホールディングス	29,800	3,722.00	110,915,600	
日石輸送	200	2,845.00	569,000	
福山通運	8,900	3,795.00	33,775,500	
セイノーホールディングス	54,400	2,431.50	132,273,600	貸付株式数 21,200株
神奈川中央交通	2,700	3,370.00	9,099,000	貸付株式数 1,000株
AZ-COM 丸和ホールディ	24,800	1,107.00	27,453,600	貸付株式数 9,600株
日本郵船	250,700	4,700.00	1,178,290,000	
商船三井	210,300	4,791.00	1,007,547,300	貸付株式数 82,200株
川崎汽船	233,200	1,942.50	452,991,000	貸付株式数 91,200株
NS ユナイテッド海運	5,200	4,375.00	22,750,000	貸付株式数 2,000株
明海グループ	2,400	706.00	1,694,400	貸付株式数 800株
飯野海運	35,600	1,175.00	41,830,000	貸付株式数 13,800株
共栄タンカー	400	986.00	394,400	貸付株式数 200株
九州旅客鉄道	68,400	4,068.00	278,251,200	
SG ホールディングス	162,500	1,604.50	260,731,250	
NIPPON EXPRESS	36,100	7,100.00	256,310,000	
ID&E ホールディングス	6,000	3,970.00	23,820,000	
日本航空	237,800	2,410.50	573,216,900	
ANA ホールディングス	263,500	2,965.50	781,409,250	
ビーウィズ	2,100	1,827.00	3,836,700	貸付株式数 700株
パスコ	400	2,135.00	854,000	
TRE ホールディングス	19,100	1,590.00	30,369,000	貸付株式数 7,400株
人・夢・技術グループ	4,100	1,784.00	7,314,400	
西本 WISMETTAC HD	6,300	1,394.00	8,782,200	貸付株式数 2,400株
シルバーライフ	2,800	917.00	2,567,600	
ヤマシタヘルスケア HLDGS	200	2,615.00	523,000	
GENKY DRUGSTORES	9,000	3,765.00	33,885,000	
コア商事 HLDGS	7,500	608.00	4,560,000	貸付株式数 2,300株
KPP グループホールディン	26,600	672.00	17,875,200	
ナルミヤ・インターナショナル	400	1,235.00	494,000	貸付株式数 100株
ブックオフGHD	7,400	1,292.00	9,560,800	貸付株式数 2,900株
ギフトホールディングス	5,100	2,551.00	13,010,100	貸付株式数 2,000株
三菱倉庫	23,100	5,189.00	119,865,900	
三井倉庫 HOLD	9,100	5,760.00	52,416,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
住友倉庫	25,900	2,683.00	69,489,700	貸付株式数 7,100 株
渋沢倉庫	4,400	2,938.00	12,927,200	
ヤマタネ	4,500	3,265.00	14,692,500	
東陽倉庫	500	1,343.00	671,500	
乾汽船	11,300	1,102.00	12,452,600	貸付株式数 4,400 株
日本トランスシティ	19,500	872.00	17,004,000	
ケイヒン	400	2,036.00	814,400	
中央倉庫	5,200	1,408.00	7,321,600	貸付株式数 1,900 株
川西倉庫	400	1,148.00	459,200	貸付株式数 200 株
安田倉庫	6,600	1,655.00	10,923,000	貸付株式数 2,200 株
ファイブホールディングス	300	842.00	252,600	貸付株式数 100 株
N I S S O H D	8,700	752.00	6,542,400	貸付株式数 2,900 株
大栄環境	18,100	3,100.00	56,110,000	
日本管財ホールディング	10,300	2,619.00	26,975,700	貸付株式数 4,000 株
東洋埠頭	600	1,278.00	766,800	
上組	44,700	3,334.00	149,029,800	
サンリツ	500	801.00	400,500	
キムラユニティー	1,000	1,492.00	1,492,000	
キューソー流通システム	6,400	1,950.00	12,480,000	貸付株式数 2,500 株
東海運	1,200	323.00	387,600	貸付株式数 600 株
エーアイテイー	6,100	1,653.00	10,083,300	貸付株式数 1,600 株
内外トランスライン	3,900	2,688.00	10,483,200	貸付株式数 1,300 株
ショーエイコーポ	700	571.00	399,700	貸付株式数 300 株
日本コンセプト	3,500	1,679.00	5,876,500	
TBS ホールディングス	48,900	3,985.00	194,866,500	
日本テレビ HLDS	86,100	2,346.00	201,990,600	貸付株式数 33,600 株
朝日放送グループ HD	9,200	635.00	5,842,000	貸付株式数 3,500 株
テレビ朝日 HD	23,600	1,984.00	46,822,400	
スカパーJSATHD	75,600	827.00	62,521,200	
テレビ東京 HD	7,000	3,880.00	27,160,000	貸付株式数 2,700 株
日本BS放送	800	883.00	706,400	貸付株式数 400 株
ビジョン	14,600	1,308.00	19,096,800	
スマートバリュー	600	301.00	180,600	貸付株式数 300 株
U-NEXT HOLDINGS	10,900	5,430.00	59,187,000	貸付株式数 4,200 株
ワイヤレスゲート	1,000	255.00	255,000	貸付株式数 400 株
日本通信	96,000	169.00	16,224,000	貸付株式数 33,900 株
クロップス	300	957.00	287,100	
日本電信電話	28,926,500	154.20	4,460,466,300	
KDD I	715,300	4,855.00	3,472,781,500	
ソフトバンク	1,554,400	2,007.50	3,120,458,000	
光通信	9,600	32,000.00	307,200,000	
エムティーアイ	6,700	1,116.00	7,477,200	貸付株式数 2,000 株
GMO インターネットグループ	31,700	2,461.00	78,013,700	
ファイバーゲート	5,200	1,078.00	5,605,600	貸付株式数 2,000 株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
アイドママーケティングコ ミュ	900	218.00	196,200	貸付株式数 300株
KADOKAWA	51,400	3,045.00	156,513,000	
学研ホールディングス	17,800	993.00	17,675,400	
ゼンリン	16,600	858.00	14,242,800	
昭文社ホールディングス	1,000	375.00	375,000	
インプレスホールディング ス	2,400	147.00	352,800	貸付株式数 1,100株
東京電力HD	874,100	656.30	573,671,830	貸付株式数 325,300株
中部電力	357,300	1,794.50	641,174,850	
関西電力	374,400	2,444.50	915,220,800	貸付株式数 13,700株
中国電力	168,500	1,008.00	169,848,000	貸付株式数 65,800株
北陸電力	99,100	985.90	97,702,690	貸付株式数 6,800株
東北電力	255,300	1,374.00	350,782,200	貸付株式数 48,800株
四国電力	90,300	1,315.00	118,744,500	貸付株式数 12,000株
九州電力	223,500	1,598.00	357,153,000	
北海道電力	93,700	1,038.50	97,307,450	
沖縄電力	24,800	1,078.00	26,734,400	貸付株式数 9,700株
電源開発	79,700	2,392.00	190,642,400	貸付株式数 31,100株
エフオン	7,000	375.00	2,625,000	
イーレックス	17,300	718.00	12,421,400	貸付株式数 6,700株
レノバ	25,900	953.00	24,682,700	貸付株式数 500株
東京瓦斯	188,800	3,562.00	672,505,600	
大阪瓦斯	193,200	3,529.00	681,802,800	
東邦瓦斯	42,000	4,256.00	178,752,000	
北海道瓦斯	5,800	3,085.00	17,893,000	貸付株式数 1,000株
広島ガス	20,600	383.00	7,889,800	貸付株式数 7,900株
西部ガス HLDGS	10,100	1,893.00	19,119,300	貸付株式数 3,900株
静岡ガス	22,100	1,103.00	24,376,300	
メタウォーター	11,600	1,715.00	19,894,000	
アイネット	5,900	1,527.00	9,009,300	貸付株式数 2,300株
松竹	5,100	9,680.00	49,368,000	貸付株式数 1,900株
東宝	54,100	5,894.00	318,865,400	
エイチ・アイ・エス	31,900	1,832.00	58,440,800	貸付株式数 9,700株
東映	16,100	4,435.00	71,403,500	
ラックランド	4,500	1,936.00	8,712,000	貸付株式数 1,700株
NTT データグループ	254,300	2,330.00	592,519,000	
共立メンテナンス	31,300	2,265.50	70,910,150	貸付株式数 12,200株
イチネンホールディングス	10,500	1,692.00	17,766,000	
建設技術研究所	5,100	4,440.00	22,644,000	
スペース	7,300	1,104.00	8,059,200	
アインホールディングス	14,100	5,270.00	74,307,000	貸付株式数 5,500株
燦ホールディングス	9,200	1,168.00	10,745,600	
ピー・シー・エー	5,600	2,020.00	11,312,000	
スバル興業	3,900	2,934.00	11,442,600	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
東京テアトル	800	1,100.00	880,000	貸付株式数 100株
タナベコンサルティンググループ	4,300	1,231.00	5,293,300	貸付株式数 1,600株
ビジネスB太田昭和	3,800	1,793.00	6,813,400	
ナガワ	3,100	7,200.00	22,320,000	貸付株式数 1,200株
東京都競馬	7,300	3,965.00	28,944,500	貸付株式数 2,700株
常磐興産	800	1,540.00	1,232,000	貸付株式数 400株
カナモト	15,400	2,917.00	44,921,800	貸付株式数 4,800株
D T S	19,200	4,010.00	76,992,000	
スクウェア・エニックス・HD	44,400	5,499.00	244,155,600	
シーイーシー	12,300	1,843.00	22,668,900	貸付株式数 3,700株
カプコン	174,000	3,231.00	562,194,000	
ニシオホールディングス	8,200	4,100.00	33,620,000	
アイ・エス・ビー	4,500	1,416.00	6,372,000	貸付株式数 1,200株
アゴーラ ホスピタリティィーG	13,600	39.00	530,400	貸付株式数 7,600株
日本空港ビルデング	33,800	4,998.00	168,932,400	
トランス・コスモス	11,100	3,525.00	39,127,500	
乃村工藝社	43,500	820.00	35,670,000	
S C S K	68,000	2,903.00	197,404,000	
藤田観光	4,400	9,300.00	40,920,000	貸付株式数 1,700株
KNT-CT ホールディングス	6,000	1,262.00	7,572,000	貸付株式数 200株
トーカイ	8,800	2,204.00	19,395,200	
白洋舎	300	2,298.00	689,400	貸付株式数 100株
セコム	101,500	11,000.00	1,116,500,000	
N S W	4,300	2,912.00	12,521,600	
セントラル警備保障	5,400	2,664.00	14,385,600	
アイネス	7,600	1,523.00	11,574,800	
丹青社	19,300	882.00	17,022,600	
メイテックグループホールデ	34,000	3,331.00	113,254,000	
T K C	17,400	3,725.00	64,815,000	
富士ソフト	26,300	9,390.00	246,957,000	
応用地質	9,300	2,471.00	22,980,300	
船井総研ホールディン	20,000	2,270.00	45,400,000	
N S D	34,300	3,160.00	108,388,000	
進学会ホールディングス	800	226.00	180,800	貸付株式数 300株 (300株)
丸紅建材リース	200	2,883.00	576,600	
オオバ	1,500	1,007.00	1,510,500	貸付株式数 800株 (800株)
コナミグループ	36,400	13,490.00	491,036,000	
いであ	600	2,261.00	1,356,600	
学究社	4,000	1,998.00	7,992,000	貸付株式数 1,500株
イオンディライト	10,700	4,135.00	44,244,500	貸付株式数 4,100株

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
ナック	8,400	550.00	4,620,000	貸付株式数 2,400株
福井コンピュータ HLDS	6,000	2,572.00	15,432,000	
ダイセキ	20,300	3,710.00	75,313,000	
ステップ	3,700	1,976.00	7,311,200	
泉州電業	7,100	4,625.00	32,837,500	貸付株式数 2,700株
GENKI GLOBAL DIN	5,800	4,145.00	24,041,000	貸付株式数 2,200株
トラスコ中山	21,500	2,497.00	53,685,500	
ヤマダホールディングス	315,400	450.60	142,119,240	
オートバックスセブン	35,700	1,483.00	52,943,100	
モリト	8,200	1,345.00	11,029,000	
アーケランズ	30,500	1,717.00	52,368,500	
ニトリホールディングス	37,300	21,930.00	817,989,000	
グルメ杵屋	8,300	1,104.00	9,163,200	貸付株式数 3,100株
愛眼	1,600	163.00	260,800	貸付株式数 100株
ケーユーホールディングス	4,700	1,053.00	4,949,100	
吉野家ホールディングス	37,800	3,150.00	119,070,000	貸付株式数 14,800株 (4,400株)
加藤産業	12,700	4,175.00	53,022,500	
北恵	600	907.00	544,200	
イノテック	6,400	1,466.00	9,382,400	
イエローハット	16,300	2,429.00	39,592,700	貸付株式数 600株
松屋フーズ HLDGS	4,800	5,580.00	26,784,000	
JBCC ホールディングス	6,500	4,500.00	29,250,000	
JK ホールディングス	7,800	975.00	7,605,000	
サガミホールディングス	15,400	1,674.00	25,779,600	貸付株式数 5,800株 (5,400株)
日伝	6,700	3,270.00	21,909,000	貸付株式数 2,600株
ミロク情報サービス	8,800	1,859.00	16,359,200	
北沢産業	1,300	355.00	461,500	貸付株式数 700株
杉本商事	5,000	2,994.00	14,970,000	
因幡電機産業	26,600	3,810.00	101,346,000	
王将フードサービス	7,600	8,300.00	63,080,000	
ミニストップ	7,500	1,660.00	12,450,000	貸付株式数 2,800株 (500株)
アークス	18,800	2,525.00	47,470,000	
パローホールディングス	19,500	2,211.00	43,114,500	
東テック	10,300	2,294.00	23,628,200	
ミスミグループ本社	155,000	2,589.50	401,372,500	
アルテック	1,200	223.00	267,600	
ベルク	5,100	6,250.00	31,875,000	
大庄	6,200	1,063.00	6,590,600	貸付株式数 2,000株 (500株)
タキヒヨー	500	1,236.00	618,000	貸付株式数 200株
ファーストリテイリング	57,700	43,900.00	2,533,030,000	
ソフトバンクグループ	479,700	7,692.00	3,689,852,400	
蔵王産業	400	2,515.00	1,006,000	

銘柄	株式数	評価額 (円)		備考
		単価	金額	
スズケン	36,600	5,243.00	191,893,800	
サンドラッグ	34,600	4,241.00	146,738,600	
サックスパーホールディング	8,700	802.00	6,977,400	貸付株式数 3,000 株
ジェコス	6,100	929.00	5,666,900	
ヤマザワ	500	1,237.00	618,500	
やまや	500	3,050.00	1,525,000	貸付株式数 200 株
ベルーナ	24,600	722.00	17,761,200	貸付株式数 9,600 株
合計			351,881,446,280	

(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
トヨタ自動車	60,000 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

	2023年9月7日現在 金額(円)	2024年9月9日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,917,359,599	2,406,309,279
コール・ローン	7,969,622,467	17,582,607,405
株式	369,025,891,697	523,045,340,869
新株予約権証券	677,067	-
投資証券	7,863,588,380	11,493,815,458
派生商品評価勘定	178,197,741	84,815,852
未収入金	22,629,419	5,497,286
未収配当金	569,139,290	717,628,521
差入委託証拠金	7,582,758,561	10,197,038,669
流動資産合計	395,129,864,221	565,533,053,339
資産合計	395,129,864,221	565,533,053,339
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	235,260,850	949,726,919
未払解約金	44,491,900	222,732,100
流動負債合計	279,752,750	1,172,459,019
負債合計	279,752,750	1,172,459,019
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	76,227,957,902	93,061,760,460
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	318,622,153,569	471,298,833,860
元本等合計	394,850,111,471	564,360,594,320
純資産合計	394,850,111,471	564,360,594,320
負債純資産合計	395,129,864,221	565,533,053,339

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023 年 9 月 7 日現在	2024 年 9 月 9 日現在
1. ※1 期首	2022 年 9 月 8 日	2023 年 9 月 8 日
期首元本額	65,876,384,035 円	76,227,957,902 円
期中追加設定元本額	14,448,980,049 円	23,020,134,056 円
期中一部解約元本額	4,097,406,182 円	6,186,331,498 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	266,142,130 円	225,230,635 円
ダイワ国内重視バランスファンド 30VA (一般投資家私募)	2,431,213 円	1,402,785 円
ダイワ国内重視バランスファンド 50VA (一般投資家私募)	28,769,357 円	18,086,551 円
ダイワ国際分散バランスファンド 30VA (一般投資家私募)	4,226,482 円	3,444,397 円
ダイワ国際分散バランスファンド 50VA (一般投資家私募)	138,562,474 円	100,489,854 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)	93,024,761 円	114,106,768 円
ダイワバランスファンド 2023-01 (適格機関投資家専用)	90,561,111 円	78,362,997 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)	-円	6,770,830,091 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)	686,532,691 円	768,590,433 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)	4,091,559,346 円	5,609,050,842 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)	580,726,284 円	566,472,797 円

区分	2023年9月7日現在	2024年9月9日現在
D-I's 外国株式インデックス	20,194,422 円	16,325,240 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	51,142,609 円	49,059,003 円
iFree 外国株式インデックス (為替ヘッジなし)	7,210,449,916 円	9,171,696,796 円
iFree 8資産バランス	1,457,394,551 円	1,497,529,348 円
iFree 年金バランス	298,658,157 円	353,932,925 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	3,735,460 円	19,363,392 円
DCダイワ外国株式インデックス	46,490,450,097 円	50,556,549,718 円
ダイワ・ライフ・バランス30	507,850,174 円	460,963,110 円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,044,087,634 円	1,034,239,767 円
ダイワ・ライフ・バランス70	982,686,811 円	1,027,431,638 円
大和DC海外株式インデックスファンド	1,991,165,737 円	1,242,109,512 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	11,868,804 円	10,009,386 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	12,631,727 円	11,822,069 円
ダイワつみたてインデックス外国株式	1,940,135,571 円	2,670,717,096 円
ダイワつみたてインデックスバランス30	2,127,648 円	1,865,562 円
ダイワつみたてインデックスバランス50	2,236,515 円	2,794,350 円
ダイワつみたてインデックスバランス70	4,975,739 円	5,889,309 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)	8,327,442 円	14,825,536 円
ダイワ世界バランスファンド40VA	55,216,016 円	42,895,445 円
ダイワ世界バランスファンド60VA	35,351,507 円	30,065,390 円
ダイワ・バランスファンド35VA	970,948,063 円	701,581,123 円
ダイワ・バランスファンド25VA (適格機関投資家専用)	54,476,271 円	39,452,864 円
ダイワバランスファンド2021-02 (適格機関投資家専用)	140,584,660 円	123,320,896 円
スタイル9 (4資産分散・保守型)	-円	221,681 円
スタイル9 (4資産分散・バランス型)	-円	1,758,388 円
スタイル9 (4資産分散・積極型)	-円	2,513,560 円
スタイル9 (6資産分散・保守型)	-円	109,963 円

区分	2023年9月7日現在	2024年9月9日現在
スタイル9 (6資産分散・バランス型)	-円	3,149,074円
スタイル9 (6資産分散・積極型)	-円	3,708,744円
スタイル9 (8資産分散・保守型)	-円	155,698円
スタイル9 (8資産分散・バランス型)	-円	2,264,732円
スタイル9 (8資産分散・積極型)	-円	7,098,499円
ダイワ・インデックスセレクト外国株式	1,336,428,135円	1,260,299,293円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	429,292,129円	429,563,603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)	2,033,235,410円	4,486,545,620円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,977,492,751円	3,226,456,468円
ダイワライフスタイル25	9,029,390円	7,236,293円
ダイワライフスタイル50	40,429,242円	33,086,936円
ダイワライフスタイル75	33,165,466円	28,903,662円
ダイワバランスファンド 2023-08 (適格機関投資家専用)	89,653,999円	78,106,048円
ダイワバランスファンド 2024-01 (適格機関投資家専用)	-円	75,686,081円
ダイワバランスファンド 2024-05 (適格機関投資家専用)	-円	74,388,492円
計	76,227,957,902円	93,061,760,460円
2. 期末日における受益権の総数	76,227,957,902口	93,061,760,460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2023年9月8日 至2024年9月9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	自 2023 年 9 月 8 日 至 2024 年 9 月 9 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、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	2024 年 9 月 9 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	2023 年 9 月 7 日現在	2024 年 9 月 9 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	33,931,663,367	63,172,648,855
新株予約権証券	164,199	-
投資証券	△416,145,155	1,573,922,346

種類	2023年9月7日現在	2024年9月9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）
合計	33,515,682,411	64,746,571,201

(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	2023年9月7日現在				2024年9月9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	18,686,004,353	-	18,549,278,564	△136,725,789	30,336,842,208	-	29,698,800,021	△638,042,187
合計	18,686,004,353	-	18,549,278,564	△136,725,789	30,336,842,208	-	29,698,800,021	△638,042,187

- (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	2023年9月7日現在				2024年9月9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	8,547,732,760	-	8,627,395,440	79,662,680	17,336,313,480	-	17,109,444,600	△226,868,880
アメリカ・ド ル	5,131,119,790	-	5,198,083,850	66,964,060	10,837,406,950	-	10,733,910,500	△103,496,450
イギリス・ ポンド	459,161,550	-	460,044,000	882,450	1,158,743,640	-	1,139,211,600	△19,532,040
オーストラ リア・ドル	563,735,400	-	563,751,000	15,600	754,949,600	-	730,976,400	△23,973,200
カナダ・ドル	665,808,060	-	669,192,040	3,383,980	1,796,310,930	-	1,752,035,410	△44,275,520

種類	2023年9月7日現在				2024年9月9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)
スイス・フラン	641,992,810	-	645,752,640	3,759,830	1,336,818,600	-	1,317,464,460	△19,354,140
ユーロ	1,085,915,150	-	1,090,571,910	4,656,760	1,452,083,760	-	1,435,846,230	△16,237,530
合計	8,547,732,760	-	8,627,395,440	79,662,680	17,336,313,480	-	17,109,444,600	△226,868,880

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2023年9月7日現在	2024年9月9日現在
1口当たり純資産額	5.1799円	6.0644円
(1万口当たり純資産額)	(51,799円)	(60,644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	7,200	207.590	1,494,648.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	19,700	335.820	6,615,654.000	
	FIRST SOLAR INC	6,200	208.650	1,293,630.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	10,600	143.110	1,516,966.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	7,900	152.110	1,201,669.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	24,000	47.410	1,137,840.000	
	ABBOTT LABORATORIES	105,566	113.860	12,019,744.760	
	HOWMET AEROSPACE INC	23,483	91.440	2,147,285.520	
	VERISK ANALYTICS INC	8,700	271.660	2,363,442.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	22,600	39.700	897,220.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	72,900	59.850	4,363,065.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,000	806.310	2,418,930.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	33,700	81.360	2,741,832.000	
	QORVO INC	5,720	104.350	596,882.000	
	AFLAC INC	32,700	108.890	3,560,703.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	7,200	157.430	1,133,496.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	9,800	92.780	909,244.000	
	ADOBE INC	26,920	563.410	15,166,997.200	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	11,100	78.560	872,016.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	6,900	253.840	1,751,496.000	
	GARMIN LTD	9,300	180.170	1,675,581.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	13,500	268.710	3,627,585.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	39,500	198.130	7,826,135.000	
	WR BERKLEY CORP	18,613	58.690	1,092,396.970	
	AUTOZONE INC	1,020	3,092.560	3,154,411.200	
	DOLLAR TREE INC	12,371	66.500	822,671.500	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	71,700	18.080	1,296,336.000	
	CELANESE CORP	6,650	120.040	798,266.000	
	DR HORTON INC	18,016	186.140	3,353,498.240	
	AUTODESK INC	13,100	250.370	3,279,847.000	
	MOODY'S CORP	10,000	475.440	4,754,400.000	
	DEVON ENERGY CORP	38,100	41.340	1,575,054.000	
	ALBEMARLE CORP	7,000	76.900	538,300.000	
	ATMOS ENERGY CORP	9,200	130.800	1,203,360.000	
	ALLIANT ENERGY CORP	15,600	58.580	913,848.000	
	CITIGROUP INC	115,773	59.090	6,841,026.570	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	24,800	269.560	6,685,088.000	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	32,000	102.050	3,265,600.000	
	DOMINO'S PIZZA INC	2,130	408.490	870,083.700	
	HESS CORP	16,800	126.300	2,121,840.000	
DAVITA INC	3,250	149.980	487,435.000		
DANAHER CORP	40,350	266.200	10,741,170.000		

