

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)

2025年12月2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2025年12月1日に関東財務局長に提出しており、2025年12月2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 佐野 径 |
| 本店の所在の場所 | 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号 |
| 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 Free 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】

2025年12月2日から2026年6月1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 一般 大型株 中小型株 | 年1回 | グローバル (含む日本) | | |
| 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 () | 年2回 年4回 年6回 (隔月) | 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) | ファミリー ファンド | あり () |
| 不動産投信 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)) | 年12回 (毎月) | | ファンド・オブ・ ファンズ | なし |
| 資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型 | 日々 その他 () | エマージング | | |

(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・マネジメント・ファンド) | 「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMF |
| | MRF(マネー・リザーブ・ファンド) | 「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRF |
| | ETF | 投資信託及び投資法人に関する法律施行令(平成12年政令480号)第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法(昭和32年法律第26号)第9条の4の2に規定する上場証券投資信託 |
| 補足分類 | インデックス型 | 目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの |
| | 特殊型 | 目論見書等において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの |

(注2) 属性区分の定義

| | | | |
|------------|----|-------|---|
| 投資対象 資産 | 株式 | 一般 | 大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの |
| | | 大型株 | 目論見書等において、主として大型株に投資する旨の記載があるもの |
| | | 中小型株 | 目論見書等において、主として中小型株に投資する旨の記載があるもの |
| 債券 | 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、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの |
| 対象インデックス | 日経 225 | 目論見書等において、日経 225 に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの |
| | TOPIX | 目論見書等において、TOPIX に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの |
| | その他の指数 | 目論見書等において、上記以外の指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの |
| 特殊型 | ブル・ベア型 | 目論見書等において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行なうとともに各種指標・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。

<ファンドの特色>

シンプル
& イージー

インデックスってなに?

無料
& ロー

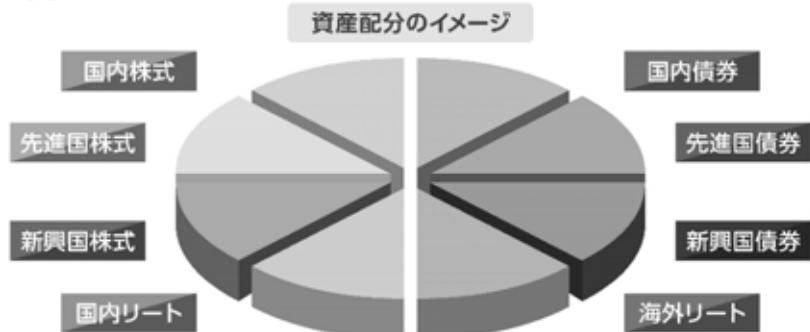
費用はどれくらいかかるのかな?

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？

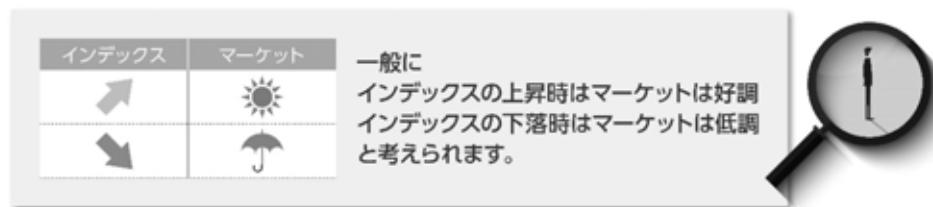


「インデックス」とは

いふなれば「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。



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。

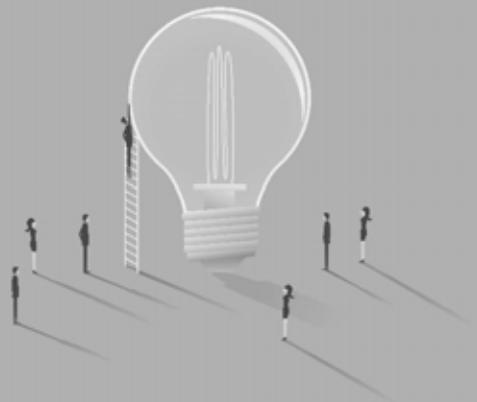
■対象インデックスについて

| 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コクサイ指數(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指數(配当込み) |
| 国内債券 | NOMURA-BPI総合指數 | 海外リート | S&P先進国REIT指數(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

| 購入時 | 保有期間中 | 売却時 |
|---|---|--|
| 購入時手数料 購入時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供等に対するものです。 | 運用管理費用（信託報酬） ファンドの運用・管理等に対するものです。 | 換金時手数料 信託財産留保額 換金する際に必要な費用等です。 |
| 当ファンドは | | |
| 無料 | 低水準 | 無料 |

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)が変わらなかつたと仮定した場合の1年間にかかる費用はおよそ…

$$\begin{array}{l} \text{Aさんの保有残高} \quad \times \quad \text{運用管理費用の料率} \\ \boxed{10万円} \quad \times \quad \boxed{0.242\%} \\ \hline \text{1年間にかかる運用管理費用} \\ \boxed{242円(税込)} \end{array}$$

※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)

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

配当込みTOPIXの指数值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、指数值の公表、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、同指数の指数值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社(FTSE International Limited)による基準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、銘柄の選定およびウェイト付けを行なう指數です。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ありません。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值について何ら保証や表明を行うことはございません。当該指數はまた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、指數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指数の指値および同指値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、指値の算出、指値の公表、利用など同指値に関するすべての権利・ノウハウおよび同指値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、同指値の指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。

●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プ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、遗漏、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ないます。
ファミリーファンド方式とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をまとめてペピーファンド（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とき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、「ファンドの特色」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、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など |
| ↑↓※1 | 収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※3） |
| 委託会社 | 大和アセットマネジメント株式会社 当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（※2）の委託者であり、次の業務を行ないます。 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、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充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ないます。) |

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は、自動的に再投資されます。

※1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。

※2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。

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

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

<委託会社の概況（2025年9月末日現在）>

・資本金の額 414億2,454万1,896円

・沿革

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

・大株主の状況

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

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、それぞれかつて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】

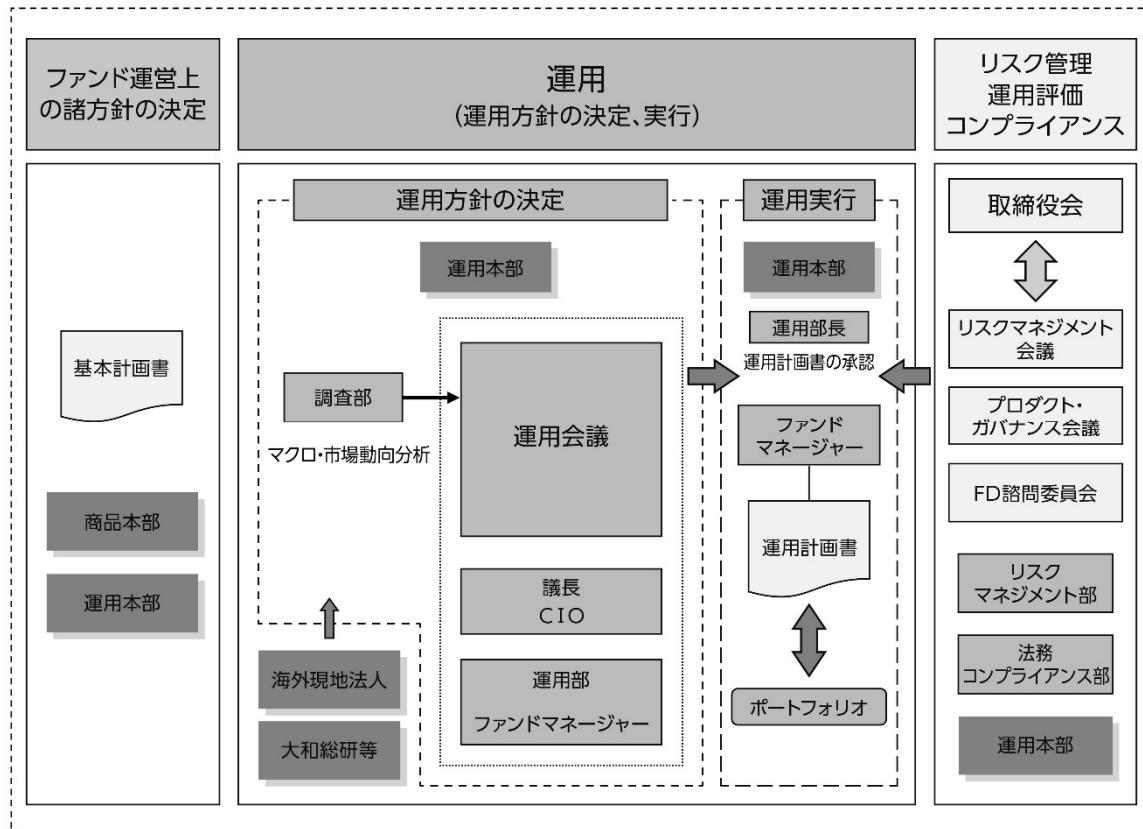
- ① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
 - イ. 有価証券
 - ロ. 約束手形
 - ハ. 金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
- イ. 為替手形
- ② 委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1.から8.までに掲げる親投資信託（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券、ならびに次の9.から12.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-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2025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、分配を行なわ

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トジャー、債券等エクスポートジャーおよびデリバティブ等エクスポート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（一部解約に伴う支払資金の手当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を目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

ロ. 一部解約に伴う支払資金の手当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。

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

ものをいいます。)

14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
19. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

- 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D R（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E T F（上場投資信託証券）
- ② 投資態度
イ. 主として、新興国の株式（D R（預託証券）を含みます。以下同じ。）（※）に投資し、

投資成果を FTSE RAFI エマージング インデックス（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

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

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

13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. 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。）
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ます。）
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（B P I）

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

② 投資態度

イ. 主としてわが国の公社債等に投資しベンチマーク（NOMURA-B P I 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

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

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書
 2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 4 号で定めるものをいいます。）
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 6 号で定めるものをいいます。）
 8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 7 号で定めるものをいいます。）
 9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品

取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)

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

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って金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
18. 外国の者に対する権利で前17.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書ならびに前8.および前13.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券ならびに前10.の証券のうち投資法人債券ならびに前8.および前13.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前9.の証券および前10.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

(3) 主な投資制限

① 株式

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

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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

⑥ 金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

ハ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.に掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。）の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

ホ. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。

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

7. ダイワJ-REITマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

※金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号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できます。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、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、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号口に掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。）および外国の金融商品取引所におけるこの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

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

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す。

ロ. 組入銘柄はベンチマーク構成銘柄とし、不動産投資信託証券の組入比率を高位に保ちます。

ハ. 運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することができます。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、上記の運用を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、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. 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ができるものとします。
 - ④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
 - ⑤ 先物取引
- 委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。）および外国の金融商品取引所におけるこの取引と類似の取引を行なうことの指図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、よろしくお願ひ申上げます。

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、倒産等に陥つ

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、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

- ・リートの収益は、所有する不動産から得られる賃料収入がその大半を占めます。したがって、賃料水準や入居率の低下等により賃料収入が減少した場合には、リートの収益が悪化し、価格や配当が下落することが考えられます。

- ・リートの資産価値は、所有する不動産の評価等により変動します。市況の悪化、不動産の老朽化等によってリートの資産価値が低下した場合には、価格が下落することがあります。なお、実物資産である不動産には、人的災害、自然災害等に伴って大きな損害が発生する可能性もあり、このような場合、リートの価格が大幅に下落することも想定されます。

- ・リートでは、投資資金を調達するために金融機関等から借り入れを行なうことがあります。したがって、金利上昇局面において金利負担等が増加し、収益の悪化要因となることが考えられます。

- ・法人形態のリートでは、経営陣の運営如何によっては収益や財務内容が著しく悪化する可能性があります。リートが倒産等に陥り、投資資金が回収できなくなることもあります。

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

- ・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リートの価格や配当が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けを中止すること、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けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受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。

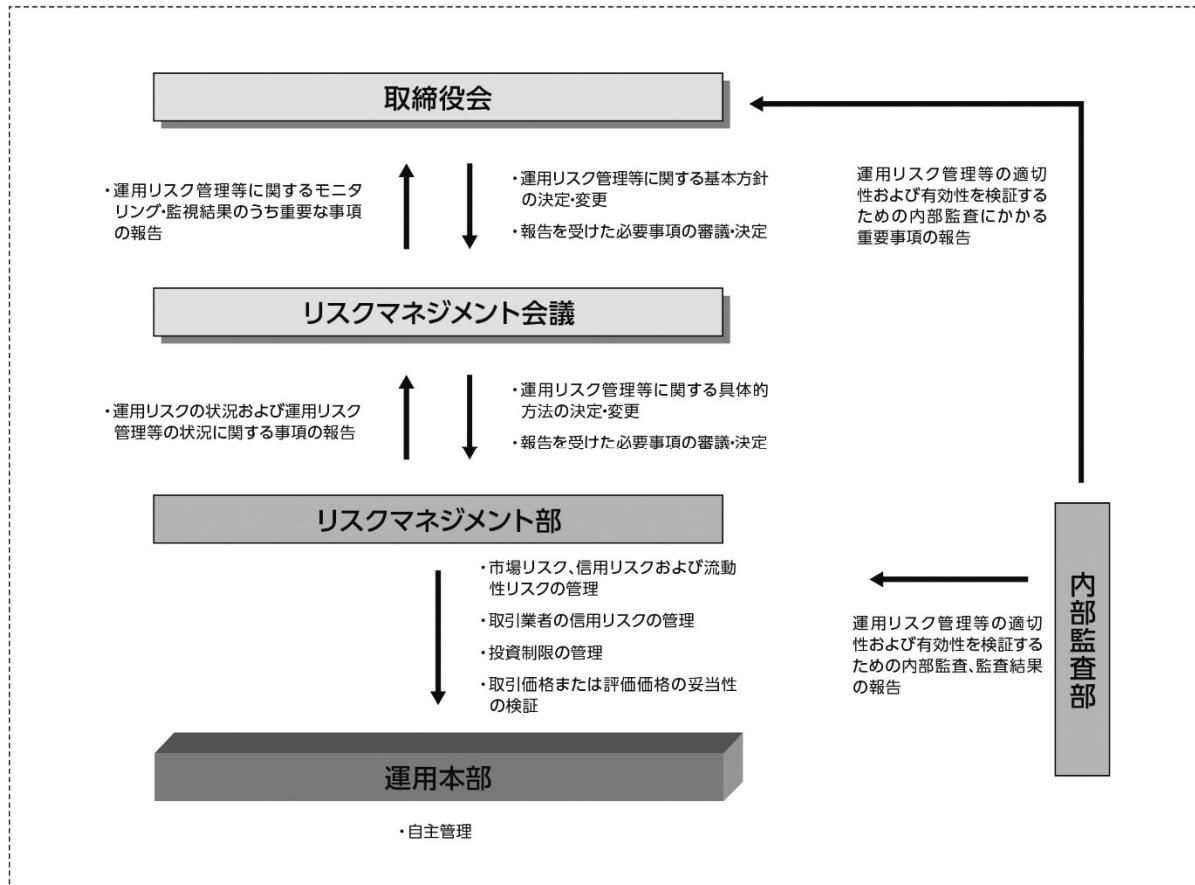
※ 流動性リスクに関する事項

- 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・検証などを行なっています。
- 取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

参考情報

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



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

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

※指標について

- 配当込みTOPIXの指標値および同指標にかかる標準または商標は、株式会社JPX研究所または株式会社JPX研究所の関連会社（以下「JPX」といいます。）の知的財産であり、指標の算出、指標値の公表、利用など同指標に関するすべての権利・ノウハウおよび同指標にかかる標準または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指標の指標値の算出または公表の譲渡、譲収又は中断に対し、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】) が開発した指標です。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または監査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つい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算利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指標で、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、同社は当該指標の正確性、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。同指標はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指標に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、JP. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指標は許諾を受けて使用しています。JP. Morganからの書面による事前承認なしに本指標を複製・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收受した後、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にかかる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、2025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】 (2025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 | 102,606,279,309 | 99.00 |
| 内 日本 | 102,606,279,309 | 99.00 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 1,031,337,727 | 1.00 |
| 純資産総額 | 103,637,617,036 | 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】 (2025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 | 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 | 5,563,325,660 | 2.3397 13,016,513,063 | 2.3611 13,135,568,215 | 12.67 |
| 2 | 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 | 3,877,959,010 | 3.2419 12,571,955,963 | 3.3807 13,110,216,025 | 12.65 |
| 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 | 1,654,073,081 | 7.6457 12,646,546,558 | 7.8609 13,002,503,082 | 12.55 |
| 4 | ダイワREITマザーファンド | 日本 | 親投資信託受益証券 | 3,381,995,867 | 3.7100 12,547,264,333 | 3.7654 12,734,567,237 | 12.29 |
| 5 | 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 | 6,109,073,381 | 2.0613 12,592,654,880 | 2.0823 12,720,923,501 | 12.27 |
| 6 | 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 | 3,090,231,364 | 4.1087 12,696,925,509 | 4.1155 12,717,847,178 | 12.27 |
| 7 | 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 | 3,310,759,866 | 3.8151 12,631,065,597 | 3.8259 12,666,636,171 | 12.22 |
| 8 | ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI) | 日本 | 親投資信託受益証券 | 10,930,857,405 | 1.1454 12,521,275,096 | 1.1452 12,518,017,900 | 12.08 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

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 | 99.00% |
| 合計 | 99.00% |

(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 |
| 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 |
| 2024年9月末日 | 79,925,821,039 | — | 1.8135 | — |
| 10月末日 | 83,274,905,219 | — | 1.8635 | — |
| 11月末日 | 83,010,731,036 | — | 1.8339 | — |
| 12月末日 | 85,632,832,803 | — | 1.8733 | — |
| 2025年1月末日 | 86,739,613,541 | — | 1.8697 | — |
| 2月末日 | 86,301,851,254 | — | 1.8380 | — |
| 3月末日 | 86,930,678,613 | — | 1.8270 | — |
| 4月末日 | 86,143,942,091 | — | 1.7883 | — |
| 5月末日 | 90,428,744,297 | — | 1.8479 | — |
| 6月末日 | 93,738,488,578 | — | 1.8947 | — |
| 7月末日 | 97,866,137,929 | — | 1.9562 | — |
| 8月末日 | 100,226,915,250 | — | 1.9798 | — |
| 第9計算期間末 (2025年9月8日) | 101,431,793,489 | 101,431,793,489 | 2.0000 | 2.0000 |
| 9月末日 | 103,637,617,036 | — | 2.0269 | — |

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 |

| | 1口当たり分配金(円) |
|--------|-------------|
| 第5計算期間 | 0.0000 |
| 第6計算期間 | 0.0000 |
| 第7計算期間 | 0.0000 |
| 第8計算期間 | 0.0000 |
| 第9計算期間 | 0.0000 |

(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 |
| 第9計算期間 | 14.0 |

(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 |
| 第9計算期間 | 11,116,436,322 | 3,874,421,453 |

(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 (2025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 | 501,622,811,620 | 97.53 |
| 内 日本 | 501,622,811,620 | 97.53 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 12,694,597,231 | 2.47 |
| 純資産総額 | 514,317,408,851 | 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) | 12,626,820,000 | 2.46 |
| 内 日本 | 12,626,820,000 | 2.46 |

(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 (2025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 | 6,014,300 | 2,922.94 17,579,476,454 | 2,849.50 17,137,747,850 | 3.33 |
| 2 | 三菱UFJフィナンシャルG | 日本 | 株式 | 銀行業 | 7,147,800 | 2,341.48 16,736,471,531 | 2,394.00 17,111,833,200 | 3.33 |
| 3 | ソニーグループ | 日本 | 株式 | 電気機器 | 3,902,800 | 3,431.71 13,393,280,619 | 4,259.00 16,622,025,200 | 3.23 |
| 4 | 日立 | 日本 | 株式 | 電気機器 | 2,906,800 | 3,863.05 11,229,133,970 | 3,930.00 11,423,724,000 | 2.22 |
| 5 | ソフトバンクグループ | 日本 | 株式 | 情報・通信業 | 559,700 | 18,375.59 10,284,820,455 | 18,685.00 10,457,994,500 | 2.03 |
| 6 | 三井住友フィナンシャルG | 日本 | 株式 | 銀行業 | 2,284,500 | 4,147.00 9,473,821,500 | 4,176.00 9,540,072,000 | 1.85 |
| 7 | 任天堂 | 日本 | 株式 | その他製品 | 714,300 | 12,800.00 9,143,040,427 | 12,805.00 9,146,611,500 | 1.78 |
| 8 | 三菱商事 | 日本 | 株式 | 卸売業 | 2,212,200 | 3,570.94 7,899,642,657 | 3,531.00 7,811,278,200 | 1.52 |

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 業種 | 株数、口数 または 額面金額 | 簿価単価 簿価 (円) | 評価単価 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|---------------|----|----|--------|----------------------|----------------------------|----------------------------|-----------------|
| 9 | 三菱重工業 | 日本 | 株式 | 機械 | 1,998,200 | 3,698.22 7,389,797,980 | 3,879.00 7,751,017,800 | 1.51 |
| 10 | みずほフィナンシャルG | 日本 | 株式 | 銀行業 | 1,488,900 | 4,844.07 7,212,345,960 | 4,988.00 7,426,633,200 | 1.44 |
| 11 | リクルートホールディングス | 日本 | 株式 | サービス業 | 860,200 | 7,930.02 6,821,409,742 | 7,963.00 6,849,772,600 | 1.33 |
| 12 | 伊藤忠 | 日本 | 株式 | 卸売業 | 804,600 | 8,699.74 6,999,813,120 | 8,426.00 6,779,559,600 | 1.32 |
| 13 | 東京海上HD | 日本 | 株式 | 保険業 | 1,063,700 | 6,325.76 6,728,715,719 | 6,269.00 6,668,335,300 | 1.30 |
| 14 | 三井物産 | 日本 | 株式 | 卸売業 | 1,720,900 | 3,723.98 6,408,599,524 | 3,680.00 6,332,912,000 | 1.23 |
| 15 | 東京エレクトロン | 日本 | 株式 | 電気機器 | 239,400 | 25,610.74 6,131,213,254 | 26,360.00 6,310,584,000 | 1.23 |
| 16 | キーエンス | 日本 | 株式 | 電気機器 | 113,200 | 55,728.66 6,308,485,260 | 55,180.00 6,246,376,000 | 1.21 |
| 17 | アドバンテスト | 日本 | 株式 | 電気機器 | 356,600 | 15,020.14 5,356,182,292 | 14,650.00 5,224,190,000 | 1.02 |
| 18 | NTT | 日本 | 株式 | 情報・通信業 | 33,751,800 | 157.99 5,332,696,599 | 154.70 5,221,403,460 | 1.02 |
| 19 | 信越化学 | 日本 | 株式 | 化学 | 1,007,800 | 4,632.14 4,668,275,830 | 4,853.00 4,890,853,400 | 0.95 |
| 20 | HOYA | 日本 | 株式 | 精密機器 | 217,800 | 20,499.76 4,464,849,294 | 20,475.00 4,459,455,000 | 0.87 |
| 21 | 三菱電機 | 日本 | 株式 | 電気機器 | 1,162,300 | 3,791.94 4,407,381,816 | 3,803.00 4,420,226,900 | 0.86 |
| 22 | 武田薬品 | 日本 | 株式 | 医薬品 | 1,009,700 | 4,477.78 4,521,219,020 | 4,315.00 4,356,855,500 | 0.85 |
| 23 | 本田技研 | 日本 | 株式 | 輸送用機器 | 2,680,600 | 1,630.93 4,371,877,889 | 1,531.00 4,103,998,600 | 0.80 |
| 24 | ソフトバンク | 日本 | 株式 | 情報・通信業 | 18,227,200 | 228.88 4,171,885,032 | 217.70 3,968,061,440 | 0.77 |
| 25 | 日本電気 | 日本 | 株式 | 電気機器 | 808,100 | 4,684.90 3,785,868,598 | 4,739.00 3,829,585,900 | 0.74 |
| 26 | KDDI | 日本 | 株式 | 情報・通信業 | 1,594,600 | 2,469.41 3,937,730,476 | 2,360.50 3,764,053,300 | 0.73 |
| 27 | 富士通 | 日本 | 株式 | 電気機器 | 1,051,500 | 3,664.81 3,853,554,087 | 3,484.00 3,663,426,000 | 0.71 |
| 28 | ファーストリテイリング | 日本 | 株式 | 小売業 | 80,800 | 45,719.59 3,694,143,218 | 45,040.00 3,639,232,000 | 0.71 |
| 29 | 丸紅 | 日本 | 株式 | 卸売業 | 983,700 | 3,616.00 3,557,067,370 | 3,698.00 3,637,722,600 | 0.71 |
| 30 | 第一三共 | 日本 | 株式 | 医薬品 | 1,041,900 | 3,542.76 3,691,203,860 | 3,315.00 3,453,898,500 | 0.67 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率 |
|-----------|--------|
| 株式 | 97.53% |
| 合計 | 97.53% |

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

| 業種 | 投資比率 |
|------------|--------|
| 水産・農林業 | 0.08% |
| 鉱業 | 0.32% |
| 建設業 | 2.31% |
| 食料品 | 2.83% |
| 繊維製品 | 0.36% |
| パルプ・紙 | 0.14% |
| 化学 | 4.62% |
| 医薬品 | 3.49% |
| 石油・石炭製品 | 0.47% |
| ゴム製品 | 0.66% |
| ガラス・土石製品 | 0.62% |
| 鉄鋼 | 0.73% |
| 非鉄金属 | 1.26% |
| 金属製品 | 0.47% |
| 機械 | 5.92% |
| 電気機器 | 17.11% |
| 輸送用機器 | 6.67% |
| 精密機器 | 1.92% |
| その他製品 | 2.95% |
| 電気・ガス業 | 1.28% |
| 陸運業 | 2.38% |
| 海運業 | 0.53% |
| 空運業 | 0.32% |
| 倉庫・運輸関連業 | 0.14% |
| 情報・通信業 | 7.84% |
| 卸売業 | 7.14% |
| 小売業 | 4.39% |
| 銀行業 | 9.36% |
| 証券、商品先物取引業 | 0.94% |
| 保険業 | 3.20% |
| その他金融業 | 1.13% |
| 不動産業 | 1.91% |
| サービス業 | 4.04% |
| 合計 | 97.53% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該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 0712月 | 買建 | 402 | 12,612,061,150 | 12,626,820,000 | 2.46% |