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	FORTIVE CORP	21,400	70.670	1,512,338.000	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	34,800	160.490	5,585,052.000	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	30,000	59.470	1,784,100.000	
	TE CONNECTIVITY LTD	18,495	143.380	2,651,813.100	
	APPLE INC	884,000	220.820	195,204,880.000	
	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	15,200	128.680	1,955,936.000	
	BOEING CO/THE	35,500	157.620	5,595,510.000	
	CINCINNATI FINANCIAL CORP	9,515	135.390	1,288,235.850	
	BECTON DICKINSON AND CO	17,499	232.670	4,071,492.330	
	LEIDOS HOLDINGS INC	7,800	152.850	1,192,230.000	
	NISOURCE INC	27,200	33.200	903,040.000	
	C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	7,100	100.800	715,680.000	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	44,771	66.410	2,973,242.110	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	255,604	41.150	10,518,104.600	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	80,550	459.420	37,006,281.000	
	ANSYS INC	5,300	305.040	1,616,712.000	
	TRUIST FINANCIAL CORP	81,317	42.060	3,420,193.020	
	BLACKSTONE GROUP INC/THE	43,400	137.120	5,951,008.000	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	123,100	48.700	5,994,970.000	
	JPMORGAN CHASE & CO	174,370	212.460	37,046,650.200	
	T ROWE PRICE GROUP INC	13,600	101.690	1,382,984.000	
	LKQ CORP	16,200	39.980	647,676.000	
	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	10,712	45.140	483,539.680	
	CADENCE DESIGN SYS INC	16,500	247.520	4,084,080.000	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,000	430.170	2,581,020.000	
	DOLLAR GENERAL CORP	13,300	82.580	1,098,314.000	
	SERVICENOW INC	12,400	825.040	10,230,496.000	
	CATERPILLAR INC	29,700	329.360	9,781,992.000	
	BROWN & BROWN INC	14,700	103.940	1,527,918.000	
	ESSENTIAL UTILITIES INC	15,800	38.860	613,988.000	
	CHARLES RIVER LABORATORIES	3,100	187.960	582,676.000	
	CMS ENERGY CORP	18,100	68.010	1,230,981.000	
	MOSAIC CO/THE	19,500	25.580	498,810.000	
	DELTA AIR LINES INC	9,800	42.030	411,894.000	
	CORNING INC	49,400	40.640	2,007,616.000	
	CISCO SYSTEMS INC	244,650	48.500	11,865,525.000	
	MORGAN STANLEY	73,952	96.590	7,143,023.680	
	DECKERS OUTDOOR CORP	1,500	859.960	1,289,940.000	
	MSCI INC	4,800	559.850	2,687,280.000	
	FAIR ISAAC CORP	1,500	1,734.010	2,601,015.000	
	LENNOX INTERNATIONAL INC	1,900	554.590	1,053,721.000	
	MANHATTAN ASSOCIATES INC	3,700	250.660	927,442.000	
	SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	13,500	72.100	973,350.000	
	BROADCOM INC	268,620	136.995	36,799,596.900	
	UNITED THERAPEUTICS CORP	2,500	345.630	864,075.000	
	CNH INDUSTRIAL NV	53,200	10.070	535,724.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	DICK'S SPORTING GOODS INC	3,500	208.040	728,140.000	
	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,700	246.780	1,900,206.000	
	DTE ENERGY COMPANY	12,600	123.190	1,552,194.000	
	CENTENE CORP	32,407	70.830	2,295,387.810	
	CBOE GLOBAL MARKETS INC	6,400	211.150	1,351,360.000	
	CITIZENS FINANCIAL GROUP	27,600	40.690	1,123,044.000	
	ARTHUR J GALLAGHER & CO	13,300	294.190	3,912,727.000	
	GARTNER INC	4,750	483.680	2,297,480.000	
	DOMINION ENERGY INC	50,941	57.110	2,909,240.510	
	MONSTER BEVERAGE CORP	44,600	48.650	2,169,790.000	
	SMITH (A. O.) CORP	7,200	76.910	553,752.000	
	DEERE & CO	15,900	381.560	6,066,804.000	
	QUANTA SERVICES INC	8,900	247.920	2,206,488.000	
	POOL CORP	2,300	341.370	785,151.000	
	GLOBAL PAYMENTS INC	15,484	107.950	1,671,497.800	
	BURLINGTON STORES INC	3,900	259.920	1,013,688.000	
	NASDAQ INC	26,300	71.950	1,892,285.000	
	TARGA RESOURCES CORP	12,800	146.750	1,878,400.000	
	AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,300	134.080	576,544.000	
	WESTLAKE CORP	2,300	135.010	310,523.000	
	CONSOLIDATED EDISON INC	21,000	103.280	2,168,880.000	
	TELEFLEX INC	2,900	244.530	709,137.000	
	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,000	167.770	838,850.000	
	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,400	297.240	1,307,856.000	
	BIO-RAD LABORATORIES-A	1,200	329.750	395,700.000	
	CATALENT INC	11,000	60.010	660,110.000	
	VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	9,300	215.890	2,007,777.000	
	MOLINA HEALTHCARE INC	3,600	327.480	1,178,928.000	
	CARLISLE COS INC	2,900	402.110	1,166,119.000	
	IDEX CORP	4,600	195.140	897,644.000	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	47,300	107.860	5,101,778.000	
	ROLLINS INC	17,607	49.590	873,131.130	
	AECOM	8,300	94.050	780,615.000	
	WATSCO INC	2,100	448.660	942,186.000	
	GRACO INC	10,300	80.030	824,309.000	
	AMETEK INC	14,100	163.640	2,307,324.000	
	TORO CO	6,200	82.040	508,648.000	
	CHURCH & DWIGHT CO INC	14,800	105.180	1,556,664.000	
	KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	9,850	50.080	493,288.000	
	HEICO CORP	2,700	249.430	673,461.000	
	FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,300	424.030	975,269.000	
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	15,800	93.490	1,477,142.000	
	TYLER TECHNOLOGIES INC	2,600	581.160	1,511,016.000	
	COSTCO WHOLESALE CORP	26,860	876.680	23,547,624.800	
	EPAM SYSTEMS INC	3,500	204.820	716,870.000	
	RPM INTERNATIONAL INC	7,800	115.320	899,496.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	RELIANCE INC	3,500	272.690	954,415.000	
	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	83,400	53.680	4,476,912.000	
	CUMMINS INC	8,300	293.210	2,433,643.000	
	CDW CORP/DE	8,200	212.210	1,740,122.000	
	COSTAR GROUP INC	24,800	77.450	1,920,760.000	
	OLD DOMINION FREIGHT LINE	11,900	184.820	2,199,358.000	
	MERCADOLIBRE INC	2,790	1,986.050	5,541,079.500	
	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,400	169.640	746,416.000	
	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	15,216	213.100	3,242,529.600	
	DEXCOM INC	24,200	68.610	1,660,362.000	
	NORDSON CORP	3,290	244.270	803,648.300	
	COPART INC	52,600	49.460	2,601,596.000	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	10,900	179.730	1,959,057.000	
	ALIGN TECHNOLOGY INC	4,300	221.150	950,945.000	
	LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	4,500	211.430	951,435.000	
	TRANSDIGM GROUP INC	3,390	1,294.170	4,387,236.300	
	BIO-TECHNE CORP	9,620	71.490	687,733.800	
	NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,100	120.170	733,037.000	
	KINDER MORGAN INC	121,281	21.130	2,562,667.530	
	HCA HEALTHCARE INC	11,900	387.980	4,616,962.000	
	MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,300	256.850	590,755.000	
	COTERRA ENERGY INC	45,200	22.920	1,035,984.000	
	T-MOBILE US INC	32,127	193.000	6,200,511.000	
	ZILLOW GROUP INC - C	9,650	53.320	514,538.000	
	EMCOR GROUP INC	2,800	352.880	988,064.000	
	COCA-COLA CO/THE	248,550	71.140	17,681,847.000	
	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	13,200	80.750	1,065,900.000	
	EXPEDITORS INTL WASH INC	8,550	121.000	1,034,550.000	
	FRANKLIN RESOURCES INC	17,100	19.130	327,123.000	
	CSX CORP	118,700	33.370	3,961,019.000	
	EXPEDIA GROUP INC	7,725	132.260	1,021,708.500	
	AMAZON.COM INC	568,700	171.390	97,469,493.000	
	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	36,600	66.810	2,445,246.000	
	EXXON MOBIL CORP	272,409	112.640	30,684,149.760	
	AES CORP	43,100	16.190	697,789.000	
	EVEREST GROUP LTD	2,600	383.390	996,814.000	
	EOG RESOURCES INC	34,900	120.350	4,200,215.000	
	EQT CORP	34,300	32.360	1,109,948.000	
	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	9,200	96.540	888,168.000	
	FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	600	1,898.100	1,138,860.000	
	CENCORA INC	10,900	234.970	2,561,173.000	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	17,700	137.200	2,428,440.000	
	FORD MOTOR CO	238,223	10.580	2,520,399.340	
	EXACT SCIENCES CORP	11,200	59.110	662,032.000	
	ENTEGRIS INC	9,200	107.110	985,412.000	
	MICROSTRATEGY INC-CL A	9,500	114.300	1,085,850.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	AERCAP HOLDINGS NV	12,400	90.600	1,123,440.000	
	FORTINET INC	39,400	75.155	2,961,107.000	
	MARKEL CORP	790	1,533.790	1,211,694.100	
	NEXTERA ENERGY INC	124,680	79.980	9,971,906.400	
	FREEMPORT-MCMORAN INC	87,208	40.000	3,488,320.000	
	INSULET CORP	4,200	214.750	901,950.000	
	US BANCORP	94,800	44.490	4,217,652.000	
	UNITED RENTALS INC	4,000	681.100	2,724,400.000	
	F5 NETWORKS INC	3,600	198.930	716,148.000	
	SUPER MICRO COMPUTER INC	3,200	386.460	1,236,672.000	
	FASTENAL CO	34,800	65.890	2,292,972.000	
	FISERV INC	35,533	170.020	6,041,320.660	
	GENERAL ELECTRIC CO	66,506	161.230	10,722,762.380	
	AXON ENTERPRISE INC	4,300	354.620	1,524,866.000	
	GENERAL MOTORS CO	68,700	47.140	3,238,518.000	
	GENERAL DYNAMICS CORP	14,200	292.780	4,157,476.000	
	GOLDMAN SACHS GROUP INC	19,650	479.610	9,424,336.500	
	ALPHABET INC-CL A	356,600	150.920	53,818,072.000	
	ALPHABET INC-CL C	306,840	152.130	46,679,569.200	
	OWENS CORNING	5,300	157.150	832,895.000	
	GENERAL MILLS INC	33,900	75.060	2,544,534.000	
	FIRSTENERGY CORP	33,218	44.190	1,467,903.420	
	GENUINE PARTS CO	8,550	134.300	1,148,265.000	
	FIFTH THIRD BANCORP	41,500	40.690	1,688,635.000	
	L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,550	227.230	2,624,506.500	
	HALLIBURTON CO	53,700	28.590	1,535,283.000	
	HOME DEPOT INC	60,250	360.050	21,693,012.500	
	ASSURANT INC	3,250	192.580	625,885.000	
	HUNTINGTON BANCSHARES INC	88,000	14.310	1,259,280.000	
	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,410	269.210	648,796.100	
	HERSHEY CO/THE	9,000	199.800	1,798,200.000	
	HUMANA INC	7,300	357.860	2,612,378.000	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	15,500	226.700	3,513,850.000	
	HENRY SCHEIN INC	7,800	68.810	536,718.000	
	HP INC	59,400	33.820	2,008,908.000	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	78,900	17.530	1,383,117.000	
	ARCH CAPITAL GROUP LTD	22,800	110.450	2,518,260.000	
	KRAFT HEINZ CO/THE	55,303	35.840	1,982,059.520	
	ENPHASE ENERGY INC	8,300	108.650	901,795.000	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	55,800	200.740	11,201,292.000	
	HUBBELL INC	3,300	370.930	1,224,069.000	
	INTERNATIONAL PAPER CO	20,000	47.110	942,200.000	
	FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	7,500	77.400	580,500.000	
	ZOETIS INC	27,700	189.230	5,241,671.000	
	TRANE TECHNOLOGIES PLC	13,699	342.070	4,686,016.930	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	CHENIERE ENERGY INC	13,900	180.640	2,510,896.000	
	HYATT HOTELS CORP - CL A	2,700	144.500	390,150.000	
	ALLEGION PLC	5,350	134.500	719,575.000	
	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	7,400	168.510	1,246,974.000	
	WASTE CONNECTIONS INC	15,737	182.620	2,873,890.940	
	JUNIPER NETWORKS INC	16,900	38.400	648,960.000	
	JM SMUCKER CO/THE	6,500	120.270	781,755.000	
	JOHNSON & JOHNSON	146,100	164.380	24,015,918.000	
	ABBVIE INC	107,172	193.400	20,727,064.800	
	HOLOGIC INC	14,200	81.570	1,158,294.000	
	KIMBERLY-CLARK CORP	20,400	146.910	2,996,964.000	
	KROGER CO	41,600	52.270	2,174,432.000	
	KLA CORP	8,200	702.800	5,762,960.000	
	LOCKHEED MARTIN CORP	13,100	566.630	7,422,853.000	
	CORPAY INC	4,000	302.970	1,211,880.000	
	BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	12,900	28.590	368,811.000	
	LOWE'S COS INC	34,600	243.810	8,435,826.000	
	ELI LILLY & CO	48,985	902.710	44,219,249.350	
	LAM RESEARCH CORP	7,880	733.830	5,782,580.400	
	LOEWS CORP	11,400	79.390	905,046.000	
	MCDONALD'S CORP	43,850	289.510	12,695,013.500	
	3M CO	33,490	128.600	4,306,814.000	
	META PLATFORMS INC CLASS A	133,100	500.270	66,585,937.000	
	S&P GLOBAL INC	19,439	510.640	9,926,330.960	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,700	502.480	1,859,176.000	
	PHILLIPS 66	25,700	128.140	3,293,198.000	
	ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	9,700	161.310	1,564,707.000	
	MGM RESORTS INTERNATIONAL	14,150	35.010	495,391.500	
	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	15,300	82.880	1,268,064.000	
	METLIFE INC	36,700	74.080	2,718,736.000	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	52,600	66.200	3,482,120.000	
	ARISTA NETWORKS INC	16,200	314.310	5,091,822.000	
	MOTOROLA SOLUTIONS INC	10,098	431.500	4,357,287.000	
	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,300	1,374.680	1,787,084.000	
	BAKER HUGHES CO	60,623	33.940	2,057,544.620	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	6,900	255.680	1,764,192.000	
	MERCK & CO. INC.	153,821	117.840	18,126,266.640	
	DUPONT DE NEMOURS INC	25,351	79.140	2,006,278.140	
	MASCO CORP	13,400	77.220	1,034,748.000	
	M & T BANK CORP	10,099	166.510	1,681,584.490	
	MARSH & MCLENNAN COS	29,970	227.850	6,828,664.500	
	HEICO CORP-CLASS A	4,620	194.050	896,511.000	
	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	14,702	227.600	3,346,175.200	
	WORKDAY INC-CLASS A	12,900	254.600	3,284,340.000	
	BLOCK INC CLASS A	33,812	61.240	2,070,646.880	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	TRANSUNION	11,800	94.180	1,111,324.000	
	VISTRA CORP	21,100	73.700	1,555,070.000	
	NETAPP INC	12,500	114.180	1,427,250.000	
	NIKE INC -CL B	73,600	80.630	5,934,368.000	
	NORFOLK SOUTHERN CORP	13,700	250.010	3,425,137.000	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	32,600	74.090	2,415,334.000	
	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,905	115.200	1,371,456.000	
	ALLY FINANCIAL INC	16,600	39.560	656,696.000	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	8,500	515.000	4,377,500.000	
	APTIV PLC	16,500	68.490	1,130,085.000	
	NEWMONT CORP	70,011	50.340	3,524,353.740	
	MCKESSON CORP	7,900	504.170	3,982,943.000	
	XYLEM INC	14,700	126.710	1,862,637.000	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	94,400	125.810	11,876,464.000	
	NUCOR CORP	14,600	138.790	2,026,334.000	
	GODADDY INC - CLASS A	8,600	150.000	1,290,000.000	
	EVERGY INC	14,050	59.760	839,628.000	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	40,424	52.030	2,103,260.720	
	ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,450	506.300	734,135.000	
	OKTA INC	9,800	72.450	710,010.000	
	WIX.COM LTD	3,410	156.080	532,232.800	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	19,700	39.580	779,726.000	
	KKR & CO INC	37,700	116.240	4,382,248.000	
	PAYCHEX INC	19,700	129.380	2,548,786.000	
	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,600	1,119.180	4,029,048.000	
	ALTRIA GROUP INC	104,300	53.690	5,599,867.000	
	P G & E CORP	123,300	20.080	2,475,864.000	
	PFIZER INC	344,113	28.560	9,827,867.280	
	CIGNA CORP	17,200	353.490	6,080,028.000	
	DELL TECHNOLOGIES -C	17,101	102.000	1,744,302.000	
	XCEL ENERGY INC	33,700	62.910	2,120,067.000	
	STERIS PLC	6,000	239.820	1,438,920.000	
	SEA LTD-ADR	23,700	77.180	1,829,166.000	
	FOX CORP - CLASS B	8,633	37.360	322,528.880	
	FOX CORP - CLASS A	14,099	40.310	568,330.690	
	STRYKER CORP	20,780	358.920	7,458,357.600	
	DOW INC	42,718	50.680	2,164,948.240	
	TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	6,900	111.810	771,489.000	
	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	15,200	67.180	1,021,136.000	
	PARKER HANNIFIN CORP	7,800	571.310	4,456,218.000	
	UBER TECHNOLOGIES INC	114,200	69.580	7,946,036.000	
	PROCTER & GAMBLE CO/THE	143,267	175.590	25,156,252.530	
	EXELON CORP	60,722	38.200	2,319,580.400	
	INGERSOLL-RAND INC	24,508	86.840	2,128,274.720	
	NVR INC	190	9,068.540	1,723,022.600	
	CONOCOPHILLIPS	70,702	106.020	7,495,826.040	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	TWILIO INC - A	9,800	58.100	569,380.000	
	DOCUSIGN INC	12,400	59.190	733,956.000	
	PAYCOM SOFTWARE INC	3,100	154.910	480,221.000	
	DAYFORCE INC	9,600	54.470	522,912.000	
	PURE STORAGE INC - CLASS A	18,700	45.730	855,151.000	
	PEPSICO INC	83,400	177.340	14,790,156.000	
	CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,820	264.840	746,848.800	
	MONGODB INC	4,500	281.880	1,268,460.000	
	SNAP INC - A	61,600	8.620	530,992.000	
	CORTEVA INC	42,268	55.330	2,338,688.440	
	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	21,800	113.250	2,468,850.000	
	AMCOR PLC	87,800	11.080	972,824.000	
	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	14,000	246.390	3,449,460.000	
	ROKU INC	7,700	64.370	495,649.000	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,800	143.940	1,698,492.000	
	ACCENTURE PLC-CL A	38,000	339.840	12,913,920.000	
	PENTAIR PLC	10,075	85.120	857,584.000	
	QUALCOMM INC	67,800	158.190	10,725,282.000	
	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	14,200	77.530	1,100,926.000	
	DATADOG INC - CLASS A	16,900	107.200	1,811,680.000	
	PINTEREST INC- CLASS A	36,400	29.250	1,064,700.000	
	REGENERON PHARMACEUTICALS	6,600	1,131.500	7,467,900.000	
	REPUBLIC SERVICES INC	13,400	202.820	2,717,788.000	
	BOOKING HOLDINGS INC	2,100	3,731.350	7,835,835.000	
	ROSS STORES INC	20,200	150.530	3,040,706.000	
	PACKAGING CORP OF AMERICA	5,430	201.810	1,095,828.300	
	RESMED INC	8,900	244.870	2,179,343.000	
	QUEST DIAGNOSTICS INC	6,730	152.930	1,029,218.900	
	MODERNA INC	19,800	72.890	1,443,222.000	
	HUBSPOT INC	2,880	496.480	1,429,862.400	
	REVVITY INC	7,500	115.410	865,575.000	
	CARRIER GLOBAL CORP	49,187	69.480	3,417,512.760	
	OTIS WORLDWIDE CORP	24,538	91.430	2,243,509.340	
	AVANTOR INC	41,200	25.540	1,052,248.000	
	CARLYLE GROUP INC/THE	14,200	37.230	528,666.000	
	DYNATRACE INC	17,300	50.180	868,114.000	
	TRADE DESK INC/THE -CLASS A	27,000	100.310	2,708,370.000	
	REGIONS FINANCIAL CORP	55,585	22.170	1,232,319.450	
	ROYALTY PHARMA PLC- CL A	23,300	28.700	668,710.000	
	MATCH GROUP INC	15,300	35.820	548,046.000	
	CHEVRON CORP	106,318	138.560	14,731,422.080	
	ZSCALER INC	5,500	156.780	862,290.000	
	EDISON INTERNATIONAL	23,400	86.650	2,027,610.000	
	TESLA INC	174,350	210.730	36,740,775.500	
	SNOWFLAKE INC-CLASS A	18,300	108.560	1,986,648.000	
	GEN DIGITAL INC	33,700	25.380	855,306.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	STANLEY BLACK & DECKER INC	9,302	97.180	903,968.360	
	SYNOPSIS INC	9,300	463.970	4,314,921.000	
	CLOUDFLARE INC - CLASS A	18,300	76.050	1,391,715.000	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	5,705	327.430	1,867,988.150	
	VIATRIS INC	72,321	11.270	815,057.670	
	DOORDASH INC - A	18,650	123.560	2,304,394.000	
	ROBLOX CORP -CLASS A	28,700	43.640	1,252,468.000	
	AIRBNB INC-CLASS A	26,800	114.280	3,062,704.000	
	CBRE GROUP INC - A	18,600	113.550	2,112,030.000	
	SOUTHERN CO/THE	66,400	88.410	5,870,424.000	
	SYSCO CORP	30,200	78.580	2,373,116.000	
	TRAVELERS COS INC/THE	13,903	234.460	3,259,697.380	
	FUTU HOLDINGS LTD-ADR	3,400	58.690	199,546.000	
	SEI INVESTMENTS COMPANY	6,600	65.400	431,640.000	
	STEEL DYNAMICS INC	9,150	111.000	1,015,650.000	
	SCHLUMBERGER LTD	86,752	40.620	3,523,866.240	
	AT&T INC	435,391	20.970	9,130,149.270	
	APA CORP	22,500	25.240	567,900.000	
	SOUTHWEST AIRLINES CO	9,150	29.700	271,755.000	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	26,100	67.920	1,772,712.000	
	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	14,600	360.830	5,268,118.000	
	SEMPRA ENERGY	38,400	82.100	3,152,640.000	
	BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	9,500	48.290	458,755.000	
	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	123,400	30.330	3,742,722.000	
	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	12,150	97.980	1,190,457.000	
	COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	11,500	147.350	1,694,525.000	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	55,300	197.450	10,918,985.000	
	SALESFORCE.COM INC	58,766	243.970	14,337,141.020	
	APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	24,209	108.000	2,614,572.000	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	40,934	67.840	2,776,962.560	
	TERADYNE INC	9,500	121.450	1,153,775.000	
	UNION PACIFIC CORP	36,980	249.630	9,231,317.400	
	MARATHON OIL CORP	34,000	26.720	908,480.000	
	MARATHON PETROLEUM CORP	21,388	166.000	3,550,408.000	
	RTX CORP	80,579	118.440	9,543,776.760	
	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	44,300	127.540	5,650,022.000	
	IQVIA HOLDINGS INC	11,104	243.070	2,699,049.280	
	AMEREN CORPORATION	16,200	83.160	1,347,192.000	
	UNITEDHEALTH GROUP INC	55,866	596.880	33,345,298.080	
	APPLOVIN CORP CLASS A	12,500	84.570	1,057,125.000	
	TOAST INC CLASS A	22,000	23.290	512,380.000	
	VERISIGN INC	5,400	181.840	981,936.000	
	RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO)	45,000	13.230	595,350.000	
	ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO)	32,100	18.940	607,974.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	VALERO ENERGY CORP	19,842	134.190	2,662,597.980	
	ULTA BEAUTY INC	2,900	367.590	1,066,011.000	
	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	15,788	58.830	928,808.040	
	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,630	229.150	831,814.500	
	ELEVANCE HEALTH INC	14,100	541.910	7,640,931.000	
	WALT DISNEY CO/THE	110,562	87.940	9,722,822.280	
	WELLS FARGO & CO	211,522	54.000	11,422,188.000	
	WASTE MANAGEMENT INC	24,400	204.730	4,995,412.000	
	WILLIAMS COS INC	74,000	44.260	3,275,240.000	
	TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,500	270.590	1,758,835.000	
	WALMART INC	268,600	76.640	20,585,504.000	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	12,500	104.810	1,310,125.000	
	WYNN RESORTS LTD	6,000	76.720	460,320.000	
	GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	135,200	3.290	444,808.000	
	CELSIUS HOLDINGS INC	9,200	31.960	294,032.000	
	WABTEC CORP	10,711	160.870	1,723,078.570	
	TJX COMPANIES INC	68,600	115.620	7,931,532.000	
	WATERS CORP	3,600	328.840	1,183,824.000	
	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	3,100	320.770	994,387.000	
	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	44,600	8.770	391,142.000	
	WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,163	291.090	1,793,987.670	
	WILLIAMS-SONOMA INC	7,800	130.430	1,017,354.000	
	WESTERN DIGITAL CORP	19,800	60.770	1,203,246.000	
	WEC ENERGY GROUP INC	19,200	93.650	1,798,080.000	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	30,200	79.940	2,414,188.000	
	VISA INC-CLASS A SHARES	95,650	279.370	26,721,740.500	
	PPL CORP	44,800	32.070	1,436,736.000	
	CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	19,124	173.110	3,310,555.640	
	PULTEGROUP INC	12,850	130.200	1,673,070.000	
	WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	141,353	7.220	1,020,568.660	
	PPG INDUSTRIES INC	14,200	124.780	1,771,876.000	
	NORTHERN TRUST CORP	12,400	86.660	1,074,584.000	
	NVIDIA CORP	1,492,200	102.830	153,442,926.000	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	24,213	176.700	4,278,437.100	
	DRAFTKINGS INC CLASS A	26,500	35.110	930,415.000	
	ASPEN TECHNOLOGY CORP	1,700	225.100	382,670.000	
	TYSON FOODS INC-CL A	17,400	65.870	1,146,138.000	
	NETFLIX INC	26,190	665.770	17,436,516.300	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	23,200	611.330	14,182,856.000	
	NRG ENERGY INC	12,550	76.510	960,200.500	
	TEXTRON INC	11,600	85.710	994,236.000	
	NEWS CORP - CLASS A	22,987	26.570	610,764.590	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,250	798.510	998,137.500	
	OMNICOM GROUP	11,900	98.740	1,175,006.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	JACOBS SOLUTIONS INC	7,620	141.910	1,081,354.200	
	ORACLE CORP	100,533	141.810	14,256,584.730	
	MASTERCARD INC - A	50,400	476.120	23,996,448.000	
	ONEOK INC	35,400	91.060	3,223,524.000	
	ROPER TECHNOLOGIES INC	6,500	547.760	3,560,440.000	
	U HAUL NON VOTING SERIES N	5,900	66.650	393,235.000	
	ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	11,300	137.450	1,553,185.000	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	6,800	70.840	481,712.000	
	HF SINCLAIR CORP	9,900	45.690	452,331.000	
	OVINTIV INC	16,200	40.290	652,698.000	
	YUM! BRANDS INC	17,100	133.870	2,289,177.000	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,100	156.610	1,581,761.000	
	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	11,300	55.770	630,201.000	
	BANK OF AMERICA CORP	427,101	38.760	16,554,434.760	
	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,900	421.770	1,223,133.000	
	BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	11,500	84.080	966,920.000	
	AMERICAN EXPRESS CO	34,900	244.060	8,517,694.000	
	GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	26,335	85.090	2,240,845.150	
	LINDE PLC	29,246	456.850	13,361,035.100	
	ANALOG DEVICES INC	30,091	213.640	6,428,641.240	
	ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	23,000	18.470	424,810.000	
	MONDAYCOM LTD	2,400	241.080	578,592.000	
	ADVANCED MICRO DEVICES	98,127	134.350	13,183,362.450	
	COREBRIDGE FINANCIAL INC	16,700	26.810	447,727.000	
	LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER	12,000	75.950	911,400.000	
	KENVUE INC	116,200	22.860	2,656,332.000	
	GLOBAL E ONLINE LTD	6,100	32.760	199,836.000	
	VERALTO CORP	15,016	108.720	1,632,539.520	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	40,272	71.910	2,895,959.520	
	BUNGE GLOBAL LTD	8,500	98.440	836,740.000	
	VERTIV HOLDINGS CLASS A	21,600	71.770	1,550,232.000	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	9,700	98.790	958,263.000	
	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,800	156.550	2,316,940.000	
	AVERY DENNISON CORP	4,930	216.910	1,069,366.300	
	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	30,200	75.840	2,290,368.000	
	EMERSON ELECTRIC CO	34,700	98.190	3,407,193.000	
	AON PLC-CLASS A	11,900	348.030	4,141,557.000	
	AMGEN INC	32,600	320.560	10,450,256.000	
	SAMSARA INC CLASS A	12,600	44.020	554,652.000	
	EATON CORP PLC	24,336	284.970	6,935,029.920	
	COOPER INC	12,100	106.590	1,289,739.000	
	CONSTELLATION BRANDS INC-A	10,000	249.010	2,490,100.000	
	APPLIED MATERIALS INC	50,300	174.750	8,789,925.000	
	CME GROUP INC	21,900	220.500	4,828,950.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	ECOLAB INC	15,600	245.050	3,822,780.000	
	EQUIFAX INC	7,500	292.080	2,190,600.000	
	GILEAD SCIENCES INC	75,600	78.720	5,951,232.000	
	KEURIG DR PEPPER INC	65,900	36.860	2,429,074.000	
	HORMEL FOODS CORP	18,300	32.570	596,031.000	
	CHORD ENERGY CORP	3,800	134.370	510,606.000	
	STATE STREET CORP	18,213	83.290	1,516,960.770	
	SOLVENTUM CORP	8,872	66.200	587,326.400	
	GE VERNOVA	16,626	198.330	3,297,434.580	
	SCHWAB (CHARLES) CORP	91,740	62.900	5,770,446.000	
	CRH PUBLIC LIMITED PLC	41,600	85.330	3,549,728.000	
	LABCORP HOLDINGS	5,100	223.910	1,141,941.000	
	BAXTER INTERNATIONAL INC	30,900	38.960	1,203,864.000	
	SMURFIT WESTROCK PLC	31,500	44.720	1,408,680.000	
	FERGUSON ENTERPRISES LTD	12,300	190.200	2,339,460.000	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	11,400	213.670	2,435,838.000	
	CAMPBELL SOUP CO	11,800	51.890	612,302.000	
	CROWN HOLDINGS INC	7,180	91.360	655,964.800	
	CARDINAL HEALTH INC	14,800	111.770	1,654,196.000	
	FEDEX CORP	14,100	283.040	3,990,864.000	
	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	23,154	139.000	3,218,406.000	
	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	15,513	103.010	1,597,994.130	
	INTEL CORP	258,500	18.890	4,883,065.000	
	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	22,900	31.090	711,961.000	
	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	18,050	114.490	2,066,544.500	
	ILLINOIS TOOL WORKS	18,100	243.600	4,409,160.000	
	ILLUMINA INC	9,700	124.390	1,206,583.000	
	INTUITIVE SURGICAL INC	21,500	471.820	10,144,130.000	
	CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,750	188.420	1,083,415.000	
	SNAP-ON INC	3,200	270.840	866,688.000	
	CARMAX INC	9,500	79.380	754,110.000	
	DUKE ENERGY CORP	46,928	116.600	5,471,804.800	
	TARGET CORP	28,100	151.280	4,250,968.000	
	DOVER CORP	8,300	175.380	1,455,654.000	
	WW GRAINGER INC	2,700	947.930	2,559,411.000	
	JABIL INC	6,900	101.040	697,176.000	
	CINTAS CORP	5,500	781.900	4,300,450.000	
	CONAGRA BRANDS INC	29,000	32.740	949,460.000	
	LAMB WESTON HOLDINGS INC	8,800	63.020	554,576.000	
	CLOROX COMPANY	7,500	164.750	1,235,625.000	
	ENTERGY CORP	13,000	121.900	1,584,700.000	
	MICROSOFT CORP	428,700	401.700	172,208,790.000	
	INCYTE CORP	9,800	61.260	600,348.000	
	CVS HEALTH CORP	76,169	57.750	4,398,759.750	
	MEDTRONIC PLC	77,698	89.890	6,984,273.220	
	MICRON TECHNOLOGY INC	67,300	86.380	5,813,374.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	BLACKROCK INC	9,000	866.920	7,802,280.000	
	CENTERPOINT ENERGY INC	38,900	27.280	1,061,192.000	
	KELLOGG CO	16,600	80.090	1,329,494.000	
	KEYCORP	57,300	15.700	899,610.000	
	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	81,411	75.310	6,131,062.410	
	CHUBB LTD	23,399	287.500	6,727,212.500	
	ALLSTATE CORP	16,000	185.360	2,965,760.000	
	EBAY INC	30,500	59.200	1,805,600.000	
	PAYPAL HOLDINGS INC	60,350	68.890	4,157,511.500	
	EASTMAN CHEMICAL CO	7,000	97.170	680,190.000	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	14,100	87.500	1,233,750.000	
	TRIMBLE INC	14,800	54.150	801,420.000	
	LENNAR CORP-A	14,700	179.420	2,637,474.000	
	PROGRESSIVE CORP	35,600	248.690	8,853,364.000	
	PACCAR INC	31,755	93.250	2,961,153.750	
	BIOGEN INC	8,800	200.810	1,767,128.000	
	IDEXX LABORATORIES INC	5,000	472.350	2,361,750.000	
	STARBUCKS CORP	68,800	91.150	6,271,120.000	
	PTC INC	7,300	164.760	1,202,748.000	
	EVERSOURCE ENERGY	21,400	67.400	1,442,360.000	
	INTUIT INC	16,980	615.120	10,444,737.600	
	BEST BUY CO INC	12,550	98.500	1,236,175.000	
	BALL CORP	18,804	64.300	1,209,097.200	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	89,297	81.600	7,286,635.200	
	ELECTRONIC ARTS INC	15,300	144.010	2,203,353.000	
	VULCAN MATERIALS CO	8,000	231.970	1,855,760.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	15,700	468.000	7,347,600.000	
	PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	36,325	10.090	366,519.250	
	CARNIVAL CORP	61,300	15.670	960,571.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	237,490	39.610	9,406,978.900	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	10,200	35.710	364,242.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	70,600	3.670	259,102.000	
アメリカ・ドル	小計			2,802,151,553.300 (400,091,198,781)	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	369,956	25.160	9,308,092.960	
	HALEON PLC	431,917	3.897	1,683,180.540	
	WISE PLC CLASS A	39,424	6.310	248,765.440	
	BP PLC	970,318	4.057	3,936,580.120	
	UNILEVER PLC	146,626	49.850	7,309,306.100	
	BARCLAYS PLC	866,582	2.208	1,913,846.340	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	500,504	4.627	2,315,832.000	
	PRUDENTIAL PLC	161,241	6.200	999,694.200	
	NATWEST GROUP PLC	391,358	3.284	1,285,219.670	
	BAE SYSTEMS PLC	178,184	12.940	2,305,700.960	
	AVIVA PLC	157,230	4.884	767,911.320	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	GSK	243,704	16.515	4,024,771.560	
	INFORMA PLC	77,876	8.292	645,747.790	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	77,383	4.533	350,777.130	
	AUTO TRADER GROUP PLC	52,668	8.572	451,470.090	
	DCC PLC	5,690	51.300	291,897.000	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	4,337	73.250	317,685.250	
	HALMA PLC	22,322	24.900	555,817.800	
	ENTAIN PLC	37,644	6.394	240,695.730	
	JD SPORTS FASHION PLC	148,598	1.336	198,526.920	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	41,285	5.630	232,434.550	
	M&G PLC	133,210	2.062	274,679.020	
	ENDEAVOUR MINING PLC	10,449	15.610	163,108.890	
	RELX PLC	109,721	35.190	3,861,081.990	
	DIAGEO PLC	130,697	24.000	3,136,728.000	
	RIO TINTO PLC	66,283	45.160	2,993,340.280	
	STANDARD CHARTERED PLC	126,247	7.502	947,104.990	
	TESCO PLC	406,618	3.666	1,490,661.580	
	SMITH & NEPHEW PLC	51,409	11.985	616,136.860	
	GLENCORE PLC	609,739	3.671	2,238,351.860	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,353	11.050	224,900.650	
	SMITHS GROUP PLC	20,328	17.660	358,992.480	
	PEARSON PLC	34,965	10.735	375,349.270	
	SAINSBURY (J) PLC	97,388	2.964	288,658.030	
	NEXT PLC	7,040	99.260	698,790.400	
	TAYLOR WIMPEY PLC	208,530	1.587	330,937.110	
	WHITBREAD PLC	10,575	29.840	315,558.000	
	BUNZL PLC	19,890	36.100	718,029.000	
	VODAFONE GROUP PLC	1,316,719	0.764	1,006,763.340	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,638	38.680	295,437.840	
	KINGFISHER PLC	107,257	2.750	294,956.750	
	WPP PLC	63,417	7.392	468,778.460	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	40,165	10.680	428,962.200	
	SEVERN TRENT PLC	15,901	27.100	430,917.100	
	RENTOKIL INITIAL PLC	148,427	4.674	693,747.790	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	40,997	45.380	1,860,443.860	
	SCHRODERS PLC	46,239	3.332	154,068.340	
	SSE PLC	64,290	19.735	1,268,763.150	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	83,251	4.926	410,094.420	
	ASTRAZENECA PLC	91,148	126.500	11,530,222.000	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	350,119	2.251	788,117.860	
	3I GROUP PLC	57,233	30.750	1,759,914.750	
	ASHTED GROUP PLC	25,708	51.900	1,334,245.200	
	SAGE GROUP PLC/THE	58,983	9.852	581,100.510	
	NATIONAL GRID PLC	281,774	10.195	2,872,685.930	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,663,964	0.564	2,067,208.480	
	IMPERIAL BRANDS PLC	47,694	22.290	1,063,099.260	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	CENTRICA PLC	305,567	1.206	368,666.580	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	6,226	49.620	308,934.120	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	117,366	29.290	3,437,650.140	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	19,380	22.040	427,135.200	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,086,876	6.488	7,051,651.480	
	ANGLO AMERICAN PLC	74,715	20.240	1,512,231.600	
	MONDI PLC	26,000	14.160	368,160.000	
	COMPASS GROUP PLC	99,978	24.460	2,445,461.880	
	PERSIMMON PLC	18,842	15.830	298,268.860	
	BT GROUP PLC	380,402	1.433	545,116.060	
	COCA-COLA HBC AG-DI	12,856	28.160	362,024.960	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	9,476	75.320	713,732.320	
	INTERTEK GROUP PLC	9,510	49.420	469,984.200	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	28,236	101.800	2,874,424.800	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	9,366	19.560	183,198.960	
	ADMIRAL GROUP PLC	15,333	27.920	428,097.360	
	ANTOFAGASTA PLC	23,183	16.385	379,853.450	
	EXPERIAN PLC	54,029	36.040	1,947,205.160	
イギリス・ポンド 小計				111,847,686.250 (20,972,559,650)	
イスラエル・シ ュケル	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	73,333	20.200	1,481,326.600	
	AZRIELI GROUP LTD	2,516	253.000	636,548.000	
	ICL GROUP LTD	44,023	15.440	679,715.120	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,518	743.800	1,129,088.400	
	BANK HAPOLIM BM	75,312	36.000	2,711,232.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	90,278	34.460	3,110,979.880	
	NICE LTD	3,754	595.300	2,234,756.200	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,181	141.000	1,294,521.000	
イスラエル・シュケル 小計				13,278,167.200 (508,154,132)	
オーストラリ ア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	122,328	5.000	611,640.000	
	TELSTRA GROUP LTD	229,639	3.930	902,481.270	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	170,939	31.790	5,434,150.810	
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	11,606	40.630	471,551.780	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	151,405	3.830	579,881.150	
	BHP GROUP LTD	288,082	38.450	11,076,752.900	
	SOUTH32 LTD	257,278	2.980	766,688.440	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	107,856	24.020	2,590,701.120	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	96,192	16.120	1,550,615.040	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	175,627	39.050	6,858,234.350	
	WESTPAC BANKING CORP	196,608	32.100	6,311,116.800	
	SANTOS LTD	184,483	6.920	1,276,622.360	
	RIO TINTO LTD	21,086	107.020	2,256,623.720	
ORIGIN ENERGY LTD	97,859	9.610	940,424.990		

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	PILBARA MINERALS LTD	162,919	2.410	392,634.790	
	XERO LTD	8,235	142.470	1,173,240.450	
	PRO MEDICUS LTD	3,216	155.160	498,994.560	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,901	33.550	432,828.550	
	COLES GROUP LTD	76,084	18.680	1,421,249.120	
	WISETECH GLOBAL LTD	9,466	122.820	1,162,614.120	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	65,272	14.730	961,456.560	
	REECE LTD	12,443	26.580	330,734.940	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	86,625	5.040	436,590.000	
	SEEK LTD	19,628	22.570	443,003.960	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	46,225	11.150	515,408.750	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	95,063	143.470	13,638,688.610	
	AMPOL LTD	13,578	28.480	386,701.440	
	ORICA LTD	27,752	17.830	494,818.160	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	85,338	16.290	1,390,156.020	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	69,391	34.640	2,403,704.240	
	QANTAS AIRWAYS LTD	44,332	6.740	298,797.680	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	24,470	54.080	1,323,337.600	
	MACQUARIE GROUP LTD	20,605	225.170	4,639,627.850	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	32,237	54.890	1,769,488.930	
	CSL LTD	27,455	303.990	8,346,045.450	
	WESFARMERS LTD	64,466	70.010	4,513,264.660	
	COCHLEAR LTD	3,719	288.750	1,073,861.250	
	BLUESCOPE STEEL LTD	25,058	20.060	502,663.480	
	SUNCORP GROUP LTD	72,267	17.990	1,300,083.330	
	ASX LTD	11,009	63.100	694,667.900	
	COMPUTERSHARE LTD	30,190	28.210	851,659.900	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	134,474	7.770	1,044,862.980	
	SONIC HEALTHCARE LTD	26,010	27.190	707,211.900	
	BRAMBLES LTD	79,104	18.630	1,473,707.520	
	CARSALES.COM LTD	20,406	36.840	751,757.040	
	MINERAL RESOURCES LTD	10,088	30.650	309,197.200	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	10,141	39.840	404,017.440	
	REA GROUP LTD	2,950	204.660	603,747.000	
	オーストラリア・ドル 小計			98,318,308.110 (9,367,768,396)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	42,600	76.860	3,274,236.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	19,781	55.370	1,095,273.970	
	IMPERIAL OIL LTD	10,400	92.280	959,712.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,100	4,186.490	4,605,139.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	16,687	91.780	1,531,532.860	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	25,200	78.640	1,981,728.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	9,950	250.640	2,493,868.000	
	BCE INC	4,130	48.500	200,305.000	
	FRANCO-NEVADA CORP	10,700	159.990	1,711,893.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	SUNCOR ENERGY INC	71,030	50.640	3,596,959.200	
	METRO INC/CN	11,800	84.910	1,001,938.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	18,900	123.470	2,333,583.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	68,500	68.510	4,692,935.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	52,600	80.470	4,232,722.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	97,100	81.890	7,951,519.000	
	GREAT-WEST LIFE CO INC	15,600	44.520	694,512.000	
	MEG ENERGY CORP	15,100	24.270	366,477.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	78,850	164.080	12,937,708.000	
	TOURMALINE OIL CORP	18,600	60.140	1,118,604.000	
	TC ENERGY CORP	57,850	63.340	3,664,219.000	
	PEMBINA PIPELINE CORP	32,329	54.910	1,775,185.390	
	BARRICK GOLD CORP	97,800	25.790	2,522,262.000	
	CAE INC	17,800	23.860	424,708.000	
	THOMSON REUTERS CORP	8,741	225.520	1,971,270.320	
	EMPIRE CO LTD 'A'	7,600	38.490	292,524.000	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,000	118.420	355,260.000	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,450	79.610	672,704.500	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	22,700	27.420	622,434.000	
	HYDRO ONE LTD	18,400	46.190	849,896.000	
	LOBLAW COMPANIES LTD	8,460	174.250	1,474,155.000	
	STANTEC INC	6,400	105.700	676,480.000	
	WSP GLOBAL INC	6,900	222.860	1,537,734.000	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	4,600	120.760	555,496.000	
	PARKLAND CORP	7,600	35.570	270,332.000	
	QUEBECOR INC -CL B	8,400	33.810	284,004.000	
	EMERA INC	16,100	51.130	823,193.000	
	TFI INTERNATIONAL INC	4,500	189.820	854,190.000	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,500	34.540	259,050.000	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	19,900	55.500	1,104,450.000	
	BRP INC/CA- SUB VOTING	1,900	85.300	162,070.000	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	37,700	15.810	596,037.000	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	27,717	104.310	2,891,160.270	
	AIR CANADA	8,900	15.250	135,725.000	
	KINROSS GOLD CORP	68,400	11.300	772,920.000	
	BANK OF MONTREAL	40,600	111.690	4,534,614.000	
	POWER CORP OF CANADA	31,400	41.200	1,293,680.000	
	SHOPIFY INC - CLASS A	67,400	90.890	6,125,986.000	
	NUTRIEN LTD	27,519	62.840	1,729,293.960	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	7,500	37.520	281,400.000	
	CAMECO CORP	24,200	50.140	1,213,388.000	
	FIRSTSERVICE CORP	2,300	240.120	552,276.000	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	12,200	54.020	659,044.000	
	TELUS CORP	10,800	22.860	246,888.000	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	25,600	59.010	1,510,656.000	
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,800	156.000	436,800.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	118,400	45.070	5,336,288.000	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,100	1,602.650	1,762,915.000	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	15,200	53.390	811,528.000	
	WESTON (GEORGE) LTD	3,337	221.560	739,345.720	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	20,300	25.240	512,372.000	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	4,800	128.200	615,360.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	32,200	74.090	2,385,698.000	
	ENBRIDGE INC	121,700	54.790	6,667,943.000	
	BROOKFIELD CORP	75,825	62.590	4,745,886.750	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	99,200	36.730	3,643,616.000	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	51,920	112.390	5,835,288.800	
	IA FINANCIAL CORP INC	5,400	103.640	559,656.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	8,300	59.700	495,510.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	29,950	156.460	4,685,977.000	
	CGI INC - CLASS A	11,200	152.060	1,703,072.000	
	ONEX CORPORATION	3,600	88.530	318,708.000	
	IGM FINANCIAL INC	4,700	38.640	181,608.000	
	TMX GROUP LTD	15,500	42.750	662,625.000	
	OPEN TEXT CORP	14,900	42.550	633,995.000	
	SAPUTO INC	14,200	29.700	421,740.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	38,500	14.130	544,005.000	
	FORTIS INC	27,500	60.520	1,664,300.000	
	RB GLOBAL INC	10,200	112.080	1,143,216.000	
	LUNDIN MINING CORP	36,900	11.470	423,243.000	
	CENOVUS ENERGY INC	77,500	22.870	1,772,425.000	
	DOLLARAMA INC	15,800	128.270	2,026,666.000	
	ALTAGAS LTD	16,600	34.370	570,542.000	
	KEYERA CORP	12,800	40.600	519,680.000	
	ARC RESOURCES LTD	33,300	22.330	743,589.000	
	カナダ・ドル 小計			153,038,928.740 (16,110,408,028)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	149,800	2.790	417,942.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	80,900	31.460	2,545,114.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	127,540	36.530	4,659,036.200	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	95,275	6.280	598,327.000	
	KEPPEL CORP LTD	93,200	6.100	568,520.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	216,700	14.630	3,170,321.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	366,100	0.820	300,202.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	475,550	3.130	1,488,471.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	99,900	4.400	439,560.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	54,100	4.860	262,926.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	54,900	10.870	596,763.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	122,900	3.110	382,219.000	
	シンガポール・ドル 小計			15,429,401.700 (1,689,673,780)	
スイス・フラン	SANDOZ GROUP AG	22,986	35.850	824,048.100	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	GALDERMA GROUP N AG	3,045	79.450	241,925.250	
	AVOLTA AG	4,854	31.720	153,968.880	
	UBS GROUP AG-REG	184,684	24.280	4,484,127.520	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,803	295.000	531,885.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	398	685.000	272,630.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	9,481	27.320	259,020.920	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	39,446	274.200	10,816,093.200	
	SIKA AG-REG	8,568	259.000	2,219,112.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	108,400.000	650,400.000	
	ABB LTD-REG	88,666	45.170	4,005,043.220	
	SWISS RE AG	16,935	114.450	1,938,210.750	
	NESTLE SA-REG	146,723	87.540	12,844,131.420	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,273	1,091.500	1,389,479.500	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,289	234.200	536,083.800	
	JULIUS BAER GROUP LTD	11,569	46.320	535,876.080	
	SGS SA-REG	8,675	93.980	815,276.500	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,291	227.500	293,702.500	
	TEMENOS AG - REG	3,532	58.000	204,856.000	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,028	134.900	273,577.200	
	VAT GROUP AG	1,498	387.700	580,774.600	
	BKW AG	1,174	156.000	183,144.000	
	ALCON INC	28,055	79.260	2,223,639.300	
	SIG GROUP N AG	16,764	17.010	285,155.640	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,600	163.650	261,840.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,223	489.500	4,025,158.500	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,424	158.100	383,234.400	
	CLARIANT AG-REG	11,862	12.510	148,393.620	
	NOVARTIS AG-REG	110,677	98.600	10,912,752.200	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	202	1,429.000	288,658.000	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,766	75.150	132,714.900	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	30,184	119.700	3,613,024.800	
	SWISSCOM AG-REG	1,441	548.500	790,388.500	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,706	88.500	150,981.000	
	GEBERIT AG-REG	1,877	519.600	975,289.200	
	GIVAUDAN-REG	522	4,409.000	2,301,498.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	6,272	116.200	728,806.400	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,852	298.700	851,892.400	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	8,747	71.300	623,661.100	
	LONZA GROUP AG-REG	4,056	536.200	2,174,827.200	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,686	32.200	86,489.200	
	HOLCIM LTD	29,272	78.600	2,300,779.200	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,605	692.400	1,111,302.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,688	248.000	666,624.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	4,348	96.900	421,321.200	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	56	11,070.000	619,920.000	
	スイス・フラン 小計			80,131,717.200	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
				(13,547,869,426)	
スウェーデン・ クローナ	SAGAX CLASS B	14,063	266.200	3,743,570.600	
	VOLVO CAR CLASS B	45,114	25.085	1,131,684.690	
	ERICSSON LM-B SHS	177,537	74.580	13,240,709.460	
	VOLVO AB-B SHS	101,657	254.700	25,892,037.900	
	SKF AB-B SHARES	21,813	179.100	3,906,708.300	
	TELE2 AB-B SHS	34,321	118.000	4,049,878.000	
	GETINGE AB-B SHS	14,638	218.500	3,198,403.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	101,555	154.800	15,720,714.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	93,345	105.150	9,815,226.750	
	SWEDBANK AB - A SHARES	54,334	217.300	11,806,778.200	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	36,251	157.850	5,722,220.350	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	38,783	138.600	5,375,323.800	
	SKANSKA AB-B SHS	21,775	199.650	4,347,378.750	
	SANDVIK AB	68,235	198.650	13,554,882.750	
	INVESTOR AB-B SHS	110,768	294.100	32,576,868.800	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	171,899	172.600	29,669,767.400	
	VOLVO AB-A SHS	12,815	257.800	3,303,707.000	
	HOLMEN AB-B SHARES	4,577	412.200	1,886,639.400	
	SECURITAS AB-B SHS	31,474	119.650	3,765,864.100	
	TELIA CO AB	150,986	33.330	5,032,363.380	
	ALFA LAVAL AB	18,516	433.200	8,021,131.200	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	99,891	151.950	15,178,437.450	
	ASSA ABLOY AB-B	64,144	319.500	20,494,008.000	
	TRELLEBORG AB-B SHS	13,634	379.200	5,170,012.800	
	SAAB AB-B	20,499	221.600	4,542,578.400	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	7,455	351.000	2,616,705.000	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	42,415	83.700	3,550,135.500	
	INDUTRADE AB	17,487	296.400	5,183,146.800	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	12,473	307.800	3,839,189.400	
	LUNDBERGS AB-B SHS	4,864	547.500	2,663,040.000	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	9,475	304.100	2,881,347.500	
	LIFCO AB-B SHS	14,918	318.400	4,749,891.200	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	96,987	46.520	4,511,835.240	
	BEIJER REF AB	23,093	166.000	3,833,438.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	38,994	319.800	12,470,281.200	
	BOLIDEN AB	17,504	289.400	5,065,657.600	
EPIROC AB-A	42,175	187.000	7,886,725.000		
EPIROC AB-B	24,957	168.100	4,195,271.700		
HUSQVARNA AB-B SHS	21,195	64.920	1,375,979.400		
EQT AB	23,904	317.300	7,584,739.200		
EVOLUTION AB	11,523	993.800	11,451,557.400		
HEXAGON AB-B SHS	132,869	98.620	13,103,540.780		
ADDTech AB-B SHARES	16,633	303.000	5,039,799.000		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,239	350.000	3,583,650.000		