(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 (2025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 | 244,365,627,250 | 95.80 |
| 内 日本 | 244,365,627,250 | 95.80 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 10,711,531,123 | 4.20 |
| 純資産総額 | 255,077,158,373 | 100.00 |

その他の資産の投資状況

| 投資資産の種類 | 時価(円) | 投資比率(%) |
|-----------------|----------------|---------|
| 不動産投信指数先物取引(買建) | 10,710,000,000 | 4.20 |
| 内 日本 | 10,710,000,000 | 4.20 |

(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 (2025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 | 129,585 | 143,899.13 18,647,169,483 | 139,500.00 18,077,107,500 | 7.09 |
| 2 | ジャパンリアルエステイト | 日本 | 投資証券 | 112,188 | 131,298.13 14,730,075,568 | 124,500.00 13,967,406,000 | 5.48 |
| 3 | 日本都市ファンド投資法人 | 日本 | 投資証券 | 113,426 | 116,599.20 13,225,381,211 | 113,700.00 12,896,536,200 | 5.06 |
| 4 | 野村不動産マスターF | 日本 | 投資証券 | 69,607 | 164,998.36 11,485,041,197 | 160,400.00 11,164,962,800 | 4.38 |
| 5 | KDX不動産投資法人 | 日本 | 投資証券 | 63,695 | 171,798.60 10,942,712,411 | 168,500.00 10,732,607,500 | 4.21 |
| 6 | GLP投資法人 | 日本 | 投資証券 | 71,874 | 136,599.80 9,817,974,435 | 136,500.00 9,810,801,000 | 3.85 |
| 7 | 日本プロロジスリート | 日本 | 投資証券 | 112,447 | 86,000.39 9,670,486,100 | 86,400.00 9,715,420,800 | 3.81 |
| 8 | オリックス不動産投資 | 日本 | 投資証券 | 87,047 | 101,300.40 8,817,896,053 | 100,200.00 8,722,109,400 | 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 | 大和ハウスリート投資法人 | 日本 | 投資証券 | 68,769 | 129,098.59 8,877,981,262 | 126,000.00 8,664,894,000 | 3.40 |
| 10 | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 日本 | 投資証券 | 48,295 | 182,598.92 8,818,615,051 | 179,400.00 8,664,123,000 | 3.40 |
| 11 | インヴィンシブル投資法人 | 日本 | 投資証券 | 120,579 | 67,400.16 8,127,044,611 | 67,400.00 8,127,024,600 | 3.19 |
| 12 | アドバンス・レジデンス | 日本 | 投資証券 | 44,979 | 168,001.47 7,556,538,213 | 166,100.00 7,471,011,900 | 2.93 |
| 13 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 日本 | 投資証券 | 80,376 | 88,999.64 7,153,435,647 | 89,200.00 7,169,539,200 | 2.81 |
| 14 | 日本プライムリアルティ | 日本 | 投資証券 | 59,073 | 106,199.65 6,273,532,033 | 103,100.00 6,090,426,300 | 2.39 |
| 15 | 産業ファンド | 日本 | 投資証券 | 39,994 | 130,004.74 5,199,409,881 | 135,800.00 5,431,185,200 | 2.13 |
| 16 | 積水ハウス・リート投資 | 日本 | 投資証券 | 65,248 | 81,598.96 5,324,169,503 | 79,600.00 5,193,740,800 | 2.04 |
| 17 | 三井不ロジパーク | 日本 | 投資証券 | 48,234 | 109,898.38 5,300,838,706 | 106,300.00 5,127,274,200 | 2.01 |
| 18 | 三井不動産アコモデーションファンド投資法人 | 日本 | 投資証券 | 37,712 | 129,902.92 4,898,898,922 | 132,000.00 4,977,984,000 | 1.95 |
| 19 | API投資法人 | 日本 | 投資証券 | 33,726 | 138,098.10 4,657,496,733 | 134,600.00 4,539,519,600 | 1.78 |
| 20 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 日本 | 投資証券 | 43,305 | 98,001.12 4,243,938,867 | 97,800.00 4,235,229,000 | 1.66 |
| 21 | ラサールロジポート投資 | 日本 | 投資証券 | 28,318 | 142,101.72 4,024,036,518 | 143,500.00 4,063,633,000 | 1.59 |
| 22 | 森ヒルズリート | 日本 | 投資証券 | 25,283 | 141,401.75 3,575,060,640 | 143,000.00 3,615,469,000 | 1.42 |
| 23 | コンフォリア・レジデンシャル | 日本 | 投資証券 | 11,075 | 325,005.11 3,599,431,695 | 325,000.00 3,599,375,000 | 1.41 |
| 24 | 大和証券リビング投資法人 | 日本 | 投資証券 | 32,262 | 110,001.10 3,548,855,771 | 107,400.00 3,464,938,800 | 1.36 |
| 25 | イオンリート投資 | 日本 | 投資証券 | 26,525 | 134,597.47 3,570,197,910 | 129,700.00 3,440,292,500 | 1.35 |
| 26 | フロンティア不動産投資 | 日本 | 投資証券 | 38,390 | 90,500.24 3,474,304,473 | 89,300.00 3,428,227,000 | 1.34 |
| 27 | ヒューリックリート投資法 | 日本 | 投資証券 | 19,302 | 168,601.20 3,254,340,424 | 169,500.00 3,271,689,000 | 1.28 |
| 28 | 大和証券オフィス投資法人 | 日本 | 投資証券 | 8,924 | 376,496.56 3,359,855,337 | 365,000.00 3,257,260,000 | 1.28 |
| 29 | 森トラストリート投資法人 | 日本 | 投資証券 | 42,104 | 76,400.24 3,216,755,919 | 75,800.00 3,191,483,200 | 1.25 |
| 30 | NTT都市開発リート投資法人 | 日本 | 投資証券 | 21,995 | 137,500.80 3,024,330,174 | 136,000.00 2,991,320,000 | 1.17 |

(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 | 95.80% |
| 合計 | 95.80% |

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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 | 賃建/ 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 0712 月 | 賃建 | 5,600 | 10,866,800,000 | 10,710,000,000 | 4.20% |

(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（2025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 | 94,467,755,130 | 84.65 |
| 内 日本 | 94,467,755,130 | 84.65 |
| 地方債証券 | 5,056,833,974 | 4.53 |
| 内 日本 | 5,056,833,974 | 4.53 |
| 特殊債券 | 4,502,923,006 | 4.03 |
| 内 日本 | 4,502,923,006 | 4.03 |
| 社債券 | 7,162,768,100 | 6.42 |
| 内 日本 | 7,162,768,100 | 6.42 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 408,221,312 | 0.37 |
| 純資産総額 | 111,598,501,522 | 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（2025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 | 158 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 2,050,000,000 | 98.18 2,012,690,900 | 97.89 2,006,806,500 | 0.100000 2028/03/20 | 1.80 |
| 2 | 154 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,900,000,000 | 98.55 1,872,561,600 | 98.39 1,869,486,000 | 0.100000 2027/09/20 | 1.68 |
| 3 | 156 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,870,000,000 | 98.63 1,844,447,600 | 98.38 1,839,706,000 | 0.200000 2027/12/20 | 1.65 |
| 4 | 163 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,810,000,000 | 98.89 1,789,949,000 | 98.18 1,777,130,400 | 0.400000 2028/09/20 | 1.59 |
| 5 | 169 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,800,000,000 | 98.54 1,773,833,000 | 98.01 1,764,234,000 | 0.500000 2029/03/20 | 1.58 |
| 6 | 153 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,520,000,000 | 98.47 1,496,758,500 | 98.46 1,496,728,800 | 0.005000 2027/06/20 | 1.34 |
| 7 | 360 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,530,000,000 | 96.13 1,470,899,200 | 94.55 1,446,645,600 | 0.100000 2030/09/20 | 1.30 |
| 8 | 150 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,450,000,000 | 98.79 1,432,556,500 | 99.00 1,435,558,000 | 0.005000 2026/12/20 | 1.29 |
| 9 | 362 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,530,000,000 | 95.89 1,467,234,400 | 93.80 1,435,201,200 | 0.100000 2031/03/20 | 1.29 |

| | 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 | 366 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,500,000,000 | 95.22 1,428,418,900 | 92.83 1,392,450,000 | 0.200000 2032/03/20 | 1.25 |
| 11 | 369 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,370,000,000 | 96.75 1,325,521,400 | 93.63 1,282,840,600 | 0.500000 2032/12/20 | 1.15 |
| 12 | 358 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,280,000,000 | 96.48 1,235,030,200 | 95.23 1,219,020,800 | 0.100000 2030/03/20 | 1.09 |
| 13 | 368 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,300,000,000 | 94.05 1,222,673,000 | 91.99 1,195,987,000 | 0.200000 2032/09/20 | 1.07 |
| 14 | 361 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,250,000,000 | 95.96 1,199,582,900 | 94.18 1,177,250,000 | 0.100000 2030/12/20 | 1.05 |
| 15 | 373 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,260,000,000 | 96.76 1,219,190,600 | 92.97 1,171,447,200 | 0.600000 2033/12/20 | 1.05 |
| 16 | 164 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,200,000,000 | 98.05 1,176,612,000 | 97.30 1,167,684,000 | 0.200000 2028/12/20 | 1.05 |
| 17 | 370 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,250,000,000 | 96.55 1,206,950,000 | 93.28 1,166,075,000 | 0.500000 2033/03/20 | 1.04 |
| 18 | 178 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,175,000,000 | 99.89 1,173,785,450 | 99.13 1,164,789,250 | 1.000000 2030/03/20 | 1.04 |
| 19 | 367 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,250,000,000 | 95.10 1,188,852,500 | 92.43 1,155,400,000 | 0.200000 2032/06/20 | 1.04 |
| 20 | 372 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,180,000,000 | 98.21 1,158,951,500 | 94.81 1,118,805,200 | 0.800000 2033/09/20 | 1.00 |
| 21 | 371 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,200,000,000 | 95.52 1,146,252,900 | 92.19 1,106,388,000 | 0.400000 2033/06/20 | 0.99 |
| 22 | 374 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,170,000,000 | 98.17 1,148,625,800 | 94.17 1,101,847,500 | 0.800000 2034/03/20 | 0.99 |
| 23 | 365 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,180,000,000 | 94.79 1,118,574,600 | 92.61 1,092,857,000 | 0.100000 2031/12/20 | 0.98 |
| 24 | 359 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,060,000,000 | 96.43 1,022,191,400 | 94.87 1,005,685,600 | 0.100000 2030/06/20 | 0.90 |
| 25 | 377 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,000,000,000 | 98.12 981,208,900 | 96.59 965,920,000 | 1.200000 2034/12/20 | 0.87 |
| 26 | 378 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 950,000,000 | 99.54 945,685,550 | 98.11 932,073,500 | 1.400000 2035/03/20 | 0.84 |
| 27 | 364 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,000,000,000 | 95.25 952,588,500 | 93.01 930,170,000 | 0.100000 2031/09/20 | 0.83 |
| 28 | 174 5年国債 | 日本 | 国債証券 | 920,000,000 | 98.93 910,161,800 | 98.25 903,936,800 | 0.700000 2029/09/20 | 0.81 |
| 29 | 376 10年国債 | 日本 | 国債証券 | 858,000,000 | 97.02 832,439,880 | 94.32 809,299,920 | 0.900000 2034/09/20 | 0.73 |
| 30 | 17 40年国債 | 日本 | 国債証券 | 1,050,000,000 | 89.84 943,387,200 | 76.67 805,098,000 | 2.200000 2064/03/20 | 0.72 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

四. 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 | 84.65% |
| 地方債証券 | 4.53% |
| 特殊債券 | 4.03% |
| 社債券 | 6.42% |
| 合計 | 99.63% |

(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 (2025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 | 46,948,093,587 | 84.53 |
| | 内 中国 | 19,473,090,835 |
| | 内 台湾 | 8,303,533,642 |
| | 内 タイ | 1,202,271,077 |
| | 内 マレーシア | 239,426,354 |
| | 内 インドネシア | 499,813,371 |
| | 内 インド | 5,546,163,731 |
| | 内 サウジアラビア | 981,333,358 |
| | 内 トルコ | 786,980,179 |
| | 内 カナダ | 35,557,755 |
| | 内 メキシコ | 1,278,953,835 |
| | 内 チリ | 141,615,174 |
| 投資証券 | 6,470,359,764 | 11.65 |
| | 内 ブラジル | 1,988,994,512 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 5,052,250,988 | 9.10 |
| | 内 アメリカ | 5,052,250,988 |
| 純資産総額 | 3,541,301,433 | 6.38 |
| | 55,541,646,008 | 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) | 3,026,655,960 | 5.45 |
| | 内 アメリカ | 3,026,655,960 |
| 為替予約取引(買建) | 14,875,200 | 0.03 |
| | 内 日本 | 14,875,200 |

(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 (2025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 | INVESTCO FTSE RAFI EMERGING M | アメリカ | 投資証券 | — | 1,335,500 | 3,564.78 4,760,781,541 | 3,783.04 5,052,250,988 | 9.10 |
| 2 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 台湾 | 株式 | 情報技術 | 428,000 | 5,303.58 2,269,935,878 | 6,354.53 2,719,738,840 | 4.90 |
| 3 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 中国 | 株式 | 一般消費 財・サービス | 534,800 | 2,010.56 1,075,249,092 | 3,317.14 1,774,007,542 | 3.19 |
| 4 | TENCENT HOLDINGS LTD | 中国 | 株式 | コミュニケーション・サービス | 102,500 | 9,503.78 974,137,860 | 12,625.80 1,294,144,500 | 2.33 |
| 5 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 中国 | 株式 | 金融 | 8,592,000 | 157.05 1,349,436,322 | 143.09 1,229,449,901 | 2.21 |
| 6 | VALE SA | ブラジル | 株式 | 素材 | 755,090 | 1,543.37 1,165,387,361 | 1,601.53 1,209,300,508 | 2.18 |
| 7 | IND & COMM BK OF CHINA-H | 中国 | 株式 | 金融 | 10,101,000 | 117.26 1,184,512,957 | 109.61 1,107,220,105 | 1.99 |
| 8 | HON HAI PRECISION INDUSTRY | 台湾 | 株式 | 情報技術 | 999,902 | 786.98 786,906,976 | 1,072.93 1,072,832,802 | 1.93 |
| 9 | PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 中国 | 株式 | 金融 | 879,500 | 957.45 842,082,992 | 1,023.45 900,128,673 | 1.62 |
| 10 | BANK OF CHINA LTD-H | 中国 | 株式 | 金融 | 8,967,000 | 87.61 785,647,292 | 80.91 725,608,743 | 1.31 |
| 11 | PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | ブラジル | 株式 | エネルギー | 783,300 | 898.06 703,454,756 | 889.39 696,665,498 | 1.25 |
| 12 | ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF | ブラジル | 株式 | 金融 | 584,519 | 1,054.91 616,620,480 | 1,087.35 635,578,332 | 1.14 |
| 13 | RELIANCE INDUSTRIES LTD | インド | 株式 | エネルギー | 260,907 | 2,581.13 673,436,711 | 2,320.03 605,312,589 | 1.09 |
| 14 | BANCO BRADESCO SA-PREF | ブラジル | 株式 | 金融 | 1,085,759 | 466.08 506,059,457 | 498.80 541,577,727 | 0.98 |
| 15 | PETROBRAS - PETROLEO BRAS | ブラジル | 株式 | エネルギー | 539,700 | 982.78 530,408,231 | 959.57 517,883,655 | 0.93 |
| 16 | BAIDU INC-CLASS A | 中国 | 株式 | コミュニケーション・サービス | 203,300 | 1,643.26 334,076,181 | 2,515.59 511,420,464 | 0.92 |
| 17 | HDFC BANK LIMITED | インド | 株式 | 金融 | 315,618 | 1,680.95 530,540,760 | 1,606.00 506,884,717 | 0.91 |
| 18 | JD.COM INC - CL A | 中国 | 株式 | 一般消費 財・サービス | 192,895 | 2,375.94 458,308,104 | 2,613.15 504,065,112 | 0.91 |
| 19 | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H | 中国 | 株式 | エネルギー | 5,521,800 | 79.96 441,541,902 | 78.43 433,091,339 | 0.78 |
| 20 | PETROCHINA CO LTD-H | 中国 | 株式 | エネルギー | 2,884,000 | 130.27 375,713,965 | 139.26 401,644,298 | 0.72 |

| | 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 (%) |
|----|------------------------------|-------|----|----------------|----------------------|-------------------------|-------------------------|-----------------|
| 21 | AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H | 中国 | 株式 | 金融 | 3,741,000 | 108.84 407,206,728 | 100.62 376,433,636 | 0.68 |
| 22 | MEDIATEK INC | 台湾 | 株式 | 情報技術 | 52,003 | 6,305.64 327,912,665 | 6,403.41 332,996,582 | 0.60 |
| 23 | SIBANYE STILLWATER LTD | 南アフリカ | 株式 | 素材 | 734,423 | 301.18 221,195,576 | 427.29 313,814,101 | 0.57 |
| 24 | DELTA ELECTRONICS INC | 台湾 | 株式 | 情報技術 | 73,000 | 2,233.86 163,071,904 | 4,145.10 302,592,942 | 0.54 |
| 25 | CHINA MERCHANTS BANK-H | 中国 | 株式 | 金融 | 315,500 | 992.84 313,243,229 | 894.13 282,099,971 | 0.51 |
| 26 | ICICI BANK LTD | インド | 株式 | 金融 | 120,003 | 2,438.33 292,607,155 | 2,278.28 273,401,515 | 0.49 |
| 27 | XIAOMI CORP-CLASS B | 中国 | 株式 | 情報技術 | 259,000 | 1,099.97 284,893,525 | 1,024.41 265,322,579 | 0.48 |
| 28 | AMERICA MOVIL L | メキシコ | 株式 | コミュニケーション・サービス | 1,654,100 | 137.62 227,646,829 | 154.96 256,320,414 | 0.46 |
| 29 | INFOSYS LTD | インド | 株式 | 情報技術 | 98,020 | 2,772.78 271,788,190 | 2,436.64 238,839,649 | 0.43 |
| 30 | UNITED MICROELECTRONICS CORP | 台湾 | 株式 | 情報技術 | 1,073,000 | 213.85 229,465,744 | 219.23 235,235,169 | 0.42 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率 |
|-----------|--------|
| 株式 | 84.53% |
| 投資証券 | 9.10% |
| 合計 | 93.62% |

(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 |
|----------------|--------|
| エネルギー | 7.83% |
| 素材 | 9.85% |
| 資本財・サービス | 3.60% |
| 一般消費財・サービス | 8.64% |
| 生活必需品 | 2.85% |
| ヘルスケア | 1.05% |
| 金融 | 26.59% |
| 情報技術 | 13.68% |
| コミュニケーション・サービス | 6.40% |
| 公益事業 | 2.66% |
| 不動産 | 1.37% |
| 合計 | 84.53% |

(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 25 | 買建 | 300 | 3,018,147,468 | 3,026,655,960 | 5.45% |
| 為替予約取引 | 日本 | 米ドル買/円売 2025年10月 | 買建 | 100,000 | 14,668,220 | 14,875,200 | 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) 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 (2025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 | 778,726,675,903 | 94.80 |
| 内 香港 | 4,186,190,370 | 0.51 |
| 内 シンガポール | 3,584,086,073 | 0.44 |
| 内 イスラエル | 2,242,706,943 | 0.27 |
| 内 ノルウェー | 1,282,399,741 | 0.16 |
| 内 スウェーデン | 7,674,488,806 | 0.93 |
| 内 デンマーク | 4,018,580,851 | 0.49 |
| 内 イギリス | 29,038,637,121 | 3.53 |
| 内 アイルランド | 881,156,448 | 0.11 |
| 内 オランダ | 9,852,031,890 | 1.20 |
| 内 ベルギー | 2,096,129,155 | 0.26 |
| 内 フランス | 21,480,347,038 | 2.61 |
| 内 ドイツ | 19,610,227,818 | 2.39 |
| 内 スイス | 17,799,888,819 | 2.17 |
| 内 ポルトガル | 425,484,583 | 0.05 |
| 内 スペイン | 7,164,244,295 | 0.87 |
| 内 イタリア | 6,409,993,053 | 0.78 |
| 内 フィンランド | 2,142,039,176 | 0.26 |
| 内 オーストリア | 441,789,562 | 0.05 |
| 内 カナダ | 25,677,179,122 | 3.13 |
| 内 アメリカ | 600,354,869,248 | 73.08 |
| 内 オーストラリア | 11,982,561,067 | 1.46 |
| 内 ニュージーランド | 381,644,724 | 0.05 |
| 投資証券 | 13,339,360,692 | 1.62 |
| 内 香港 | 206,191,251 | 0.03 |
| 内 シンガポール | 203,989,647 | 0.02 |
| 内 イギリス | 170,146,641 | 0.02 |
| 内 フランス | 298,370,380 | 0.04 |
| 内 アメリカ | 11,376,564,362 | 1.38 |
| 内 オーストラリア | 1,084,098,411 | 0.13 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 29,409,179,199 | 3.58 |
| 純資産総額 | 821,475,215,794 | 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(%) |
|--------------|----------------|---------|
| 株価指数先物取引(買建) | 30,358,871,002 | 3.70 |
| 内 イギリス | 1,739,834,263 | 0.21 |
| 内 ドイツ | 5,754,413,302 | 0.70 |
| 内 カナダ | 2,874,356,602 | 0.35 |
| 内 アメリカ | 18,640,784,662 | 2.27 |
| 内 オーストラリア | 1,349,482,173 | 0.16 |
| 為替予約取引(買建) | 14,166,808,430 | 1.72 |
| 内 日本 | 14,166,808,430 | 1.72 |

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

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

(注3) 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 (2025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 | NVIDIA CORP | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 1,723,100 | 20,753.42 35,760,378,545 | 27,073.82 46,650,913,027 | 5.68 |
| 2 | APPLE INC | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 1,054,800 | 35,150.41 37,076,784,140 | 37,879.53 39,955,337,104 | 4.86 |
| 3 | MICROSOFT CORP | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 498,700 | 63,532.75 31,683,829,906 | 76,613.64 38,207,226,258 | 4.65 |
| 4 | AMAZON.COM INC | アメリカ | 株式 | 一般消費 財・サービス | 674,100 | 31,091.65 20,958,940,354 | 33,076.66 22,296,982,977 | 2.71 |
| 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 | 153,200 | 86,844.68 13,304,619,811 | 110,677.39 16,955,776,454 | 2.06 |
| 6 | BROADCOM INC | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 315,220 | 25,347.56 7,990,080,466 | 48,817.75 15,388,331,785 | 1.87 |
| 7 | ALPHABET INC-CL A | アメリカ | 株式 | コミュニケーション・サービス | 410,600 | 25,332.82 10,401,688,640 | 36,334.16 14,918,807,738 | 1.82 |
| 8 | TESLA INC | アメリカ | 株式 | 一般消費 財・サービス | 204,550 | 51,030.40 10,438,294,957 | 65,985.10 13,497,253,187 | 1.64 |
| 9 | ALPHABET INC-CL C | アメリカ | 株式 | コミュニケーション・サービス | 346,540 | 25,529.49 8,846,994,143 | 36,380.31 12,607,234,984 | 1.53 |

| | 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 (%) |
|----|-----------------------------|------|----|----------------|----------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------|
| 10 | JPMORGAN CHASE & CO | アメリカ | 株式 | 金融 | 196,070 | 37,488.28 7,350,352,604 | 46,999.92 9,215,275,726 | 1.12 |
| 11 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | アメリカ | 株式 | 金融 | 95,650 | 72,173.30 6,903,384,860 | 74,328.34 7,109,505,721 | 0.87 |
| 12 | ELI LILLY & CO | アメリカ | 株式 | ヘルスケア | 56,885 | 118,628.62 6,748,189,928 | 108,162.80 6,152,841,379 | 0.75 |
| 13 | VISA INC-CLASS A SHARES | アメリカ | 株式 | 金融 | 120,750 | 47,625.37 5,750,773,914 | 50,643.02 6,115,144,762 | 0.74 |
| 14 | NETFLIX INC | アメリカ | 株式 | コミュニケーション・サービス | 30,090 | 134,993.81 4,061,966,125 | 179,610.32 5,404,474,553 | 0.66 |
| 15 | EXXON MOBIL CORP | アメリカ | 株式 | エネルギー | 304,009 | 17,496.22 5,319,025,583 | 17,005.07 5,169,695,420 | 0.63 |
| 16 | MASTERCARD INC - A | アメリカ | 株式 | 金融 | 60,500 | 80,266.56 4,856,129,578 | 84,584.68 5,117,373,334 | 0.62 |
| 17 | ORACLE CORP | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 119,533 | 27,717.58 3,313,181,880 | 42,097.30 5,032,017,613 | 0.61 |
| 18 | WALMART INC | アメリカ | 株式 | 生活必需品 | 309,600 | 13,833.78 4,282,983,264 | 15,346.55 4,751,292,004 | 0.58 |
| 19 | JOHNSON & JOHNSON | アメリカ | 株式 | ヘルスケア | 169,800 | 23,222.74 3,943,226,747 | 27,039.58 4,591,321,635 | 0.56 |
| 20 | COSTCO WHOLESALE CORP | アメリカ | 株式 | 生活必需品 | 31,360 | 145,056.91 4,548,987,130 | 136,503.60 4,280,753,072 | 0.52 |
| 21 | PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A | アメリカ | 株式 | 情報技術 | 160,100 | 11,732.04 1,878,304,620 | 26,628.67 4,263,251,156 | 0.52 |
| 22 | HOME DEPOT INC | アメリカ | 株式 | 一般消費財・サービス | 70,250 | 63,334.29 4,449,242,250 | 60,564.38 4,254,647,976 | 0.52 |
| 23 | ABBVIE INC | アメリカ | 株式 | ヘルスケア | 124,672 | 27,450.79 3,422,358,895 | 33,224.06 4,142,110,108 | 0.50 |
| 24 | BANK OF AMERICA CORP | アメリカ | 株式 | 金融 | 504,601 | 7,041.72 3,553,334,519 | 7,804.28 3,938,052,336 | 0.48 |
| 25 | ASML HOLDING NV | オランダ | 株式 | 情報技術 | 27,134 | 114,763.05 3,113,981,934 | 144,024.98 3,907,973,943 | 0.48 |
| 26 | PROCTER & GAMBLE CO/THE | アメリカ | 株式 | 生活必需品 | 165,467 | 26,512.55 4,386,970,349 | 22,857.54 3,782,169,630 | 0.46 |
| 27 | UNITEDHEALTH GROUP INC | アメリカ | 株式 | ヘルスケア | 64,066 | 88,161.82 5,648,180,438 | 51,390.39 3,292,377,264 | 0.40 |
| 28 | GENERAL ELECTRIC CO | アメリカ | 株式 | 資本財・サービス | 75,306 | 27,800.21 2,093,530,157 | 43,715.63 3,292,049,564 | 0.40 |
| 29 | CHEVRON CORP | アメリカ | 株式 | エネルギー | 138,318 | 23,643.93 3,270,393,712 | 23,240.16 3,214,533,557 | 0.39 |
| 30 | WELLS FARGO & CO | アメリカ | 株式 | 金融 | 227,122 | 11,366.24 2,581,541,346 | 12,602.69 2,862,348,612 | 0.35 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率 |
|-----------|--------|
| 株式 | 94.80% |
| 投資証券 | 1.62% |
| 合計 | 96.42% |