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 小計				356,732,824.400 (4,937,182,290)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	200,987	881.500	177,170,040.500	
	DANSKE BANK A/S	44,142	207.700	9,168,293.400	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	187	9,445.000	1,766,215.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	64,628	147.050	9,503,547.400	
	CARLSBERG AS-B	6,114	780.600	4,772,588.400	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	22,618	459.200	10,386,185.600	
	COLOPLAST-B	8,071	916.800	7,399,492.800	
	DSV PANALPINA A/S	10,956	1,236.000	13,541,616.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	599	2,758.000	1,652,042.000	
	DEMANT A/S	6,039	280.400	1,693,335.600	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	291	9,698.000	2,822,118.000	
	TRYG A/S	21,099	153.800	3,245,026.200	
	PANDORA A/S	5,248	1,146.500	6,016,832.000	
	GENMAB A/S	4,017	1,860.000	7,471,620.000	
ZEALAND PHARMA A/S	4,089	828.000	3,385,692.000		
ORSTED A/S	12,106	422.400	5,113,574.400		
デンマーク・クローネ 小計				265,108,219.300 (5,622,945,331)	
ニュージーランド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	82,831	6.090	504,440.790	
	MERCURY NZ LTD	42,143	6.480	273,086.640	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	116,100	3.520	408,672.000	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	85,257	7.540	642,837.780	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	37,484	37.400	1,401,901.600	
ニュージーランド・ドル 小計				3,230,938.810 (284,871,875)	
ノルウェー・クローネ	DNB BANK	57,310	215.600	12,356,036.000	
	NORSK HYDRO ASA	89,999	55.500	4,994,944.500	
	ORKLA ASA	44,862	97.500	4,374,045.000	
	TELENOR ASA	39,407	134.900	5,316,004.300	
	EQUINOR ASA	53,619	269.950	14,474,449.050	
	YARA INTERNATIONAL ASA	10,596	295.200	3,127,939.200	
	MOWI ASA	29,784	181.900	5,417,709.600	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	12,098	189.200	2,288,941.600	
	AKER BP ASA	20,224	230.300	4,657,587.200	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	5,629	1,057.000	5,949,853.000	
	SALMAR ASA	3,973	540.000	2,145,420.000	
ノルウェー・クローネ 小計				65,102,929.450 (867,171,020)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	48,827	22.930	1,119,603.110	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	29,095	31.080	904,272.600	
	EXOR NV	5,898	97.400	574,465.200	
	DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	6,758	66.320	448,190.560	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	DSM FIRMENICH AG	11,033	119.000	1,312,927.000	
	FERROVIAL	30,960	37.580	1,163,476.800	
	LOTUS BAKERIES NV	24	11,680.000	280,320.000	
	SYENSCO SA	4,287	70.540	302,404.980	
	BAYER AG-REG	58,269	28.910	1,684,556.790	
	EVONIK INDUSTRIES AG	14,881	19.615	291,890.810	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	112,393	14.668	1,648,580.520	
	COMMERZBANK AG	59,502	12.705	755,972.910	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	12,232	92.000	1,125,344.000	
	SIEMENS AG-REG	45,078	161.140	7,263,868.920	
	E.ON SE	133,162	13.290	1,769,722.980	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	18,911	78.200	1,478,840.200	
	GEA GROUP AG	9,211	41.480	382,072.280	
	CONTINENTAL AG	6,541	58.600	383,302.600	
	BASF SE	52,940	43.415	2,298,390.100	
	ALLIANZ SE-REG	23,238	280.200	6,511,287.600	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	10,035	81.240	815,243.400	
	RHEINMETALL AG	2,581	502.000	1,295,662.000	
	RWE AG	37,501	32.810	1,230,407.810	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	35,585	5.794	206,179.490	
	BRENTAG SE	7,527	64.280	483,835.560	
	FRESENTUS SE & CO KGAA	25,057	33.220	832,393.540	
	SAP SE	61,938	190.720	11,812,815.360	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	7,924	477.300	3,782,125.200	
	ZALANDO SE	13,345	22.150	295,591.750	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	8,097	90.860	735,693.420	
	COVESTRO AG	11,206	55.280	619,467.680	
	RATIONAL AG	306	869.500	266,067.000	
	CTS EVENTIM AG & CO KGAA	3,800	85.250	323,950.000	
	SARTORIUS AG-VORZUG	1,507	237.500	357,912.500	
	TALANX AG	3,771	75.350	284,144.850	
	PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	8,787	39.220	344,626.140	
	DELIVERY HERO SE	10,712	28.120	301,221.440	
	CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,294	58.250	133,625.500	
	BECHTLE AG	4,723	36.560	172,672.880	
	NEMETSCHEK SE	3,434	86.600	297,384.400	
	SCOUT24 AG	4,319	72.450	312,911.550	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	16,727	50.540	845,382.580	
	KNORR-BREMSE AG	4,202	74.000	310,948.000	
	SIEMENS ENERGY AG	38,112	23.840	908,590.080	
	BEIERSDORF AG	5,814	127.850	743,319.900	
	MERCK KGAA	7,667	168.800	1,294,189.600	
	ADIDAS AG	9,612	220.700	2,121,368.400	
	PUMA SE	6,126	38.990	238,852.740	
	HENKEL AG & CO KGAA	6,021	73.800	444,349.800	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	208,201	26.020	5,417,390.020	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	12,185	35.630	434,151.550	
	MERCEDES-BENZ GROUP N AG	44,166	58.450	2,581,502.700	
	QIAGEN N. V.	13,160	39.955	525,807.800	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	77,454	28.980	2,244,616.920	
	HANNOVER RUECK SE	3,580	252.000	902,160.000	
	DHL GROUP	60,635	38.470	2,332,628.450	
	DEUTSCHE BOERSE AG	11,265	206.000	2,320,590.000	
	MTU AERO ENGINES AG	3,193	267.500	854,127.500	
	SYMRISE AG	7,878	119.100	938,269.800	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,505	73.500	257,617.500	
	VONOVIA SE	43,959	32.910	1,446,690.690	
	LEG IMMOBILIEN SE	4,286	92.940	398,340.840	
	KONINKLIJKE PHILIPS NV	47,367	27.320	1,294,066.440	
	NN GROUP NV	16,062	44.890	721,023.180	
	ARCELORMITTAL	27,534	20.000	550,680.000	
	HEINEKEN NV	17,085	81.080	1,385,251.800	
	AEGON LTD	77,964	5.420	422,564.880	
	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	55,531	31.080	1,725,903.480	
	AKZO NOBEL N. V.	10,117	57.640	583,143.880	
	WOLTERS KLUWER	14,739	149.700	2,206,428.300	
	ING GROEP NV	195,933	15.966	3,128,266.270	
	KONINKLIJKE KPN NV	234,145	3.757	879,682.760	
	ASML HOLDING NV	23,700	681.000	16,139,700.000	
	ABN AMRO BANK NV-CVA	27,245	15.265	415,894.920	
	IMCD NV	3,382	146.900	496,815.800	
	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	4,573	103.750	474,448.750	
	ASR NEDERLAND NV	9,162	44.130	404,319.060	
	ADYEN NV	1,288	1,258.200	1,620,561.600	
	PROSUS NV	84,078	32.315	2,716,980.570	
	JDE PEET'S NV	6,885	20.540	141,417.900	
	INPOST SA	12,100	17.890	216,469.000	
	ASM INTERNATIONAL NV	2,784	533.800	1,486,099.200	
	RANDSTAD NV	6,452	42.000	270,984.000	
	HEINEKEN HOLDING NV	7,688	67.500	518,940.000	
	OCI NV	6,120	28.380	173,685.600	
	TOTALENERGIES SE	128,035	59.860	7,664,175.100	
	MICHELIN (CGDE)	40,284	35.370	1,424,845.080	
	AIR LIQUIDE SA	34,295	162.360	5,568,136.200	
	KERING	4,415	236.250	1,043,043.750	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	32,439	214.950	6,972,763.050	
	BOUYGUES SA	10,949	31.980	350,149.020	
	BNP PARIBAS	60,293	62.180	3,749,018.740	
	THALES SA	5,609	144.900	812,744.100	
	DANONE	38,302	65.220	2,498,056.440	
	CARREFOUR SA	32,745	14.850	486,263.250	
	VIVENDI	42,766	10.105	432,150.430	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	L' OREAL	14,268	382.800	5,461,790.400	
	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	26,894	75.040	2,018,125.760	
	LEGRAND SA	15,550	96.660	1,503,063.000	
	PERNOD RICARD SA	12,013	123.150	1,479,400.950	
	EURAZEO SE	2,589	69.250	179,288.250	
	REXEL SA	13,443	22.040	296,283.720	
	SOCIETE GENERALE SA	42,861	21.825	935,441.320	
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	16,310	612.000	9,981,720.000	
	ACCOR SA	11,565	37.770	436,810.050	
	CAPGEMINI SE	9,215	180.050	1,659,160.750	
	PUBLICIS GROUPE	13,576	95.140	1,291,620.640	
	BUREAU VERITAS SA	18,839	29.220	550,475.580	
	EIFFAGE	4,369	95.800	418,550.200	
	SODEXO SA	5,156	79.400	409,386.400	
	IPSEN	2,131	108.000	230,148.000	
	AMUNDI SA	3,652	65.800	240,301.600	
	TELEPERFORMANCE	3,231	97.480	314,957.880	
	EURONEXT NV	4,671	98.250	458,925.750	
	EUROFINS SCIENTIFIC	8,015	52.740	422,711.100	
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,670	178.700	298,429.000	
	SEB SA	1,488	90.550	134,738.400	
	ESSILORLUXOTTICA	17,639	208.800	3,683,023.200	
	DASSAULT AVIATION SA	1,189	187.200	222,580.800	
	LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	6,098	38.020	231,845.960	
	AXA SA	107,786	34.490	3,717,539.140	
	EDENRED	14,803	37.400	553,632.200	
	RENAULT SA	11,120	40.340	448,580.800	
	HERMES INTERNATIONAL	1,881	1,909.500	3,591,769.500	
	STMICROELECTRONICS NV	40,162	25.820	1,036,982.840	
	DASSAULT SYSTEMES SE	39,693	33.520	1,330,509.360	
	ORANGE	110,439	10.795	1,192,189.000	
	ALSTOM	20,133	17.270	347,696.910	
	SANOFI	67,607	104.540	7,067,635.780	
	VINCI SA	29,667	109.100	3,236,669.700	
	AIRBUS SE	35,246	128.340	4,523,471.640	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	40,921	29.600	1,211,261.600	
	CREDIT AGRICOLE SA	62,814	14.130	887,561.820	
	BIOMERIEUX	2,352	105.600	248,371.200	
	ENGIE	108,334	16.115	1,745,802.410	
	SAFRAN SA	20,270	192.350	3,898,934.500	
	ARKEMA	3,434	79.050	271,457.700	
	ADP	2,012	117.300	236,007.600	
	GETLINK SE	17,844	16.230	289,608.120	
	BOLLORE	41,168	5.670	233,422.560	
	UCB SA	7,499	160.400	1,202,839.600	
	KBC GROUP NV	13,515	66.920	904,423.800	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,901	68.250	334,493.250	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	53,295	56.560	3,014,365.200	
	AGEAS	9,478	46.340	439,210.520	
	D' IETEREN GROUP	1,222	216.400	264,440.800	
	ELIA GROUP SA/NV	1,662	103.100	171,352.200	
	SOFINA	931	220.400	205,192.400	
	ARGENX SE	3,529	487.600	1,720,740.400	
	PRYSMIAN SPA	16,070	59.200	951,344.000	
	GENERALI	60,494	24.980	1,511,140.120	
	MEDIOBANCA SPA	29,418	14.935	439,357.830	
	TENARIS SA	27,253	12.885	351,154.900	
	UNICREDIT SPA	87,272	36.225	3,161,428.200	
	TELECOM ITALIA SPA	556,274	0.232	129,222.450	
	INTESA SANPAOLO	867,518	3.666	3,180,754.740	
	POSTE ITALIANE SPA	26,393	12.290	324,369.970	
	MONCLER SPA	13,041	50.400	657,266.400	
	RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	6,029	51.400	309,890.600	
	ENI SPA	137,134	13.988	1,918,230.390	
	DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	36,620	7.936	290,616.320	
	BANCO BPM SPA	76,394	5.906	451,182.960	
	DIASORIN SPA	1,344	101.150	135,945.600	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	19,391	10.980	212,913.180	
	NEXI SPA	35,152	6.276	220,613.950	
	AMPLIFON SPA	7,224	27.990	202,199.760	
	LEONARDO SPA	24,005	20.380	489,221.900	
	ENEL SPA	482,406	7.051	3,401,444.700	
	SNAM SPA	119,605	4.553	544,561.560	
	TERNA SPA	83,451	7.994	667,107.290	
	FINECOBANK SPA	36,244	15.395	557,976.380	
	STELLANTIS NV	125,048	14.060	1,758,174.880	
	FERRARI NV	7,476	425.300	3,179,542.800	
	TELEFONICA SA	232,684	4.213	980,297.690	
	ENDESA SA	18,355	19.445	356,912.970	
	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	341,484	8.912	3,043,305.400	
	IBERDROLA SA	362,978	13.155	4,774,975.590	
	BANCO DE SABADELL SA	321,405	1.807	580,778.830	
	REPSOL SA	72,209	11.725	846,650.520	
	GRIFOLS SA	17,213	9.306	160,184.170	
	BANCO SANTANDER SA	917,445	4.292	3,938,132.660	
	AMADEUS IT GROUP SA	26,719	61.580	1,645,356.020	
	CAIXABANK SA	216,340	5.318	1,150,496.120	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	10,757	40.040	430,710.280	
	AENA SME SA	4,448	182.600	812,204.800	
	CELLNEX TELECOM SA	31,589	35.280	1,114,459.920	
	ACCIONA SA	1,472	126.200	185,766.400	
	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	64,701	46.600	3,015,066.600	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,357	17.340	405,010.380	
	UPM-KYMMENE OYJ	31,658	29.280	926,946.240	
	NOKIA OYJ	316,298	3.846	1,216,640.250	
	WARTSILA OYJ ABP	29,833	18.420	549,523.860	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	33,532	10.860	364,157.520	
	ELISA OYJ	8,214	46.740	383,922.360	
	SAMPO OYJ-A SHS	26,775	40.670	1,088,939.250	
	FORTUM OYJ	25,889	14.220	368,141.580	
	KESKO OYJ-B SHS	16,250	18.360	298,350.000	
	KONE OYJ-B	20,163	48.520	978,308.760	
	NESTE OYJ	25,095	18.260	458,234.700	
	ORION OYJ-CLASS B	6,416	48.220	309,379.520	
	METSO CORPORATION	35,673	8.350	297,869.550	
	NORDEA BANK ABP	187,132	10.435	1,952,722.420	
	VERBUND AG	4,049	76.250	308,736.250	
	OMV AG	8,524	37.860	322,718.640	
	ERSTE GROUP BANK AG	19,968	47.640	951,275.520	
	VOESTALPINE AG	6,073	20.700	125,711.100	
	AIB GROUP PLC	108,205	5.275	570,781.370	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	60,030	9.934	596,338.020	
	KINGSPAN GROUP PLC	9,163	76.400	700,053.200	
	JERONIMO MARTINS	16,364	16.190	264,933.160	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	186,120	4.029	749,877.480	
	GALP ENERGIA SGPS SA	27,565	17.465	481,422.720	
	EDP RENOVAVEIS SA	18,553	15.380	285,345.140	
	KERRY GROUP PLC-A	9,156	92.400	846,014.400	
ユーロ 小計				294,206,242.350 (46,552,253,727)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	88,500	53.750	4,756,875.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	140,000	29.150	4,081,000.000	
	MTR CORP	99,500	26.750	2,661,625.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	92,500	75.150	6,951,375.000	
	SINO LAND CO	250,000	8.240	2,060,000.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	171,669	42.700	7,330,266.300	
	WHARF HOLDINGS LTD	65,000	20.450	1,329,250.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	26,000	64.550	1,678,300.000	
	CLP HOLDINGS LTD	105,000	69.600	7,308,000.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	88,507	23.850	2,110,891.950	
	HONG KONG & CHINA GAS	717,475	6.200	4,448,345.000	
	HANG SENG BANK LTD	48,500	93.250	4,522,625.000	
	WH GROUP LTD	533,500	5.710	3,046,285.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	77,100	230.000	17,733,000.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	123,169	31.400	3,867,506.600	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	40,500	57.800	2,340,900.000	
	AIA GROUP LTD	713,200	55.000	39,226,000.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	82,000	17.320	1,420,240.000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	107,000	22.000	2,354,000.000	
	SANDS CHINA LTD	155,200	13.780	2,138,656.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	88,000	102.800	9,046,400.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	237,000	24.300	5,759,100.000	
香港・ドル 小計				136,170,640.850 (2,493,284,433)	
合計				523,045,340,869 [523,045,340,869]	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AVALONBAY COMMUNITIES INC	8,637	1,931,233.200	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	19,807	3,258,251.500	
		BXP INC	9,100	678,496.000	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	6,500	1,550,315.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	20,700	1,538,838.000	
		EQUINIX INC	5,808	4,750,711.680	
		AMERICAN TOWER CORP	28,400	6,706,944.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	42,843	716,763.390	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	20,000	788,000.000	
		KIMCO REALTY CORP	40,900	940,291.000	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	16,500	850,080.000	
		INVITATION HOMES INC	37,200	1,337,340.000	
		VICI PROPERTIES INC	63,300	2,118,651.000	
		VENTAS INC	24,600	1,546,356.000	
		WEYERHAEUSER CO	44,314	1,344,929.900	
		CROWN CASTLE INTL CORP	26,400	3,065,568.000	
		IRON MOUNTAIN INC	17,800	1,948,744.000	
		SUN COMMUNITIES INC	7,600	1,073,272.000	
		PROLOGIS INC	56,154	7,144,473.420	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,600	1,116,384.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,500	794,105.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,900	1,163,019.000	
		WELLTOWER INC	36,400	4,535,440.000	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	42,700	938,973.000	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	7,100	1,132,663.000	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	10,800	797,796.000	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	30,400	613,168.000	
		REALTY INCOME CORP	52,895	3,300,648.000	
		PUBLIC STORAGE	9,600	3,318,048.000	
		REGENCY CENTERS CORP	10,700	777,034.000	
UDR INC	19,000	836,950.000			
WP CAREY INC	13,300	817,684.000			
DIGITAL REALTY TRUST INC	19,700	2,919,934.000			

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		EXTRA SPACE STORAGE INC	12,900	2,239,182.000	
	アメリカ・ドル 小計			68,590,286.090 (9,793,321,048)	
	イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	41,690	273,903.300	
		SEGRO PLC	75,605	663,358.270	
	イギリス・ポンド 小計			937,261.570 (175,745,917)	
	オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	59,130	438,153.300	
		TRANSURBAN GROUP	175,649	2,401,121.830	
		APA GROUP	73,115	528,621.450	
		SCENTRE GROUP	295,090	1,032,815.000	
		GPT GROUP	105,302	532,828.120	
		MIRVAC GROUP	224,818	485,606.880	
		STOCKLAND	136,007	692,275.630	
		GOODMAN GROUP	97,098	3,223,653.600	
		VICINITY CENTRES	212,703	482,835.810	
	オーストラリア・ドル 小計			9,817,911.620 (935,450,619)	
	カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,300	228,244.000	
	カナダ・ドル 小計			228,244.000 (24,027,246)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	239,200	696,072.000	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	344,770	737,807.800	
	シンガポール・ドル 小計			1,433,879.800 (157,024,177)	
	ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,857	518,937.760	
		GECINA SA	2,708	281,632.000	
		KLEPIERRE	12,472	350,712.640	
		COVIVIO	3,349	180,008.750	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	10,663	262,523.060	
	ユーロ 小計			1,593,814.210 (252,189,222)	
	香港・ドル	LINK REIT	163,400	6,078,480.000	
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	243,000	2,444,580.000	
	香港・ドル 小計			8,523,060.000 (156,057,229)	
投資証券 合計				11,493,815,458 [11,493,815,458]	
合計				11,493,815,458 [11,493,815,458]	

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 572 銘柄 投資証券 34 銘柄	97.6%	2.4%	76.6%
イギリス・ポンド	株式 75 銘柄 投資証券 2 銘柄	99.2%	0.8%	4.0%
イスラエル・シケル	株式 8 銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 48 銘柄 投資証券 9 銘柄	90.9%	9.1%	1.9%
カナダ・ドル	株式 84 銘柄 投資証券 1 銘柄	99.9%	0.1%	3.0%
シンガポール・ドル	投資証券 2 銘柄 株式 12 銘柄	91.5%	8.5%	0.3%
スイス・フラン	株式 46 銘柄	100%	-%	2.5%
スウェーデン・クローナ	株式 44 銘柄	100%	-%	0.9%
デンマーク・クローネ	株式 16 銘柄	100%	-%	1.1%
ニュージーランド・ドル	株式 5 銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 11 銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式 214 銘柄 投資証券 5 銘柄	99.5%	0.5%	8.8%
香港・ドル	投資証券 2 銘柄 株式 22 銘柄	94.1%	5.9%	0.5%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年9月7日現在 金額(円)	2024年9月9日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	5,169,670,190	2,519,089,461
コール・ローン	2,142,004,041	999,645,481
国債証券	266,541,276,843	308,161,268,383
派生商品評価勘定	14,837,311	1,015
未収利息	1,760,176,571	2,211,509,089
前払費用	106,662,157	149,220,358
流動資産合計	275,734,627,113	314,040,733,787
資産合計	275,734,627,113	314,040,733,787
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	48,376	19,406,553
未払金	2,505,365,151	455,507
未払解約金	185,238,837	126,946,817
流動負債合計	2,690,652,364	146,808,877
負債合計	2,690,652,364	146,808,877
純資産の部		
元本等		
元本	※1 81,490,428,967	88,440,035,633
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	191,553,545,782	225,453,889,277
元本等合計	273,043,974,749	313,893,924,910
純資産合計	273,043,974,749	313,893,924,910
負債純資産合計	275,734,627,113	314,040,733,787

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 9 月 9 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	2023 年 9 月 7 日現在	2024 年 9 月 9 日現在
1. ※1 期首	2022 年 9 月 8 日	2023 年 9 月 8 日
期首元本額	75,361,838,720 円	81,490,428,967 円
期中追加設定元本額	11,462,056,956 円	13,845,307,021 円
期中一部解約元本額	5,333,466,709 円	6,895,700,355 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	402,712,308 円	334,284,052 円

区分	2023年9月7日現在	2024年9月9日現在
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	7,360,920円	4,950,980円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	43,963,859円	31,902,746円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	15,130,453円	14,267,455円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	209,031,796円	178,441,285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)	516,076,270円	796,100,609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)	-円	613,146,390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)	808,911,779円	969,436,086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)	3,391,527,422円	5,638,316,159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)	852,087,032円	1,128,937,747円
D-I's 外国債券インデックス	2,130,624円	1,826,625円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	18,843,191円	21,719,982円
iFree 外国債券インデックス	2,168,952,293円	2,039,529,754円
iFree 8資産バランス	2,218,246,601円	2,647,928,780円
iFree 年金バランス	457,574,246円	623,529,591円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	382,798円	2,275,241円
DCダイワ外国債券インデックス	51,018,771,217円	51,775,310,181円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,141,716,911円	1,194,490,715円
ダイワ・ライフ・バランス50	781,538,835円	918,786,615円
ダイワ・ライフ・バランス70	608,476,406円	730,856,465円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	690,011,616円	721,177,932円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	543,955,599円	592,006,270円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	215,733,645円	241,749,041円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	34,639,105円	34,439,660円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	18,191,164円	21,631,919円
ダイワつみたてインデックス外国債券	1,767,734,506円	2,393,028,554円

区分	2023年9月7日現在	2024年9月9日現在
ダイワつみたてインデックスバ ランス30	4,818,337円	4,983,279円
ダイワつみたてインデックスバ ランス50	1,698,924円	2,478,881円
ダイワつみたてインデックスバ ランス70	2,999,998円	4,158,514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)	843,244,763円	2,194,163,571円
ダイワ世界バランスファンド4 0VA	99,236,250円	90,046,824円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	27,226,820円	27,047,472円
ダイワ・バランスファンド35 VA	2,960,692,945円	2,512,298,728円
ダイワ・バランスファンド25 VA (適格機関投資家専用)	190,500,217円	162,551,333円
スタイル9 (4資産分散・保守 型)	-円	147,695円
スタイル9 (4資産分散・バラ ンス型)	-円	1,833,793円
スタイル9 (4資産分散・積極 型)	-円	1,674,011円
スタイル9 (6資産分散・保守 型)	-円	38,982円
スタイル9 (6資産分散・バラ ンス型)	-円	1,220,989円
スタイル9 (6資産分散・積極 型)	-円	431,674円
スタイル9 (8資産分散・保守 型)	-円	61,560円
スタイル9 (8資産分散・バラ ンス型)	-円	1,210,582円
スタイル9 (8資産分散・積極 型)	-円	1,348,851円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	159,757,160円	135,760,414円
ダイワ・ノーロード 外国債券フ ァンド	67,677,570円	68,716,898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)	3,339,608,775円	3,504,769,883円
ダイワ投信倶楽部外国債券イン デックス	5,754,077,250円	5,953,669,728円
ダイワライフスタイル25	27,435,793円	25,738,639円
ダイワライフスタイル50	60,909,034円	58,505,542円
ダイワライフスタイル75	16,844,535円	17,106,956円
計	81,490,428,967円	88,440,035,633円
2. 期末日における受益権の総数	81,490,428,967口	88,440,035,633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 2023 年 9 月 8 日 至 2024 年 9 月 9 日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2024 年 9 月 9 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	2023年9月7日現在	2024年9月9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	△9,604,905,666	11,323,285,016
合計	△9,604,905,666	11,323,285,016

(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	2023年9月7日現在				2024年9月9日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超				1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	2,103,689,590	-	2,118,478,525	14,788,935	900,446,984	-	881,041,446	△19,405,538
アメリカ・ドル	219,265,105	-	220,091,367	826,262	92,558,185	-	91,327,710	△1,230,475
イギリス・ポンド	191,209,766	-	191,592,927	383,161	11,956,631	-	11,772,180	△184,451
イスラエル・シケル	-	-	-	-	64,850,317	-	61,840,696	△3,009,621
オーストラリア・ドル	31,562,798	-	31,574,121	11,323	-	-	-	-
オフショア・人民元	1,134,657,071	-	1,146,041,075	11,384,004	583,897,032	-	571,393,720	△12,503,312
カナダ・ドル	74,458,616	-	75,025,458	566,842	-	-	-	-
シンガポール・ドル	80,779,313	-	81,243,598	464,285	13,368,888	-	13,113,204	△255,684
デンマーク・クローネ	-	-	-	-	1,917,798	-	1,883,240	△34,558
ノルウェー・クローネ	-	-	-	-	15,253,779	-	14,792,026	△461,753
ポーランド・ズロチ	-	-	-	-	52,778,680	-	51,779,991	△998,689
ユーロ	371,756,921	-	372,909,979	1,153,058	63,865,674	-	63,138,679	△726,995
合計	2,103,689,590	-	2,118,478,525	14,788,935	900,446,984	-	881,041,446	△19,405,538

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

(1口当たり情報)

	2023年9月7日現在	2024年9月9日現在
1口当たり純資産額	3,3506円	3,5492円
(1万口当たり純資産額)	(33,506円)	(35,492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	882,650.700	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	764,691.950	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	788,014.260	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	812,282.100	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,645,115.480	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,269,480.240	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	954,425.010	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	582,699.360	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	558,226.020	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	1,011,991.280	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,170,738.770	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,135,397.800	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,279,054.700	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,096,809.500	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	1,774,384.320	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,086,712.370	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,528,303.530	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,382,058.480	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,438,095.750	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,474,326.790	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,291,007.500	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,437,685.860	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,170,345.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	4,342,723.890			

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	1,348,564.200	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,292,392.960	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,924,643.940	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	3,004,447.200	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	1,978,573.180	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	3,084,934.950	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	2,987,646.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,664,881.320	
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,319,381.440	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	1,983,710.740	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	1,835,000.000	1,545,620.500	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,542,883.750	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,722,966.400	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	553,724.750	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,715,445.960	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	2,413,477.160	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,462,040.340	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	2,158,691.640	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,183,136.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	2,020,921.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	5,120,277.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	815,660.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,527,378.400	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	1,950,594.450	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,204,992.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,660,700.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,688,603.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,450,000.000	1,939,273.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,289,020.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	1,975,175.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	6,189,726.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,478,750.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	3,206,098.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,353,815.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,539,669.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,652,088.600	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,551,364.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,472,050.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,471,675.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,641,651.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,655,999.400	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	2,960,490.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,500,000.000	1,475,325.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,359,298.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,458,000.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	3,863,541.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,452,425.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,441,775.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,150,000.000	3,328,632.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,708,120.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,738,092.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,919,840.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,710,288.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,417,575.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,304,166.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	2,200,000.000	1,550,296.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,679,012.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,401,050.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,876,340.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	2,850,000.000	2,612,310.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	3,253,590.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,915,300.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,398,925.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,498,200.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	6,190,730.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	3,583,386.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	282,726.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,485,744.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,785,032.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,216,424.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	1,000,000.000	546,750.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	3,335,900.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,224,760.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,217,655.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,754,000.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,568,650.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	8,200,000.000	4,615,698.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	5,000,000.000	3,306,600.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,202,675.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	4,000,000.000	3,842,760.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,637,320.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,370,395.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	8,350,286.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,832,960.000	

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	3,642,000.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	4,084,624.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,490,593.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,882,230.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,561,700.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,551,150.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	5,000,000.000	4,775,750.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,383,930.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	3,774,584.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	9,222,437.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,764,800.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,610,900.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,478,611.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,857,380.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,697,480.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,817,240.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	7,689,234.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,285,170.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,536,140.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	4,600,320.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	2,970,574.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	6,000,000.000	5,527,500.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	4,182,024.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,598,500.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,753,800.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,823,701.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	6,900,000.000	4,535,784.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	5,700,000.000	4,081,029.000	

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	5,667,180.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,545,000.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,559,150.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,724,600.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,574,500.000	
		0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,310,405.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	10,000,000.000	8,593,100.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,600,000.000	4,199,844.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	2,972,320.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,506,620.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	7,000,000.000	6,640,690.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,798,880.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	5,158,888.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	4,000,000.000	3,660,360.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,795,000.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	5,400,000.000	4,788,342.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,991,432.000	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	6,900,000.000	4,805,988.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	1,965,900.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,660,900.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	5,000,000.000	4,800,000.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,855,490.000	
		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,873,000.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	9,300,000.000	8,831,466.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	3,994,700.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,343,085.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,916,900.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,939,280.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	6,000,000.000	5,797,500.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,951,940.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,950,040.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,977,140.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	3,981,762.400	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	9,500,000.000	8,921,070.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	5,200,000.000	4,263,168.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	2,000,000.000	1,819,360.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,224,020.800	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,471,225.000	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,434,900.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250915	2,300,000.000	2,285,855.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,538,475.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	3,500,000.000	3,561,285.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251015	3,400,000.000	3,407,276.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031	3,000,000.000	3,052,140.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	9,700,000.000	10,026,987.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251115	1,500,000.000	1,508,610.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	3,700,000.000	3,660,891.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	3,063,960.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	2,500,000.000	2,539,350.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	3,000,000.000	3,031,170.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20421115	2,500,000.000	2,477,675.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251215	3,500,000.000	3,502,310.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260115	1,500,000.000	1,499,640.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	5,000,000.000	5,078,100.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271231	1,500,000.000	1,516,755.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	5,000,000.000	4,987,500.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260215	3,500,000.000	3,507,420.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	8,000,000.000	7,904,000.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	2,500,000.000	2,431,150.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	4,500,000.000	4,168,350.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131	3,700,000.000	3,697,225.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300228	4,000,000.000	4,089,040.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280229	3,000,000.000	3,046,980.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260315	2,500,000.000	2,529,525.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,800,000.000	1,806,534.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280331	3,700,000.000	3,713,875.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260415	2,000,000.000	1,998,860.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	3,000,000.000	2,991,660.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280430	2,000,000.000	1,999,020.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260515	4,000,000.000	3,990,840.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	7,800,000.000	7,626,450.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	5,600,000.000	5,193,440.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	2,500,000.000	2,426,050.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280531	3,700,000.000	3,713,357.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531	1,500,000.000	1,514,760.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260615	3,000,000.000	3,020,010.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	3,000,000.000	3,029,160.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630	3,500,000.000	3,559,920.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260715	5,000,000.000	5,070,300.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	3,500,000.000	3,576,195.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815	11,000,000.000	11,152,900.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260815	6,000,000.000	6,078,240.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815	5,000,000.000	5,067,450.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430815	2,300,000.000	2,385,974.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	3,000,000.000	3,068,670.000	
		5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250831	3,900,000.000	3,930,732.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300831	3,100,000.000	3,191,543.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	3,000,000.000	3,094,560.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260915	3,000,000.000	3,055,770.000	
		5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250930	1,000,000.000	1,009,260.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930	1,500,000.000	1,585,365.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	4,200,000.000	4,373,880.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261015	1,000,000.000	1,019,640.000	
		5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251031	3,000,000.000	3,032,040.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	6,311,220.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20331115	10,000,000.000	10,621,000.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261115	3,800,000.000	3,878,736.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20431115	2,300,000.000	2,502,952.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301031	3,100,000.000	3,321,030.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20531115	5,300,000.000	5,950,999.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251130	3,500,000.000	3,536,820.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301130	3,000,000.000	3,132,180.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	4,000,000.000	4,133,320.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261215	2,000,000.000	2,033,000.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310131	2,000,000.000	2,047,380.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301231	4,500,000.000	4,543,200.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251231	1,000,000.000	1,004,000.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260131	6,000,000.000	6,030,300.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,800,000.000	4,894,368.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	1,000,000.000	1,009,210.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270115	1,000,000.000	1,008,920.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340215	8,200,000.000	8,388,928.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270215	4,000,000.000	4,049,040.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540215	4,400,000.000	4,559,808.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440215	3,000,000.000	3,158,430.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310228	3,600,000.000	3,737,736.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260228	5,000,000.000	5,055,450.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,200,000.000	5,359,224.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270315	5,000,000.000	5,083,100.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	5,000,000.000	5,127,500.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310331	2,000,000.000	2,062,460.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260331	5,200,000.000	5,253,092.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270415	5,000,000.000	5,114,800.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260430	2,500,000.000	2,543,050.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340515	8,500,000.000	8,952,200.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270515	4,000,000.000	4,094,520.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	2,500,000.000	2,618,050.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310430	1,600,000.000	1,697,152.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540515	4,000,000.000	4,411,240.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440515	1,000,000.000	1,069,840.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	5,600,000.000	5,840,576.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260531	5,000,000.000	5,092,350.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310531	2,300,000.000	2,440,369.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270615	4,500,000.000	4,627,935.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260630	4,000,000.000	4,062,080.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310630	2,500,000.000	2,598,825.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	100,000.000	103,222.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270715	2,200,000.000	2,249,236.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	4,200,000.000	4,251,828.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	8,300,000.000	8,480,193.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310731	5,000,000.000	5,160,900.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340815	1,500,000.000	1,519,560.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270815	10,000,000.000	10,058,900.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540815	2,000,000.000	2,077,960.000	
	アメリカ・ドル	小計		1,012,533,548.140 (144,569,540,004)	
	イギリス・ポンド	2% United Kingdom Gilt 20250907	921,000.000	901,262.970	
		2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,282,000.000	838,043.400	
		1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,404,349.000	
		1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	1,034,528.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,120,197.500	
		1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	996,567.900	
		1.25% United Kingdom Gilt 20270722	2,610,000.000	2,436,722.100	
		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,387,560.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,740,000.000	833,634.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	737,253.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20541022	1,150,000.000	624,565.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,500,000.000	1,310,355.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	760,767.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,300,000.000	1,069,965.000	
		0.5% United Kingdom Gilt 20611022	1,700,000.000	541,960.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,429,485.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,424,288.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	468,160.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20350731	3,700,000.000	2,630,330.000	
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	1,984,700.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20460131	2,000,000.000	1,040,600.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20261022	3,500,000.000	3,262,210.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,800,000.000	916,920.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	2,100,000.000	1,422,540.000	
		0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	2,700,000.000	2,358,099.000	
		0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	2,600,000.000	2,028,884.000	
		1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	1,300,000.000	689,650.000	
		1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	3,600,000.000	2,971,044.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	820,000.000	316,520.000	
		4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	2,000,000.000	2,003,800.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	1,000,000.000	968,200.000	
		3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	4,300,000.000	4,132,257.000	
		3.5% UNITED KINGDOM GILT 20251022	400,000.000	396,532.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	2,500,000.000	2,233,000.000	
		4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	1,500,000.000	1,391,100.000	
		4.5% UNITED KINGDOM GILT 20280607	2,200,000.000	2,253,064.000	
		4.625% UNITED KINGDOM GILT 20340131	1,000,000.000	1,059,760.000	
		4.75% UNITED KINGDOM GILT 20431022	1,000,000.000	1,052,200.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20270307	1,900,000.000	1,891,526.000	
		4.375% UNITED KINGDOM GILT 20540731	1,080,000.000	1,070,172.000	
		4% UNITED KINGDOM GILT 20311022	500,000.000	507,150.000	
		4.125% UNITED KINGDOM GILT 20290722	2,100,000.000	2,132,970.000	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT 20340731	1,100,000.000	1,132,692.000	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,036,829.950	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,040,000.000	1,077,169.600	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,362,000.000	1,398,501.600	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,757,000.000	1,878,584.400	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	1,662,738.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,339,226.400	
		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,252,438.880	
		4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	2,171,016.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4.75% United Kingdom Gilt 20301207	2,300,000.000	2,437,264.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,311,976.700	
		4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,846,000.000	1,862,244.800	
		4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,639,092.000	
		4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	1,094,285.400	
		4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,580,942.500	
		3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,389,971.200	
		3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,466,000.000	2,115,088.200	
		3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	1,164,933.000	
		3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,524,000.000	1,347,673.200	
		イギリス・ポンド 小計		88,925,558.700 (16,674,431,511)	
	イスラエル・シ ュケル	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	1,872,414.000	
		5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	2,200,000.000	2,306,238.000	
		1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,247,790.000	
		2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,700,676.000	
		3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	1,941,120.000	
		2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,105,764.000	
		1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	1,994,304.000	
		1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,152,991.000	
		0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	189,548.000	
		1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	2,300,000.000	1,813,274.000	
		2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129	820,000.000	523,717.600	
		3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290228	3,000,000.000	2,917,710.000	
		4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20350330	1,000,000.000	935,090.000	
		3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20270930	2,500,000.000	2,463,100.000	
		イスラエル・シュケル 小計		23,163,736.600 (886,473,884)	
	オーストラリ ア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,050,619.220	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,338,794.580	
		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	2,258,000.000	2,368,438.780	
		4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,748,000.000	1,764,815.760	
		3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,086,454.950	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,172,849.520	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	715,904.640	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,635,216.000	
		2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,127,970.340	
		3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,000,661.000	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,456,920.000	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,827,952.000	
		2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,707,845.000	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,142,816.300	
		1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,467,164.800	
		1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	2,700,000.000	2,246,589.000	
		1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,703,600.000	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	809,410.000	
		0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,600,000.000	1,534,320.000	
		1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,070,375.000	
		0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,128,636.000	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,600,000.000	1,368,768.000	
		3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,700,000.000	1,587,103.000	
		3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	1,200,000.000	1,187,616.000	
		3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221	1,600,000.000	1,545,760.000	
		4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20540621	900,000.000	942,741.000	
		4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340621	1,100,000.000	1,133,363.000	
		4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20351221	800,000.000	822,792.000	
		オーストラリア・ドル 小計		41,945,495.890 (3,996,566,848)	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	オフショア・人民元	3.22% China Government Bond 20251206	5,200,000.000	5,318,040.000	
		3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,316,500.000	
		3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,360,150.000	
		3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,157,300.000	
		3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,422,400.000	
		3.13% China Government Bond 20291121	8,000,000.000	8,535,200.000	
		2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,447,070.000	
		2.68% China Government Bond 20300521	11,500,000.000	11,967,590.000	
		3.02% China Government Bond 20251022	18,000,000.000	18,327,240.000	
		3.28% China Government Bond 20271203	9,000,000.000	9,484,200.000	
		3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	13,520,625.000	
		3.03% China Government Bond 20260311	7,000,000.000	7,163,100.000	
		3.81% China Government Bond 20500914	7,300,000.000	9,407,656.000	
		3.01% China Government Bond 20280513	7,000,000.000	7,326,270.000	
		3.72% China Government Bond 20510412	14,000,000.000	17,863,860.000	
		3.02% China Government Bond 20310527	15,800,000.000	16,864,130.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,601,610.000	
		2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,114,100.000	
		3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,834,125.000	
		3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,392,300.000	
		3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,838,850.000	
		4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	4,500,000.000	5,951,880.000	
		3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	6,300,000.000	8,103,186.000	
		3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	12,000,000.000	14,448,720.000	
		2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,751,900.000	
		3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	11,500,000.000	14,280,010.000	
		2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	16,000,000.000	16,918,720.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	17,000,000.000	17,326,740.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	7,200,000.000	7,553,088.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	15,668,400.000	
		2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	15,000,000.000	15,351,150.000	
		3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	6,612,485.000	
		2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	5,249,550.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	4,000,000.000	4,173,920.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	19,000,000.000	19,856,520.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	32,000,000.000	33,234,240.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	9,860,715.000	
		2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	17,200,000.000	17,621,744.000	
		3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	14,000,000.000	16,294,460.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	5,500,000.000	5,799,970.000	
		2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20251125	18,000,000.000	18,171,900.000	
		2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	19,000,000.000	19,900,410.000	
		2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	20,000,000.000	20,625,200.000	
		2.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20260215	38,000,000.000	38,498,180.000	
		2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	15,000,000.000	15,944,550.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	15,000,000.000	15,707,850.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	25,000,000.000	25,809,750.000	
		3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	23,000,000.000	27,147,820.000	
		2.3% CHINA GOVERNMENT BOND 20260515	7,000,000.000	7,094,290.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	40,000,000.000	41,774,400.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	33,000,000.000	34,231,230.000	
		2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	35,000,000.000	35,828,450.000	
		2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	40,000,000.000	41,283,200.000	
		2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	30,000,000.000	30,384,000.000	
		2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925	25,000,000.000	25,708,500.000	
		2.22% CHINA GOVERNMENT BOND 20250925	30,000,000.000	30,237,300.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	20,000,000.000	20,732,600.000	
		3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	49,000,000.000	56,056,490.000	
		2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	20,000,000.000	20,630,600.000	
		2.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20261115	60,000,000.000	61,105,800.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	36,000,000.000	37,613,160.000	
		2.33% CHINA GOVERNMENT BOND 20251215	18,000,000.000	18,194,940.000	
		2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225	50,000,000.000	51,704,500.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20290115	58,000,000.000	59,484,220.000	
		2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20270225	35,000,000.000	35,411,600.000	
		2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225	8,000,000.000	8,154,160.000	
		1.99% CHINA GOVERNMENT BOND 20260315	26,000,000.000	26,215,800.000	
		2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325	44,000,000.000	44,807,840.000	
		2.05% CHINA GOVERNMENT BOND 20290415	73,000,000.000	73,882,570.000	
		1.85% CHINA GOVERNMENT BOND 20270515	85,000,000.000	85,667,250.000	
		2.27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525	21,000,000.000	21,232,470.000	
		1.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20260615	45,000,000.000	45,175,950.000	
		2.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20310625	30,000,000.000	30,236,100.000	
		1.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20290715	28,000,000.000	28,178,640.000	
		1.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20270815	45,000,000.000	45,108,450.000	
		2.11% CHINA GOVERNMENT BOND 20340825	16,000,000.000	15,974,560.000	
		オフショア・人民元 小計		1,647,234,444.000 (33,095,081,384)	
	カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	605,000.000	563,902.350	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,113,915.940	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,356,049.170	
		5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,220,725.000	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	1,019,373.630	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	1,018,756.100	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,254,734.390	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		1. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	943,515.300	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,182,513.600	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	632,333.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,945,740.000	
		2. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,195,856.200	
		1. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,166,479.000	
		0. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,807,288.200	
		0. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,736,420.000	
		0. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	2,011,254.000	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	288,705.000	
		1. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	3,120,452.000	
		1. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	2,650,000.000	1,958,297.000	
		1. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	2,200,000.000	2,113,716.000	
		1. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,100,000.000	1,912,743.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,407,780.000	
		2. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	97,754.000	
		2. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	400,000.000	398,856.000	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20251001	1,000,000.000	995,470.000	
		2. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	2,270,000.000	2,203,829.500	
		3. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	1,300,000.000	1,328,951.000	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260401	600,000.000	597,984.000	
		2. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,700,000.000	1,678,546.000	
		2. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201	900,000.000	834,867.000	
		3. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280901	1,200,000.000	1,219,824.000	
		3. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20331201	1,000,000.000	1,024,940.000	
		4. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20251101	2,000,000.000	2,024,060.000	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290301	1,800,000.000	1,890,108.000	
		4. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260201	2,000,000.000	2,032,160.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340601	1,700,000.000	1,705,117.000	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260501	1,000,000.000	1,012,430.000	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340301	1,500,000.000	1,571,820.000	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290901	800,000.000	825,816.000	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260801	700,000.000	712,145.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20341201	500,000.000	511,295.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20261101	500,000.000	502,885.000	
	カナダ・ドル	小計		58,139,406.380 (6,120,335,310)	
	シンガポール・ ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	792,458.000	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	829,629.500	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	404,400.000	
		3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	605,488.000	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	638,437.500	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	693,854.880	
		2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	447,345.000	
		2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	723,375.000	
		2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	553,960.000	
		2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	339,202.500	
		1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	459,000.000	
		0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	750,000.000	731,475.000	
		1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	568,206.000	
		1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	500,000.000	420,300.000	
		1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	195,014.000	
		2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	242,040.000	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	620,000.000	669,556.600	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	100,000.000	101,300.000	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20280801	400,000.000	406,696.000	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20290401	600,000.000	614,436.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20340501	300,000.000	320,967.000	
		3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20540601	100,000.000	111,637.000	
		シンガポール・ドル 小計		10,868,777.980 (1,190,239,877)	
	スウェーデン・ クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	3,655,000.000	4,281,284.250	
		1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	7,071,582.000	
		0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,884,107.500	
		2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,391,806.000	
		0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	6,086,016.000	
		0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,476,250.000	
		1.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20331111	2,000,000.000	1,974,140.000	
		スウェーデン・クローナ 小計		32,165,185.750 (445,166,171)	
	デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	17,406,754.200	
		1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	5,975,779.530	
		0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,873,509.000	
		0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	4,090,000.000	3,798,342.100	
		0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	2,027,970.000	
		DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	435,145.000	
		2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20331115	2,000,000.000	2,025,560.000	
		2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20261115	50,000.000	50,233.500	
		デンマーク・クローネ 小計		36,593,293.330 (776,143,751)	
	ニュージーラン ド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	600,000.000	611,100.000	
		3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	1,500,000.000	1,431,630.000	
		2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	412,442.800	
		3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	600,000.000	580,740.000	
		1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	530,000.000	453,383.200	
		1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	235,501.000	
		0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	1,100,000.000	969,749.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20260515	500,000.000	472,050.000	
		2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	440,000.000	380,234.800	
		2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	270,955.200	
		4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20340515	200,000.000	201,132.000	
		4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20300515	500,000.000	515,555.000	
		5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20540515	700,000.000	737,135.000	
		4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20350515	500,000.000	510,930.000	
		4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20360515	1,300,000.000	1,291,615.000	
		ニュージーランド・ドル 小計		9,074,153.000 (800,068,070)	
	ノルウェー・クローネ	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,221,301.000	
		1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,303,550.500	
		2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,370,605.000	
		1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,611,646.500	
		1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,355,664.000	
		1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	3,086,650.000	
		2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	1,700,000.000	1,580,133.000	
		3.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20421006	3,500,000.000	3,606,610.000	
		3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20330815	1,500,000.000	1,474,860.000	
		3.625% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20340413	3,500,000.000	3,591,315.000	
		ノルウェー・クローネ 小計		33,202,335.000 (442,255,102)	
	ポーランド・ズロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,208,704.350	
		2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	2,980,307.200	
		2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,358,274.800	
		1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,408,850.000	
		0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	2,005,806.000	
		1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,800,000.000	1,422,450.000	
		3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	500,000.000	486,945.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	5,000,000.000	5,443,000.000	
		POLAND GOVERNMENT BOND 20251025	1,500,000.000	1,433,400.000	
		6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	5,000,000.000	5,288,750.000	
		POLAND GOVERNMENT BOND 20260425	2,000,000.000	1,864,400.000	
		4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725	2,000,000.000	1,977,880.000	
		5% POLAND GOVERNMENT BOND 20341025	1,500,000.000	1,469,220.000	
		5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	851,942.320	
		2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,400,011.500	
		ポーランド・ズロチ 小計		39,599,941.170 (1,463,605,906)	
	マレーシア・リンギット	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,382,373.350	
		4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	3,378,000.000	3,531,023.400	
		4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,541,146.020	
		4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,342,432.000	
		3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	741,182.830	
		3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,433,906.680	
		3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,904,426.220	
		4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,451,866.000	
		3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,750,948.110	
		4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,267,397.000	
		4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,014,723.000	
		3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,571,204.000	
		3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,208,885.300	
		4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,116,140.000	
		4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,282,212.000	
		4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	2,000,000.000	2,203,160.000	
		3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	657,592.000	
		3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,350,702.200	
		4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,340,280.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	2,000,000.000	2,014,680.000	
		3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,705,480.000	
		4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,611,681.000	
		2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,690,092.000	
		3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	1,400,000.000	1,385,132.000	
		4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	1,900,000.000	2,062,678.000	
		4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	521,785.000	
		4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	1,400,000.000	1,463,070.000	
		3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	1,000,000.000	1,002,770.000	
		4.054% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390418	1,200,000.000	1,221,048.000	
		4.18% MALAYSIAN GOVERNMENT 20440516	800,000.000	813,696.000	
		マレーシア・リンギット 小計		47,583,712.110 (1,560,821,891)	
	メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	37,290,000.000	35,125,315.500	
		8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	17,684,964.000	
		5.5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	6,397,790.000	
		8% MEXICAN BONOS 20530731	37,000,000.000	30,432,130.000	
		7.5% MEXICAN BONOS 20330526	30,000,000.000	26,512,800.000	
		7% MEXICAN BONOS 20260903	23,000,000.000	21,867,940.000	
		8% MEXICAN BONOS 20350524	5,000,000.000	4,445,500.000	
		8.5% MEXICAN BONOS 20290301	10,000,000.000	9,652,400.000	
		7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	26,677,556.480	
		10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,205,621.380	
		8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	28,514,982.480	
		8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	17,176,913.280	
		7.75% Mexican Bonos 20310529	44,515,000.000	40,854,086.400	
		7.75% Mexican Bonos 20421113	29,654,000.000	24,331,996.620	
		7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	7,070,636.640	
		メキシコ・ペソ 小計		305,950,632.780 (2,189,474,513)	
	ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	326,162.200	
		0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	274,075.650	
		0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	787,124.160	
		1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	268,009.200	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	759,152.000	
		1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	409,750.700	
		0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	465,245.000	
		0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	455,725.000	
		0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	228,578.500	
		0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	264,220.000	
		Finland Government Bond 20300915	500,000.000	432,475.000	
		0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	193,680.000	
		0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	509,220.000	
		FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	190,802.000	
		0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	293,301.000	
		1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	800,000.000	738,904.000	
		1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	263,649.600	
		2.75% FINLAND GOVERNMENT BOND 20380415	400,000.000	393,808.000	
		3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20330915	300,000.000	308,916.000	
		2.875% FINLAND GOVERNMENT BOND 20290415	1,000,000.000	1,021,720.000	
		2.95% FINLAND GOVERNMENT BOND 20550415	400,000.000	397,708.000	
		3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20340915	100,000.000	102,664.000	
		2.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20300415	500,000.000	502,010.000	
		1.2% Austria Government Bond 20251020	200,000.000	196,972.000	
		0.75% Austria Government Bond 20261020	2,126,000.000	2,057,330.200	
		1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	595,126.560	
		1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	150,736.800	
		0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,222,502.400	
		2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	427,998.600	
		0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,138,584.000	
		0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,180,608.000	
		Austria Government Bond 20300220	980,000.000	859,695.200	