(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 | 3.45% |
| 素材 | 3.04% |
| 資本財・サービス | 9.99% |
| 一般消費財・サービス | 9.66% |
| 生活必需品 | 5.23% |
| ヘルスケア | 8.79% |
| 金融 | 16.17% |
| 情報技術 | 27.23% |
| コミュニケーション・サービス | 8.41% |
| 公益事業 | 2.55% |
| 不動産 | 0.27% |
| 合計 | 94.80% |

(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 25 | 買建 | 373 | 18,556,166,228 | 18,640,784,662 | 2.27% |
| | イギリス | FTSE 100 INDEX DEC 25 | 買建 | 93 | 1,731,809,034 | 1,739,834,263 | 0.21% |
| | オーストラリア | SPI 200 DEC 25 | 買建 | 62 | 1,352,561,205 | 1,349,482,173 | 0.16% |
| | カナダ | S&P/TSE 60 INDEX DEC 25 | 買建 | 76 | 2,829,805,708 | 2,874,356,602 | 0.35% |
| | ドイツ | SWISS MKT IX DEC 25 | 買建 | 75 | 1,694,896,748 | 1,682,876,700 | 0.20% |
| | | EURO STOXX 50 DEC 25 | 買建 | 422 | 4,017,556,805 | 4,071,536,602 | 0.50% |
| 為替予約取引 | 日本 | 英ポンド買/円売 2025年10月 | 買建 | 4,000,000 | 794,981,810 | 798,870,800 | 0.10% |
| | | カナダ・ドル買/円売 2025年10月 | 買建 | 14,700,000 | 1,573,514,490 | 1,570,925,790 | 0.19% |
| | | スイス・フラン買/円売 2025年10月 | 買建 | 5,700,000 | 1,050,899,130 | 1,063,270,590 | 0.13% |
| | | ユーロ買/円売 2025年10月 | 買建 | 8,900,000 | 1,537,367,110 | 1,552,284,600 | 0.19% |

| 種類 | 地域 | 資産名 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価 | 時価 | 投資 比率 |
|----|----|------------------|-----------|------------|---------------|---------------|----------|
| | | 豪ドル買/円売 2025年10月 | 買建 | 5,500,000 | 529,028,190 | 538,035,850 | 0.07% |
| | | 米ドル買/円売 2025年10月 | 買建 | 58,100,000 | 8,592,243,070 | 8,643,420,800 | 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) 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 (2025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 | 749,891,588 | 1.40 |
| 内 アメリカ | 749,891,588 | 1.40 |
| 投資証券 | 51,471,497,626 | 96.02 |
| 内 ガーンジー | 70,574,896 | 0.13 |
| 内 韓国 | 111,489,646 | 0.21 |
| 内 香港 | 509,390,414 | 0.95 |
| 内 シンガポール | 1,794,702,794 | 3.35 |
| 内 イスラエル | 89,723,649 | 0.17 |
| 内 イギリス | 2,023,119,529 | 3.77 |
| 内 アイルランド | 18,041,350 | 0.03 |
| 内 オランダ | 77,627,783 | 0.14 |
| 内 ベルギー | 499,824,158 | 0.93 |
| 内 フランス | 1,035,072,548 | 1.93 |
| 内 ドイツ | 14,700,594 | 0.03 |
| 内 スペイン | 247,265,075 | 0.46 |
| 内 イタリア | 6,729,830 | 0.01 |
| 内 カナダ | 662,481,752 | 1.24 |
| 内 アメリカ | 40,063,553,211 | 74.74 |
| 内 オーストラリア | 4,180,810,796 | 7.80 |
| 内 ニュージーランド | 66,389,601 | 0.12 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 1,381,044,352 | 2.58 |
| 純資産総額 | 53,602,433,566 | 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) | 1,458,380,306 | 2.72 |
| 内 ドイツ | 393,185,592 | 0.73 |
| 内 アメリカ | 1,065,194,714 | 1.99 |
| 為替予約取引(買建) | 278,567,398 | 0.52 |
| 内 日本 | 278,567,398 | 0.52 |

(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 (2025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 | WELLTOWER INC | アメリカ | 投資証券 | 151,175 | 21,045.82 3,181,621,947 | 26,232.65 3,965,721,771 | 7.40 |
| 2 | PROLOGIS INC | アメリカ | 投資証券 | 209,770 | 17,239.41 3,616,312,074 | 17,008.05 3,567,778,900 | 6.66 |
| 3 | EQUINIX INC | アメリカ | 投資証券 | 22,120 | 143,350.89 3,170,924,593 | 116,382.47 2,574,380,316 | 4.80 |
| 4 | SIMON PROPERTY GROUP INC | アメリカ | 投資証券 | 73,795 | 27,049.26 1,996,101,744 | 27,669.34 2,041,859,536 | 3.81 |
| 5 | REALTY INCOME CORP | アメリカ | 投資証券 | 206,661 | 8,575.33 1,772,195,586 | 9,014.68 1,862,983,610 | 3.48 |
| 6 | DIGITAL REALTY TRUST INC | アメリカ | 投資証券 | 72,462 | 28,523.77 2,066,889,549 | 25,325.97 1,835,170,931 | 3.42 |
| 7 | GOODMAN GROUP | オーストラリア | 投資証券 | 476,274 | 3,647.08 1,737,032,865 | 3,235.26 1,540,872,364 | 2.87 |
| 8 | PUBLIC STORAGE | アメリカ | 投資証券 | 35,692 | 50,690.06 1,809,233,293 | 42,956.34 1,533,197,916 | 2.86 |
| 9 | VICI PROPERTIES INC | アメリカ | 投資証券 | 241,032 | 4,818.20 1,161,370,279 | 4,847.53 1,168,410,526 | 2.18 |
| 10 | VENTAS INC | アメリカ | 投資証券 | 102,724 | 9,529.51 978,910,326 | 10,302.49 1,058,313,599 | 1.97 |
| 11 | EXTRA SPACE STORAGE INC | アメリカ | 投資証券 | 47,976 | 24,951.54 1,197,080,575 | 21,059.07 1,010,330,230 | 1.88 |
| 12 | IRON MOUNTAIN INC | アメリカ | 投資証券 | 66,757 | 17,941.23 1,197,706,867 | 14,940.10 997,356,790 | 1.86 |
| 13 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | アメリカ | 投資証券 | 32,143 | 34,470.93 1,108,003,134 | 28,817.21 926,271,671 | 1.73 |
| 14 | VANGUARD REAL ESTATE ETF | アメリカ | 投資信託 受益証券 | 55,320 | 13,487.48 746,130,298 | 13,555.52 749,891,588 | 1.40 |
| 15 | EQUITY RESIDENTIAL | アメリカ | 投資証券 | 78,552 | 11,225.10 881,758,748 | 9,546.18 749,871,971 | 1.40 |
| 16 | ESSEX PROPERTY TRUST INC | アメリカ | 投資証券 | 14,557 | 45,634.54 664,303,157 | 39,634.83 576,964,273 | 1.08 |
| 17 | INVITATION HOMES INC | アメリカ | 投資証券 | 127,474 | 5,060.28 645,056,939 | 4,323.47 551,130,678 | 1.03 |
| 18 | MID-AMERICA APARTMENT COMM | アメリカ | 投資証券 | 26,462 | 24,187.64 640,056,185 | 20,636.25 546,076,627 | 1.02 |
| 19 | SUN COMMUNITIES INC | アメリカ | 投資証券 | 26,591 | 18,769.74 499,108,711 | 19,221.89 511,129,458 | 0.95 |
| 20 | WP CAREY INC | アメリカ | 投資証券 | 49,499 | 8,567.15 424,071,327 | 10,135.75 501,709,509 | 0.94 |

| | 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 | KIMCO REALTY CORP | アメリカ | 投資証券 | 153,067 | 3,734.80 571,686,014 | 3,226.22 493,829,286 | 0.92 |
| 22 | SCENTRE GROUP | オーストラリア | 投資証券 | 1,221,353 | 359.94 439,733,792 | 401.34 490,188,805 | 0.91 |
| 23 | LINK REIT | 香港 | 投資証券 | 606,674 | 657.21 398,722,218 | 768.64 466,315,966 | 0.87 |
| 24 | GAMING AND LEISURE PROPERTIES | アメリカ | 投資証券 | 63,968 | 7,574.41 484,525,613 | 6,978.00 446,369,062 | 0.83 |
| 25 | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | アメリカ | 投資証券 | 157,073 | 3,216.10 505,174,590 | 2,830.20 444,549,387 | 0.83 |
| 26 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITY | アメリカ | 投資証券 | 35,185 | 15,935.07 560,679,230 | 12,568.44 442,220,899 | 0.83 |
| 27 | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | アメリカ | 投資証券 | 66,679 | 5,960.55 397,447,388 | 6,185.96 412,473,894 | 0.77 |
| 28 | REGENCY CENTERS CORP | アメリカ | 投資証券 | 36,933 | 11,181.18 412,958,310 | 10,752.11 397,107,812 | 0.74 |
| 29 | SEGRO PLC | イギリス | 投資証券 | 302,927 | 1,542.51 467,279,659 | 1,302.28 394,498,124 | 0.74 |
| 30 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | アメリカ | 投資証券 | 43,802 | 10,429.49 456,839,063 | 8,859.84 388,079,097 | 0.72 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率 |
|-----------|--------|
| 投資信託受益証券 | 1.40% |
| 投資証券 | 96.02% |
| 合計 | 97.42% |

(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 25 | 買建 | 194 | 1,073,660,239 | 1,065,194,714 | 1.99% |
| | ドイツ | STOXX EUROPE 600 RE DEC 25 | 買建 | 360 | 396,475,538 | 393,185,592 | 0.73% |

| 種類 | 地域 | 資産名 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価 | 時価 | 投資 比率 |
|--------|----|------------------|-----------|-----------|-------------|-------------|----------|
| 為替予約取引 | 日本 | 米ドル買/円売 2025年10月 | 買建 | 664,600 | 98,619,522 | 98,920,978 | 0.18% |
| | | ユーロ買/円売 2025年10月 | 買建 | 1,030,000 | 177,112,929 | 179,646,420 | 0.34% |

(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 (2025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 | 60,674,649,632 | 97.94 |
| 内 中国 | 6,043,863,632 | 9.76 |
| 内 タイ | 5,249,537,404 | 8.47 |
| 内 マレーシア | 5,942,897,966 | 9.59 |
| 内 インドネシア | 6,136,906,848 | 9.91 |
| 内 インド | 6,050,207,825 | 9.77 |
| 内 ポーランド | 4,645,974,628 | 7.50 |
| 内 ハンガリー | 1,355,511,052 | 2.19 |
| 内 セルビア | 174,961,679 | 0.28 |
| 内 ルーマニア | 1,958,179,425 | 3.16 |
| 内 トルコ | 716,402,423 | 1.16 |
| 内 チェコ | 2,934,326,744 | 4.74 |
| 内 メキシコ | 6,135,157,640 | 9.90 |
| 内 ドミニカ共和国 | 164,252,579 | 0.27 |
| 内 コロンビア | 2,253,400,773 | 3.64 |
| 内 ペルー | 1,132,311,288 | 1.83 |
| 内 チリ | 1,002,295,585 | 1.62 |
| 内 ブラジル | 4,181,328,623 | 6.75 |
| 内 ウルグアイ | 101,115,676 | 0.16 |
| 内 南アフリカ | 4,496,017,842 | 7.26 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 1,274,927,530 | 2.06 |
| 純資産総額 | 61,949,577,162 | 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) | 291,205,371 | 0.47 |
| 内 日本 | 291,205,371 | 0.47 |
| 為替予約取引(売建) | 72,035,460 | △0.12 |
| 内 日本 | 72,035,460 | △0.12 |

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

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

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

(2) 投資資産 (2025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 | 30,000,000 | 87.35 732,717,490 | 90.38 758,174,796 | — 2026/07/01 | 1.22 |
| 2 | Mexican Bonos | メキシコ | 国債証券 | 80,000,000 | 95.75 620,512,690 | 97.44 631,461,821 | 7.750000 2031/05/29 | 1.02 |
| 3 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 南アフリカ | 国債証券 | 75,000,000 | 82.01 530,215,469 | 86.48 559,125,525 | 8.750000 2048/02/28 | 0.90 |
| 4 | Mexican Bonos | メキシコ | 国債証券 | 71,000,000 | 91.36 525,460,311 | 94.50 543,536,596 | 7.750000 2034/11/23 | 0.88 |
| 5 | Mexican Bonos | メキシコ | 国債証券 | 65,000,000 | 99.92 526,148,628 | 101.26 533,165,492 | 8.500000 2029/05/31 | 0.86 |
| 6 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 南アフリカ | 国債証券 | 60,000,000 | 94.82 490,430,855 | 98.34 508,629,996 | 8.875000 2035/02/28 | 0.82 |
| 7 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | ブラジル | 国債証券 | 19,000,000 | 94.83 503,780,111 | 95.74 508,624,968 | 10.000000 2027/01/01 | 0.82 |
| 8 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 南アフリカ | 国債証券 | 58,500,000 | 99.06 499,555,075 | 100.46 506,624,940 | 8.000000 2030/01/31 | 0.82 |
| 9 | BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL | ブラジル | 国債証券 | 27,000,000 | 64.98 490,592,925 | 66.69 503,488,491 | — 2029/01/01 | 0.81 |
| 10 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 南アフリカ | 国債証券 | 59,000,000 | 96.69 491,762,342 | 98.78 502,385,495 | 8.250000 2032/03/31 | 0.81 |
| 11 | MEXICAN BONOS | メキシコ | 国債証券 | 60,000,000 | 99.93 485,698,363 | 101.27 492,201,365 | 8.500000 2029/03/01 | 0.79 |
| 12 | Mexican Bonos | メキシコ | 国債証券 | 60,500,000 | 98.83 484,384,438 | 99.91 489,672,339 | 7.500000 2027/06/03 | 0.79 |
| 13 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | ブラジル | 国債証券 | 20,000,000 | 87.43 488,939,371 | 87.38 488,674,044 | 10.000000 2031/01/01 | 0.79 |
| 14 | Mexican Bonos | メキシコ | 国債証券 | 67,000,000 | 83.50 453,192,894 | 87.07 472,595,642 | 7.750000 2042/11/13 | 0.76 |
| 15 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | ブラジル | 国債証券 | 18,000,000 | 91.40 460,023,180 | 91.80 462,046,344 | 10.000000 2029/01/01 | 0.75 |
| 16 | MEXICAN BONOS | メキシコ | 国債証券 | 65,000,000 | 83.05 437,307,303 | 87.07 458,456,718 | 8.000000 2053/07/31 | 0.74 |
| 17 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 南アフリカ | 国債証券 | 55,000,000 | 88.37 418,962,170 | 92.16 436,968,488 | 8.500000 2037/01/31 | 0.71 |
| 18 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 南アフリカ | 国債証券 | 48,500,000 | 103.82 434,061,177 | 103.49 432,673,185 | 10.500000 2026/12/21 | 0.70 |
| 19 | POLAND GOVERNMENT BOND | ポーランド | 国債証券 | 10,000,000 | 105.37 430,448,705 | 104.69 427,695,415 | 6.000000 2033/10/25 | 0.69 |
| 20 | MEXICAN BONOS | メキシコ | 国債証券 | 55,400,000 | 91.71 411,595,677 | 94.29 423,173,741 | 7.500000 2033/05/26 | 0.68 |

| | 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 | POLAND GOVERNMENT BOND | ポーランド | 国債証券 | 9,400,000 | 108.71 417,435,529 | 107.92 414,417,367 | 7.500000 2028/07/25 | 0.67 |
| 22 | Poland Government Bond | ポーランド | 国債証券 | 10,850,000 | 93.10 412,640,147 | 92.96 412,041,797 | 2.750000 2029/10/25 | 0.67 |
| 23 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 南アフリカ | 国債証券 | 49,400,000 | 87.71 373,510,771 | 91.70 390,501,309 | 9.000000 2040/01/31 | 0.63 |
| 24 | POLAND GOVERNMENT BOND | ポーランド | 国債証券 | 9,000,000 | 101.33 372,572,833 | 100.75 370,425,757 | 5.000000 2030/01/25 | 0.60 |
| 25 | POLAND GOVERNMENT BOND | ポーランド | 国債証券 | 9,000,000 | 100.65 370,066,277 | 100.25 368,569,125 | 4.750000 2029/07/25 | 0.59 |
| 26 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 南アフリカ | 国債証券 | 47,700,000 | 82.57 339,522,818 | 87.06 358,000,978 | 8.750000 2044/01/31 | 0.58 |
| 27 | POLAND GOVERNMENT BOND | ポーランド | 国債証券 | 9,000,000 | 98.04 360,449,942 | 97.20 357,359,476 | 5.000000 2034/10/25 | 0.58 |
| 28 | INDONESIA TREASURY BOND | インドネシア | 国債証券 | 36,300,000,000 | 99.73 325,834,245 | 102.89 336,144,897 | 6.375000 2032/04/15 | 0.54 |
| 29 | BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL | ブラジル | 国債証券 | 15,000,000 | 77.74 326,069,899 | 80.06 335,793,201 | — 2027/07/01 | 0.54 |
| 30 | MEXICAN BONOS | メキシコ | 国債証券 | 40,000,000 | 100.63 326,062,933 | 101.52 328,957,244 | 8.500000 2028/03/02 | 0.53 |

(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 | 97.94% |
| 合計 | 97.94% |

(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 | 米ドル買/円売 2025年10月 | 買建 | 300,000 | 44,752,710 | 44,659,200 | 0.07% |
| | | 南アフリカ・ランド買/円売 2025年10月 | 買建 | 4,000,000 | 33,293,840 | 34,433,200 | 0.06% |
| | | インド・ルピー買/円売 2025年10月 | 買建 | 30,000,000 | 50,241,000 | 50,700,000 | 0.08% |

| 種類 | 地域 | 資産名 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価 | 時価 | 投資 比率 |
|----|----|------------------------------|-----------|----------------|------------|------------|----------|
| | | インドネシア・ルピア 買/円売 2025年10月 | 買建 | 11,000,000,000 | 97,933,000 | 99,000,000 | 0.16% |
| | | マレーシア・リンギット 買/円売 2025年10月 | 買建 | 959,000 | 33,805,613 | 33,845,411 | 0.05% |
| | | ポーランド・ズロチ買 /円売 2025年10月 | 買建 | 700,000 | 28,192,766 | 28,567,560 | 0.05% |
| | | ルーマニア・レイ売/ 円買 2025年10月 | 売建 | 2,100,000 | 71,996,400 | 72,035,460 | △0.12% |

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況 (2025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 | 347,463,236,502 | 97.88 |
| | 内 ヨーロ | 104,799,040,709 |
| | 内 中国 | 39,145,901,737 |
| | 内 シンガポール | 1,342,264,172 |
| | 内 マレーシア | 1,794,455,733 |
| | 内 イスラエル | 1,256,234,867 |
| | 内 ノルウェー | 531,607,724 |
| | 内 スウェーデン | 570,801,907 |
| | 内 デンマーク | 753,768,263 |
| | 内 イギリス | 19,594,907,492 |
| | 内 ポーランド | 2,220,997,840 |
| | 内 カナダ | 6,861,719,741 |
| | 内 アメリカ | 160,506,615,629 |
| | 内 メキシコ | 2,841,042,924 |
| | 内 オーストラリア | 4,335,239,294 |
| | 内 ニュージーランド | 908,638,470 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 7,542,182,521 | 2.12 |
| 純資産総額 | 355,005,419,023 | 100.00 |

その他の資産の投資状況

| 投資資産の種類 | 時価(円) | 投資比率(%) |
|------------|---------------|---------|
| 為替予約取引(買建) | 2,470,573,154 | 0.70 |
| 内 日本 | 2,470,573,154 | 0.70 |

(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 (2025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 | 100.98 1,791,559,599 | 100.63 1,785,332,438 | 1.850000 2027/05/15 | 0.50 |

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数 または 額面金額 | 簿価単価 簿価 (円) | 評価単価 時価 (円) | 利率(%) 償還期限 (年/月/日) | 投資 比率 (%) |
|----|----------------------------------|------|------|----------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|-----------------|
| 2 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 11,500,000 | 96.37 1,650,101,482 | 98.10 1,679,606,841 | 2.875000 2028/05/15 | 0.47 |
| 3 | CHINA GOVERNMENT BOND | 中国 | 国債証券 | 73,000,000 | 101.70 1,549,695,281 | 101.64 1,548,704,904 | 2.050000 2029/04/15 | 0.44 |
| 4 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 10,500,000 | 97.46 1,523,533,704 | 98.53 1,540,276,004 | 3.875000 2034/08/15 | 0.43 |
| 5 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 10,000,000 | 102.31 1,523,280,608 | 103.45 1,540,178,488 | 4.500000 2033/11/15 | 0.43 |
| 6 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 10,200,000 | 98.12 1,490,170,610 | 99.80 1,515,629,962 | 4.000000 2034/02/15 | 0.43 |
| 7 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 10,000,000 | 98.66 1,468,868,176 | 101.20 1,506,710,264 | 4.250000 2034/11/15 | 0.42 |
| 8 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 9,500,000 | 99.06 1,401,066,349 | 100.98 1,428,277,302 | 4.250000 2035/05/15 | 0.40 |
| 9 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 10,700,000 | 84.02 1,338,531,694 | 87.38 1,392,009,241 | 1.125000 2031/02/15 | 0.39 |
| 10 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 8,600,000 | 102.84 1,316,811,197 | 104.00 1,331,582,720 | 4.625000 2035/02/15 | 0.38 |
| 11 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 9,000,000 | 97.76 1,309,945,989 | 99.23 1,329,629,414 | 3.875000 2033/08/15 | 0.37 |
| 12 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 10,300,000 | 83.24 1,276,578,110 | 86.50 1,326,584,371 | 1.250000 2031/08/15 | 0.37 |
| 13 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 9,500,000 | 90.78 1,283,998,438 | 92.98 1,315,128,502 | 2.750000 2032/08/15 | 0.37 |
| 14 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 8,500,000 | 101.38 1,282,968,933 | 102.36 1,295,408,602 | 4.375000 2034/05/15 | 0.36 |
| 15 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 10,000,000 | 83.41 1,241,837,856 | 86.56 1,288,735,056 | 1.375000 2031/11/15 | 0.36 |
| 16 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 8,500,000 | 99.16 1,254,947,460 | 101.06 1,278,919,397 | 4.000000 2029/01/31 | 0.36 |
| 17 | CHINA GOVERNMENT BOND | 中国 | 国債証券 | 60,000,000 | 101.85 1,275,563,059 | 101.11 1,266,308,414 | 2.390000 2026/11/15 | 0.36 |
| 18 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 9,800,000 | 83.18 1,213,659,933 | 86.69 1,264,900,856 | 0.875000 2030/11/15 | 0.36 |
| 19 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 8,300,000 | 99.59 1,230,699,398 | 101.09 1,249,185,530 | 4.000000 2029/07/31 | 0.35 |
| 20 | CHINA GOVERNMENT BOND | 中国 | 国債証券 | 58,000,000 | 102.85 1,245,113,733 | 102.64 1,242,619,946 | 2.370000 2029/01/15 | 0.35 |
| 21 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 8,000,000 | 100.43 1,196,199,335 | 100.37 1,195,482,579 | 3.875000 2027/07/31 | 0.34 |
| 22 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 8,000,000 | 95.37 1,135,990,131 | 97.12 1,156,833,331 | 3.500000 2033/02/15 | 0.33 |
| 23 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 7,500,000 | 99.85 1,114,930,956 | 101.15 1,129,507,896 | 4.000000 2030/02/28 | 0.32 |

| | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 株数、口数 または 額面金額 | 簿価単価 簿価 (円) | 評価単価 時価 (円) | 利率(%) 償還期限 (年/月/日) | 投資 比率 (%) |
|----|----------------------------------|------|------|----------------------|-------------------------|-------------------------|--------------------------|-----------------|
| 24 | CHINA GOVERNMENT BOND | 中国 | 国債証券 | 50,000,000 | 103.99 1,085,333,564 | 104.30 1,088,495,672 | 2.540000 2030/12/25 | 0.31 |
| 25 | CHINA GOVERNMENT BOND | 中国 | 国債証券 | 52,000,000 | 100.41 1,089,875,373 | 100.18 1,087,330,179 | 1.790000 2032/03/25 | 0.31 |
| 26 | United States Treasury Note/Bond | アメリカ | 国債証券 | 8,000,000 | 85.94 1,023,663,148 | 89.05 1,060,668,761 | 1.625000 2031/05/15 | 0.30 |
| 27 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 7,000,000 | 100.19 1,044,170,009 | 101.13 1,054,019,780 | 4.000000 2030/03/31 | 0.30 |
| 28 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 7,000,000 | 99.50 1,037,013,254 | 100.37 1,046,068,100 | 4.000000 2027/01/15 | 0.29 |
| 29 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 7,000,000 | 99.04 1,032,238,636 | 100.18 1,044,067,152 | 3.750000 2027/08/15 | 0.29 |
| 30 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | アメリカ | 国債証券 | 7,900,000 | 85.84 1,009,672,161 | 88.73 1,043,670,238 | 1.875000 2032/02/15 | 0.29 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

| 投資有価証券の種類 | 投資比率 |
|-----------|--------|
| 国債証券 | 97.88% |
| 合計 | 97.88% |

(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 | デンマーク・クローネ買/円売 2025年10月 | 買建 | 418,000 | 9,611,032 | 9,770,332 | 0.00% |
| | | スウェーデン・クローネ買/円売 2025年10月 | 買建 | 639,000 | 9,894,403 | 10,080,864 | 0.00% |
| | | 米ドル買/円売 2025年10月 | 買建 | 6,449,000 | 953,437,667 | 959,694,336 | 0.27% |
| | | ユーロ買/円売 2025年10月 | 買建 | 3,029,000 | 526,537,308 | 528,379,238 | 0.15% |
| | | ニュージーランド・ドル買/円売 2025年10月 | 買建 | 827,000 | 71,461,483 | 71,100,498 | 0.02% |
| | | メキシコ・ペソ買/円売 2025年10月 | 買建 | 11,942,000 | 93,335,089 | 96,590,478 | 0.03% |
| | | カナダ・ドル買/円売 2025年10月 | 買建 | 358,000 | 38,225,163 | 38,267,023 | 0.01% |

| 種類 | 地域 | 資産名 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価 | 時価 | 投資 比率 |
|----|----|------------------------------|-----------|------------|-------------|-------------|----------|
| | | イスラエル・シュケル買/ 円売 2025年10月 | 買建 | 793,000 | 34,665,836 | 35,781,746 | 0.01% |
| | | 英ポンド買/円売 2025年 10月 | 買建 | 445,000 | 88,885,704 | 88,907,004 | 0.03% |
| | | マレーシア・リンギット 買/円売 2025年10月 | 買建 | 1,330,000 | 46,935,700 | 46,938,892 | 0.01% |
| | | ノルウェー・クローネ買/ 円売 2025年10月 | 買建 | 198,000 | 2,882,721 | 2,946,636 | 0.00% |
| | | シンガポール・ドル買/円 売 2025年10月 | 買建 | 282,000 | 32,239,227 | 32,516,856 | 0.01% |
| | | 豪ドル買/円売 2025年10 月 | 買建 | 151,000 | 14,772,571 | 14,779,985 | 0.00% |
| | | ポーランド・ズロチ買/円 売 2025年10月 | 買建 | 1,188,000 | 47,660,302 | 48,489,883 | 0.01% |
| | | オフショア人民元買/円売 2025年10月 | 買建 | 23,310,000 | 481,780,420 | 486,329,383 | 0.14% |

(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

2025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 | 20,269円 |
| 純資産総額 | 1,036億円 |



※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)

| 決算期 | 直近1年間分配金合計額: 0円 | | | | | 設定来分配金合計額: 0円 | | | | |
|-----|-----------------|--------------|--------------|--------------|--------------|---------------|--------------|--------------|--------------|--|
| | 第1期 17年9月 | 第2期 18年9月 | 第3期 19年9月 | 第4期 20年9月 | 第5期 21年9月 | 第6期 22年9月 | 第7期 23年9月 | 第8期 24年9月 | 第9期 25年9月 | |
| 分配金 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | |

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産額に対するものです。

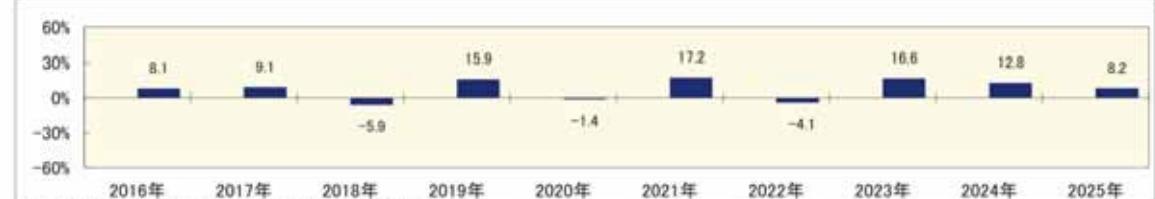
| マザーファンド(MF)別構成 | 比率 | 資産別構成 | 銘柄数 | 比率 | 通貨別構成 | 比率 | 組入上位銘柄(除く債券) | 国・地域名 | 比率 |
|------------------------|-------|-------------|-------|-------|----------|--------|----------------------------------|-------|------|
| トピックス・インデックス・MF | 12.7% | 外国債券 | 1,336 | 24.0% | 日本円 | 38.2% | INVEESCO FTSE RAFI EMERGING M | アメリカ | 1.2% |
| ダイワ新興国株式 F・INDEX・MF | 12.7% | 外国株式・先物 | 1,518 | 23.7% | 米ドル | 26.5% | WELLTOWER INC | アメリカ | 0.9% |
| 外国株式INDEXMF | 12.5% | 国内株式・先物 | 1,668 | 12.7% | ユーロ | 5.3% | 日本ビルファンド | 日本 | 0.9% |
| ダイワJ-REIT MF | 12.3% | 外国リート・先物 | 295 | 12.3% | 香港ドル | 4.0% | PROLOGIS INC | アメリカ | 0.8% |
| ダイワ新興国債券インデックス・MF | 12.3% | 国内リート・先物 | 59 | 12.3% | オフショア人民元 | 3.2% | NVIDIA CORP | アメリカ | 0.7% |
| ダイワ・グローバルREIT INDEX MF | 12.3% | 国内債券 | 394 | 12.0% | インド・ルピー | 2.5% | MSCI EMER MKT INDEX (GIC) DEC 25 | アメリカ | 0.7% |
| 外国債券INDEXMF | 12.2% | 外国投資信託等 | 6 | 1.3% | ブラジル・レアル | 2.4% | ジャパンリアルエスティート | 日本 | 0.7% |
| 日本債券インデックスMF(BPI) | 12.1% | | | | 台湾ドル | 2.0% | 日本都市ファンド投資法人 | 日本 | 0.6% |
| | | | | | 英ポンド | 1.7% | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 台湾 | 0.6% |
| | | コール・ローン、その他 | 4.0% | その他 | | 14.2% | APPLE INC | アメリカ | 0.6% |
| 合計 | 99.0% | 合計 | 5,276 | — | 合計 | 100.0% | 合計 | | 7.7% |

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2016年は設定日(9月8日)から年末、2025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) ファンドの総経费率

| | 総経费率 (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 | 0.28% | 0.24% | 0.04% |

*対象期間は2024年9月10日～2025年9月8日です。

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

*詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧下さい。

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い契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

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

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す。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す。

2【換金（解約）手続等】

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

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付けを行ないません。

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

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

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い合わせ下さい。

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できます。

（4）【計算期間】

毎年9月8日から翌年9月7日までとします。

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

（5）【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
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、信託契約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. 前 2. から前 4. までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前 2. から前 4. までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
6. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
8. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 信託約款の変更等

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

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を計算期間の末日および償還時に作成し、信託財産にかかる知れている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
 - ・委託会社のホームページ
アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>
3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

⑤ 公告

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

⑥ 関係法人との契約の更改

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

4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

〈収益分配金および償還金にかかる請求権〉

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

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

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

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

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

受益者が、収益分配金については支払開始日から5年間その支払いを請求しないときならびに信託終了による償還金については支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権

利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

＜換金請求権＞

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

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間（2024年9月10日から2025年9月8日まで）の財務諸表について、有限責任あづ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

2025年10月17日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あづさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている i F r e e 8 資産バランスの2024年9月10日から2025年9月8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2025年9月8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、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、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 Free 8 資産バランス

(1) 【貸借対照表】

| | 第8期 2024年9月9日現在 金額(円) | 第9期 2025年9月8日現在 金額(円) |
|-----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 886,721,793 | 1,144,368,519 |
| 親投資信託受益証券 | 75,510,651,169 | 100,429,988,578 |
| 未収入金 | - | 18,681,000 |
| 流動資産合計 | 76,397,372,962 | 101,593,038,097 |
| 資産合計 | 76,397,372,962 | 101,593,038,097 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 21,413,270 | 49,387,907 |
| 未払受託者報酬 | 8,334,733 | 10,068,290 |
| 未払委託者報酬 | 83,347,852 | 100,683,140 |
| その他未払費用 | 1,115,667 | 1,105,271 |
| 流動負債合計 | 114,211,522 | 161,244,608 |
| 負債合計 | 114,211,522 | 161,244,608 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ※1 43,473,244,825 | 50,715,259,694 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△) | 32,809,916,615 | 50,716,533,795 |
| (分配準備積立金) | 13,806,053,673 | 24,062,213,998 |
| 元本等合計 | 76,283,161,440 | 101,431,793,489 |
| 純資産合計 | 76,283,161,440 | 101,431,793,489 |
| 負債純資産合計 | 76,397,372,962 | 101,593,038,097 |

(2) 【損益及び剩余金計算書】

| | 第8期 自 2023年9月8日 至 2024年9月9日 金額(円) | 第9期 自 2024年9月10日 至 2025年9月8日 金額(円) |
|---|--|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 468,025 | 3,874,453 |
| 有価証券売買等損益 | 4,811,259,364 | 11,932,875,409 |
| 営業収益合計 | 4,811,727,389 | 11,936,749,862 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 56,726 | - |
| 受託者報酬 | 15,285,162 | 19,247,898 |
| 委託者報酬 | 152,852,589 | 192,479,637 |
| その他費用 | 2,210,929 | 2,192,546 |
| 営業費用合計 | 170,405,406 | 213,920,081 |
| 営業利益又は営業損失(△) | 4,641,321,983 | 11,722,829,781 |
| 経常利益又は経常損失(△) | 4,641,321,983 | 11,722,829,781 |
| 当期純利益又は当期純損失(△) | 4,641,321,983 | 11,722,829,781 |
| 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(△) | 334,562,436 | 376,139,349 |
| 期首剩余金又は期首次損金(△) | 23,485,381,199 | 32,809,916,615 |
| 剩余金増加額又は欠損金減少額 | 7,825,989,829 | 9,520,904,409 |
| 当期追加信託に伴う剩余金増加額 又は欠損金減少額 | 7,825,989,829 | 9,520,904,409 |
| 剩余金減少額又は欠損金増加額 | 2,808,213,960 | 2,960,977,661 |
| 当期一部解約に伴う剩余金減少額 又は欠損金増加額 | 2,808,213,960 | 2,960,977,661 |
| 分配金 | ※1 | - |
| 期末剩余金又は期末欠損金(△) | 32,809,916,615 | 50,716,533,795 |

(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9期 自 2024年9月10日 至 2025年9月8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、前計算期間末日を2024年9月9日としており、2025年9月7日が休日のため、当計算期間末日を2025年9月8日としております。このため、当計算期間は364日となっております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 第8期 2024年9月9日現在 | 第9期 2025年9月8日現在 |
|---------------------------------------|--|--|
| 1. ※1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額 | 37,138,831,604円 10,741,153,643円 4,406,740,422円 | 43,473,244,825円 11,116,436,322円 3,874,421,453円 |
| 2. 計算期間末日における受益権の総数 | 43,473,244,825口 | 50,715,259,694口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 区分 | 第8期 自 2023年9月8日 至 2024年9月9日 | 第9期 自 2024年9月10日 至 2025年9月8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(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。 | 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(3,810,277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(11,342,880,155円)、投資信託約款に規定される収益調整金(26,654,319,797円)及び分配準備積立金(12,715,523,566円)より分配対象額は50,716,533,795円(1万口当たり10,000.25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9期 自 2024年9月10日 至 2025年9月8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9期 2025年9月8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8期 2024年9月9日現在 | 第9期 2025年9月8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 | 4,736,207,037 | 11,853,427,097 |
| 合計 | 4,736,207,037 | 11,853,427,097 |

(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8期 2024年9月9日現在 | 第9期 2025年9月8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9期 自 2024年9月10日 至 2025年9月8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8期 2024年9月9日現在 | 第9期 2025年9月8日現在 |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1,7547円 (17,547円) | 2,0000円 (20,000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 | 3,884,372,488 | 12,592,747,168 | |
| | ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド | 6,027,006,055 | 12,422,864,880 | |
| | トピックス・インデックス・マザーファンド | 5,578,054,919 | 13,050,975,093 | |
| | 外国株式インデックススマザーファンド | 1,654,770,220 | 12,651,876,671 | |
| | 外国債券インデックススマザーファンド | 3,253,312,085 | 12,412,361,597 | |
| | ダイワJ-REITマザーファンド | 3,382,075,391 | 12,547,499,700 | |
| | ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド | 3,063,070,087 | 12,585,542,373 | |
| | ダイワ日本債券インデックススマザーファンド(BPI) | 10,620,795,370 | 12,166,121,096 | |
| 親投資信託受益証券 合計 | | | 100,429,988,578 | |
| 合計 | | | 100,429,988,578 | |

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

| | 2024年9月9日現在 金額(円) | 2025年9月8日現在 金額(円) |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 434,219,690 | 1,319,085,304 |
| コール・ローン | 641,660,171 | 823,923,192 |
| 株式 | 29,745,850,940 | 45,168,130,497 |
| 投資証券 | 3,756,297,672 | 4,512,493,251 |
| 派生商品評価勘定 | – | 151,539,800 |
| 未収入金 | 44,715 | – |
| 未収配当金 | 124,016,142 | 128,205,501 |
| 差入委託証拠金 | 627,842,549 | 879,652,004 |
| 流動資産合計 | 35,329,931,879 | 52,983,029,549 |
| 資産合計 | 35,329,931,879 | 52,983,029,549 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 39,295,440 | – |
| 未払解約金 | 10,873,400 | 41,205,600 |
| その他未払費用 | 200,797 | 240,561 |
| 流動負債合計 | 50,369,637 | 41,446,161 |
| 負債合計 | 50,369,637 | 41,446,161 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ※1 14,193,724,013 | 16,330,611,260 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 21,085,838,229 | 36,610,972,128 |
| 元本等合計 | 35,279,562,242 | 52,941,583,388 |
| 純資産合計 | 35,279,562,242 | 52,941,583,388 |
| 負債純資産合計 | 35,329,931,879 | 52,983,029,549 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | 自 2024 年 9 月 10 日 至 2025 年 9 月 8 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 | 受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 |

| 区分 | 自 2024 年 9 月 10 日 至 2025 年 9 月 8 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 | 外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計算処理を採用しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 2024 年 9 月 9 日現在 | 2025 年 9 月 8 日現在 |
|---|---------------------|---------------------|
| 1. ※1 期首 | | |
| 期首元本額 | 2023 年 9 月 8 日 | 2024 年 9 月 10 日 |
| 期中追加設定元本額 | 13, 502, 028, 807 円 | 14, 193, 724, 013 円 |
| 期中一部解約元本額 | 2, 907, 302, 409 円 | 2, 745, 247, 640 円 |
| | 2, 215, 607, 203 円 | 608, 360, 393 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) | 119, 662, 376 円 | 133, 681, 504 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) | 476, 159, 782 円 | 476, 414, 216 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) | 350, 897, 362 円 | 371, 156, 061 円 |
| D-I's 新興国株式インデッ クス | 123, 581, 490 円 | 105, 107, 616 円 |
| i Free 新興国株式インデッ クス | 7, 328, 195, 695 円 | 9, 168, 248, 570 円 |
| i Free 8 資産バランス | 3, 680, 542, 853 円 | 3, 884, 372, 488 円 |
| ダイワ新興国株式インデックス (為替ヘッジなし) (投資一任 専用) | 8, 958, 674 円 | 7, 398, 917 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) | 654, 366 円 | - 円 |
| D C 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, 697, 409, 720 円 | 1, 833, 401, 247 円 |
| ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式 | 304, 589, 361 円 | 256, 234, 459 円 |

| 区分 | 2024年9月9日現在 | 2025年9月8日現在 |
|-------------------------|------------------|------------------|
| ダイワ・ノーロード 新興国株式 ファンド | 103,072,334 円 | 94,596,182 円 |
| 計 | 14,193,724,013 円 | 16,330,611,260 円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 14,193,724,013 口 | 16,330,611,260 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 2024年9月10日 至 2025年9月8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 | 2025年9月8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 | 2025年9月8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 | 2024年9月9日現在 | 2025年9月8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 投資証券 | △1,049,019,484 △121,652,687 | 1,645,592,520 143,272,436 |
| 合計 | △1,170,672,171 | 1,788,864,956 |

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

| 種類 | 2024年9月9日現在 | | | 2025年9月8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) |
| 市場取引 | | | | | | |
| 株価指数 先物取引 | | | | | | |
| 買建 | 1,475,213,668 | - | 1,436,845,112 | △38,368,556 | 2,698,100,769 | - |
| 合計 | 1,475,213,668 | - | 1,436,845,112 | △38,368,556 | 2,698,100,769 | - |
| | | | | | | |
| | | | | | | |

(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。

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

2. 通貨関連

| 種類 | 2024年9月9日現在 | | | 2025年9月8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) |
| 市場取引以外の 取引 | | | | | | |

| 種類 | 2024年9月9日現在 | | | | 2025年9月8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 | | うち 1年超 | うち 1年超 | | うち 1年超 | |
| 為替予約取引 | | | | | | | | |
| 売建 | - | - | - | - | 889,702 | - | 889,489 | 213 |
| メキシコ・ペソ | - | - | - | - | 889,702 | - | 889,489 | 213 |
| 買建 | 40,740,644 | - | 39,813,760 | △926,884 | 15,557,922 | - | 15,687,803 | 129,881 |
| アメリカ・ドル | 40,740,644 | - | 39,813,760 | △926,884 | 15,557,922 | - | 15,687,803 | 129,881 |
| 合計 | 40,740,644 | - | 39,813,760 | △926,884 | 16,447,624 | - | 16,577,292 | 130,094 |

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1 口当たり情報)