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	720,324.000	
		Austria Government Bond 20401020	400,000.000	250,848.000	
		0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	165,609.500	
		Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	1,022,940.000	
		0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	443,148.000	
		0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	142,395.000	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	1,800,000.000	1,635,660.000	
		0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	1,500,000.000	1,334,190.000	
		1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	300,000.000	241,104.000	
		2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	300,000.000	297,939.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	800,000.000	816,368.000	
		3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20531020	300,000.000	307,044.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20290523	1,000,000.000	1,023,810.000	
		3.45% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20301020	800,000.000	843,680.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20340220	500,000.000	509,405.000	
		3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20390715	500,000.000	517,000.000	
		1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,609,443.760	
		1.9% Belgium Government Bond 20380622	758,000.000	664,917.600	
		1% Belgium Government Bond 20260622	1,463,000.000	1,427,888.000	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	920,186.800	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	564,531.200	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,055,747.000	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	457,214.000	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	505,788.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,409,942.300	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	583,134.500	
		0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,401,855.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	509,964.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.1% Belgium Government Bond 20300622	220,000.000	192,515.400	
		0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	573,362.000	
		Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,117,188.000	
		Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,339,024.000	
		0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	233,374.900	
		0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	1,400,000.000	1,180,452.000	
		1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	519,792.000	
		2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	400,000.000	387,636.000	
		3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	1,500,000.000	1,540,395.000	
		3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	600,000.000	593,790.000	
		3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20430622	700,000.000	727,216.000	
		2.85% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20341022	300,000.000	302,334.000	
		3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20550622	1,000,000.000	1,021,580.000	
		2.7% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20291022	100,000.000	101,332.000	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,305,978.030	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,407,495.100	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,044,031.000	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,359,519.890	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,661,531.920	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	2,830,378.650	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,271,000.000	3,863,312.680	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	1,629,882.500	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,270,873.150	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,974,000.000	2,205,056.700	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,308,000.000	2,326,210.120	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	2,700,298.050	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	4,168,000.000	4,060,632.320	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,322,716.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	2,200,000.000	2,106,104.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,159,618.000	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	3,470,000.000	2,730,820.600	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,806,748.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,834,648.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	4,700,000.000	4,358,545.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,722,200.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,850,000.000	1,539,912.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,572,585.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,100,000.000	1,662,906.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,876,100.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,601,748.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,068,048.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,900,000.000	1,673,463.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	2,400,000.000	1,847,064.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,842,400.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	595,507.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,600,000.000	1,394,448.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	610,372.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	3,800,000.000	3,273,510.000	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	1,600,000.000	1,348,864.000	
		1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,631,798.000	
		1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	2,350,000.000	2,047,461.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	3,200,000.000	3,208,864.000	
		2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	2,400,000.000	2,439,576.000	
		2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,700,000.000	1,728,645.000	
		1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,000,000.000	872,880.000	
		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330815	2,400,000.000	2,496,192.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,529,280.000	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340215	2,400,000.000	2,412,384.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20540815	1,800,000.000	1,826,910.000	
		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20410515	1,000,000.000	1,022,330.000	
		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340815	300,000.000	311,454.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	2,100,000.000	1,084,251.000	
		3.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250918	100,000.000	100,444.000	
		3.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20251212	300,000.000	302,181.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260319	800,000.000	801,456.000	
		2.9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260618	800,000.000	808,360.000	
		2.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260917	1,000,000.000	1,009,210.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,238,981.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	97,386.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,123,352.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	2,800,000.000	2,678,284.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	3,100,000.000	2,938,800.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,935,500.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	420,798.000	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	100,000.000	100,537.000	
		2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20281019	100,000.000	101,388.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	100,000.000	100,212.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	100,000.000	100,249.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291011	10,000.000	10,219.000	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,133,930.250	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,750,736.560	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	3,227,000.000	3,934,777.910	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,108,955.980	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	1,961,285.760	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,624,267.080	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,707,575.200	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	1,930,680.650	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	3,701,674.420	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3,099,000.000	3,128,254.560	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	3,088,000.000	3,086,208.960	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	5,079,471.240	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	3,101,000.000	3,041,119.690	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,784,691.200	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	4,387,000.000	4,243,720.580	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	3,470,900.950	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	911,924.760	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	3,861,837.000	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,270,000.000	1,915,040.100	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,274,574.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	2,011,210.500	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	5,081,184.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	5,150,000.000	4,469,582.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,616,518.500	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,850,000.000	1,963,507.500	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	5,350,000.000	4,881,768.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,693,438.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,497,517.400	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	2,891,610.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,485,154.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	5,000,000.000	4,276,300.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	1,480,000.000	568,527.200	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	1,900,000.000	1,153,528.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,818,368.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	4,800,000.000	4,524,720.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,600,000.000	1,369,550.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	3,600,000.000	2,941,308.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	3,000,000.000	2,389,320.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	4,300,000.000	4,062,210.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	4,100,000.000	3,888,522.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	896,100.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	2,100,000.000	1,943,718.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260924	3,200,000.000	3,202,784.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20330525	4,600,000.000	4,687,630.000	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290225	4,300,000.000	4,345,322.000	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20331125	3,200,000.000	3,382,432.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20490625	700,000.000	665,917.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270924	3,100,000.000	3,105,673.000	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550525	1,200,000.000	1,160,088.000	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300225	1,000,000.000	1,009,850.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20341125	500,000.000	505,515.000	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,258,788.630	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	2,018,548.350	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	1,990,614.990	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,482,944.240	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	1,966,962.720	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	938,000.000	908,706.260	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,115,146.000	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,278,922.500	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,092,852.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	660,798.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,229,200.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	2,300,000.000	2,186,863.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,250,000.000	626,400.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,114,347.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	637,029.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	818,217.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	100,000.000	96,853.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	600,000.000	522,210.000	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	1,200,000.000	1,046,412.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715	900,000.000	907,353.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300115	1,300,000.000	1,315,821.000	
		3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20440115	600,000.000	652,914.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20340715	1,000,000.000	1,004,210.000	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,216,637.700	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,668,539.120	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,342,421.490	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,855,051.450	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	2,891,000.000	2,865,559.200	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,301,443.500	
		1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,345,294.840	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	2,010,306.480	
		1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,037,316.360	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	726,784.080	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,395,375.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,493,782.600	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,650,000.000	1,503,430.500	
		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,656,395.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,180,751.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,053,422.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,552,805.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,545,691.000	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,247,635.300	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,450,000.000	1,398,133.500	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	2,900,000.000	2,914,877.000	
		2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,080,743.000	
		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,135,812.500	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,742,338.000	
		0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,257,104.500	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,153,386.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,195,980.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,775,800.000	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,929,522.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	2,092,530.000	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,648,626.000	
		1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,117,425.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,900,000.000	1,652,525.000	
		1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	751,332.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	509,768.000	
		0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,744,409.000	
		0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,518,642.000	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	2,200,000.000	1,447,050.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	1,055,648.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	287,237.800	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	734,912.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,628,281.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	3,100,000.000	2,950,642.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,000,000.000	845,030.000	
		0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	900,000.000	811,431.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	546,176.000	
		1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	288,792.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	796,560.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,600,000.000	1,509,840.000	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	2,300,000.000	2,167,612.000	
		2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	200,000.000	199,904.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	1,500,000.000	1,561,770.000	
		3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260115	3,300,000.000	3,330,954.000	
		4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	2,800,000.000	3,018,596.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	300,000.000	312,816.000	
		3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,500,000.000	1,533,075.000	
		4.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20430901	100,000.000	105,360.000	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	800,000.000	842,624.000	
		3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260415	500,000.000	508,460.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311030	900,000.000	948,285.000	
		3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	1,200,000.000	1,240,080.000	
		4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	2,100,000.000	2,251,704.000	
		3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280801	700,000.000	725,767.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260915	900,000.000	920,853.000	
		3.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250929	300,000.000	302,130.000	
		4.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340301	2,100,000.000	2,223,270.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,574,340.000	
		4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290201	600,000.000	630,276.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270215	200,000.000	201,366.000	
		3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,000,000.000	1,020,410.000	
		4.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20391001	2,000,000.000	2,055,700.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		3.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260128	100,000.000	100,548.000	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290701	400,000.000	407,568.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340701	700,000.000	719,509.000	
		4.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20371030	50,000.000	51,549.000	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310715	1,000,000.000	1,015,670.000	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270715	1,500,000.000	1,531,185.000	
		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260828	100,000.000	100,779.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350201	500,000.000	511,505.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	3,254,000.000	3,617,178.940	
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,342,247.370	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,118,925.600	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,586,628.800	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,837,955.000	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,544,000.000	1,739,362.320	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,522,724.530	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,123,012.700	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,586,460.200	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	1,992,758.950	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,383,019.900	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	3,206,000.000	3,549,651.140	
		5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,281,125.280	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	1,838,857.680	
		4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,031,720.690	
		4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	855,090.600	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	695,468.800	
		3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	765,413.550	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	965,266.840	
		2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	805,268.450	
		1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,048,331.730	
		1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	490,143.500	
		0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	762,688.000	
		1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	684,142.500	
		1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	705,690.000	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	900,932.500	
		1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	449,262.000	
		0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	278,033.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	473,695.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	705,424.000	
		IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	676,912.000	
		0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	280,880.000	
		0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	84,868.000	
		3% IRISH TREASURY 20431018	200,000.000	203,836.000	
		2.6% IRISH TREASURY 20341018	300,000.000	301,065.000	
		6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	913,770.000	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,561,636.470	
		4.85% Austria Government Bond 20260315	300,000.000	310,191.000	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	399,134.060	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	740,626.740	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	753,745.020	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	395,317.360	
		2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	389,653.660	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,038,820.720	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	1,983,093.840	
		2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,178,541.120	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	2,708,075.040	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,773,645.760	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,050,000.000	997,521.000	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,567,563.800	
		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,855,198.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,682,012.500	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	1,989,935.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,314,176.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	2,200,000.000	1,904,804.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,788,582.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,527,904.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	2,250,000.000	2,007,945.000	
		0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	3,800,000.000	3,450,628.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	2,560,000.000	2,286,771.200	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	802,032.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,291,688.000	
		1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,216,784.000	
		1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	951,002.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	482,225.000	
		0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,863,532.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	337,369.500	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	2,500,000.000	2,303,325.000	
		0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	700,000.000	527,422.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,633,772.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	409,074.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	900,000.000	848,889.000	
		0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,810,116.000	
		1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	1,600,000.000	1,124,512.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	1,100,000.000	1,013,221.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,700,000.000	1,671,525.000	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,000,000.000	994,750.000	
		3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	2,600,000.000	2,661,724.000	
		2.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260531	2,300,000.000	2,308,970.000	
		3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730	2,100,000.000	2,239,692.000	
		3.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20331031	1,500,000.000	1,578,240.000	
		3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290531	600,000.000	625,740.000	
		3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20340430	2,600,000.000	2,666,066.000	
		2.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270531	200,000.000	200,154.000	
		4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20541031	1,000,000.000	1,056,950.000	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20341031	1,000,000.000	1,039,870.000	
		3.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310730	700,000.000	721,259.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,639,640.600	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,945,168.460	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,858,000.000	2,206,876.660	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,306,318.620	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,086,378.050	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	1,954,876.500	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	1,613,254.080	
	ユーロ 小計			593,762,650.330 (93,951,064,161)	
国債証券 合計				308,161,268,383 [308,161,268,383]	
合計				308,161,268,383 [308,161,268,383]	

- (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	280 銘柄	100%	46.9%
イギリス・ポンド	国債証券	61 銘柄	100%	5.4%
イスラエル・シェケル	国債証券	14 銘柄	100%	0.3%
オーストラリア・ドル	国債証券	28 銘柄	100%	1.3%
オフショア・人民元	国債証券	76 銘柄	100%	10.7%
カナダ・ドル	国債証券	42 銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券	22 銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券	7 銘柄	100%	0.1%
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	15 銘柄	100%	0.3%
ノルウェー・クローネ	国債証券	10 銘柄	100%	0.1%
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	15 銘柄	100%	0.7%
ユーロ	国債証券	386 銘柄	100%	30.5%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「ダイワ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

	2023年9月7日現在 金額(円)	2024年9月9日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,028,627,020	4,514,428,375
投資証券 ※2	453,591,003,450	295,771,244,050
派生商品評価勘定	45,304,000	-
未収入金	660,039,743	717,868,796
未収配当金	6,082,827,389	4,662,699,802
差入委託証拠金	-	620,633,866
流動資産合計	465,407,801,602	306,286,874,889
資産合計	465,407,801,602	306,286,874,889
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	16,800,000
前受金	51,520,000	240,800,000
未払解約金	1,133,310,100	527,186,500
流動負債合計	1,184,830,100	784,786,500
負債合計	1,184,830,100	784,786,500
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	136,692,550,176	94,350,059,834
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	327,530,421,326	211,152,028,555
元本等合計	464,222,971,502	305,502,088,389
純資産合計	464,222,971,502	305,502,088,389
負債純資産合計	465,407,801,602	306,286,874,889

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 9 月 9 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	2023 年 9 月 7 日現在	2024 年 9 月 9 日現在
1. ※1 期首	2022 年 9 月 8 日	2023 年 9 月 8 日
期首元本額	145,851,213,788 円	136,692,550,176 円
期中追加設定元本額	22,487,516,622 円	7,339,411,864 円
期中一部解約元本額	31,646,180,234 円	49,681,902,206 円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ J-REIT オープン	4,291,859,572 円	3,578,820,300 円
ダイワ J-REIT オープン (毎月分配型)	118,848,053,138 円	74,819,549,026 円
ダイワ J-REIT オープン (年 1 回決算型)	438,308,348 円	672,034,345 円
DC ダイワ・ターゲットイヤー 2050	18,808,722 円	23,749,159 円
iFree J-REIT インデックス	612,932,660 円	641,563,821 円
iFree 8 資産バランス	2,227,129,451 円	3,035,489,065 円
ダイワ J-REIT オープン (奇数月決算型)	-円	102,242,888 円
DC ダイワ・ターゲットイヤー 2060	60,856 円	352,019 円

区分	2023年9月7日現在	2024年9月9日現在
DC・ダイワJ-REITオープン	5,459,557,070円	5,186,316,965円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	7,534,331円	8,750,476円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	7,941,275円	9,885,771円
ダイワ国内REITインデックス(投資一任専用)	2,604,622円	5,652,304円
ダイワ・ノーロードJ-REITファンド	99,989,261円	86,270,280円
ダイワファンドラップJ-REITインデックス	2,752,044,919円	3,999,594,498円
ダイワJ-REITインデックス(ダイワSMA専用)	544,924,556円	843,765,822円
ダイワファンドラップオンラインJ-REITインデックススタイル9(6資産分散・保守型)	-円	53,416円
スタイル9(6資産分散・バランス型)	-円	1,843,754円
スタイル9(6資産分散・積極型)	-円	1,002,513円
スタイル9(8資産分散・保守型)	-円	73,843円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	-円	1,367,883円
スタイル9(8資産分散・積極型)	-円	726,159円
ダイワ・インデックスセレクトJ-REIT	905,689,962円	721,235,838円
計	136,692,550,176円	94,350,059,834円
2. 期末日における受益権の総数	136,692,550,176口	94,350,059,834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 5,078,100,000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 755,000,000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2023年9月8日 至2024年9月9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	自 2023 年 9 月 8 日 至 2024 年 9 月 9 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、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2024 年 9 月 9 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	2023 年 9 月 7 日現在	2024 年 9 月 9 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	24,639,713,711	2,623,019,802
合計	24,639,713,711	2,623,019,802

(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	2023年9月7日現在				2024年9月9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	10,588,480,000	-	10,634,400,000	45,920,000	9,695,784,000	-	9,679,600,000	△16,184,000
合計	10,588,480,000	-	10,634,400,000	45,920,000	9,695,784,000	-	9,679,600,000	△16,184,000

(注)

1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2023年9月7日現在	2024年9月9日現在
1口当たり純資産額	3.3961円	3.2380円
(1万口当たり純資産額)	(33,961円)	(32,380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	6,505	754,580,000	
	サンケイリアルエステート	9,416	747,630,400	
	SOSILA 物流リート投	14,665	1,646,879,500	
	東海道リート投資法	5,021	565,866,700	
	日本アコモデーションファンド投資法人	10,149	6,566,403,000	
	森ヒルズリート	34,562	4,351,355,800	
	産業ファンド	53,814	6,468,442,800	
	アドバンス・レジデンス	28,886	9,546,823,000	
	A P I 投資法人	14,286	4,728,666,000	
	G L P 投資法人	98,726	13,071,322,400	
	コンフォリア・レジデンシャル	14,882	4,829,209,000	
	日本プロロジスリート	51,201	13,773,069,000	
	星野リゾート・リート	6,215	2,970,770,000	
	O n e リート投資法人	5,127	1,245,861,000	
	イオンリート投資	36,053	4,798,654,300	
	ヒューリックリート投資法	25,971	3,609,969,000	
	日本リート投資法人	9,547	2,983,437,500	
	積水ハウス・リート投資	88,319	7,162,670,900	
	トーセイ・リート投資法人	6,390	865,845,000	
	ヘルスケア&メディカル投資	7,247	850,797,800	
	サムティ・レジデンシャル	8,008	794,393,600	
	野村不動産マスターF	95,046	14,351,946,000	※
	いちごホテルリート投資	4,864	589,030,400	
	ラサールロジポート投資	37,654	5,376,991,200	
	スターアジア不動産投	54,160	2,859,648,000	
	マリモ地方創生リート	5,337	620,693,100	
	三井不ロジパーク	12,256	5,282,336,000	
	日本ホテル&レジデンシャル投資法人	4,744	332,554,400	
	投資法人みらい	40,473	1,758,551,850	
	三菱地所物流 REIT	10,149	3,785,577,000	
	CRE ロジスティクスファンド	12,653	1,881,501,100	
	ザイマックス・リート	5,032	570,628,800	
	タカラレーベン不動産投	16,595	1,457,041,000	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	12,879	1,573,813,800	
日本ビルファンド	34,288	23,075,824,000		
ジャパンリアルエステイト	30,191	17,842,881,000		
日本都市ファンド投資法人	148,073	14,866,529,200		
オリックス不動産投資	58,563	8,919,144,900		

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	日本プライムリアルティ	20,101	6,844,390,500	
	NTT 都市開発リート投資法人	29,874	3,414,598,200	
	東急リアル・エステート	19,706	2,886,929,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	21,703	2,183,321,800	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	65,747	8,961,316,100	
	森トラストリート投資法人	56,653	3,648,453,200	
	インヴィンシブル投資法人	161,937	9,376,152,300	
	フロンティア不動産投資	10,905	4,618,267,500	
	平和不動産リート	21,551	2,734,821,900	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	19,748	5,193,724,000	
	福岡リート投資法人	15,233	2,175,272,400	
	KDX 不動産投資法人	82,228	12,761,785,600	
	いちごオフィスリート投資法人	21,446	1,758,572,000	
	大和証券オフィス投資法人	12,177	3,732,250,500	
	阪急阪神リート投資法人	14,013	1,730,605,500	
	スタートアップリート投資法人	5,095	972,635,500	
	大和ハウスリート投資法人	44,079	10,340,933,400	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	107,977	7,493,603,800	
	大和証券リビング投資法人	43,410	4,367,046,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	25,238	3,099,226,400	
投資証券 合計			295,771,244,050	
合計			295,771,244,050	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

野村不動産マスターF 5,000 口

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況
 以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年9月7日現在 金額(円)	2024年9月9日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	250,359,084	434,799,819
コール・ローン	487,859,580	337,551,711
投資信託受益証券	1,047,552,784	1,922,377,070
投資証券	31,650,575,286	40,541,502,106
派生商品評価勘定	17,584,050	146,176,066
未収入金	3,460,947	2,774,040
未収配当金	47,957,524	62,361,722
差入委託証拠金	177,365,646	349,690,914
流動資産合計	33,682,714,901	43,797,233,448
資産合計	33,682,714,901	43,797,233,448
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	10,282,510	7,297,983
未払金	110,892,421	35,251,811
未払解約金	12,189,000	3,653,600
流動負債合計	133,363,931	46,203,394
負債合計	133,363,931	46,203,394
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	10,116,723,115	11,178,461,295
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	23,432,627,855	32,572,568,759
元本等合計	33,549,350,970	43,751,030,054
純資産合計	33,549,350,970	43,751,030,054
負債純資産合計	33,682,714,901	43,797,233,448

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 9 月 9 日
<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<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>
<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> <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>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023 年 9 月 7 日現在	2024 年 9 月 9 日現在
1. ※1 期首	2022 年 9 月 8 日	2023 年 9 月 8 日
期首元本額	8,693,888,748 円	10,116,723,115 円
期中追加設定元本額	2,169,522,241 円	2,114,341,286 円
期中一部解約元本額	746,687,874 円	1,052,603,106 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)	93,059,749 円	82,616,918 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)	1,565,308,473 円	2,096,952,787 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)	270,836,486 円	352,447,616 円
D - I ' s グローバル R E I T インデックス	1,764,216 円	1,480,147 円
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2050	16,424,213 円	19,599,696 円
i F r e e 外国 R E I T インデ ックス	725,696,920 円	640,252,524 円
i F r e e 8 資産バランス グローバル・リート・インデッ クスファンド (資産形成型)	2,247,903,767 円	2,473,064,144 円
グローバル・リート・インデッ クスファンド (毎月決算型)	377,923,581 円	380,225,890 円
グローバル・リート・インデッ クスファンド (毎月決算型)	247,997,588 円	234,595,966 円
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2060	711,792 円	3,804,284 円
D C ダイワ・グローバル R E I T インデックスファンド	3,992,230,488 円	4,219,241,496 円
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2030	7,671,771 円	7,239,335 円

区分	2023年9月7日現在	2024年9月9日現在
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	8,073,645 円	8,245,286 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)	2,409,588 円	4,525,126 円
ダイワバランスファンド2021-02(適格機関投資家専用)	144,489,423 円	130,015,618 円
スタイル9(6資産分散・保守型)	-円	27,608 円
スタイル9(6資産分散・バランス型)	-円	1,251,871 円
スタイル9(6資産分散・積極型)	-円	1,058,285 円
スタイル9(8資産分散・保守型)	-円	35,065 円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	-円	834,483 円
スタイル9(8資産分散・積極型)	-円	847,750 円
ダイワ・インデックスセレクトグローバルREIT	250,279,709 円	198,278,659 円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	67,445,400 円	63,434,254 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)	3,800,200 円	17,587,214 円
ダイワバランスファンド2023-08(適格機関投資家専用)	92,696,106 円	82,346,237 円
ダイワバランスファンド2024-01(適格機関投資家専用)	-円	79,777,774 円
ダイワバランスファンド2024-05(適格機関投資家専用)	-円	78,675,262 円
計	10,116,723,115 円	11,178,461,295 円
2. 期末日における受益権の総数	10,116,723,115 口	11,178,461,295 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2023年9月8日 至2024年9月9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	自 2023 年 9 月 8 日 至 2024 年 9 月 9 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、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2024 年 9 月 9 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	2023 年 9 月 7 日現在	2024 年 9 月 9 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	△23,714,486	158,456,830
投資証券	△941,817,480	6,174,110,709
合計	△965,531,966	6,332,567,539

(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	2023年9月7日現在				2024年9月9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	907,887,576	-	908,405,724	518,148	1,176,218,395	-	1,322,394,461	146,176,066
合計	907,887,576	-	908,405,724	518,148	1,176,218,395	-	1,322,394,461	146,176,066

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

2. 通貨関連

種類	2023年9月7日現在				2024年9月9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	531,618,376	-	538,401,768	6,783,392	366,909,447	-	359,611,464	△7,297,983
アメリカ・ドル	457,691,465	-	464,116,435	6,424,970	267,038,607	-	261,775,030	△5,263,577
ユーロ	73,926,911	-	74,285,333	358,422	99,870,840	-	97,836,434	△2,034,406
合計	531,618,376	-	538,401,768	6,783,392	366,909,447	-	359,611,464	△7,297,983

- (注) 1. 時価の算定方法
(1) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のよう
に評価しております。
① 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されてい
る場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2023年9月7日現在	2024年9月9日現在
1口当たり純資産額	3,3162円	3,9139円
(1万口当たり純資産額)	(33,162円)	(39,139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	141,800	13,463,910.000	
	アメリカ・ドル 小計			13,463,910.000 (1,922,377,070)	
投資信託受益証券 合計				1,922,377,070 [1,922,377,070]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	22,485	279,038.850	
		URBAN EDGE PROPERTIES	22,160	456,052.800	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	19,280	257,002.400	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	26,497	5,924,729.200	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	61,030	10,039,435.000	
		BXP INC	26,962	2,010,286.720	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	24,900	218,871.000	
		VORNADO REALTY TRUST	29,900	999,557.000	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	19,248	257,153.280	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13,056	606,712.320	
		UNITI GROUP INC	43,742	230,082.920	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	4,188	187,999.320	
		EQUITY RESIDENTIAL	64,557	4,799,167.380	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	42,198	589,084.080	
		EPR PROPERTIES	14,106	667,778.040	
		CITY OFFICE REIT INC	7,500	43,200.000	
		GLOBAL NET LEASE INC	35,794	313,197.500	
		EQUINIX INC	17,706	14,482,799.760	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	17,198	501,665.660	
		CHATHAM LODGING TRUST	8,953	72,877.420	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	11,143	1,106,388.470	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	23,793	359,512.230	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	4,348	70,524.560	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	10,300	29,458.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	131,986	2,208,125.780	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	60,189	2,371,446.600	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	23,216	112,829.760	
		RLJ LODGING TRUST	28,135	255,465.800	
FARMLAND PARTNERS INC	7,936	80,391.680			
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	12,353	146,259.520			

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		KIMCO REALTY CORP	124,985	2,873,405.150	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	11,295	103,236.300	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	70,803	1,270,913.850	
		WHITESTONE REIT	8,817	115,326.360	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	50,836	2,619,070.720	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	22,673	214,033.120	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	39,384	556,495.920	
		INVITATION HOMES INC	107,825	3,876,308.750	
		JBG SMITH PROPERTIES	15,961	273,890.760	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	13,294	254,181.280	
		CLIPPER REALTY INC	1,890	9,242.100	
		GLADSTONE LAND CORP	6,132	82,414.080	
		AMERICOLD REALTY TRUST	49,943	1,454,839.590	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	11,179	53,212.040	
		VICI PROPERTIES INC	195,300	6,536,691.000	
		BRT APARTMENTS CORP	2,049	37,189.350	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	5,239	632,190.130	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	32,795	1,052,063.600	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	6,717	152,946.090	
		BROADSTONE NET LEASE INC	35,219	642,746.750	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	19,716	125,985.240	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,928	232,306.560	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	42,031	828,431.010	
		PARAMOUNT GROUP INC	30,339	145,930.590	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	24,874	254,958.500	
		NETSTREIT CORP	13,691	230,967.170	
		CTO REALTY GROWTH INC	3,700	71,188.000	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	40,624	2,004,794.400	
		STAG INDUSTRIAL INC	34,077	1,333,433.010	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	2,066	38,944.100	
		POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	3,925	56,323.750	
		PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	22,863	847,760.040	
		ORION OFFICE REIT INC	9,048	36,915.840	
		DIGITAL CORE REIT UNITS	169,000	99,710.000	
		VENTAS INC	75,745	4,761,330.700	
		CARETRUST REIT INC	26,517	789,676.260	
		INVENTRUST PROPERTIES CORP	12,676	369,378.640	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	56,391	1,532,707.380	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,759	16,293.900	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	43,276	746,511.000	
		UMH PROPERTIES INC	12,339	241,721.010	
		CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	4,316	111,352.800	
		NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C	5,920	33,388.800	
		PEAKSTONE REALTY TRUST CLASS E	6,300	86,310.000	
		NET LEASE OFFICE PROPERTIES	2,529	74,731.950	
		AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	12,200	269,010.000	
		LINEAGE INC	10,500	850,605.000	
		IRON MOUNTAIN INC	54,813	6,000,927.240	
		TERRENO REALTY CORP	18,027	1,236,291.660	
		SUN COMMUNITIES INC	23,307	3,291,414.540	
		ACADIA REALTY TRUST	19,244	427,024.360	
		ALEXANDER' S INC	393	90,201.360	
		PROLOGIS INC	173,337	22,053,666.510	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	29,460	3,425,903.400	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	31,541	158,966.640	
		SAUL CENTERS INC	2,261	91,615.720	
		VERIS RESIDENTIAL INC	14,696	250,713.760	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	19,868	2,427,273.560	
		COUSINS PROPERTIES INC	28,416	805,025.280	
		SITE CENTERS CORP	8,422	480,138.220	
		EASTGROUP PROPERTIES INC	8,942	1,653,733.480	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,967	3,568,679.070	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	24,742	1,383,325.220	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	13,963	1,612,028.350	
		GETTY REALTY CORP	8,998	284,876.680	
		WELLTOWER INC	111,935	13,947,101.000	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	131,740	2,896,962.600	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	19,774	623,869.700	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	30,381	140,967.840	
		EQUITY COMMONWEALTH	20,057	406,154.250	
		KILROY REALTY CORP	19,967	695,250.940	
		LTC PROPERTIES INC	8,090	296,660.300	
		LXP INDUSTRIAL TRUST	55,032	555,823.200	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	21,791	3,476,318.230	
		MACERICH CO/THE	40,382	619,863.700	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	34,866	2,575,551.420	
		NATL HEALTH INVESTORS INC	8,056	663,089.360	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	34,242	1,649,437.140	
		REALTY INCOME CORP	163,016	10,172,198.400	
		COPT DEFENSE PROPERTIES TRUST	20,964	609,842.760	
		PUBLIC STORAGE	29,603	10,231,684.890	
		REGENCY CENTERS CORP	30,707	2,229,942.340	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		SAFEHOLD INC	8,205	200,940.450	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	20,435	638,389.400	
		SL GREEN REALTY CORP	12,062	755,443.060	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	40,467	129,899.070	
		UDR INC	56,660	2,495,873.000	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,229	99,502.560	
		WP CAREY INC	40,976	2,519,204.480	
		ELME	16,097	281,536.530	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4,700	3,976.200	
		AGREE REALTY CORP	18,786	1,409,701.440	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	46,253	1,833,468.920	
		CUBESMART	42,111	2,183,034.240	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	37,652	372,378.280	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	60,704	8,997,546.880	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	39,621	6,877,413.180	
		CENTERSPACE	2,759	204,745.390	
		KITE REALTY GROUP TRUST	41,107	1,055,216.690	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,892	76,638.000	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	7,428	112,459.920	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	39,319	326,347.700	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	112,379	554,028.470	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES C	16,005	26,248.200	
		DOUGLAS EMMETT INC	31,258	487,937.380	
		MANULIFE US REAL ESTATE INV	265,962	26,596.200	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	135,300	33,825.000	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	0.000	
		PRIME US REIT	101,420	18,661.280	
	アメリカ・ドル	小計		221,431,690.680 (31,616,016,795)	
	イギリス・ポンド	WAREHOUSE REIT PLC	77,771	68,049.620	
		HELICAL PLC	20,666	48,875.090	
		LIFE SCIENCE REIT PLC	61,021	20,136.930	
		ASSURA PLC	568,072	232,227.830	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	116,204	112,601.670	
		ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITE	67,467	37,848.980	
		CLS HOLDINGS PLC	22,950	20,723.850	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	104,221	77,123.540	
		REGIONAL REIT LTD	7,183	9,158.320	
		NEWRIVER REIT PLC	59,545	48,231.450	
		SHAFTESBURY CAPITAL PLC	376,124	563,057.620	
		CUSTODIAN REIT PLC	83,903	68,464.840	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		PRS REIT PLC/THE	95,537	91,524.440	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	78,863	69,793.750	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	62,933	41,346.980	
		TARGET HEALTHCARE REIT PLC	118,044	100,691.530	
		AEW UK REIT PLC	27,617	26,595.170	
		BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	133,520	126,576.960	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	237,187	180,499.300	
		URBAN LOGISTICS REIT PLC	90,888	109,065.600	
		HOME REIT PLC	117,587	11,182.520	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	144,750	951,007.500	
		SEGRO PLC	257,696	2,261,024.700	
		HAMMERSON PLC	733,072	214,057.020	
		UNITE GROUP PLC/THE	87,184	833,479.040	
		BRITISH LAND CO PLC	180,759	798,954.780	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	78,316	275,280.740	
		DERWENT LONDON PLC	21,624	516,813.600	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	254,364	253,982.450	
		WORKSPACE GROUP PLC	25,932	166,224.120	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	41,573	370,831.160	
		BIG YELLOW GROUP PLC	37,781	491,153.000	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	392,175	787,487.400	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	93,799	45,680.110	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	439,490	715,489.720	
		イギリス・ポンド 小計		10,745,241.330 (2,014,840,201)	
	イスラエル・シ ュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	125,212	218,870.570	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	40,780	297,286.200	
		REIT 1 LTD	35,212	520,785.480	
		イスラエル・シュケル 小計		1,036,942.250 (39,683,676)	
	オーストラリ ア・ドル	DEXUS/AU	212,807	1,576,899.870	
		HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	88,653	105,497.070	
		HMC CAPITAL LTD	47,711	396,001.300	
		ABACUS STORAGE KING STAPLED UNITS	106,601	134,850.260	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	66,132	181,863.000	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	274,625	109,850.000	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	105,525	335,569.500	
		RURAL FUNDS GROUP	72,888	147,233.760	
		WAYPOINT REIT	131,393	352,133.240	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	130,083	509,925.360	
		CENTURIA OFFICE REIT	77,754	90,972.180	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		CENTURIA CAPITAL GROUP	157,455	270,035.320	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	349,474	447,326.720	
		REGION GROUP	227,229	506,720.670	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	50,422	126,559.220	
		NATIONAL STORAGE REIT	252,075	612,542.250	
		DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	39,338	110,146.400	
		GDI PROPERTY GROUP	104,909	70,289.030	
		SCENTRE GROUP	1,026,952	3,594,332.000	
		ARENA REIT	70,268	283,882.720	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	38,140	132,727.200	
		BWP TRUST	105,500	379,800.000	
		GPT GROUP	379,010	1,917,790.600	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	101,171	371,297.570	
		MIRVAC GROUP	780,715	1,686,344.400	
		STOCKLAND	471,274	2,398,784.660	
		ABACUS GROUP UNIT	79,969	101,560.630	
		GOODMAN GROUP	341,947	11,352,640.400	
		VICINITY CENTRES	765,581	1,737,868.870	
		CHARTER HALL GROUP	93,585	1,459,926.000	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	73,337	382,819.140	
		オーストラリア・ドル 小計		31,884,189.340 (3,037,925,560)	
	カナダ・ドル	BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	8,400	28,140.000	
		NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	5,600	47,208.000	
		PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	9,341	140,862.280	
		PRO REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	4,400	23,936.000	
		BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST U	3,358	60,578.320	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,800	73,598.000	
		SLATE GROCERY REIT	5,500	70,125.000	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	11,000	226,270.000	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	3,400	55,692.000	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	23,500	118,205.000	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL ESTATE	1,060	11,903.800	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6,100	461,160.000	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	26,400	360,096.000	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	14,000	174,160.000	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	20,500	365,310.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		CHOICE PROPERTIES REIT	31,700	471,062.000	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	3,300	60,258.000	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	10,500	162,225.000	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	14,000	360,640.000	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	16,200	859,896.000	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	25,366	271,162.540	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	29,000	557,960.000	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	1,650	31,300.500	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,700	407,255.000	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	10,300	156,045.000	
		ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	12,400	208,444.000	
		カナダ・ドル 小計		5,763,492.440 (606,722,849)	
	シンガポール・ドル	KEPPEL DC REIT	262,783	575,494.770	
		AIMS APAC REIT	134,700	179,151.000	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERC	572,090	646,461.700	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	101,600	67,564.000	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	344,440	208,386.200	
		EC WORLD REIT	36,500	7,665.000	
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	704,077	2,048,864.070	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,011,822	2,165,299.080	
		SUNTEC REIT	438,100	547,625.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	660,400	924,560.000	
		KEPPEL REIT	439,100	406,167.500	
		CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	485,756	451,753.080	
		ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T	1,172,902	328,412.560	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	131,700	123,139.500	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	222,376	529,254.880	
		STARHILL GLOBAL REIT	273,900	139,689.000	
		CAPITALAND CHINA TRUST	227,842	168,603.080	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	75,700	292,202.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	409,369	1,015,235.120	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	451,684	636,874.440	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	200,000	128,000.000	
		PARAGON REIT	237,100	208,648.000	
		シンガポール・ドル 小計		11,799,049.980	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
				(1,292,113,963)	
	ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	157,936	184,785.120	
		KIWI PROPERTY GROUP LTD	314,982	303,957.630	
		GOODMAN PROPERTY TRUST	208,239	436,260.700	
		PRECINCT PROPERTIES GROUP	313,870	401,753.600	
	ニュージーランド・ドル 小計			1,326,757.050 (116,980,169)	
	ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	7,366	180,467.000	
		SHURGARD SELF STORAGE LTD	5,305	218,035.500	
		HAMBORNER REIT AG	12,056	79,207.920	
		WERELDHAVE NV	6,098	88,664.920	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	17,291	1,308,582.880	
		NSI NV	3,090	62,572.500	
		VASTNED RETAIL NV	3,081	75,022.350	
		ICADE	5,324	120,748.320	
		CARMILA	9,464	163,727.200	
		ALTAREA	777	81,274.200	
		GECINA SA	8,745	909,480.000	
		KLEPIERRE	33,231	934,455.720	
		COVIVIO	8,537	458,863.750	
		MERCIALYS	15,994	193,047.580	
		AEDIFICA	8,100	514,350.000	
		COFINIMMO	6,263	412,731.700	
		RETAIL ESTATES	2,081	137,554.100	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	29,997	738,526.140	
		CARE PROPERTY INVEST	6,301	91,112.460	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	5,665	196,858.750	
		MONTEA NV	3,050	239,425.000	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,930	17,290.350	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	8,412	67,968.960	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	48,722	291,844.780	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	67,596	776,678.040		
	CROMWELL REIT EUR	52,920	80,967.600		
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	73,078	63,797.090		
	ユーロ 小計			8,503,254.810 (1,345,470,009)	
	韓国・ウォン	SK REITS LTD	22,834	123,303,600.000	
		D&D PLATFORM REIT LTD	10,703	40,029,220.000	
		NH ALL ONE REIT LTD	6,454	24,041,150.000	
		KLI REIT LTD RIGTS	910	0.000	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	13,632	85,336,320.000	
		LOTTE REIT CO LTD	24,036	91,096,440.000	
		JR REIT XXVII	32,413	117,335,060.000	

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	9,157	43,083,685.000	
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	31,620	160,945,800.000	
	韓国・ウォン 小計			685,171,275.000 (73,107,775)	
	香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	444,000	421,800.000	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	181,000	338,470.000	
		FORTUNE REIT	294,000	1,211,280.000	
		PROSPERITY REIT	246,000	337,020.000	
		LINK REIT	505,200	18,793,440.000	
		CHAMPION REIT	368,000	669,760.000	
	香港・ドル 小計			21,771,770.000 (398,641,109)	
投資証券 合計				40,541,502,106 [40,541,502,106]	
合計				42,463,879,176 [42,463,879,176]	

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

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1 銘柄 投資証券 139 銘柄	5.7%	94.3%	79.0%
イギリス・ポンド	投資証券 35 銘柄	-%	100%	4.7%
イスラエル・シケル	投資証券 3 銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券 31 銘柄	-%	100%	7.2%
カナダ・ドル	投資証券 26 銘柄	-%	100%	1.4%
シンガポール・ドル	投資証券 22 銘柄	-%	100%	3.0%
ニュージーランド・ドル	投資証券 4 銘柄	-%	100%	0.3%
ユーロ	投資証券 27 銘柄	-%	100%	3.2%
韓国・ウォン	投資証券 9 銘柄	-%	100%	0.2%
香港・ドル	投資証券 6 銘柄	-%	100%	0.9%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「ダイワ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

	2023年9月7日現在 金額(円)	2024年9月9日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	409,520,505	195,343,382
国債証券	42,976,991,250	81,477,050,720
地方債証券	2,874,383,510	5,374,875,336
特殊債券	1,123,402,600	4,402,418,286
社債券	3,067,239,100	7,028,210,200
未収利息	102,169,203	202,543,354
前払費用	8,978,554	17,018,172
流動資産合計	50,562,684,722	98,697,459,450
資産合計	50,562,684,722	98,697,459,450
負債の部		
流動負債		
未払金	148,459,600	-
未払解約金	8,592,465	3,234,488
流動負債合計	157,052,065	3,234,488
負債合計	157,052,065	3,234,488
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	41,118,291,684	81,894,612,584
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	9,287,340,973	16,799,612,378
元本等合計	50,405,632,657	98,694,224,962
純資産合計	50,405,632,657	98,694,224,962
負債純資産合計	50,562,684,722	98,697,459,450

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 9 月 9 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	2023 年 9 月 7 日現在	2024 年 9 月 9 日現在
1. ※1 期首	2022 年 9 月 8 日	2023 年 9 月 8 日
期首元本額	32,762,371,290 円	41,118,291,684 円
期中追加設定元本額	9,116,937,425 円	42,482,462,228 円
期中一部解約元本額	761,017,031 円	1,706,141,328 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)	2,416,626,707 円	3,822,409,530 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)	-円	30,964,825,168 円
i F r e e 日本債券インデックス	3,448,681,548 円	2,772,696,062 円
i F r e e 8資産バランス	6,035,357,926 円	8,115,070,138 円
ダイワ・ライフ・バランス30	11,318,715,322 円	13,104,740,465 円
ダイワ・ライフ・バランス50	8,455,895,963 円	10,972,473,547 円
ダイワ・ライフ・バランス70	3,321,939,241 円	4,447,693,771 円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	1,865,214,837 円	2,203,900,623 円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	1,467,743,209 円	1,802,706,364 円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	585,459,112 円	741,243,964 円
ダイワつみたてインデックス日本債券	1,880,061,805 円	2,596,469,317 円
ダイワつみたてインデックスバ ランス30	48,091,318 円	55,133,049 円
ダイワつみたてインデックスバ ランス50	18,387,687 円	29,481,573 円

区分	2023年9月7日現在	2024年9月9日現在
ダイワつみたてインデックスバランス70	16,363,752円	24,911,566円
ダイワ世界バランスファンド40VA	194,853,512円	192,331,972円
ダイワ世界バランスファンド60VA	44,899,745円	48,525,475円
計	41,118,291,684円	81,894,612,584円
2. 期末日における受益権の総数	41,118,291,684口	81,894,612,584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2023年9月8日 至2024年9月9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	2024年9月9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	2023年9月7日現在	2024年9月9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	△660,695,950	△1,446,951,460
地方債証券	△15,731,358	△27,770,757
特殊債券	△7,754,000	△31,999,165
社債券	△29,829,700	△31,903,900
合計	△714,011,008	△1,538,625,282