| | 2024年9月9日現在 | 2025年9月8日現在 |
|----------------------------|------------------------|------------------------|
| 1 口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 2,4856 円 (24,856 円) | 3,2419 円 (32,419 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 | 42,000 | 17.140 | 719,880.000 | |
| | CANADIAN SOLAR INC | 18,500 | 11.170 | 206,645.000 | |
| | IQIYI INC-ADR | 126,000 | 2.710 | 341,460.000 | |
| | TECENT MUSIC ENTERTAINM-ADR | 17,700 | 24.490 | 433,473.000 | |
| | PINDUODUO INC-ADR | 8,700 | 124.680 | 1,084,716.000 | |
| | KE HOLDINGS INC-ADR | 14,300 | 18.990 | 271,557.000 | |
| | DAQO NEW ENERGY CORP-ADR | 13,400 | 29.210 | 391,414.000 | |
| | SBERBANK ROSSII | 698,708 | 0.000 | 0.000 | |
| | JINKOSOLAR HOLDING ADR REP LTD | 14,900 | 25.480 | 379,652.000 | |
| | 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 | |
| | QFIN HOLDINGS ADR INC | 4,900 | 28.770 | 140,973.000 | |
| | 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 | |
| | AEROFLOT PJSC | 164,910 | 0.000 | 0.000 | |
| アメリカ・ドル 小計 | | | | 3,969,770.000 (589,391,753) | |
| インド・ルピー | BHARTI AIRTEL PARTLY PAID LTD | 3,608 | 1,436.950 | 5,184,515.600 | |
| | JIO FINANCIAL SERVICES LTD | 129,991 | 309.400 | 40,219,215.400 | |
| | TATA STEEL LTD | 617,810 | 167.680 | 103,594,380.800 | |
| | AXIS BANK LTD | 91,997 | 1,055.900 | 97,139,632.300 | |
| | MARUTI SUZUKI INDIA LTD | 3,155 | 14,895.000 | 46,993,725.000 | |
| | TATA POWER CO LTD | 44,549 | 385.800 | 17,187,004.200 | |
| | FEDERAL BANK LTD | 92,910 | 190.520 | 17,701,213.200 | |
| | BANK OF BARODA | 110,407 | 234.260 | 25,863,943.820 | |
| | HINDUSTAN UNILEVER LTD | 18,566 | 2,633.400 | 48,891,704.400 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----|------------------------------|-------------|--------------|--------------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| | HINDUSTAN PETROLEUM CORP | 107, 210 | 383. 600 | 41, 125, 756. 000 | |
| | STATE BANK OF INDIA | 116, 609 | 806. 600 | 94, 056, 819. 400 | |
| | NTPC LTD | 261, 836 | 328. 700 | 86, 065, 493. 200 | |
| | POWER FINANCE CORPORATION | 157, 365 | 394. 400 | 62, 064, 756. 000 | |
| | JSW STEEL LTD | 28, 598 | 1, 073. 100 | 30, 688, 513. 800 | |
| | POWER GRID CORP OF INDIA LTD | 241, 479 | 285. 350 | 68, 906, 032. 650 | |
| | INDIAN OIL CORP LTD | 309, 597 | 139. 650 | 43, 235, 221. 050 | |
| | BAJAJ FINSERV LTD | 11, 345 | 2, 014. 400 | 22, 853, 368. 000 | |
| | BHARAT PETROLEUM CORP LTD | 172, 724 | 312. 500 | 53, 976, 250. 000 | |
| | PUNJAB NATIONAL BANK | 216, 474 | 103. 750 | 22, 459, 177. 500 | |
| | STEEL AUTHORITY OF INDIA | 240, 861 | 129. 260 | 31, 133, 692. 860 | |
| | JINDAL STEEL LTD | 28, 454 | 1, 034. 850 | 29, 445, 621. 900 | |
| | CANARA BANK | 224, 158 | 107. 140 | 24, 016, 288. 120 | |
| | UNION BANK OF INDIA | 165, 991 | 127. 340 | 21, 137, 293. 940 | |
| | ULTRATECH CEMENT LTD | 1, 986 | 12, 601. 000 | 25, 025, 586. 000 | |
| | KOTAK MAHINDRA BANK LTD | 20, 038 | 1, 945. 500 | 38, 983, 929. 000 | |
| | OIL INDIA LTD | 48, 136 | 396. 400 | 19, 081, 110. 400 | |
| | SHRIRAM FINANCE LTD | 53, 268 | 592. 500 | 31, 561, 290. 000 | |
| | TECH MAHINDRA LTD | 20, 866 | 1, 477. 900 | 30, 837, 861. 400 | |
| | YES BANK LTD | 1, 124, 842 | 20. 440 | 22, 991, 770. 480 | |
| | REC LTD | 86, 270 | 366. 150 | 31, 587, 760. 500 | |
| | COAL INDIA LTD | 138, 787 | 392. 650 | 54, 494, 715. 550 | |
| | INDUSIND BANK LTD | 38, 319 | 757. 050 | 29, 009, 398. 950 | |
| | BAJAJ FINANCE LTD | 38, 240 | 937. 600 | 35, 853, 824. 000 | |
| | INDUS TOWERS LTD | 73, 058 | 337. 400 | 24, 649, 769. 200 | |
| | GAIL INDIA LTD | 224, 065 | 173. 970 | 38, 980, 588. 050 | |
| | HINDALCO INDUSTRIES LTD | 88, 756 | 743. 800 | 66, 016, 712. 800 | |
| | GRASIM INDUSTRIES LTD | 11, 637 | 2, 804. 000 | 32, 630, 148. 000 | |
| | WIPRO LTD | 62, 662 | 243. 670 | 15, 268, 849. 540 | |
| | TATA CONSULTANCY SVCS LTD | 28, 443 | 3, 048. 300 | 86, 702, 796. 900 | |
| | INFOSYS LTD | 98, 020 | 1, 444. 600 | 141, 599, 692. 000 | |
| | LARSEN & TOUBRO LTD | 20, 484 | 3, 553. 600 | 72, 791, 942. 400 | |
| | TATA MOTORS LTD | 127, 732 | 691. 700 | 88, 352, 224. 400 | |
| | DR. REDDY'S LABORATORIES | 18, 695 | 1, 268. 100 | 23, 707, 129. 500 | |
| | HDFC BANK LIMITED | 315, 618 | 963. 400 | 304, 066, 381. 200 | |
| | ICICI BANK LTD | 120, 003 | 1, 402. 800 | 168, 340, 208. 400 | |
| | RELIANCE INDUSTRIES LTD | 260, 907 | 1, 375. 000 | 358, 747, 125. 000 | |
| | OIL & NATURAL GAS CORP LTD | 270, 203 | 234. 130 | 63, 262, 628. 390 | |
| | ITC LTD | 106, 344 | 407. 350 | 43, 319, 228. 400 | |
| | MAHINDRA & MAHINDRA LTD | 22, 275 | 3, 561. 300 | 79, 327, 957. 500 | |
| | HERO MOTOCORP LTD | 6, 689 | 5, 363. 000 | 35, 873, 107. 000 | |
| | BHARTI AIRTEL LTD | 45, 726 | 1, 895. 300 | 86, 664, 487. 800 | |
| | UPL LTD | 34, 005 | 688. 850 | 23, 424, 344. 250 | |
| | SUN PHARMACEUTICAL INDUS | 18, 283 | 1, 593. 600 | 29, 135, 788. 800 | |
| | HCL TECHNOLOGIES LTD | 33, 331 | 1, 419. 000 | 47, 296, 689. 000 | |
| | VEDANTA LTD | 162, 367 | 445. 500 | 72, 334, 498. 500 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|---------------|-----------------------------------|-------------|-------------|---|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| インド・ルピー 小計 | | | | 3, 255, 859, 162. 450 (5, 502, 401, 985) | |
| インドネシア・ルピア | ASTRA INTERNATIONAL TBK PT | 640, 200 | 5, 500. 000 | 3, 521, 100, 000. 000 | |
| | TELKOM INDONESIA PERSERO TBK | 2, 800, 500 | 3, 150. 000 | 8, 821, 575, 000. 000 | |
| | BANK NEGARA INDONESIA PERSER | 1, 052, 500 | 4, 370. 000 | 4, 599, 425, 000. 000 | |
| | BANK CENTRAL ASIA TBK PT | 1, 440, 600 | 8, 000. 000 | 11, 524, 800, 000. 000 | |
| | BANK MANDIRI PERSERO TBK PT | 2, 282, 200 | 4, 680. 000 | 10, 680, 696, 000. 000 | |
| | BANK RAKYAT INDONESIA PERSER | 4, 417, 300 | 4, 000. 000 | 17, 669, 200, 000. 000 | |
| インドネシア・ルピア 小計 | | | | 56, 816, 796, 000. 000 (517, 032, 844) | |
| オフショア・人民元 | CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD | 667, 200 | 2. 400 | 1, 601, 280. 000 | |
| | INDUSTRIAL BANK CO LTD -A | 304, 500 | 21. 750 | 6, 622, 875. 000 | |
| | BANK OF BEIJING CO LTD -A | 261, 100 | 6. 060 | 1, 582, 266. 000 | |
| | PING AN INSURANCE GROUP CO-A | 108, 853 | 57. 900 | 6, 302, 588. 700 | |
| | IND & COMM BK OF CHINA-A | 730, 100 | 7. 440 | 5, 431, 944. 000 | |
| | SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A | 30, 900 | 18. 330 | 566, 397. 000 | |
| | GREAT WALL MOTOR CO LTD-A | 8, 900 | 26. 070 | 232, 023. 000 | |
| | CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A | 42, 000 | 12. 900 | 541, 800. 000 | |
| | KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A | 2, 100 | 1, 483. 000 | 3, 114, 300. 000 | |
| | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A | 51, 200 | 23. 770 | 1, 217, 024. 000 | |
| | BANK OF JIANGSU CO LTD-A | 162, 700 | 10. 660 | 1, 734, 382. 000 | |
| | POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A | 337, 200 | 7. 740 | 2, 609, 928. 000 | |
| | SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A | 586, 300 | 13. 690 | 8, 026, 447. 000 | |
| | CITIC SECURITIES CO-A | 47, 300 | 29. 830 | 1, 410, 959. 000 | |
| | CHINA MERCHANTS BANK-A | 122, 800 | 42. 760 | 5, 250, 928. 000 | |
| | PING AN BANK CO LTD-A | 267, 300 | 11. 720 | 3, 132, 756. 000 | |
| | CHINA STATE CONSTRUCTION -A | 1, 258, 600 | 5. 490 | 6, 909, 714. 000 | |
| | HAIER SMART HOME CO LTD-A | 25, 700 | 26. 460 | 680, 022. 000 | |
| | BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A | 281, 300 | 4. 110 | 1, 156, 143. 000 | |
| | SAIC MOTOR CORP LTD-A | 108, 000 | 19. 020 | 2, 054, 160. 000 | |
| | XIAMEN C & D INC-A | 163, 900 | 10. 400 | 1, 704, 560. 000 | |
| | BBMG CORPORATION-A | 353, 100 | 1. 600 | 564, 960. 000 | |
| | CHINA GALAXY SECURITIES CO-A | 25, 300 | 17. 210 | 435, 413. 000 | |
| | CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A | 50, 900 | 6. 470 | 329, 323. 000 | |
| | POWER CONSTRUCTION CORP OF-A | 301, 100 | 5. 750 | 1, 731, 325. 000 | |
| | CHINA COAL ENERGY CO-A | 43, 400 | 11. 150 | 483, 910. 000 | |
| | COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A | 171, 690 | 15. 120 | 2, 595, 952. 800 | |
| | METALLURGICAL CORP OF CHIN-A | 382, 500 | 3. 430 | 1, 311, 975. 000 | |
| | ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A | 110, 300 | 7. 700 | 849, 310. 000 | |
| | JIANGXI COPPER CO LTD-A | 32, 700 | 29. 390 | 961, 053. 000 | |
| | YANKUANG ENERGY GROUP LTD A | 57, 250 | 12. 990 | 743, 677. 500 | |
| | CHINA CONSTRUCTION BANK-A | 59, 000 | 9. 050 | 533, 950. 000 | |
| | AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A | 807, 300 | 7. 300 | 5, 893, 290. 000 | |
| | BANK OF CHINA LTD-A | 331, 700 | 5. 520 | 1, 830, 984. 000 | |
| | PETROCHINA CO LTD-A | 310, 500 | 8. 900 | 2, 763, 450. 000 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----------------|------------------------------------|-----------|---------|------------------------------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| CHN | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A | 732,600 | 5.690 | 4,168,494.000 | |
| | CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A | 60,600 | 28.070 | 1,701,042.000 | |
| | BANK OF COMMUNICATIONS CO-A | 510,900 | 7.260 | 3,709,134.000 | |
| | CHINA SHENHUA ENERGY CO-A | 41,400 | 38.160 | 1,579,824.000 | |
| | CHINA VANKE CO LTD -A | 347,000 | 6.590 | 2,286,730.000 | |
| | CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A | 66,300 | 38.040 | 2,522,052.000 | |
| | CHINA CITIC BANK CORP LTD-A | 287,400 | 7.810 | 2,244,594.000 | |
| | CHINA MINSHENG BANKING-A | 812,700 | 4.470 | 3,632,769.000 | |
| | PICC HOLDING CO-A | 73,000 | 8.390 | 612,470.000 | |
| | CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A | 792,000 | 3.710 | 2,938,320.000 | |
| | CRRC CORP LTD-A | 136,700 | 7.490 | 1,023,883.000 | |
| | CHINA UNITED NETWORK-A | 283,100 | 5.390 | 1,525,909.000 | |
| | CGN POWER CO LTD-A | 51,100 | 3.670 | 187,537.000 | |
| | HUATAI SECURITIES CO LTD-A | 31,700 | 20.420 | 647,314.000 | |
| | CHINA RAILWAY GROUP LTD-A | 534,600 | 5.550 | 2,967,030.000 | |
| | BAOSHAN IRON & STEEL CO-A | 226,500 | 6.970 | 1,578,705.000 | |
| | NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A | 13,000 | 63.330 | 823,290.000 | |
| | HUAXIA BANK CO LTD-A | 281,800 | 7.340 | 2,068,412.000 | |
| | BYD CO LTD -A | 5,700 | 107.260 | 611,382.000 | |
| | WEICHAI POWER CO LTD-A | 44,900 | 14.890 | 668,561.000 | |
| | ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A | 59,400 | 25.270 | 1,501,038.000 | |
| | HUANENG POWER INTL INC-A | 64,000 | 7.550 | 483,200.000 | |
| | POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A | 223,100 | 6.200 | 1,383,220.000 | |
| | CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A | 285,400 | 3.080 | 879,032.000 | |
| オフショア・人民元 小計 | | | | 124,655,012.000 (2,595,678,850) | |
| サウジアラビア・リアル | SAUDI ARABIAN MINING | 35,154 | 53.300 | 1,873,708.200 | |
| | SABIC AGRI-NUTRIENTS | 6,538 | 115.000 | 751,870.000 | |
| | SAUDI AWWAL BANK | 28,600 | 30.280 | 866,008.000 | |
| | ALMARAI | 14,314 | 48.100 | 688,503.400 | |
| | SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP | 28,386 | 60.000 | 1,703,160.000 | |
| | SAUDI TELECOM CO | 52,816 | 41.820 | 2,208,765.120 | |
| | AL RAJHI BANK | 47,565 | 93.650 | 4,454,462.250 | |
| | RIYAD BANK | 40,995 | 26.180 | 1,073,249.100 | |
| | ETIHAD ETISALAT CO | 12,917 | 61.900 | 799,562.300 | |
| | ALINMA BANK | 49,136 | 24.820 | 1,219,555.520 | |
| | THE SAUDI NATIONAL BANK | 72,605 | 34.980 | 2,539,722.900 | |
| | SAUDI ARABIAN OIL CO | 196,147 | 23.470 | 4,603,570.090 | |
| サウジアラビア・リアル 小計 | | | | 22,782,136.880 (903,539,549) | |
| THA | SCB X PUBLIC COMPANY LIMITED NON-V | 179,800 | 126.500 | 22,744,700.000 | |
| | SIAM CEMENT PCL-NVDR | 99,600 | 219.000 | 21,812,400.000 | |
| | KASIKORN BANK PCL-NVDR | 203,500 | 170.000 | 34,595,000.000 | |
| | TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR | 3,719,100 | 1.910 | 7,103,481.000 | |
| | INDORAMA VENTURES PCL-NVDR | 359,100 | 22.100 | 7,936,110.000 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|-----------|------------------------------|-----------|------------|------------------------------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| THB | ADVANCED INFO SERVICE-NVDR | 49,900 | 293.000 | 14,620,700.000 | |
| | KRUNG THAI BANK - NVDR | 673,400 | 25.250 | 17,003,350.000 | |
| | BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR | 1,505,600 | 4.980 | 7,497,888.000 | |
| | BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR | 481,000 | 21.000 | 10,101,000.000 | |
| | PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR | 163,600 | 112.000 | 18,323,200.000 | |
| | BANGCHAK CORP PCL-NVDR | 195,600 | 30.750 | 6,014,700.000 | |
| | PTT PCL-NVDR | 686,000 | 31.500 | 21,609,000.000 | |
| | THAI OIL PCL-NVDR | 376,600 | 33.750 | 12,710,250.000 | |
| | CP ALL PCL-NVDR | 401,200 | 47.500 | 19,057,000.000 | |
| | BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR | 65,000 | 152.000 | 9,880,000.000 | |
| | CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR | 523,600 | 22.500 | 11,781,000.000 | |
| | PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR | 534,900 | 27.750 | 14,843,475.000 | |
| タイ・バーツ 小計 | | | | 257,633,254.000 (1,192,841,967) | |
| CLP | SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B | 15,853 | 44,160.000 | 700,068,480.000 | |
| | BANCO DE CHILE | 1,689,366 | 146.980 | 248,303,014.680 | |
| チリ・ペソ 小計 | | | | 948,371,494.680 (145,690,725) | |
| TRY | AKBANK T. A. S. | 332,664 | 62.450 | 20,774,866.800 | |
| | TURKIYE IS BANKASI-C | 821,090 | 13.690 | 11,240,722.100 | |
| | TURKCELL ILETISIM HIZMET AS | 99,505 | 90.050 | 8,960,425.250 | |
| | TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE | 172,197 | 167.500 | 28,842,997.500 | |
| | EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK | 663,979 | 27.340 | 18,153,185.860 | |
| | HACI OMER SABANCI HOLDING | 188,702 | 85.800 | 16,190,631.600 | |
| | YAPI VE KREDI BANKASI | 451,111 | 30.300 | 13,668,663.300 | |
| | KOC HOLDING AS | 262,937 | 168.000 | 44,173,416.000 | |
| | TURK HAVA YOLLARI AO | 82,811 | 319.500 | 26,458,114.500 | |
| | TURK SISE VE CAM FABRIKALARI | 198,548 | 37.680 | 7,481,288.640 | |
| トルコ・リラ 小計 | | | | 209,867,336.550 (756,256,947) | |
| BRL | CIA PARANAENSE DE ENERGIA | 84,100 | 11.400 | 958,740.000 | |
| | ENERGISA SA-UNITS | 48,400 | 50.030 | 2,421,452.000 | |
| | BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT | 58,300 | 46.270 | 2,697,541.000 | |
| | VIBRA ENERGIA SA | 193,700 | 24.950 | 4,832,815.000 | |
| | TIM SA | 72,900 | 22.950 | 1,673,055.000 | |
| | SENDAS DISTRIBUIDORA SA | 339,700 | 10.500 | 3,566,850.000 | |
| | HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE | 60,160 | 41.380 | 2,489,420.800 | |
| | PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | 783,300 | 30.590 | 23,961,147.000 | |
| | USINAS SIDER MINAS GER-PF A | 149,400 | 4.520 | 675,288.000 | |
| | BANCO BRADESCO SA-PREF | 1,085,759 | 17.240 | 18,718,485.160 | |
| | ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF | 584,519 | 38.360 | 22,422,148.840 | |
| | CIA SIDERURGICA NACIONAL SA | 295,700 | 7.790 | 2,303,503.000 | |
| | VALE SA | 755,090 | 56.220 | 42,451,159.800 | |
| | GERDAU SA-PREF | 322,292 | 17.440 | 5,620,772.480 | |
| | PETROBRAS - PETROLEO BRAS | 539,700 | 32.900 | 17,756,130.000 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|-----------------|------------------------------|-----------|---------|------------------------------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| BRL | CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF | 154,374 | 11.140 | 1,719,726.360 | |
| | ITAUSA SA | 324,429 | 11.150 | 3,617,383.350 | |
| | BRASKEM SA-PREF A | 89,500 | 9.400 | 841,300.000 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B | 21,700 | 48.040 | 1,042,468.000 | |
| | BANCO DO BRASIL S. A. | 285,900 | 21.150 | 6,046,785.000 | |
| | COSAN SA | 355,700 | 7.300 | 2,596,610.000 | |
| | CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER | 122,200 | 45.540 | 5,564,988.000 | |
| | CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB | 111,600 | 12.250 | 1,367,100.000 | |
| | EMBRAER SA | 20,200 | 82.040 | 1,657,208.000 | |
| | METALURGICA GERDAU SA-PREF | 149,000 | 9.750 | 1,452,750.000 | |
| | MOTIVA INFRAESTRUTURA DE MOB | 146,700 | 14.900 | 2,185,830.000 | |
| | BRF SA | 64,800 | 19.770 | 1,281,096.000 | |
| | NATURA COSMETICOS SA | 113,300 | 8.840 | 1,001,572.000 | |
| | CIA SANEAMENTO BASICO DE SP | 25,100 | 124.870 | 3,134,237.000 | |
| | LOJAS RENNER S. A. | 112,692 | 16.350 | 1,842,514.200 | |
| | USINAS SIDERURGICAS DE MINAS | 55,100 | 4.600 | 253,460.000 | |
| | SUZANO SA | 62,745 | 51.990 | 3,262,112.550 | |
| | LOCALIZA RENT A CAR | 94,700 | 38.100 | 3,608,070.000 | |
| | MARFRIG GLOBAL FOODS SA | 137,300 | 23.550 | 3,233,415.000 | |
| | B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO | 333,700 | 13.380 | 4,464,906.000 | |
| | EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD | 84,100 | 36.590 | 3,077,219.000 | |
| | CIA ENERGETICA DE MINAS GER | 6,009 | 15.450 | 92,839.050 | |
| | BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT | 50,500 | 29.190 | 1,474,095.000 | |
| | RAIA DROGASIL SA | 63,100 | 17.350 | 1,094,785.000 | |
| | TELEFONICA BRASIL S. A. | 108,400 | 34.000 | 3,685,600.000 | |
| | KLABIN SA - UNIT | 79,290 | 18.520 | 1,468,450.800 | |
| | ULTRAPAR PARTICIPACOES SA | 141,700 | 21.040 | 2,981,368.000 | |
| | ITAU UNIBANCO HOLDING SA | 53,790 | 34.450 | 1,853,065.500 | |
| | BANCO BRADESCO S. A. | 320,221 | 14.710 | 4,710,450.910 | |
| | AMBEV SA | 397,800 | 12.250 | 4,873,050.000 | |
| ブラジル・レアル 小計 | | | | 228,032,962.800 (6,252,527,021) | |
| マレーシア・リ ンギット | MALAYAN BANKING BHD | 140,500 | 9.990 | 1,403,595.000 | |
| | PUBLIC BANK BERHAD | 229,300 | 4.270 | 979,111.000 | |
| | CIMB GROUP HOLDINGS BHD | 303,700 | 7.300 | 2,217,010.000 | |
| | TENAGA NASIONAL BHD | 164,000 | 13.060 | 2,141,840.000 | |
| マレーシア・リンギット 小計 | | | | 6,741,556.000 (237,012,210) | |
| メキシコ・ペソ | AMERICA MOVIL L | 1,654,100 | 18.300 | 30,270,030.000 | |
| | COCA-COLA FEMSA SAB DE CV | 28,815 | 155.990 | 4,494,851.850 | |
| | GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B | 10,200 | 466.390 | 4,757,178.000 | |
| | CEMEX SAB-CPO | 1,717,719 | 17.590 | 30,214,677.210 | |
| | FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD | 136,700 | 159.530 | 21,807,751.000 | |
| | ARCA CONTINENTAL SAB DE CV | 30,100 | 189.540 | 5,705,154.000 | |
| | GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B | 95,900 | 127.020 | 12,181,218.000 | |
| | WALMART DE MEXICO SAB DE CV | 321,800 | 57.050 | 18,358,690.000 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|---------|-----------------------------------|------------|---------|------------------------------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| | GRUPO FINANCIERO BANORTE-O | 138,300 | 175.630 | 24,289,629.000 | |
| メキシコ・ペソ | 小計 | | | 152,079,179.060 (1,205,896,642) | |
| 香港・ドル | TRIP.COM GROUP LTD | 12,800 | 572.000 | 7,321,600.000 | |
| | XPENG CLASS A INC | 20,000 | 77.900 | 1,558,000.000 | |
| | LI AUTO CLASS A INC | 26,800 | 93.150 | 2,496,420.000 | |
| | JD LOGISTICS INC | 119,800 | 13.090 | 1,568,182.000 | |
| | YUM CHINA HOLDINGS INC | 15,650 | 348.000 | 5,446,200.000 | |
| | NIO CLASS A INC | 44,880 | 47.840 | 2,147,059.200 | |
| | CHINA RAILWAY GROUP LTD-H | 1,364,000 | 3.810 | 5,196,840.000 | |
| | GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT | 312,000 | 18.680 | 5,828,160.000 | |
| | BYD ELECTRONIC INTL CO LTD | 25,000 | 42.240 | 1,056,000.000 | |
| | CHINA RESOURCES BEER HOLDING | 64,000 | 27.280 | 1,745,920.000 | |
| | TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO | 134,000 | 11.300 | 1,514,200.000 | |
| | JIANGXI COPPER CO LTD-H | 301,000 | 24.560 | 7,392,560.000 | |
| | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H | 5,521,800 | 4.130 | 22,805,034.000 | |
| | DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H | 674,000 | 8.780 | 5,917,720.000 | |
| | TENCENT HOLDINGS LTD | 102,500 | 605.500 | 62,063,750.000 | |
| | CHINA RESOURCES POWER HOLDIN | 222,000 | 18.750 | 4,162,500.000 | |
| | PETROCHINA CO LTD-H | 2,884,000 | 7.690 | 22,177,960.000 | |
| | ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS | 114,500 | 16.190 | 1,853,755.000 | |
| | HUANENG POWER INTL INC-H | 648,000 | 5.890 | 3,816,720.000 | |
| | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H | 236,500 | 23.980 | 5,671,270.000 | |
| | CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 8,592,000 | 7.670 | 65,900,640.000 | |
| | CHINA CITIC BANK CORP LTD-H | 1,677,000 | 7.040 | 11,806,080.000 | |
| | GREENTOWN CHINA HOLDINGS | 167,000 | 9.360 | 1,563,120.000 | |
| | HUATAI SECURITIES CO LTD-H | 82,200 | 18.560 | 1,525,632.000 | |
| | POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H | 1,586,000 | 5.750 | 9,119,500.000 | |
| | CHINA SHENHUA ENERGY CO-H | 304,000 | 36.240 | 11,016,960.000 | |
| | CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT | 683,120 | 11.190 | 7,644,112.800 | |
| | SINOPHARM GROUP CO-H | 124,400 | 18.560 | 2,308,864.000 | |
| | CHINA RESOURCES LAND LTD | 259,000 | 31.320 | 8,111,880.000 | |
| | YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LTD | 517,500 | 9.390 | 4,859,325.000 | |
| | SINO BIOPHARMACEUTICAL | 476,500 | 8.910 | 4,245,615.000 | |
| | CHINA RESOURCES GAS GROUP LT | 54,200 | 20.520 | 1,112,184.000 | |
| | BYD CO LTD-H | 55,500 | 105.600 | 5,860,800.000 | |
| | AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H | 3,741,000 | 5.480 | 20,500,680.000 | |
| | NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H | 80,000 | 45.920 | 3,673,600.000 | |
| | PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H | 874,000 | 6.670 | 5,829,580.000 | |
| | CITIC LTD | 260,000 | 11.310 | 2,940,600.000 | |
| | CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H | 2,843,000 | 1.410 | 4,008,630.000 | |
| | CHINA HONGQIAO GROUP LTD | 340,000 | 24.960 | 8,486,400.000 | |
| | IND & COMM BK OF CHINA-H | 10,101,000 | 5.770 | 58,282,770.000 | |
| | WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | 120,500 | 36.940 | 4,451,270.000 | |
| | COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD | 354,000 | 6.520 | 2,308,080.000 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----|------------------------------|-----------|---------|----------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| | CHINA TOWER CORP LTD-H | 351,000 | 11.080 | 3,889,080.000 | |
| | XIAOMI CORP-CLASS B | 259,000 | 53.650 | 13,895,350.000 | |
| | MEITUAN-CLASS B | 75,690 | 103.000 | 7,796,070.000 | |
| | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 534,800 | 131.800 | 70,486,640.000 | |
| | CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-H | 502,000 | 2.740 | 1,375,480.000 | |
| | CHINA FEIHE LTD | 313,000 | 4.390 | 1,374,070.000 | |
| | CHINA ENERGY ENGINEERING C-H | 930,000 | 1.200 | 1,116,000.000 | |
| | GUANGDONG INVESTMENT LTD | 472,000 | 7.360 | 3,473,920.000 | |
| | JD.COM INC - CL A | 192,895 | 122.100 | 23,552,479.500 | |
| | NETEASE INC | 51,600 | 210.000 | 10,836,000.000 | |
| | ZTO EXPRESS CAYMAN INC | 19,600 | 143.500 | 2,812,600.000 | |
| | NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC | 50,400 | 37.660 | 1,898,064.000 | |
| | METALLURGICAL CORP OF CHIN-H | 991,000 | 2.310 | 2,289,210.000 | |
| | HAIER SMART HOME CO LTD-H | 152,200 | 25.740 | 3,917,628.000 | |
| | KUAISHOU TECHNOLOGY | 65,000 | 72.950 | 4,741,750.000 | |
| | BAIDU INC-CLASS A | 203,300 | 97.000 | 19,720,100.000 | |
| | CHINA OVERSEAS LAND & INVEST | 394,000 | 13.850 | 5,456,900.000 | |
| | CRRC CORP LTD - H | 424,000 | 6.000 | 2,544,000.000 | |
| | CGN POWER CO LTD-H | 1,331,000 | 2.880 | 3,833,280.000 | |
| | PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 879,500 | 55.450 | 48,768,275.000 | |
| | CHINA COAL ENERGY CO-H | 324,000 | 9.390 | 3,042,360.000 | |
| | SUNAC CHINA HOLDINGS LTD | 3,070,000 | 1.590 | 4,881,300.000 | |
| | COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H | 470,050 | 13.680 | 6,430,284.000 | |
| | CHINA MINSHENG BANKING COR-H | 1,881,580 | 4.350 | 8,184,873.000 | |
| | BBMG CORP-H | 1,454,000 | 0.810 | 1,177,740.000 | |
| | ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | 38,800 | 94.550 | 3,668,540.000 | |
| | CHINA VANKE CO LTD-H | 1,019,400 | 5.220 | 5,321,268.000 | |
| | CHINA MENGNIU DAIRY CO | 266,000 | 15.020 | 3,995,320.000 | |
| | PICC PROPERTY & CASUALTY-H | 458,000 | 18.120 | 8,298,960.000 | |
| | LI NING CO LTD | 163,500 | 18.850 | 3,081,975.000 | |
| | GREAT WALL MOTOR COMPANY-H | 108,500 | 19.280 | 2,091,880.000 | |
| | WEICHAI POWER CO LTD-H | 219,000 | 15.150 | 3,317,850.000 | |
| | SUNNY OPTICAL TECH | 19,700 | 79.800 | 1,572,060.000 | |
| | ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H | 474,000 | 6.940 | 3,289,560.000 | |
| | CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H | 277,600 | 32.140 | 8,922,064.000 | |
| | SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H | 129,600 | 12.070 | 1,564,272.000 | |
| | CHINA LIFE INSURANCE CO-H | 380,000 | 22.580 | 8,580,400.000 | |
| | ENN ENERGY HOLDINGS LTD | 69,800 | 63.950 | 4,463,710.000 | |
| | KUNLUN ENERGY CO LTD | 192,000 | 7.240 | 1,390,080.000 | |
| | ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H | 254,000 | 28.240 | 7,172,960.000 | |
| | CHINA NATIONAL BUILDING MA-H | 430,000 | 5.120 | 2,201,600.000 | |
| | BANK OF COMMUNICATIONS CO-H | 1,187,100 | 6.790 | 8,060,409.000 | |
| | CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H | 326,000 | 5.980 | 1,949,480.000 | |
| | GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD | 2,497,000 | 1.470 | 3,670,590.000 | |
| | CHINA MERCHANTS BANK-H | 315,500 | 47.400 | 14,954,700.000 | |
| | BANK OF CHINA LTD-H | 8,967,000 | 4.330 | 38,827,110.000 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----------|------------------------------------|---------|-----------|-------------------------------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| | CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H | 255,000 | 12.650 | 3,225,750.000 | |
| | CITIC SECURITIES CO LTD-H | 111,500 | 28.100 | 3,133,150.000 | |
| | CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H | 601,000 | 3.580 | 2,151,580.000 | |
| | CHINA GALAXY SECURITIES CO-H | 184,000 | 10.960 | 2,016,640.000 | |
| | BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-B | 75,100 | 2.920 | 219,292.000 | |
| | LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD | 372,500 | 10.310 | 3,840,475.000 | |
| 香港・ドル 小計 | | | | 825,771,301.500 (15,722,685,581) | |
| 台湾・ドル | POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTUR | 330,000 | 16.050 | 5,296,500.000 | |
| | MICRO-STAR INTERNATIONAL CO | 45,000 | 129.500 | 5,827,500.000 | |
| | GLOBALWAFERS CO LTD | 18,000 | 370.500 | 6,669,000.000 | |
| | SINO-AMERICAN SILICON PRODUC | 71,000 | 103.500 | 7,348,500.000 | |
| | ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT | 230,000 | 156.000 | 35,880,000.000 | |
| | WIWYNN CORP | 3,000 | 3,025.000 | 9,075,000.000 | |
| | THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA | 148,000 | 41.300 | 6,112,400.000 | |
| | UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO | 108,112 | 78.100 | 8,443,547.200 | |
| | FORMOSA PLASTICS CORP | 453,600 | 37.800 | 17,146,080.000 | |
| | NAN YA PLASTICS CORP | 309,140 | 38.450 | 11,886,433.000 | |
| | FORMOSA CHEMICALS & FIBRE | 242,000 | 28.550 | 6,909,100.000 | |
| | WALSIN LIHWA CORP | 265,000 | 23.300 | 6,174,500.000 | |
| | CHINA STEEL CORP | 477,686 | 19.550 | 9,338,761.300 | |
| | LITE-ON TECHNOLOGY CORP | 132,616 | 130.500 | 17,306,388.000 | |
| | DELTA ELECTRONICS INC | 73,000 | 726.000 | 52,998,000.000 | |
| | YAGEO CORPORATION | 114,312 | 135.000 | 15,432,120.000 | |
| | ACER INC | 173,000 | 33.400 | 5,778,200.000 | |
| | FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD | 83,000 | 68.700 | 5,702,100.000 | |
| | INVENTEC CORP | 340,000 | 41.700 | 14,178,000.000 | |
| | REALTEK SEMICONDUCTOR CORP | 24,000 | 539.000 | 12,936,000.000 | |
| | QUANTA COMPUTER INC | 145,000 | 258.500 | 37,482,500.000 | |
| | CHICONY ELECTRONICS CO LTD | 38,000 | 137.500 | 5,225,000.000 | |
| | NANYA TECHNOLOGY CORP | 150,000 | 53.000 | 7,950,000.000 | |
| | CHUNGHWA TELECOM CO LTD | 130,400 | 134.500 | 17,538,800.000 | |
| | MEDIATEK INC | 52,003 | 1,435.000 | 74,624,305.000 | |
| | CATCHER TECHNOLOGY CO LTD | 68,000 | 187.500 | 12,750,000.000 | |
| | EVERGREEN MARINE CORP LTD | 194,800 | 186.500 | 36,330,200.000 | |
| | YANG MING MARINE TRANSPORT | 368,000 | 57.900 | 21,307,200.000 | |
| | WAN HAI LINES LTD | 97,000 | 82.200 | 7,973,400.000 | |
| | EVA AIRWAYS CORP | 158,000 | 39.550 | 6,248,900.000 | |
| | HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C | 333,300 | 29.150 | 9,715,695.000 | |
| | FUBON FINANCIAL HOLDING CO | 296,735 | 87.000 | 25,815,945.000 | |
| | CATHAY FINANCIAL HOLDING CO | 385,838 | 64.600 | 24,925,134.800 | |
| | KGI FINANCIAL HOLDING CO LTD | 677,710 | 15.250 | 10,335,077.500 | |
| | E. SUN FINANCIAL HOLDING CO | 253,947 | 34.300 | 8,710,382.100 | |
| | YUANTA FINANCIAL HOLDING CO | 258,940 | 33.800 | 8,752,172.000 | |
| | MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT | 300,718 | 41.250 | 12,404,617.500 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----------------------------|------------------------------|-----------|-----------------|--------------------------------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| TS FINANCIAL HOLDING LTD | 346,270 | 24.300 | 8,414,361.000 | | |
| | 825,028 | 41.850 | 34,527,421.800 | | |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO | 225,275 | 29.200 | 6,578,030.000 | | |
| | 5,000 | 2,405.000 | 12,025,000.000 | | |
| | 37,000 | 438.500 | 16,224,500.000 | | |
| | 76,000 | 134.000 | 10,184,000.000 | | |
| | 60,000 | 106.000 | 6,360,000.000 | | |
| | 294,110 | 115.500 | 33,969,705.000 | | |
| | 869,029 | 13.500 | 11,731,891.500 | | |
| | 81,000 | 84.400 | 6,836,400.000 | | |
| | 95,000 | 70.200 | 6,669,000.000 | | |
| | 98,000 | 174.000 | 17,052,000.000 | | |
| | 140,311 | 116.500 | 16,346,231.500 | | |
| | 187,000 | 28.550 | 5,338,850.000 | | |
| | 223,000 | 28.100 | 6,266,300.000 | | |
| | 428,000 | 1,180.000 | 505,040,000.000 | | |
| | 999,902 | 205.000 | 204,979,910.000 | | |
| | 49,760 | 645.000 | 32,095,200.000 | | |
| | 1,073,000 | 41.200 | 44,207,600.000 | | |
| 台湾・ドル 小計 | | | | 1,599,157,102.400 (7,765,506,889) | |
| 南アフリカ・ラ ンド | AngloGold Ashanti Plc | 16,392 | 1,041.500 | 17,072,268.000 | |
| | PEPKOR HOLDINGS SHS LTD | 151,181 | 25.000 | 3,779,525.000 | |
| | GOLD FIELDS LTD | 34,981 | 605.810 | 21,191,839.610 | |
| | CAPITEC BANK HOLDINGS LTD | 2,220 | 3,423.800 | 7,600,836.000 | |
| | SHOPRITE HOLDINGS LTD | 25,275 | 278.330 | 7,034,790.750 | |
| | NEDBANK GROUP LTD | 16,557 | 212.510 | 3,518,528.070 | |
| | BID CORP LTD | 16,110 | 444.000 | 7,152,840.000 | |
| | STANDARD BANK GROUP LTD | 46,415 | 241.480 | 11,208,294.200 | |
| | SASOL LTD | 97,599 | 125.540 | 12,252,578.460 | |
| | DISCOVERY LTD | 16,908 | 222.240 | 3,757,633.920 | |
| | SANLAM LTD | 51,532 | 83.770 | 4,316,835.640 | |
| | FIRSTRAND LTD | 233,444 | 73.600 | 17,181,478.400 | |
| | ABSA GROUP LTD | 40,814 | 185.950 | 7,589,363.300 | |
| | NASPERS LTD-N SHS | 3,390 | 5,724.150 | 19,404,868.500 | |
| | MTN GROUP LTD | 117,184 | 139.560 | 16,354,199.040 | |
| | IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | 74,648 | 184.000 | 13,735,232.000 | |
| | ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT | 19,352 | 103.930 | 2,011,253.360 | |
| | VALTERRA PLATINUM LTD | 8,899 | 945.900 | 8,417,564.100 | |
| | SIBANYE STILLWATER LTD | 734,423 | 37.810 | 27,768,533.630 | |
| 南アフリカ・ランド 小計 | | | | 211,348,461.980 (1,781,667,534) | |
| 合計 | | | | 45,168,130,497 [45,168,130,497] | |

(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 | 1,235,500 | 30,393,300.000 | |
| | アメリカ・ドル 小計 | | | 30,393,300.000 (4,512,493,251) | |
| 投資証券 合計 | | | | 4,512,493,251 [4,512,493,251] | |
| 合計 | | | | 4,512,493,251 [4,512,493,251] | |

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 30 銘柄 投資証券 1 銘柄 | 11.6% | 88.4% | 10.3% |
| インド・ルピー | 株式 55 銘柄 | 100% | -% | 11.1% |
| インドネシア・ルピア | 株式 6 銘柄 | 100% | -% | 1.0% |
| オフショア・人民元 | 株式 59 銘柄 | 100% | -% | 5.2% |
| サウジアラビア・リアル | 株式 12 銘柄 | 100% | -% | 1.8% |
| タイ・バーツ | 株式 17 銘柄 | 100% | -% | 2.4% |
| チリ・ペソ | 株式 2 銘柄 | 100% | -% | 0.3% |
| トルコ・リラ | 株式 11 銘柄 | 100% | -% | 1.5% |
| ブラジル・レアル | 株式 45 銘柄 | 100% | -% | 12.6% |
| マレーシア・リンギット | 株式 4 銘柄 | 100% | -% | 0.5% |
| メキシコ・ペソ | 株式 9 銘柄 | 100% | -% | 2.4% |
| 香港・ドル | 株式 94 銘柄 | 100% | -% | 31.7% |
| 台湾・ドル | 株式 57 銘柄 | 100% | -% | 15.6% |
| 南アフリカ・ランド | 株式 19 銘柄 | 100% | -% | 3.6% |

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

| | 2024年9月9日現在 金額(円) | 2025年9月8日現在 金額(円) |
|------------------|----------------------|----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 402, 347, 563 | 336, 838, 997 |
| コール・ローン | 181, 704, 602 | 108, 276, 967 |
| 国債証券 | 46, 275, 157, 938 | 59, 476, 993, 947 |
| 派生商品評価勘定 | 555, 644 | 681, 504 |
| 未収入金 | 929, 548 | - |
| 未収利息 | 664, 771, 077 | 898, 693, 773 |
| 前払費用 | 78, 092, 215 | 56, 339, 307 |
| 流動資産合計 | 47, 603, 558, 587 | 60, 877, 824, 495 |
| 資産合計 | 47, 603, 558, 587 | 60, 877, 824, 495 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 319, 125 | - |
| 未払金 | 253, 331, 118 | 182, 176, 191 |
| 未払解約金 | 5, 352, 249 | 9, 065, 533 |
| 流動負債合計 | 259, 002, 492 | 191, 241, 724 |
| 負債合計 | 259, 002, 492 | 191, 241, 724 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ※1 26, 125, 724, 702 | 29, 442, 571, 409 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金 (△) | 21, 218, 831, 393 | 31, 244, 011, 362 |
| 元本等合計 | 47, 344, 556, 095 | 60, 686, 582, 771 |
| 純資産合計 | 47, 344, 556, 095 | 60, 686, 582, 771 |
| 負債純資産合計 | 47, 603, 558, 587 | 60, 877, 824, 495 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | 自 2024 年 9 月 10 日 至 2025 年 9 月 8 日 |
|----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、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> |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p> |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年總理府令第 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算処理を採用しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 2024 年 9 月 9 日現在 | 2025 年 9 月 8 日現在 |
|--|------------------|------------------|
| 1. ※1 期首 | 2023 年 9 月 8 日 | 2024 年 9 月 10 日 |
| 期首元本額 | 22,164,970,341 円 | 26,125,724,702 円 |
| 期中追加設定元本額 | 4,942,482,106 円 | 4,311,100,956 円 |
| 期中一部解約元本額 | 981,727,745 円 | 994,254,249 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) | 597,816,178 円 | 705,777,853 円 |

| 区分 | 2024年9月9日現在 | 2025年9月8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) | 475,166,876 円 | 481,643,241 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) | 553,350,187 円 | 496,890,718 円 |
| D—I's 新興国債券インデックス | 79,021,792 円 | 60,883,251 円 |
| i Free 新興国債券インデックス | 9,353,736,063 円 | 11,399,235,861 円 |
| i Free 8資産バランス | 5,163,331,504 円 | 6,027,006,055 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) | 5,542,444 円 | 9,751,796 円 |
| DCダイワ新興国債券インデックスファンド | 9,734,438,864 円 | 10,103,756,216 円 |
| スタイル9 (8資産分散・保守型) | 50,457 円 | 93,077 円 |
| スタイル9 (8資産分散・バランス型) | 1,083,643 円 | 2,581,576 円 |
| スタイル9 (8資産分散・積極型) | 1,286,308 円 | 6,542,652 円 |
| ダイワ・インデックスセレクト新興国債券 | 121,925,339 円 | 107,149,870 円 |
| ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド | 38,975,047 円 | 41,259,243 円 |
| 計 | 26,125,724,702 円 | 29,442,571,409 円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 26,125,724,702 口 | 29,442,571,409 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 2024年9月10日 至 2025年9月8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 2024 年 9 月 10 日 至 2025 年 9 月 8 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 | 2025 年 9 月 8 日現在 |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 金融商品の時価の算定方法 | (1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 2024 年 9 月 9 日現在 | 2025 年 9 月 8 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 | 927,023,685 | 330,645,924 |
| 合計 | 927,023,685 | 330,645,924 |

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

| 種類 | 2024 年 9 月 9 日現在 | | | 2025 年 9 月 8 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) |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | |

| 種類 | 2024年9月9日現在 | | | | 2025年9月8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 | | | | | |
| 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 | 162,537,050 | - | 162,762,569 | 225,519 | 96,791,526 | - | 97,473,030 | 681,504 |
| アメリカ・ド ル | 86,775,600 | - | 87,169,644 | 394,044 | - | - | - | - |
| オフショア・ 人民元 | 14,071,400 | - | 14,063,350 | △8,050 | 35,304,920 | - | 35,397,740 | 92,820 |
| トルコ・リラ | 20,795,000 | - | 20,942,000 | 147,000 | - | - | - | - |
| ポーランド・ ズロチ | 28,021,450 | - | 27,710,375 | △311,075 | 28,192,766 | - | 28,510,090 | 317,324 |
| メキシコ・ペ ソ | 12,873,600 | - | 12,877,200 | 3,600 | - | - | - | - |
| 南アフリカ・ ランド | - | - | - | - | 33,293,840 | - | 33,565,200 | 271,360 |
| 合計 | 206,592,050 | - | 206,806,569 | 236,519 | 96,791,526 | - | 97,473,030 | 681,504 |

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1 口当たり情報)