（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

2023年9月7日現在	2024年9月9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）

	2023年9月7日現在	2024年9月9日現在
1口当たり純資産額	1.2259円	1.2051円
（1万口当たり純資産額）	（12,259円）	（12,051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	453 2年国債	260,000,000	259,259,000	
	455 2年国債	1,800,000,000	1,793,286,000	
	456 2年国債	500,000,000	498,530,000	
	457 2年国債	160,000,000	159,465,600	
	458 2年国債	780,000,000	778,284,000	
	459 2年国債	40,000,000	39,900,800	
	460 2年国債	250,000,000	249,735,000	
	461 2年国債	20,000,000	20,010,200	
	462 2年国債	50,000,000	50,022,000	
	463 2年国債	250,000,000	250,070,000	
	146 5年国債	540,000,000	538,520,400	
	147 5年国債	800,000,000	795,816,000	
	148 5年国債	1,500,000,000	1,490,070,000	
	149 5年国債	2,380,000,000	2,361,555,000	
	150 5年国債	1,350,000,000	1,338,106,500	
	151 5年国債	300,000,000	297,039,000	
	152 5年国債	130,000,000	129,025,000	
	153 5年国債	1,600,000,000	1,582,432,000	
	154 5年国債	2,180,000,000	2,159,791,400	
	155 5年国債	90,000,000	89,665,200	
	156 5年国債	680,000,000	675,267,200	
	157 5年国債	60,000,000	59,530,800	
	158 5年国債	1,620,000,000	1,601,710,200	
	159 5年国債	200,000,000	197,474,000	
	161 5年国債	400,000,000	397,920,000	
	162 5年国債	280,000,000	278,280,800	
	163 5年国債	1,400,000,000	1,396,948,000	
	164 5年国債	1,200,000,000	1,186,416,000	
	166 5年国債	320,000,000	319,059,200	
	168 5年国債	450,000,000	452,187,000	
	169 5年国債	500,000,000	500,220,000	
	171 5年国債	650,000,000	646,516,000	
	1 40年国債	30,000,000	32,920,200	
2 40年国債	48,000,000	50,535,360		
3 40年国債	19,000,000	19,877,040		
4 40年国債	54,000,000	56,114,640		
5 40年国債	61,000,000	60,516,270		
6 40年国債	268,000,000	258,898,720		
7 40年国債	190,000,000	174,716,400		

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	8 40 年国債	40,000,000	33,878,000	
	9 40 年国債	40,000,000	24,458,000	
	10 40 年国債	290,000,000	208,449,100	
	11 40 年国債	85,000,000	58,273,450	
	12 40 年国債	99,000,000	59,656,410	
	13 40 年国債	252,000,000	148,644,720	
	14 40 年国債	273,000,000	171,020,850	
	15 40 年国債	650,000,000	448,630,000	
	16 40 年国債	1,030,000,000	778,278,300	
	17 40 年国債	440,000,000	430,443,200	
	341 10 年国債	15,000,000	14,997,000	
	342 10 年国債	700,000,000	697,347,000	
	343 10 年国債	300,000,000	298,518,000	
	344 10 年国債	90,000,000	89,474,400	
	345 10 年国債	410,000,000	407,269,400	
	346 10 年国債	20,000,000	19,850,000	
	347 10 年国債	500,000,000	495,810,000	
	348 10 年国債	430,000,000	426,013,900	
	349 10 年国債	430,000,000	425,618,300	
	350 10 年国債	400,000,000	395,484,000	
	351 10 年国債	500,000,000	493,685,000	
	352 10 年国債	250,000,000	246,490,000	
	353 10 年国債	520,000,000	512,038,800	
	355 10 年国債	100,000,000	98,111,000	
	356 10 年国債	500,000,000	489,830,000	
	357 10 年国債	700,000,000	684,894,000	
	358 10 年国債	920,000,000	899,005,600	
	359 10 年国債	1,000,000,000	975,900,000	
	360 10 年国債	1,000,000,000	974,030,000	
	361 10 年国債	900,000,000	874,890,000	
	362 10 年国債	1,430,000,000	1,387,285,900	
	363 10 年国債	830,000,000	803,240,800	
	364 10 年国債	850,000,000	820,505,000	
	365 10 年国債	880,000,000	846,956,000	
	366 10 年国債	1,100,000,000	1,064,107,000	
	367 10 年国債	1,025,000,000	988,294,750	
	368 10 年国債	1,000,000,000	961,260,000	
	369 10 年国債	1,100,000,000	1,080,673,000	
	370 10 年国債	1,050,000,000	1,028,968,500	
	371 10 年国債	1,060,000,000	1,026,906,800	
	372 10 年国債	950,000,000	950,000,000	
	373 10 年国債	1,130,000,000	1,106,654,200	
	374 10 年国債	750,000,000	745,710,000	
	375 10 年国債	600,000,000	611,328,000	
	2 30 年国債	9,000,000	9,909,270	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	3 30 年国債	4,000,000	4,398,360	
	4 30 年国債	8,000,000	9,145,360	
	5 30 年国債	8,000,000	8,848,880	
	6 30 年国債	9,000,000	10,124,190	
	7 30 年国債	12,000,000	13,464,960	
	10 30 年国債	25,000,000	25,731,750	
	11 30 年国債	9,000,000	9,707,940	
	12 30 年国債	11,000,000	12,240,030	
	13 30 年国債	11,000,000	12,145,100	
	14 30 年国債	22,000,000	25,081,540	
	15 30 年国債	21,000,000	24,138,030	
	16 30 年国債	26,000,000	29,908,580	
	17 30 年国債	17,000,000	19,407,710	
	18 30 年国債	20,000,000	22,637,000	
	19 30 年国債	15,000,000	16,971,000	
	20 30 年国債	16,000,000	18,438,560	
	21 30 年国債	16,000,000	18,107,840	
	22 30 年国債	17,000,000	19,604,400	
	23 30 年国債	16,000,000	18,460,160	
	24 30 年国債	15,000,000	17,313,300	
	25 30 年国債	17,000,000	19,227,170	
	26 30 年国債	32,000,000	36,558,720	
	27 30 年国債	32,000,000	36,915,200	
	28 30 年国債	34,000,000	39,210,840	
	29 30 年国債	43,000,000	48,959,800	
	30 30 年国債	56,000,000	62,917,680	
	31 30 年国債	76,000,000	84,175,320	
	32 30 年国債	115,000,000	128,689,600	
	33 30 年国債	95,000,000	101,993,900	
	34 30 年国債	110,000,000	120,996,700	
	35 30 年国債	120,000,000	128,050,800	
	36 30 年国債	138,000,000	146,860,980	
	37 30 年国債	165,000,000	172,528,950	
	38 30 年国債	250,000,000	256,410,000	
	39 30 年国債	105,000,000	109,153,800	
	40 30 年国債	80,000,000	81,737,600	
	41 30 年国債	80,000,000	80,291,200	
	42 30 年国債	200,000,000	200,146,000	
	43 30 年国債	335,000,000	334,256,300	
	44 30 年国債	155,000,000	154,421,850	
	45 30 年国債	200,000,000	191,942,000	
	46 30 年国債	170,000,000	162,722,300	
	47 30 年国債	355,000,000	345,045,800	
	48 30 年国債	170,000,000	158,899,000	
	49 30 年国債	340,000,000	316,880,000	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	50 30 年国債	270,000,000	222,083,100	
	51 30 年国債	350,000,000	255,290,000	
	52 30 年国債	300,000,000	228,222,000	
	53 30 年国債	230,000,000	178,314,400	
	54 30 年国債	290,000,000	234,322,900	
	55 30 年国債	390,000,000	313,821,300	
	56 30 年国債	160,000,000	128,211,200	
	57 30 年国債	235,000,000	187,530,000	
	58 30 年国債	390,000,000	309,925,200	
	59 30 年国債	185,000,000	142,906,950	
	60 30 年国債	250,000,000	201,767,500	
	61 30 年国債	260,000,000	198,910,400	
	62 30 年国債	265,000,000	191,406,850	
	63 30 年国債	240,000,000	167,635,200	
	64 30 年国債	250,000,000	173,585,000	
	65 30 年国債	275,000,000	189,964,500	
	66 30 年国債	350,000,000	240,345,000	
	67 30 年国債	290,000,000	209,542,400	
	68 30 年国債	255,000,000	183,227,700	
	69 30 年国債	261,000,000	191,973,330	
	70 30 年国債	391,000,000	286,286,290	
	71 30 年国債	280,000,000	204,072,400	
	72 30 年国債	250,000,000	181,367,500	
	73 30 年国債	340,000,000	245,524,200	
	74 30 年国債	335,000,000	262,040,350	
	75 30 年国債	360,000,000	303,354,000	
	76 30 年国債	220,000,000	189,648,800	
	77 30 年国債	245,000,000	221,301,150	
	78 30 年国債	180,000,000	154,627,200	
	79 30 年国債	250,000,000	203,792,500	
	80 30 年国債	230,000,000	216,968,200	
	81 30 年国債	300,000,000	269,625,000	
	82 30 年国債	350,000,000	329,360,500	
	83 30 年国債	110,000,000	113,050,300	
	85 20 年国債	31,000,000	31,824,290	
	86 20 年国債	6,000,000	6,177,720	
	87 20 年国債	35,000,000	35,983,500	
	88 20 年国債	33,000,000	34,120,020	
	89 20 年国債	15,000,000	15,482,700	
	92 20 年国債	60,000,000	62,314,800	
	93 20 年国債	18,000,000	18,721,620	
	94 20 年国債	45,000,000	46,916,550	
	95 20 年国債	30,000,000	31,568,700	
	96 20 年国債	63,000,000	65,948,400	
	97 20 年国債	25,000,000	26,346,000	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	98 20年国債	64,000,000	67,253,760	
	99 20年国債	53,000,000	55,904,930	
	100 20年国債	35,000,000	37,175,600	
	101 20年国債	18,000,000	19,243,980	
	102 20年国債	10,000,000	10,733,800	
	103 20年国債	21,000,000	22,462,860	
	104 20年国債	64,000,000	67,982,720	
	105 20年国債	38,000,000	40,496,220	
	106 20年国債	16,000,000	17,114,240	
	107 20年国債	40,000,000	42,760,000	
	108 20年国債	68,000,000	72,121,480	
	109 20年国債	60,000,000	63,786,000	
	110 20年国債	27,000,000	28,942,650	
	111 20年国債	35,000,000	37,783,550	
	113 20年国債	70,000,000	75,511,100	
	114 20年国債	45,000,000	48,713,850	
	115 20年国債	42,000,000	45,682,140	
	116 20年国債	27,000,000	29,466,990	
	117 20年国債	77,000,000	83,621,230	
	118 20年国債	13,000,000	14,090,570	
	119 20年国債	23,000,000	24,664,510	
	120 20年国債	98,000,000	103,992,700	
	123 20年国債	42,000,000	46,005,540	
	124 20年国債	100,000,000	108,929,000	
	125 20年国債	25,000,000	27,615,000	
	126 20年国債	21,000,000	22,924,650	
	127 20年国債	110,000,000	119,388,500	
	128 20年国債	32,000,000	34,787,520	
	129 20年国債	95,000,000	102,656,050	
	130 20年国債	110,000,000	119,021,100	
	131 20年国債	150,000,000	161,289,000	
	132 20年国債	25,000,000	26,908,000	
	133 20年国債	150,000,000	162,492,000	
	134 20年国債	15,000,000	16,266,300	
	135 20年国債	20,000,000	21,544,800	
	136 20年国債	180,000,000	192,540,600	
	137 20年国債	18,000,000	19,398,780	
	139 20年国債	250,000,000	267,477,500	
	140 20年国債	100,000,000	107,805,000	
	141 20年国債	140,000,000	151,011,000	
	142 20年国債	210,000,000	228,160,800	
	143 20年国債	100,000,000	107,066,000	
	144 20年国債	50,000,000	53,110,500	
	145 20年国債	40,000,000	43,146,400	
	146 20年国債	160,000,000	172,486,400	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	147 20年国債	350,000,000	373,856,000	
	148 20年国債	290,000,000	306,875,100	
	149 20年国債	110,000,000	116,242,500	
	150 20年国債	350,000,000	365,925,000	
	151 20年国債	190,000,000	194,628,400	
	152 20年国債	500,000,000	510,980,000	
	153 20年国債	400,000,000	411,872,000	
	154 20年国債	380,000,000	386,585,400	
	155 20年国債	530,000,000	526,793,500	
	156 20年国債	480,000,000	444,724,800	
	157 20年国債	510,000,000	459,275,400	
	158 20年国債	680,000,000	632,291,200	
	159 20年国債	530,000,000	496,769,000	
	160 20年国債	780,000,000	737,131,200	
	161 20年国債	290,000,000	269,528,900	
	162 20年国債	540,000,000	499,834,800	
	163 20年国債	300,000,000	276,534,000	
	164 20年国債	600,000,000	543,228,000	
	165 20年国債	550,000,000	495,407,000	
	166 20年国債	620,000,000	571,454,000	
	167 20年国債	300,000,000	267,555,000	
	168 20年国債	540,000,000	471,976,200	
	169 20年国債	350,000,000	299,561,500	
	170 20年国債	530,000,000	451,173,100	
	171 20年国債	400,000,000	338,656,000	
	172 20年国債	510,000,000	436,335,600	
	173 20年国債	400,000,000	340,396,000	
	174 20年国債	650,000,000	550,147,000	
	175 20年国債	370,000,000	316,827,300	
	176 20年国債	595,000,000	507,142,300	
	177 20年国債	340,000,000	283,413,800	
	178 20年国債	600,000,000	506,256,000	
	179 20年国債	510,000,000	428,267,400	
	180 20年国債	650,000,000	572,949,000	
	181 20年国債	310,000,000	276,901,300	
	182 20年国債	510,000,000	469,720,200	
	183 20年国債	410,000,000	395,604,900	
	184 20年国債	420,000,000	383,955,600	
	185 20年国債	490,000,000	446,247,900	
	186 20年国債	530,000,000	515,499,200	
	187 20年国債	380,000,000	356,375,400	
	188 20年国債	400,000,000	393,556,000	
	189 20年国債	300,000,000	309,336,000	
	1 フィリピン共和国	100,000,000	98,974,100	
国債証券 合計			81,477,050,720	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
地方債証券	751 東京都公債	100,000,000	99,935,600	
	797 東京都公債	100,000,000	97,203,900	
	28 東京都 20年	100,000,000	106,208,400	
	27-15 北海道公債	100,000,000	99,663,600	
	3-5 北海道公債	100,000,000	96,456,200	
	222 神奈川県公債	100,000,000	99,258,900	
	262 神奈川県公債	300,000,000	303,483,600	
	401 大阪府公債	100,000,000	100,089,900	
	457 大阪府公債	100,000,000	97,040,800	
	26-5 京都府 20年	100,000,000	104,303,000	
	6-1 京都府 5年	200,000,000	199,103,800	
	11 兵庫県公債 20年	100,000,000	106,994,500	
	28-1 静岡県公債	100,000,000	99,434,200	
	8 静岡県 20年	100,000,000	107,974,900	
	5-3 愛知県公債	100,000,000	98,555,400	
	6-1 愛知県 5年	300,000,000	298,605,300	
	24-1 広島県 20年	100,000,000	107,076,100	
	25-1 広島県 20年	100,000,000	107,433,900	
	1 埼玉県 15年	100,000,000	101,696,500	
	9 埼玉県 20年	100,000,000	108,560,700	
	22-1 福岡県 15年	100,000,000	101,513,500	
	29-6 千葉県公債	100,000,000	99,116,600	
	30-3 新潟県公債	134,160,000	131,639,536	
	3-1 茨城県公債	100,000,000	96,487,500	
	151 共同発行地方	100,000,000	100,081,100	
	168 共同発行地方	100,000,000	99,292,600	
	170 共同発行地方	200,000,000	198,322,400	
	206 共同発行地方	200,000,000	194,547,600	
	244 共同発行地方	100,000,000	97,612,900	
	255 共同発行地方	300,000,000	302,732,700	
	3-3 堺市公債	100,000,000	95,788,600	
	4-3 長崎県公債	100,000,000	96,994,000	
	27-1 滋賀県公債	100,000,000	100,082,400	
	2-1 静岡市公債	100,000,000	96,947,000	
	6-1 大阪市 5年	200,000,000	199,945,000	
	6-2 大阪市公債	200,000,000	200,389,800	
	11 名古屋市 20年	100,000,000	107,907,200	
	10 京都市 20年	100,000,000	107,665,300	
	24-3 神戸市 20年	100,000,000	106,565,100	
	2-2 横浜市公債	100,000,000	97,100,600	
6 札幌市 20年	100,000,000	107,747,700		
2-1 千葉市公債	100,000,000	97,317,000		
地方債証券 合計			5,374,875,336	
特殊債券	47 日本政策投資 CO	100,000,000	101,682,700	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	174 日本政策投資	100,000,000	97,322,000	
	184 日本政策投資	200,000,000	198,468,000	
	79 政保道路機構	100,000,000	107,012,900	
	81 政保道路機構	100,000,000	107,120,900	
	97 政保道路機構	100,000,000	107,913,100	
	143 政保道路機構	200,000,000	215,335,800	
	235 政保道路機構	100,000,000	101,892,100	
	261 政保道路機構	100,000,000	100,002,300	
	321 政保道路機構	100,000,000	99,046,600	
	397 政保道路機構	100,000,000	97,332,900	
	478 政保道路機構	300,000,000	303,223,200	
	23 地方公共団 20	100,000,000	106,272,700	
	F163 地方公共団体	100,000,000	101,662,400	
	F168 地方公共団体	200,000,000	207,100,400	
	3 地方公共団 15 年	100,000,000	102,340,700	
	F231 地方公共団体	100,000,000	102,682,200	
	129 地方公共団体	100,000,000	96,844,100	
	F568 地方公共団体	300,000,000	273,610,200	
	95 日本政策金融	300,000,000	298,120,500	
	4 国際協力銀行 CO	100,000,000	99,925,300	
	127 都市再生	100,000,000	99,054,400	
	80 住宅支援機構	100,000,000	102,092,300	
	47 住宅機構 RMBS	173,712,000	178,923,360	
	92 住宅機構 RMBS	80,662,000	79,177,819	
	100 住宅機構 RMBS	49,605,000	48,677,386	
	120 住宅機構 RMBS	920,290,000	869,582,021	
特殊債券	合計		4,402,418,286	
社債券	4 香港上海銀行	100,000,000	99,888,100	
	33 首都高速道路	300,000,000	298,314,000	
	30 阪神高速道路	200,000,000	198,681,000	
	20 成田国際空港	100,000,000	99,038,800	
	111 東日本高速道	300,000,000	298,870,500	
	101 中日本高速道	200,000,000	198,436,400	
	88 西日本高速道	300,000,000	301,259,700	
	32 大和ハウス工業	100,000,000	99,361,000	
	22 積水ハウス	100,000,000	98,603,900	
	11 サントリーホールディング	100,000,000	98,737,900	
	3 伊藤園	100,000,000	99,100,200	
	11 ヒューリツク	100,000,000	99,362,600	
	29 東急不動産 HD	100,000,000	98,430,900	
	14 セブンアンドアイ	100,000,000	99,429,200	
	18 セブンアンドアイ	100,000,000	99,878,800	
	35 東レ	100,000,000	100,128,800	
	57 三井化学	200,000,000	198,529,400	
	16 武田薬品	100,000,000	95,194,500	

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
	32 住友電工	100,000,000	98,303,400	
	16 クボタ	100,000,000	99,226,500	
	17 パナソニック	100,000,000	99,453,000	
	40 ソニーG	100,000,000	99,474,300	
	31 トヨタ自動車	100,000,000	97,591,200	
	6 楽天カード	100,000,000	95,645,800	
	4 オリックス銀行	100,000,000	99,901,800	
	26 りそなホールディング	100,000,000	98,894,200	
	36 芙蓉総合リース	100,000,000	99,280,800	
	39 芙蓉総合リース	200,000,000	198,211,800	
	5 NTTファイナンス	100,000,000	95,278,300	
	33 NTTファイナンス	200,000,000	201,819,000	
	58 日産フィナンシャル	200,000,000	198,630,800	
	81 ホンダファイナンス	100,000,000	98,826,100	
	102 トヨタファイナンス	100,000,000	99,383,300	
	103 トヨタファイナンス	200,000,000	198,732,400	
	42 リコーリース	100,000,000	99,062,100	
	214 オリックス	100,000,000	96,241,900	
	1 SOMPOHD	100,000,000	99,228,800	
	7 三井住友海上	100,000,000	99,031,400	
	82 三井不動産	100,000,000	98,443,400	
	80 三菱地所	100,000,000	104,046,600	
	143 三菱地所	100,000,000	97,711,700	
	55 西日本鉄道	200,000,000	198,375,600	
	20 三菱倉庫	100,000,000	98,883,600	
	34 KDDI	100,000,000	100,660,900	
	9 ソフトバンク	100,000,000	98,362,300	
	46 光通信	100,000,000	99,158,400	
	566 中部電力	200,000,000	196,065,200	
	448 中国電力	100,000,000	97,157,000	
	563 東北電力	200,000,000	195,879,200	
	489 九州電力	100,000,000	97,498,900	
	87 電源開発	100,000,000	97,791,300	
	16 JERA	100,000,000	99,338,400	
	65 東京瓦斯	100,000,000	96,403,400	
	50 大阪瓦斯	100,000,000	98,841,500	
	60 ソフトバンクグループ	100,000,000	100,130,200	
社債券 合計			7,028,210,200	
合計			98,282,554,542	

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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2024年9月30日

I 資産総額	79,967,095,741 円
II 負債総額	41,274,702 円
III 純資産総額 (I - II)	79,925,821,039 円
IV 発行済数量	44,072,626,013 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.8135 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9月30日

I 資産総額	398,553,175,624 円
II 負債総額	25,107,870,223 円
III 純資産総額 (I - II)	373,445,305,401 円
IV 発行済数量	192,262,079,386 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.9424 円

(参考) ダイワJ-REITマザーファンド

純資産額計算書

2024年9月30日

I 資産総額	299,612,697,372 円
II 負債総額	894,185,578 円
III 純資産総額 (I - II)	298,718,511,794 円
IV 発行済数量	92,817,045,770 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	3.2184 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9月30日

I 資産総額	98,991,196,872 円
II 負債総額	106,563,138 円
III 純資産総額 (I - II)	98,884,633,734 円
IV 発行済数量	81,902,375,883 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.2073 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9月30日

I 資産総額	40,863,588,414 円
II 負債総額	923,163,314 円
III 純資産総額 (I - II)	39,940,425,100 円
IV 発行済数量	14,431,320,714 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	2.7676 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9月30日

I 資産総額	600,705,183,194 円
II 負債総額	416,155,514 円
III 純資産総額 (I - II)	600,289,027,680 円
IV 発行済数量	93,342,780,153 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	6.4310 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9月30日

I 資産総額	45,588,550,050 円
II 負債総額	48,925,650 円
III 純資産総額 (I - II)	45,539,624,400 円
IV 発行済数量	11,279,170,523 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	4.0375 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9月30日

I 資産総額	49,272,056,398 円
II 負債総額	73,854,759 円
III 純資産総額 (I - II)	49,198,201,639 円
IV 発行済数量	26,310,903,931 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	1.8699 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9月30日

I 資産総額	320,792,787,798 円
II 負債総額	149,725,141 円
III 純資産総額 (I - II)	320,643,062,657 円
IV 発行済数量	89,669,196,318 口
V 1 単位当たり純資産額 (III / IV)	3.5758 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 9 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9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	88	345,346
追加型株式投資信託	799	29,337,134
株式投資信託 合計	887	29,682,480
単位型公社債投資信託	83	153,891
追加型公社債投資信託	14	1,422,977
公社債投資信託 合計	97	1,576,868
総合計	984	31,259,348

3 【委託会社等の経理状況】

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

独立監査人の監査報告書

2024年5月27日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRL データは監査の対象には含まれていません。

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

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

(単位:百万円)

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

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

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

(単位:百万円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 収益及び費用の計上基準

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

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

(重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

(表示方法の変更)

(損益計算書関係)

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

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

(貸借対照表関係)

※1 有形固定資産の減価償却累計額

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

※2 関係会社項目

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

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

3 保証債務

前事業年度 (2023年3月31日)

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

当事業年度 (2024年3月31日)

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

(i) 為替変動リスクの管理

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

(ii) 価格変動リスクの管理

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

②信用リスクの管理

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

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

前事業年度（2023年3月31日）

（1）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

当事業年度（2024年3月31日）

（1）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

（2）時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

（注1）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

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

（単位：百万円）

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度 (2023年3月31日)

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

当事業年度 (2024年3月31日)

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

2. その他有価証券

前事業年度 (2023年3月31日)

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

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

当事業年度 (2024年3月31日)

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

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(注) その他には、臨時に支払った割増退職金等を含んでおります。

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

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

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

前事業年度（2023年3月31日）

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

当事業年度（2024年3月31日）

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

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

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

(収益認識関係)

(1) 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

(2) 収益を理解するための基礎となる情報

(重要な会計方針)の4.収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2. 親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

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

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

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

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

(重要な後発事象)

(株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行)

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

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

4 【利害関係人との取引制限】

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

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

5 【その他】

- a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項
2024年5月15日、株式会社かんぽ生命保険と資本業務提携を締結し、本提携に基づき2024年10月1日、かんぽ生命保険を引き受け先とする第三者割当増資を実施いたしました。
- b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実
訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

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」といふことがあります。以下同じ。）等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（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せん。

(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にあっても、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