| | 2024年9月9日現在 | 2025年9月8日現在 |
|----------------------------|------------------------|------------------------|
| 1 口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.8122 円 (18,122 円) | 2.0612 円 (20,612 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 | 90,000,000.000 | 87,965,100.000 | |
| | | 7. 26% INDIA GOVERNMENT BOND 20320822 | 130,000,000.000 | 135,205,200.000 | |
| | | 7. 18% INDIA GOVERNMENT BOND 20330814 | 160,000,000.000 | 166,028,800.000 | |
| | | 7. 26% INDIA GOVERNMENT BOND 20290114 | 100,000,000.000 | 103,586,000.000 | |
| | | 7. 72% INDIA GOVERNMENT BOND 20490615 | 66,000,000.000 | 70,888,620.000 | |
| | | 6. 45% INDIA GOVERNMENT BOND 20291007 | 100,000,000.000 | 100,620,000.000 | |
| | | 7. 16% INDIA GOVERNMENT BOND 20500920 | 90,000,000.000 | 90,055,800.000 | |
| | | 5. 79% INDIA GOVERNMENT BOND 20300511 | 90,000,000.000 | 88,390,800.000 | |
| | | 5. 77% INDIA GOVERNMENT BOND 20300803 | 100,000,000.000 | 97,981,000.000 | |
| | | 6. 67% INDIA GOVERNMENT BOND 20501217 | 130,000,000.000 | 121,654,000.000 | |
| | | 6. 1% INDIA GOVERNMENT BOND 20310712 | 140,000,000.000 | 138,418,000.000 | |
| | | 6. 99% INDIA GOVERNMENT BOND 20511215 | 130,000,000.000 | 127,530,000.000 | |
| | | 6. 54% INDIA GOVERNMENT BOND 20320117 | 130,000,000.000 | 130,055,900.000 | |
| | | 7. 1% INDIA GOVERNMENT BOND 20290418 | 120,000,000.000 | 123,574,800.000 | |
| | | 7. 54% INDIA GOVERNMENT BOND 20360523 | 140,000,000.000 | 148,190,000.000 | |
| | | 7. 38% INDIA GOVERNMENT BOND 20270620 | 65,000,000.000 | 66,852,500.000 | |
| | | 7. 36% INDIA GOVERNMENT BOND 20520912 | 130,000,000.000 | 132,264,600.000 | |
| | | 7. 41% INDIA GOVERNMENT BOND 20361219 | 125,000,000.000 | 131,628,750.000 | |
| | | 7. 26% INDIA GOVERNMENT BOND 20330206 | 120,000,000.000 | 124,572,000.000 | |
| | | 7. 06% INDIA GOVERNMENT BOND 20280410 | 91,000,000.000 | 93,487,030.000 | |
| | | 7. 17% INDIA GOVERNMENT BOND 20300417 | 80,000,000.000 | 82,812,800.000 | |
| | | 7. 3% INDIA GOVERNMENT BOND 20530619 | 160,000,000.000 | 162,966,400.000 | |
| | | 7. 18% INDIA GOVERNMENT BOND 20370724 | 150,000,000.000 | 155,790,000.000 | |
| | | 7. 37% INDIA GOVERNMENT BOND 20281023 | 60,000,000.000 | 62,222,400.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|------------|--|--------------------|--------------------------------------|----|
| | | 7. 32% INDIA GOVERNMENT BOND 20301113 | 50,000,000.000 | 52,365,500.000 | |
| | | 7. 37% INDIA GOVERNMENT BOND 20540123 | 8,000,000.000 | 8,185,440.000 | |
| | | 7. 1% INDIA GOVERNMENT BOND 20340408 | 142,000,000.000 | 147,026,800.000 | |
| | | 7. 04% INDIA GOVERNMENT BOND 20290603 | 70,000,000.000 | 71,945,300.000 | |
| | | 7. 02% INDIA GOVERNMENT BOND 20310618 | 50,000,000.000 | 51,425,500.000 | |
| | | 6. 79% INDIA GOVERNMENT BOND 20341007 | 160,000,000.000 | 162,712,000.000 | |
| | | 6. 75% INDIA GOVERNMENT BOND 20291223 | 80,000,000.000 | 81,602,400.000 | |
| | | 6. 79% INDIA GOVERNMENT BOND 20311230 | 50,000,000.000 | 50,765,000.000 | |
| | | 6. 79% INDIA GOVERNMENT BOND 20341202 | 10,000,000.000 | 10,164,700.000 | |
| | | 6. 33% INDIA GOVERNMENT BOND 20350505 | 100,000,000.000 | 99,430,000.000 | |
| | | 6. 28% INDIA GOVERNMENT BOND 20320714 | 10,000,000.000 | 9,906,700.000 | |
| | | 6. 01% INDIA GOVERNMENT BOND 20300721 | 30,000,000.000 | 29,812,500.000 | |
| | インド・ルピー | 小計 | | 3,518,082,340.000 (5,945,559,155) | |
| | インドネシア・ルピア | 8. 25% Indonesia Treasury Bond 20360515 | 15,250,000,000.000 | 17,349,010,000.000 | |
| | | 8. 75% Indonesia Treasury Bond 20310515 | 12,000,000,000.000 | 13,613,880,000.000 | |
| | | 7. 5% Indonesia Treasury Bond 20320815 | 10,000,000,000.000 | 10,724,400,000.000 | |
| | | 7. 5% Indonesia Treasury Bond 20380515 | 10,000,000,000.000 | 10,701,600,000.000 | |
| | | 8. 375% Indonesia Treasury Bond 20390415 | 12,000,000,000.000 | 13,733,040,000.000 | |
| | | 8. 25% Indonesia Treasury Bond 20290515 | 17,000,000,000.000 | 18,492,600,000.000 | |
| | | 7% Indonesia Treasury Bond 20300915 | 30,000,000,000.000 | 31,535,100,000.000 | |
| | | 7. 5% Indonesia Treasury Bond 20350615 | 22,000,000,000.000 | 23,699,060,000.000 | |
| | | 7. 5% Indonesia Treasury Bond 20400415 | 19,000,000,000.000 | 20,297,320,000.000 | |
| | | 5. 5% Indonesia Treasury Bond 20260415 | 20,600,000,000.000 | 20,638,110,000.000 | |
| | | 6. 5% Indonesia Treasury Bond 20310215 | 28,000,000,000.000 | 28,846,440,000.000 | |
| | | 6. 25% Indonesia Treasury Bond 20360615 | 7,300,000,000.000 | 7,225,394,000.000 | |
| | | 6. 375% INDONESIA TREASURY BOND 20320415 | 36,300,000,000.000 | 36,906,210,000.000 | |
| | | 5. 125% INDONESIA TREASURY BOND 20270415 | 20,000,000,000.000 | 19,952,200,000.000 | |
| | | 7. 125% INDONESIA TREASURY BOND 20420615 | 17,000,000,000.000 | 17,486,200,000.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|-----------|---|--|------------------------|---|----|
| | | 6. 375% INDONESIA TREASURY BOND 20370715 | 2, 700, 000, 000. 000 | 2, 675, 970, 000. 000 | |
| | | 7% INDONESIA TREASURY BOND 20330215 | 24, 000, 000, 000. 000 | 25, 049, 280, 000. 000 | |
| | | 6. 375% INDONESIA TREASURY BOND 20280815 | 16, 100, 000, 000. 000 | 16, 484, 951, 000. 000 | |
| | | 7. 125% INDONESIA TREASURY BOND 20430615 | 18, 000, 000, 000. 000 | 18, 530, 100, 000. 000 | |
| | | 7. 125% INDONESIA TREASURY BOND 20380615 | 20, 000, 000, 000. 000 | 20, 768, 400, 000. 000 | |
| | | 6. 625% INDONESIA TREASURY BOND 20340215 | 23, 500, 000, 000. 000 | 23, 902, 320, 000. 000 | |
| | | 6. 875% INDONESIA TREASURY BOND 20290415 | 26, 000, 000, 000. 000 | 27, 073, 800, 000. 000 | |
| | | 6. 75% INDONESIA TREASURY BOND 20350715 | 31, 000, 000, 000. 000 | 31, 842, 580, 000. 000 | |
| | | 6. 5% INDONESIA TREASURY BOND 20300715 | 26, 000, 000, 000. 000 | 26, 855, 920, 000. 000 | |
| | | 7. 125% INDONESIA TREASURY BOND 20400815 | 8, 000, 000, 000. 000 | 8, 305, 040, 000. 000 | |
| | | 7. 125% INDONESIA TREASURY BOND 20450815 | 7, 000, 000, 000. 000 | 7, 207, 130, 000. 000 | |
| | | 6. 5% INDONESIA TREASURY BOND 20360415 | 7, 000, 000, 000. 000 | 7, 075, 740, 000. 000 | |
| | | 10. 5% Indonesia Treasury Bond 20300815 | 5, 000, 000, 000. 000 | 6, 000, 600, 000. 000 | |
| | | 9. 5% Indonesia Treasury Bond 20310715 | 5, 100, 000, 000. 000 | 5, 959, 248, 000. 000 | |
| | | 8. 375% Indonesia Treasury Bond 20260915 | 22, 024, 000, 000. 000 | 22, 731, 190, 640. 000 | |
| | | 8. 25% Indonesia Treasury Bond 20320615 | 6, 500, 000, 000. 000 | 7, 218, 900, 000. 000 | |
| | | 7% Indonesia Treasury Bond 20270515 | 20, 000, 000, 000. 000 | 20, 559, 600, 000. 000 | |
| | | 6. 125% Indonesia Treasury Bond 20280515 | 20, 000, 000, 000. 000 | 20, 316, 800, 000. 000 | |
| | | 6. 625% Indonesia Treasury Bond 20330515 | 17, 000, 000, 000. 000 | 17, 311, 100, 000. 000 | |
| | | 8. 375% Indonesia Treasury Bond 20340315 | 26, 920, 000, 000. 000 | 30, 433, 867, 600. 000 | |
| | | 9% Indonesia Treasury Bond 20290315 | 17, 000, 000, 000. 000 | 18, 832, 600, 000. 000 | |
| | インドネシア・ルピア | 小計 | | 656, 335, 701, 240. 000 (5, 972, 654, 881) | |
| ウルグアイ・ペソ | 8. 5% Uruguay Government International Bond 20280315 | | 2, 800, 000. 000 | 2, 837, 968. 000 | |
| | 8. 25% Uruguay Government International Bond 20310521 | | 12, 000, 000. 000 | 12, 138, 000. 000 | |
| | 9. 75% URUGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 20330720 | | 11, 000, 000. 000 | 12, 072, 500. 000 | |
| | ウルグアイ・ペソ | 小計 | | 27, 048, 468. 000 (100, 357, 930) | |
| オフショア・人民元 | 3. 25% China Government Bond 20281122 | | 4, 800, 000. 000 | 5, 089, 872. 000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---------------------------------------|---------------|---------------|----|
| | | 3. 29% China Government Bond 20290523 | 5,900,000.000 | 6,312,941.000 | |
| | | 3. 25% China Government Bond 20260606 | 2,000,000.000 | 2,032,500.000 | |
| | | 3. 12% China Government Bond 20261205 | 4,200,000.000 | 4,301,766.000 | |
| | | 3. 13% China Government Bond 20291121 | 5,700,000.000 | 6,094,953.000 | |
| | | 2. 85% China Government Bond 20270604 | 4,800,000.000 | 4,926,816.000 | |
| | | 2. 68% China Government Bond 20300521 | 4,000,000.000 | 4,195,560.000 | |
| | | 3. 28% China Government Bond 20271203 | 3,700,000.000 | 3,867,018.000 | |
| | | 3. 27% China Government Bond 20301119 | 5,500,000.000 | 5,997,475.000 | |
| | | 3. 81% China Government Bond 20500914 | 5,500,000.000 | 7,292,615.000 | |
| | | 3. 01% China Government Bond 20280513 | 3,000,000.000 | 3,130,170.000 | |
| | | 3. 72% China Government Bond 20510412 | 2,000,000.000 | 2,648,720.000 | |
| | | 3. 02% China Government Bond 20310527 | 7,000,000.000 | 7,549,220.000 | |
| | | 2. 69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812 | 4,500,000.000 | 4,560,030.000 | |
| | | 2. 91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014 | 1,800,000.000 | 1,880,550.000 | |
| | | 3. 53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018 | 2,000,000.000 | 2,573,140.000 | |
| | | 2. 89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118 | 3,500,000.000 | 3,755,850.000 | |
| | | 2. 37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120 | 2,800,000.000 | 2,837,016.000 | |
| | | 2. 75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217 | 3,000,000.000 | 3,193,020.000 | |
| | | 2. 8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324 | 3,500,000.000 | 3,657,010.000 | |
| | | 2. 48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415 | 2,200,000.000 | 2,237,730.000 | |
| | | 3. 32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415 | 2,000,000.000 | 2,493,700.000 | |
| | | 2. 76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515 | 2,500,000.000 | 2,666,100.000 | |
| | | 2. 75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615 | 3,600,000.000 | 3,762,576.000 | |
| | | 2. 5% CHINA GOVERNMENT BOND 20270725 | 3,700,000.000 | 3,767,451.000 | |
| | | 2. 69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815 | 3,000,000.000 | 3,182,160.000 | |
| | | 2. 6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901 | 1,600,000.000 | 1,692,448.000 | |
| | | 2. 62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925 | 3,300,000.000 | 3,435,993.000 | |
| | | 2. 44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015 | 3,200,000.000 | 3,263,808.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---------------------------------------|------------------|------------------|----|
| | | 3. 12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025 | 1, 200, 000. 000 | 1, 454, 520. 000 | |
| | | 2. 8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115 | 3, 700, 000. 000 | 3, 969, 841. 000 | |
| | | 2. 79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215 | 3, 000, 000. 000 | 3, 152, 520. 000 | |
| | | 2. 64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115 | 3, 200, 000. 000 | 3, 289, 728. 000 | |
| | | 2. 88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225 | 2, 500, 000. 000 | 2, 706, 125. 000 | |
| | | 2. 8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325 | 3, 700, 000. 000 | 3, 899, 726. 000 | |
| | | 2. 62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415 | 3, 300, 000. 000 | 3, 399, 693. 000 | |
| | | 3. 19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415 | 2, 200, 000. 000 | 2, 703, 382. 000 | |
| | | 2. 3% CHINA GOVERNMENT BOND 20260515 | 1, 000, 000. 000 | 1, 006, 580. 000 | |
| | | 2. 67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525 | 3, 200, 000. 000 | 3, 414, 528. 000 | |
| | | 2. 62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625 | 3, 000, 000. 000 | 3, 139, 680. 000 | |
| | | 2. 4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715 | 3, 000, 000. 000 | 3, 080, 940. 000 | |
| | | 2. 52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825 | 3, 000, 000. 000 | 3, 165, 180. 000 | |
| | | 2. 18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815 | 4, 500, 000. 000 | 4, 533, 435. 000 | |
| | | 2. 48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925 | 1, 200, 000. 000 | 1, 236, 252. 000 | |
| | | 2. 6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915 | 4, 700, 000. 000 | 4, 923, 955. 000 | |
| | | 3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015 | 2, 800, 000. 000 | 3, 367, 224. 000 | |
| | | 2. 55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015 | 4, 000, 000. 000 | 4, 130, 760. 000 | |
| | | 2. 39% CHINA GOVERNMENT BOND 20261115 | 3, 000, 000. 000 | 3, 035, 790. 000 | |
| | | 2. 67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125 | 2, 400, 000. 000 | 2, 564, 280. 000 | |
| | | 2. 54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225 | 4, 500, 000. 000 | 4, 703, 220. 000 | |
| | | 2. 37% CHINA GOVERNMENT BOND 20290115 | 2, 200, 000. 000 | 2, 262, 436. 000 | |
| | | 2. 04% CHINA GOVERNMENT BOND 20270225 | 4, 000, 000. 000 | 4, 036, 160. 000 | |
| | | 2. 35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225 | 5, 500, 000. 000 | 5, 743, 265. 000 | |
| | | 2. 28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325 | 900, 000. 000 | 929, 583. 000 | |
| | | 2. 05% CHINA GOVERNMENT BOND 20290415 | 2, 200, 000. 000 | 2, 240, 282. 000 | |
| | | 1. 85% CHINA GOVERNMENT BOND 20270515 | 3, 300, 000. 000 | 3, 323, 991. 000 | |
| | | 2. 49% CHINA GOVERNMENT BOND 20440525 | 1, 700, 000. 000 | 1, 808, 800. 000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---------------------------------------|---------------|---------------|----|
| | | 2. 27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525 | 3,900,000.000 | 4,049,916.000 | |
| | | 2. 12% CHINA GOVERNMENT BOND 20310625 | 2,700,000.000 | 2,766,555.000 | |
| | | 1. 91% CHINA GOVERNMENT BOND 20290715 | 3,000,000.000 | 3,039,360.000 | |
| | | 2. 57% CHINA GOVERNMENT BOND 20540520 | 2,300,000.000 | 2,537,912.000 | |
| | | 2. 47% CHINA GOVERNMENT BOND 20540725 | 2,500,000.000 | 2,703,850.000 | |
| | | 1. 62% CHINA GOVERNMENT BOND 20270815 | 3,000,000.000 | 3,012,180.000 | |
| | | 2. 11% CHINA GOVERNMENT BOND 20340825 | 4,700,000.000 | 4,823,563.000 | |
| | | 2. 33% CHINA GOVERNMENT BOND 20440815 | 500,000.000 | 519,740.000 | |
| | | 1. 87% CHINA GOVERNMENT BOND 20310915 | 1,000,000.000 | 1,010,900.000 | |
| | | 2. 17% CHINA GOVERNMENT BOND 20340829 | 3,300,000.000 | 3,402,069.000 | |
| | | 2. 25% CHINA GOVERNMENT BOND 20390829 | 1,000,000.000 | 1,030,210.000 | |
| | | 2. 19% CHINA GOVERNMENT BOND 20540925 | 2,100,000.000 | 2,150,484.000 | |
| | | 1. 74% CHINA GOVERNMENT BOND 20291015 | 500,000.000 | 503,455.000 | |
| | | 1. 42% CHINA GOVERNMENT BOND 20271115 | 1,500,000.000 | 1,499,940.000 | |
| | | 2. 04% CHINA GOVERNMENT BOND 20341125 | 2,000,000.000 | 2,043,200.000 | |
| | | 1. 49% CHINA GOVERNMENT BOND 20311225 | 2,500,000.000 | 2,467,950.000 | |
| | | 1. 43% CHINA GOVERNMENT BOND 20300125 | 5,200,000.000 | 5,166,616.000 | |
| | | 1. 92% CHINA GOVERNMENT BOND 20550115 | 2,200,000.000 | 2,125,552.000 | |
| | | 1. 61% CHINA GOVERNMENT BOND 20350215 | 6,000,000.000 | 5,908,200.000 | |
| | | 1. 45% CHINA GOVERNMENT BOND 20280225 | 4,300,000.000 | 4,303,526.000 | |
| | | 1. 79% CHINA GOVERNMENT BOND 20320325 | 4,000,000.000 | 4,024,080.000 | |
| | | 1. 65% CHINA GOVERNMENT BOND 20350515 | 2,000,000.000 | 1,977,060.000 | |
| | | 1. 46% CHINA GOVERNMENT BOND 20280525 | 3,800,000.000 | 3,803,078.000 | |
| | | 1. 67% CHINA GOVERNMENT BOND 20350525 | 5,000,000.000 | 4,953,900.000 | |
| | | 1. 88% CHINA GOVERNMENT BOND 20550425 | 4,300,000.000 | 4,177,149.000 | |
| | | 1. 98% CHINA GOVERNMENT BOND 20450425 | 2,000,000.000 | 1,970,860.000 | |
| | | 1. 57% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515 | 500,000.000 | 495,185.000 | |
| | | 1. 45% CHINA GOVERNMENT BOND 20300425 | 2,000,000.000 | 1,986,240.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|------------|---|-----------------------|--|----|
| | | 1. 55% CHINA GOVERNMENT BOND 20300725 | 1, 500, 000. 000 | 1, 495, 530. 000 | |
| | | 1. 42% CHINA GOVERNMENT BOND 20280815 | 2, 000, 000. 000 | 1, 996, 320. 000 | |
| | | 1. 83% CHINA GOVERNMENT BOND 20350825 | 2, 000, 000. 000 | 2, 002, 040. 000 | |
| | | 2. 15% CHINA GOVERNMENT BOND 20550825 | 150, 000. 000 | 151, 771. 500 | |
| | | 1. 9% CHINA GOVERNMENT BOND 20550715 | 3, 000, 000. 000 | 2, 883, 480. 000 | |
| | オフショア・人民元 | 小計 | | 286, 601, 955. 500 (5, 967, 883, 859) | |
| | コロンビア・ペソ | 6% Colombian TES 20280428 | 7, 300, 000, 000. 000 | 6, 665, 703, 000. 000 | |
| | | 7. 5% Colombian TES 20260826 | 5, 000, 000, 000. 000 | 4, 929, 850, 000. 000 | |
| | | 7. 75% Colombian TES 20300918 | 4, 000, 000, 000. 000 | 3, 518, 520, 000. 000 | |
| | | 7% Colombian TES 20320630 | 5, 300, 000, 000. 000 | 4, 190, 127, 000. 000 | |
| | | 7. 25% Colombian TES 20341018 | 4, 500, 000, 000. 000 | 3, 421, 170, 000. 000 | |
| | | 5. 75% Colombian TES 20271103 | 3, 500, 000, 000. 000 | 3, 267, 005, 000. 000 | |
| | | 7. 25% Colombian TES 20501026 | 8, 000, 000, 000. 000 | 5, 049, 520, 000. 000 | |
| | | 6. 25% Colombian TES 20360709 | 3, 750, 000, 000. 000 | 2, 560, 237, 500. 000 | |
| | | 7% COLOMBIAN TES 20310326 | 4, 500, 000, 000. 000 | 3, 729, 285, 000. 000 | |
| | | 9. 25% COLOMBIAN TES 20420528 | 9, 300, 000, 000. 000 | 7, 471, 527, 000. 000 | |
| | | 13. 25% COLOMBIAN TES 20330209 | 5, 200, 000, 000. 000 | 5, 538, 572, 000. 000 | |
| | | 11. 5% COLOMBIAN TES 20460725 | 6, 000, 000, 000. 000 | 5, 639, 580, 000. 000 | |
| | | 11% COLOMBIAN TES 20290822 | 1, 000, 000, 000. 000 | 1, 007, 370, 000. 000 | |
| | コロンビア・ペソ | 小計 | | 56, 988, 466, 500. 000 (2, 135, 756, 760) | |
| | セルビア・ディナール | 5. 875% Serbia Treasury Bonds 20280208 | 25, 000, 000. 000 | 25, 912, 500. 000 | |
| | | 4. 5% Serbia Treasury Bonds 20320820 | 35, 000, 000. 000 | 34, 212, 500. 000 | |
| | | 7% SERBIA TREASURY BONDS 20311026 | 29, 000, 000. 000 | 32, 407, 500. 000 | |
| | | 5. 25% SERBIA TREASURY BONDS 20350727 | 25, 000, 000. 000 | 25, 037, 500. 000 | |
| | セルビア・ディナール | 小計 | | 117, 570, 000. 000 (174, 529, 255) | |
| | タイ・バーツ | 4. 875% Thailand Government Bond 20290622 | 48, 050, 000. 000 | 54, 771, 234. 000 | |
| | | 3. 65% Thailand Government Bond 20310620 | 39, 200, 000. 000 | 44, 744, 448. 000 | |
| | | 3. 4% Thailand Government Bond 20360617 | 34, 600, 000. 000 | 41, 736, 942. 000 | |
| | | 2. 125% Thailand Government Bond 20261217 | 40, 000, 000. 000 | 40, 529, 600. 000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---------|----|---|----------------|--------------------------------------|----|
| | | 3. 775% Thailand Government Bond 20320625 | 40,000,000.000 | 46,782,800.000 | |
| | | 2. 875% Thailand Government Bond 20460617 | 34,900,000.000 | 41,392,796.000 | |
| | | 2. 875% Thailand Government Bond 20281217 | 39,000,000.000 | 41,217,540.000 | |
| | | 3. 3% Thailand Government Bond 20380617 | 40,000,000.000 | 48,754,400.000 | |
| | | 1. 6% Thailand Government Bond 20291217 | 38,500,000.000 | 39,307,730.000 | |
| | | 1. 6% Thailand Government Bond 20350617 | 20,500,000.000 | 21,173,220.000 | |
| | | 1. 585% Thailand Government Bond 20351217 | 40,900,000.000 | 42,215,344.000 | |
| | | 2% Thailand Government Bond 20311217 | 60,000,000.000 | 63,134,400.000 | |
| | | 2% Thailand Government Bond 20420617 | 29,000,000.000 | 30,835,410.000 | |
| | | 1% THAILAND GOVERNMENT BOND 20270617 | 61,000,000.000 | 60,912,160.000 | |
| | | 2. 65% THAILAND GOVERNMENT BOND 20280617 | 50,000,000.000 | 52,137,000.000 | |
| | | 3. 39% THAILAND GOVERNMENT BOND 20370617 | 48,500,000.000 | 59,407,165.000 | |
| | | 2. 35% THAILAND GOVERNMENT BOND 20260617 | 17,000,000.000 | 17,148,920.000 | |
| | | 3. 45% THAILAND GOVERNMENT BOND 20430617 | 49,500,000.000 | 62,909,055.000 | |
| | | 3. 35% THAILAND GOVERNMENT BOND 20330617 | 37,000,000.000 | 42,905,570.000 | |
| | | 2. 25% THAILAND GOVERNMENT BOND 20270317 | 50,000,000.000 | 50,871,000.000 | |
| | | 2. 4% THAILAND GOVERNMENT BOND 20290317 | 37,000,000.000 | 38,676,100.000 | |
| | | 2. 8% THAILAND GOVERNMENT BOND 20340617 | 40,000,000.000 | 45,240,000.000 | |
| | | 2. 4% THAILAND GOVERNMENT BOND 20271117 | 28,700,000.000 | 29,505,322.000 | |
| | | 2. 5% THAILAND GOVERNMENT BOND 20291117 | 44,000,000.000 | 46,537,920.000 | |
| | | 2. 98% THAILAND GOVERNMENT BOND 20450617 | 20,000,000.000 | 24,207,200.000 | |
| | | 2. 05% THAILAND GOVERNMENT BOND 20280417 | 20,000,000.000 | 20,501,200.000 | |
| | | 2. 41% THAILAND GOVERNMENT BOND 20350317 | 16,000,000.000 | 17,712,640.000 | |
| | | 2. 7% THAILAND GOVERNMENT BOND 20400617 | 7,000,000.000 | 8,197,350.000 | |
| | | 1. 66% THAILAND GOVERNMENT BOND 20300317 | 10,000,000.000 | 10,250,800.000 | |
| | | タイ・バーツ 小計 | | 1,143,715,266.000 (5,295,401,681) | |
| チェコ・コルナ | | 2. 5% Czech Republic Government Bond 20280825 | 26,600,000.000 | 25,757,046.000 | |
| | | 1% Czech Republic Government Bond 20260626 | 25,000,000.000 | 24,587,500.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|---------|--|--------------------|--|----|
| | | 0. 95% Czech Republic Government Bond 20300515 | 27, 500, 000. 000 | 24, 105, 675. 000 | |
| | | 0. 25% Czech Republic Government Bond 20270210 | 27, 000, 000. 000 | 25, 849, 800. 000 | |
| | | 2. 75% Czech Republic Government Bond 20290723 | 21, 800, 000. 000 | 21, 020, 868. 000 | |
| | | 2% Czech Republic Government Bond 20331013 | 29, 500, 000. 000 | 24, 993, 875. 000 | |
| | | 1. 2% Czech Republic Government Bond 20310313 | 23, 000, 000. 000 | 19, 891, 550. 000 | |
| | | 0. 05% Czech Republic Government Bond 20291129 | 15, 500, 000. 000 | 13, 264, 745. 000 | |
| | | 4. 2% Czech Republic Government Bond 20361204 | 15, 300, 000. 000 | 14, 951, 925. 000 | |
| | | 1. 75% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20320623 | 29, 500, 000. 000 | 25, 477, 970. 000 | |
| | | 1. 5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20400424 | 16, 500, 000. 000 | 11, 030, 250. 000 | |
| | | 3. 5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20350530 | 25, 000, 000. 000 | 23, 365, 000. 000 | |
| | | 5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20300930 | 26, 000, 000. 000 | 27, 272, 180. 000 | |
| | | 5. 5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20281212 | 20, 500, 000. 000 | 21, 682, 645. 000 | |
| | | 1. 95% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20370730 | 14, 000, 000. 000 | 10, 736, 460. 000 | |
| | | 4. 9% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20340414 | 26, 000, 000. 000 | 27, 145, 820. 000 | |
| | | 5. 75% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20290329 | 12, 000, 000. 000 | 12, 830, 520. 000 | |
| | | 6. 2% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20310616 | 8, 000, 000. 000 | 8, 904, 480. 000 | |
| | | 4. 5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20321111 | 20, 000, 000. 000 | 20, 407, 600. 000 | |
| | | 3% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20330303 | 11, 000, 000. 000 | 10, 166, 420. 000 | |
| | | 3. 6% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20360603 | 10, 000, 000. 000 | 9, 293, 300. 000 | |
| | | 4. 25% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20341024 | 4, 000, 000. 000 | 3, 973, 960. 000 | |
| | チエコ・コルナ | 小計 | | 406, 709, 589. 000 (2, 899, 839, 370) | |
| | チリ・ペソ | 5% BONOS TESORERIA PESOS 20350301 | 970, 000, 000. 000 | 927, 814, 700. 000 | |
| | | 6% BONOS TESORERIA PESOS 20430101 | 630, 000, 000. 000 | 655, 678, 800. 000 | |
| | | 4. 7% BONOS TESORERIA PESOS 20300901 | 800, 000, 000. 000 | 779, 368, 000. 000 | |
| | | 5% BONOS TESORERIA PESOS 20281001 | 720, 000, 000. 000 | 718, 466, 400. 000 | |
| | | 7% BONOS TESORERIA PESOS 20340501 | 220, 000, 000. 000 | 241, 716, 200. 000 | |
| | | 6% BONOS TESORERIA PESOS 20330401 | 850, 000, 000. 000 | 875, 304, 500. 000 | |
| | | 6. 2% BONOS TESORERIA PESOS 20401001 | 350, 000, 000. 000 | 370, 370, 000. 000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|-------------|---|-----------------------|---|----|
| | | 5. 8% BONOS TESORERIA PESOS 20291001 | 1, 000, 000, 000. 000 | 1, 021, 460, 000. 000 | |
| | | 5. 8% BONOS TESORERIA PESOS 20341001 | 440, 000, 000. 000 | 447, 735, 200. 000 | |
| | | 5. 3% BONOS TESORERIA PESOS 20371101 | 150, 000, 000. 000 | 145, 560, 000. 000 | |
| | | BONOS TESORERIA PESOS 20290401 | 400, 000, 000. 000 | 336, 672, 000. 000 | |
| | チリ・ペソ | チリ・ペソ 小計 | | 6, 520, 145, 800. 000 (1, 001, 637, 838) | |
| | ドミニカ・ペソ | 13. 625% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20330203 | 11, 400, 000. 000 | 13, 724, 232. 000 | |
| | | 11. 25% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20350915 | 12, 500, 000. 000 | 13, 780, 375. 000 | |
| | | 10. 75% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20360601 | 20, 000, 000. 000 | 21, 385, 000. 000 | |
| | | 10. 5% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20370315 | 18, 000, 000. 000 | 19, 080, 000. 000 | |
| | ドミニカ・ペソ | ドミニカ・ペソ 小計 | | 67, 969, 607. 000 (159, 008, 098) | |
| | トルコ・リラ | 11% Turkey Government Bond 20270224 | 2, 970, 000. 000 | 2, 139, 914. 700 | |
| | | 10. 5% Turkey Government Bond 20270811 | 20, 000, 000. 000 | 13, 175, 200. 000 | |
| | | 12. 4% Turkey Government Bond 20280308 | 15, 000, 000. 000 | 9, 535, 050. 000 | |
| | | 11. 7% Turkey Government Bond 20301113 | 13, 900, 000. 000 | 7, 110, 684. 000 | |
| | | 16. 9% TURKEY GOVERNMENT BOND 20260902 | 8, 500, 000. 000 | 7, 088, 320. 000 | |
| | | 17. 8% TURKEY GOVERNMENT BOND 20330713 | 11, 500, 000. 000 | 7, 398, 755. 000 | |
| | | 17. 3% TURKEY GOVERNMENT BOND 20280719 | 23, 000, 000. 000 | 15, 926, 350. 000 | |
| | | 26. 2% TURKEY GOVERNMENT BOND 20331005 | 52, 000, 000. 000 | 46, 384, 000. 000 | |
| | | 31. 08% TURKEY GOVERNMENT BOND 20281108 | 39, 500, 000. 000 | 36, 548, 560. 000 | |
| | | 30% TURKEY GOVERNMENT BOND 20290912 | 40, 000, 000. 000 | 36, 180, 000. 000 | |
| | | 27. 7% TURKEY GOVERNMENT BOND 20340927 | 12, 000, 000. 000 | 11, 007, 000. 000 | |
| | トルコ・リラ | トルコ・リラ 小計 | | 192, 493, 833. 700 (693, 651, 530) | |
| | ハンガリー・フォリント | 3% Hungary Government Bond 20271027 | 270, 000, 000. 000 | 252, 865, 800. 000 | |
| | | 2. 75% Hungary Government Bond 20261222 | 170, 000, 000. 000 | 163, 203, 400. 000 | |
| | | 6. 75% Hungary Government Bond 20281022 | 373, 000, 000. 000 | 376, 584, 530. 000 | |
| | | 3% Hungary Government Bond 20300821 | 300, 000, 000. 000 | 256, 599, 000. 000 | |
| | | 3. 25% Hungary Government Bond 20311022 | 332, 000, 000. 000 | 275, 666, 240. 000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----------|---|-----------------|--------------------------------------|----|
| | | 3% Hungary Government Bond 20381027 | 100,000,000.000 | 64,810,000.000 | |
| | | 1.5% Hungary Government Bond 20260422 | 224,000,000.000 | 218,267,840.000 | |
| | | 2% Hungary Government Bond 20290523 | 300,000,000.000 | 257,178,000.000 | |
| | | 2.25% Hungary Government Bond 20330420 | 315,000,000.000 | 229,707,450.000 | |
| | | 1.5% Hungary Government Bond 20260826 | 100,000,000.000 | 95,989,000.000 | |
| | | 3% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20410425 | 130,000,000.000 | 78,183,300.000 | |
| | | 2.25% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20340622 | 75,000,000.000 | 52,043,250.000 | |
| | | 4.5% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20280323 | 100,000,000.000 | 95,689,000.000 | |
| | | 4.75% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20321124 | 235,000,000.000 | 206,727,150.000 | |
| | | 9.5% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20261021 | 190,000,000.000 | 196,579,700.000 | |
| | | 7% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20351024 | 170,000,000.000 | 168,607,700.000 | |
| | | ハンガリー・フォリント 小計 | | 2,988,701,360.000 (1,315,028,598) | |
| | ブラジル・レアル | 10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20270101 | 19,000,000.000 | 18,180,150.000 | |
| | | 10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20290101 | 18,000,000.000 | 16,549,920.000 | |
| | | 10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20310101 | 19,000,000.000 | 16,580,160.000 | |
| | | 10% BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F 20330101 | 9,000,000.000 | 7,535,250.000 | |
| | | 10% BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F 20350101 | 12,000,000.000 | 9,722,040.000 | |
| | | BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20260701 | 30,000,000.000 | 26,897,700.000 | |
| | | BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20270701 | 15,000,000.000 | 11,943,600.000 | |
| | | BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20300101 | 10,000,000.000 | 5,830,300.000 | |
| | | BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20280101 | 9,200,000.000 | 6,906,164.000 | |
| | | BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20280701 | 4,000,000.000 | 2,830,720.000 | |
| | | BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20290101 | 27,000,000.000 | 17,926,380.000 | |
| | | BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20320101 | 8,700,000.000 | 3,870,021.000 | |
| | | BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20290701 | 3,000,000.000 | 1,866,090.000 | |
| | | ブラジル・レアル 小計 | | 146,638,495.000 (4,020,739,550) | |
| | ペルー・ソル | 6.35% Peru Government Bond 20280812 | 1,270,000.000 | 1,349,933.800 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|--------------|--|----------------|-----------------------------------|----|
| | | 6. 15% Peru Government Bond 20320812 | 3,350,000.000 | 3,557,901.000 | |
| | | 5. 94% Peru Government Bond 20290212 | 2,300,000.000 | 2,421,463.000 | |
| | | 5. 4% Peru Government Bond 20340812 | 2,850,000.000 | 2,764,528.500 | |
| | | 5. 35% Peru Government Bond 20400812 | 2,100,000.000 | 1,860,348.000 | |
| | | 7. 3% PERU GOVERNMENT BOND 20330812 | 2,500,000.000 | 2,793,425.000 | |
| | | 7. 6% PERU GOVERNMENT BOND 20390812 | 1,800,000.000 | 1,967,328.000 | |
| | | 6. 85% PERU GOVERNMENT BOND 20350812 | 1,300,000.000 | 1,371,825.000 | |
| | | 8. 2% Peru Government Bond 20260812 | 175,000.000 | 181,616.750 | |
| | | 6. 9% Peru Government Bond 20370812 | 4,465,000.000 | 4,660,299.100 | |
| | | 6. 95% Peru Government Bond 20310812 | 3,370,000.000 | 3,735,982.000 | |
| | ペルー・ソル 小計 | | | 26,664,650.150 (1,123,371,045) | |
| | ポーランド・ズロチ | 2. 5% Poland Government Bond 20260725 | 4,900,000.000 | 4,854,381.000 | |
| | | 2. 5% Poland Government Bond 20270725 | 7,100,000.000 | 6,882,101.000 | |
| | | 2. 75% Poland Government Bond 20291025 | 10,850,000.000 | 10,091,368.000 | |
| | | 1. 25% Poland Government Bond 20301025 | 9,400,000.000 | 7,904,742.000 | |
| | | 0. 25% Poland Government Bond 20261025 | 6,300,000.000 | 6,053,985.000 | |
| | | 1. 75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425 | 9,400,000.000 | 7,692,772.000 | |
| | | 3. 75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525 | 6,150,000.000 | 6,107,196.000 | |
| | | 7. 5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725 | 9,400,000.000 | 10,165,724.000 | |
| | | 6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025 | 10,000,000.000 | 10,521,000.000 | |
| | | 4. 75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725 | 9,000,000.000 | 9,035,640.000 | |
| | | 5% POLAND GOVERNMENT BOND 20341025 | 9,000,000.000 | 8,792,820.000 | |
| | | 5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300125 | 9,000,000.000 | 9,083,610.000 | |
| | | 4. 5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300725 | 7,500,000.000 | 7,390,275.000 | |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND 20280125 | 800,000.000 | 720,032.000 | |
| | | 5% POLAND GOVERNMENT BOND 20351025 | 1,500,000.000 | 1,455,975.000 | |
| | | 2. 75% Poland Government Bond 20280425 | 6,950,000.000 | 6,687,359.500 | |
| | ポーランド・ズロチ 小計 | | | 113,438,980.500 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|-----------------|---|---------------|-----------------|----|
| | | | | (4,637,385,523) | |
| | マレーシア・リ ンギット | 4.07% Malaysia Government Investment Issue 20260930 | 4,650,000.000 | 4,708,497.000 | |
| | | 4.258% Malaysia Government Investment Issue 20270726 | 1,800,000.000 | 1,842,282.000 | |
| | | 4.369% Malaysia Government Investment Issue 20281031 | 4,400,000.000 | 4,567,728.000 | |
| | | 4.13% Malaysia Government Investment Issue 20290709 | 5,000,000.000 | 5,180,050.000 | |
| | | 3.465% Malaysia Government Investment Issue 20301015 | 5,100,000.000 | 5,172,369.000 | |
| | | 3.422% Malaysia Government Investment Issue 20270930 | 4,250,000.000 | 4,286,337.500 | |
| | | 3.447% Malaysia Government Investment Issue 20360715 | 3,700,000.000 | 3,683,276.000 | |
| | | 4.417% MALAYSIA T-BILL 20410930 | 3,300,000.000 | 3,596,670.000 | |
| | | 3.804% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20311008 | 4,000,000.000 | 4,117,960.000 | |
| | | 3.635% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20300830 | 1,000,000.000 | 1,022,200.000 | |
| | | 3.612% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20350430 | 1,500,000.000 | 1,521,705.000 | |
| | | 3.974% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20400716 | 2,000,000.000 | 2,080,000.000 | |
| | | 3.775% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20450531 | 800,000.000 | 799,632.000 | |
| | | 3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531 | 6,000,000.000 | 6,052,740.000 | |
| | | 3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615 | 3,850,000.000 | 3,910,868.500 | |
| | | 4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531 | 3,100,000.000 | 3,313,590.000 | |
| | | 3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130 | 3,700,000.000 | 3,745,991.000 | |
| | | 3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116 | 3,820,000.000 | 3,892,847.400 | |
| | | 4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407 | 4,300,000.000 | 4,792,737.000 | |
| | | 4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107 | 4,200,000.000 | 4,577,664.000 | |
| | | 4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608 | 4,450,000.000 | 5,037,489.000 | |
| | | 3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715 | 3,100,000.000 | 3,128,830.000 | |
| | | 3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815 | 5,000,000.000 | 5,136,600.000 | |
| | | 4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706 | 2,750,000.000 | 3,196,490.000 | |
| | | 3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705 | 5,000,000.000 | 5,165,050.000 | |
| | | 3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522 | 4,400,000.000 | 4,473,084.000 | |
| | | 4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615 | 5,000,000.000 | 5,163,450.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|--------------|---------------------------------------|-------------------|--|----|
| | | 2. 632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415 | 5, 400, 000. 000 | 5, 232, 222. 000 | |
| | | 3. 582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715 | 4, 000, 000. 000 | 4, 063, 600. 000 | |
| | | 4. 193% MALAYSIAN GOVERNMENT 20321007 | 4, 000, 000. 000 | 4, 209, 560. 000 | |
| | | 4. 696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015 | 4, 100, 000. 000 | 4, 602, 783. 000 | |
| | | 4. 504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430 | 1, 500, 000. 000 | 1, 570, 665. 000 | |
| | | 3. 599% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280731 | 5, 000, 000. 000 | 5, 074, 050. 000 | |
| | | 4. 291% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430814 | 5, 000, 000. 000 | 5, 358, 800. 000 | |
| | | 4. 662% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380331 | 1, 400, 000. 000 | 1, 554, 448. 000 | |
| | | 4. 245% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300930 | 3, 600, 000. 000 | 3, 781, 764. 000 | |
| | | 4. 457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331 | 4, 100, 000. 000 | 4, 475, 396. 000 | |
| | | 3. 519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420 | 3, 000, 000. 000 | 3, 036, 540. 000 | |
| | | 4. 467% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390915 | 4, 900, 000. 000 | 5, 355, 945. 000 | |
| | | 4. 054% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390418 | 4, 000, 000. 000 | 4, 187, 320. 000 | |
| | | 4. 18% MALAYSIAN GOVERNMENT 20440516 | 2, 500, 000. 000 | 2, 643, 375. 000 | |
| | | 4. 119% MALAYSIAN GOVERNMENT 20341130 | 5, 000, 000. 000 | 5, 272, 700. 000 | |
| | | 3. 336% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300515 | 2, 000, 000. 000 | 2, 018, 620. 000 | |
| | | 3. 476% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350702 | 500, 000. 000 | 502, 925. 000 | |
| | | 3. 917% MALAYSIAN GOVERNMENT 20550715 | 550, 000. 000 | 553, 069. 000 | |
| | マレーシア・リングギット | マレーシア・リングギット 小計 | | 167, 659, 919. 400 (5, 894, 403, 020) | |
| | メキシコ・ペソ | 8% Mexican Bonos 20471107 | 40, 000, 000. 000 | 34, 754, 400. 000 | |
| | | 5. 5% MEXICAN BONOS 20270304 | 40, 000, 000. 000 | 38, 809, 600. 000 | |
| | | 8% MEXICAN BONOS 20530731 | 65, 000, 000. 000 | 55, 941, 600. 000 | |
| | | 7. 5% MEXICAN BONOS 20330526 | 55, 400, 000. 000 | 52, 048, 854. 000 | |
| | | 7% MEXICAN BONOS 20260903 | 30, 000, 000. 000 | 29, 807, 100. 000 | |
| | | 8% MEXICAN BONOS 20350524 | 6, 000, 000. 000 | 5, 690, 520. 000 | |
| | | 8. 5% MEXICAN BONOS 20290301 | 60, 000, 000. 000 | 60, 729, 000. 000 | |
| | | 8. 5% MEXICAN BONOS 20280302 | 40, 000, 000. 000 | 40, 542, 800. 000 | |
| | | 8. 5% MEXICAN BONOS 20300228 | 34, 300, 000. 000 | 34, 651, 575. 000 | |
| | | 8% MEXICAN BONOS 20360221 | 20, 000, 000. 000 | 18, 851, 800. 000 | |
| | | 7. 5% Mexican Bonos 20270603 | 60, 500, 000. 000 | 60, 315, 475. 000 | |
| | | 10% Mexican Bonos 20361120 | 16, 890, 000. 000 | 18, 299, 808. 300 | |
| | | 8. 5% Mexican Bonos 20290531 | 59, 500, 000. 000 | 60, 218, 760. 000 | |
| | | 8. 5% Mexican Bonos 20381118 | 35, 000, 000. 000 | 33, 408, 900. 000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----------|--|----------------|------------------------------------|----|
| | | 7.75% Mexican Bonos 20310529 | 80,000,000.000 | 77,949,600.000 | |
| | | 7.75% Mexican Bonos 20421113 | 65,000,000.000 | 56,072,900.000 | |
| | | 7.75% Mexican Bonos 20341123 | 71,000,000.000 | 66,817,390.000 | |
| | メキシコ・ペソ | 小計 | | 744,910,082.300 (5,906,690,007) | |
| | ルーマニア・レイ | 5.8% Romania Government Bond 20270726 | 2,800,000.000 | 2,728,600.000 | |
| | | 5% Romania Government Bond 20290212 | 2,600,000.000 | 2,410,122.000 | |
| | | 4.85% Romania Government Bond 20260422 | 2,500,000.000 | 2,469,300.000 | |
| | | 3.65% Romania Government Bond 20310924 | 2,500,000.000 | 2,048,325.000 | |
| | | 4.15% Romania Government Bond 20280126 | 2,600,000.000 | 2,423,564.000 | |
| | | 3.25% Romania Government Bond 20260624 | 2,000,000.000 | 1,945,560.000 | |
| | | 4.15% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20301024 | 2,500,000.000 | 2,152,825.000 | |
| | | 4.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20341011 | 2,700,000.000 | 2,220,777.000 | |
| | | 2.5% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20271025 | 2,300,000.000 | 2,089,113.000 | |
| | | 4.85% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20290725 | 2,300,000.000 | 2,100,498.000 | |
| | | 6.7% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20320225 | 3,000,000.000 | 2,876,520.000 | |
| | | 4.25% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20360428 | 2,300,000.000 | 1,774,818.000 | |
| | | 8.25% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20320929 | 2,500,000.000 | 2,596,575.000 | |
| | | 8.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20281030 | 2,700,000.000 | 2,793,717.000 | |
| | | 8% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20300429 | 3,500,000.000 | 3,561,285.000 | |
| | | 7.9% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20380224 | 2,600,000.000 | 2,695,732.000 | |
| | | 7.2% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20261028 | 2,400,000.000 | 2,406,480.000 | |
| | | 7.2% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20331030 | 2,700,000.000 | 2,648,889.000 | |
| | | 7.35% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20310428 | 2,500,000.000 | 2,477,900.000 | |
| | | 7.2% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20270531 | 3,000,000.000 | 2,997,420.000 | |
| | | 7.1% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20340731 | 2,700,000.000 | 2,628,450.000 | |
| | | 6.3% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20290425 | 2,000,000.000 | 1,925,840.000 | |
| | | 6.3% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20280426 | 500,000.000 | 486,945.000 | |
| | | 6.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20350425 | 500,000.000 | 473,425.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------|---------------|---|----------------|------------------------------------|----|
| | | 6. 85% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20300729 | 1,000,000.000 | 974,050.000 | |
| | | 7. 65% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20310727 | 700,000.000 | 704,760.000 | |
| | ルーマニア・レイ | 小計 | | 56,611,490.000 (1,939,509,647) | |
| | 南アフリカ・ラ ンド | 10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221 | 48,500,000.000 | 50,237,755.000 | |
| | | 6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331 | 17,720,000.000 | 13,655,386.400 | |
| | | 6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228 | 16,280,000.000 | 11,375,650.000 | |
| | | 7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228 | 38,000,000.000 | 35,730,260.000 | |
| | | 8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228 | 75,000,000.000 | 62,079,000.000 | |
| | | 8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131 | 55,000,000.000 | 49,209,050.000 | |
| | | 8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131 | 58,500,000.000 | 58,391,190.000 | |
| | | 8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131 | 47,700,000.000 | 39,869,091.000 | |
| | | 8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331 | 59,000,000.000 | 57,514,380.000 | |
| | | 8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228 | 60,000,000.000 | 57,579,000.000 | |
| | | 9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131 | 49,400,000.000 | 43,820,764.000 | |
| | | 11.625% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20530331 | 15,000,000.000 | 16,192,500.000 | |
| | | 10.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20380331 | 8,000,000.000 | 8,416,480.000 | |
| | | 10% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20330331 | 5,000,000.000 | 5,251,700.000 | |
| | 南アフリカ・ラ ンド | 小計 | | 509,322,206.400 (4,293,586,200) | |
| 国債証券 | 合計 | | | 59,476,993,947 [59,476,993,947] | |
| 合計 | | | | 59,476,993,947 [59,476,993,947] | |

(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 36 銘柄 | 100% | 9.9% |
| インドネシア・ルピア | 国債証券 36 銘柄 | 100% | 10.0% |
| 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 | 90 銘柄 | 100% | 10. 0% |
| コロンビア・ペソ | 国債証券 | 13 銘柄 | 100% | 3. 6% |
| 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 | 29 銘柄 | 100% | 8. 9% |
| チェコ・コルナ | 国債証券 | 22 銘柄 | 100% | 4. 9% |
| チリ・ペソ | 国債証券 | 11 銘柄 | 100% | 1. 7% |
| ドミニカ・ペソ | 国債証券 | 4 銘柄 | 100% | 0. 3% |
| トルコ・リラ | 国債証券 | 11 銘柄 | 100% | 1. 2% |
| ハンガリー・フォリント | 国債証券 | 16 銘柄 | 100% | 2. 2% |
| ブラジル・レアル | 国債証券 | 13 銘柄 | 100% | 6. 8% |
| ペルー・ソル | 国債証券 | 11 銘柄 | 100% | 1. 9% |
| ポーランド・ズロチ | 国債証券 | 16 銘柄 | 100% | 7. 8% |
| マレーシア・リンギット | 国債証券 | 45 銘柄 | 100% | 9. 9% |
| メキシコ・ペソ | 国債証券 | 17 銘柄 | 100% | 9. 9% |
| ルーマニア・レイ | 国債証券 | 26 銘柄 | 100% | 3. 3% |
| 南アフリカ・ランド | 国債証券 | 14 銘柄 | 100% | 7. 2% |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

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

貸借対照表

| | 2024年9月9日現在 金額(円) | 2025年9月8日現在 金額(円) |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 27,438,981,412 | 17,753,600,364 |
| 株式 | ※2※3 351,881,446,280 | 501,745,134,810 |
| 派生商品評価勘定 | 622,850 | 196,033,600 |
| 未収入金 | - | 2,926,570 |
| 未収配当金 | 177,546,647 | 254,747,591 |
| 前払金 | 201,845,000 | - |
| その他未収収益 | ※4 8,382,924 | 15,366,347 |
| 差入委託証拠金 | 62,898,786 | - |
| 流動資産合計 | 379,771,723,899 | 519,967,809,282 |
| 資産合計 | 379,771,723,899 | 519,967,809,282 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 209,781,350 | - |
| 前受金 | - | 140,577,500 |
| 未払金 | 7,880,295,743 | - |
| 未払解約金 | 236,715,530 | 226,985,900 |
| 未払利息 | 3,140,364 | 5,622,398 |
| 受入担保金 | 15,430,748,673 | 12,082,284,099 |
| 流動負債合計 | 23,760,681,660 | 12,455,469,897 |
| 負債合計 | 23,760,681,660 | 12,455,469,897 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ※1 189,731,081,337 | 216,909,286,048 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△) | 166,279,960,902 | 290,603,053,337 |
| 元本等合計 | 356,011,042,239 | 507,512,339,385 |
| 純資産合計 | 356,011,042,239 | 507,512,339,385 |
| 負債純資産合計 | 379,771,723,899 | 519,967,809,282 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | 自 2024 年 9 月 10 日 至 2025 年 9 月 8 日 |
|------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | 受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 2024 年 9 月 9 日現在 | 2025 年 9 月 8 日現在 |
|----------------------------------|-------------------|-------------------|
| 1. ※1 期首 | | |
| 期首元本額 | 2023 年 9 月 8 日 | 2024 年 9 月 10 日 |
| 期中追加設定元本額 | 161,837,366,239 円 | 189,731,081,337 円 |
| 期中一部解約元本額 | 45,131,685,403 円 | 55,360,566,250 円 |
| | 17,237,970,305 円 | 28,182,361,539 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 | 2,796,289,328 円 | 2,780,907,612 円 |
| ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA | 3,855,336,127 円 | 3,539,447,475 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 | 906,394 円 | 900,080 円 |
| ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募) | 9,102,808 円 | 8,390,437 円 |
| ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募) | 139,731,414 円 | 93,321,668 円 |
| ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募) | 11,345,216 円 | 9,421,930 円 |
| ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募) | 326,312,724 円 | 223,926,031 円 |

| 区分 | 2024年9月9日現在 | 2025年9月8日現在 |
|---|------------------|------------------|
| 国内株式ファンド（適格機関投資家専用） | 1,210,358,757 円 | 1,500,239,796 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） | 806,501,924 円 | 932,945,619 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） | 1,139,715,535 円 | 320,911,436 円 |
| D-I's TOPIXインデックス | 12,940,316 円 | 9,985,752 円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2050 | 244,560,257 円 | 238,704,010 円 |
| iFree TOPIXインデックス | 8,736,405,174 円 | 11,215,469,502 円 |
| iFree 8資産バランス | 4,923,229,766 円 | 5,578,054,919 円 |
| iFree 年金バランス | 1,164,622,244 円 | 1,262,782,851 円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2060 | 4,217,861 円 | 5,440,436 円 |
| DCダイワ日本株式インデックス | 71,512,201,743 円 | 71,239,078,609 円 |
| ダイワ・ライフ・バランス30 | 2,976,357,767 円 | 2,780,924,299 円 |
| ダイワ・ライフ・バランス50 | 5,065,079,023 円 | 5,194,963,513 円 |
| ダイワ・ライフ・バランス70 | 6,061,926,904 円 | 6,291,386,823 円 |
| 年金ダイワ日本株式インデックス | 7,869,642,736 円 | 10,600,746,704 円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2030 | 48,273,526 円 | 39,453,807 円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2040 | 75,818,829 円 | 76,542,379 円 |
| ダイワつみたてインデックス日本株式 | 6,239,751,271 円 | 7,583,670,623 円 |
| ダイワつみたてインデックスバランス30 | 12,225,840 円 | 12,171,768 円 |
| ダイワつみたてインデックスバランス50 | 13,614,963 円 | 14,345,245 円 |
| ダイワつみたてインデックスバランス70 | 34,614,877 円 | 290,582,027 円 |
| ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用） | 20,766,034,706 円 | 31,248,891,497 円 |
| ダイワ世界バランスファンド40VA | 46,891,177 円 | 39,002,619 円 |
| ダイワ世界バランスファンド60VA | 19,720,730 円 | 17,507,099 円 |
| ダイワ・バランスファンド35VA | 3,083,043,311 円 | 2,355,819,558 円 |
| ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用） | 302,012,383 円 | 243,904,985 円 |
| ダイワ国内バランスファンド25VA（適格機関投資家専用） | 40,356,490 円 | 30,851,624 円 |

| 区分 | 2024年9月9日現在 | 2025年9月8日現在 |
|------------------------------------|---|---|
| ダイワ国内バランスファンド30 V A (適格機関投資家専用) | 57,882,863 円 | 42,157,846 円 |
| ダイワ・ノーロード T O P I X ファンド | 252,298,401 円 | 211,295,033 円 |
| ダイワファンドラップ T O P I X インデックス | 14,290,905,074 円 | 18,950,681,597 円 |
| ダイワT O P I X インデックス (ダイワSMA専用) | 12,373,133,432 円 | 19,560,355,816 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 | 3,448,211,798 円 | 3,283,801,344 円 |
| スタイル9 (4資産分散・保守型) | 550,348 円 | 1,459,735 円 |
| スタイル9 (4資産分散・バランス型) | 4,363,232 円 | 10,249,166 円 |
| スタイル9 (4資産分散・積極型) | 6,118,317 円 | 15,700,988 円 |
| スタイル9 (6資産分散・保守型) | 273,622 円 | 639,450 円 |
| スタイル9 (6資産分散・バランス型) | 7,841,413 円 | 18,514,343 円 |
| スタイル9 (6資産分散・積極型) | 9,101,329 円 | 21,913,104 円 |
| スタイル9 (8資産分散・保守型) | 435,270 円 | 1,013,262 円 |
| スタイル9 (8資産分散・バランス型) | 6,346,993 円 | 16,907,278 円 |
| スタイル9 (8資産分散・積極型) | 19,070,869 円 | 45,343,238 円 |
| ダイワ国内株式インデックス (投資一任専用) | -円 | 20,832,657 円 |
| ダイワ・インデックスセレクト T O P I X | 1,027,576,483 円 | 887,745,098 円 |
| ダイワライフスタイル25 | 94,085,020 円 | 81,844,944 円 |
| ダイワライフスタイル50 | 430,730,614 円 | 407,368,951 円 |
| ダイワライフスタイル75 | 380,782,713 円 | 365,658,040 円 |
| DC・ダイワ・トピックス・インデックス (確定拠出年金専用ファンド) | 7,772,231,425 円 | 7,185,111,425 円 |
| 計 | 189,731,081,337 円 | 216,909,286,048 円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 189,731,081,337 口 | 216,909,286,048 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 14,570,847,450 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 11,661,423,930 円 |

| 区分 | 2024年9月9日現在 | 2025年9月8日現在 |
|---------------------|--|--|
| 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 679,700,000 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 998,390,000 円 |
| 5. ※4 その他未収収益 | 貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。 | 貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。 |

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

| 区分 | 自 2024年9月10日 至 2025年9月8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 | 2025年9月8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 |

| 区分 | 2025年9月8日現在 |
|----|---|
| | デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 2024年9月9日現在 | 2025年9月8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 | 15,818,431,709 | 79,377,736,323 |
| 合計 | 15,818,431,709 | 79,377,736,323 |

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

| 種類 | 2024年9月9日現在 | | | 2025年9月8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) |
| 市場取引 | | | | | | |
| 株価指数 先物取引 | | | | | | |
| 買建 | 4,603,565,000 | - | 4,394,500,000 | △209,065,000 | 6,020,067,500 | - |
| 合計 | 4,603,565,000 | - | 4,394,500,000 | △209,065,000 | 6,020,067,500 | - |
| | | | | | | |
| | | | | | | |

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

| | 2024年9月9日現在 | 2025年9月8日現在 |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.8764円 (18,764円) | 2.3397円 (23,397円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

| 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 |
|----------------|---------|-----------|---------------|---------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| 極洋 | 6,600 | 5,120.00 | 33,792,000 | |
| ニッスイ | 158,500 | 1,079.00 | 171,021,500 | |
| マルハニチロ | 23,500 | 3,544.00 | 83,284,000 | |
| ユキグニファクトリー | 13,500 | 1,081.00 | 14,593,500 | 貸付株式数 5,300 株 |
| カネコ種苗 | 4,500 | 1,426.00 | 6,417,000 | |
| サカタのタネ | 19,600 | 3,665.00 | 71,834,000 | 貸付株式数 6,900 株 |
| ホクト | 14,100 | 1,909.00 | 26,916,900 | |
| ショーボンドHD | 20,800 | 5,144.00 | 106,995,200 | |
| ミライト・ワン | 50,200 | 2,873.00 | 144,224,600 | |
| タマホーム | 10,000 | 3,755.00 | 37,550,000 | 貸付株式数 3,900 株 |
| 住石ホールディングス | 19,900 | 642.00 | 12,775,800 | 貸付株式数 7,900 株 |
| 日鉄鉱業 | 6,400 | 8,950.00 | 57,280,000 | 貸付株式数 2,300 株 |
| 三井松島 HLDGS | 7,700 | 6,620.00 | 50,974,000 | 貸付株式数 500 株 |
| I N P E X | 532,200 | 2,618.50 | 1,393,565,700 | |
| 石油資源開発 | 86,900 | 1,247.00 | 108,364,300 | |
| K&O エナジーグループ | 7,200 | 3,250.00 | 23,400,000 | 貸付株式数 2,300 株 |
| リヨーサン菱洋 HD | 18,300 | 3,050.00 | 55,815,000 | 貸付株式数 2,100 株 |
| 第一カッター興業 | 4,100 | 1,349.00 | 5,530,900 | |
| 安藤・間 | 91,800 | 1,758.00 | 161,384,400 | |
| 東急建設 | 49,600 | 1,170.00 | 58,032,000 | |
| コムシスホールディングス | 56,200 | 3,749.00 | 210,693,800 | |
| ビーアールホールディングス | 23,200 | 347.00 | 8,050,400 | |
| 高松コンストラクション GP | 11,800 | 3,375.00 | 39,825,000 | |
| 東建コーポレーション | 3,400 | 14,430.00 | 49,062,000 | |
| ヤマウラ | 8,000 | 1,430.00 | 11,440,000 | 貸付株式数 3,000 株 |
| オリエンタル白石 | 58,700 | 426.00 | 25,006,200 | |
| 大成建設 | 100,600 | 10,140.00 | 1,020,084,000 | |
| 大林組 | 365,900 | 2,483.50 | 908,712,650 | |
| 清水建設 | 302,900 | 2,105.00 | 637,604,500 | |
| 長谷工コーポレーション | 101,700 | 2,528.50 | 257,148,450 | |
| 松井建設 | 10,300 | 1,442.00 | 14,852,600 | 貸付株式数 1,700 株 |
| 鹿島建設 | 245,800 | 4,541.00 | 1,116,177,800 | |
| 不動テトラ | 7,000 | 2,745.00 | 19,215,000 | 貸付株式数 2,700 株 |
| 鉄建建設 | 7,000 | 3,500.00 | 24,500,000 | |
| 西松建設 | 17,700 | 5,316.00 | 94,093,200 | |
| 三井住友建設 | 87,800 | 598.00 | 52,504,400 | |
| 大豊建設 | 15,300 | 860.00 | 13,158,000 | |
| 奥村組 | 19,600 | 4,910.00 | 96,236,000 | |
| 東鉄工業 | 12,200 | 4,435.00 | 54,107,000 | |
| 浅沼組 | 44,400 | 907.00 | 40,270,800 | |
| 戸田建設 | 136,400 | 1,064.50 | 145,197,800 | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 (円) | | 備考 |
|----------------|---------|-----------|---------------|---------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| 熊谷組 | 18,300 | 4,825.00 | 88,297,500 | |
| 矢作建設 | 15,100 | 2,278.00 | 34,397,800 | 貸付株式数 100 株 |
| ピーエス・コンストラクション | 8,000 | 1,888.00 | 15,104,000 | |
| 日本ハウス HLDGS | 23,700 | 318.00 | 7,536,600 | 貸付株式数 9,100 株 |
| 大東建託 | 37,900 | 16,340.00 | 619,286,000 | |
| 新日本建設 | 15,600 | 1,923.00 | 29,998,800 | |
| 東亜道路 | 19,200 | 1,711.00 | 32,851,200 | |
| 日本道路 | 5,500 | 2,513.00 | 13,821,500 | |
| 東亜建設 | 33,500 | 2,226.00 | 74,571,000 | |
| 日本国土開発 | 34,000 | 532.00 | 18,088,000 | |
| 若築建設 | 3,300 | 5,900.00 | 19,470,000 | 貸付株式数 500 株 |
| 東洋建設 | 31,900 | 1,744.00 | 55,633,600 | |
| 五洋建設 | 145,100 | 1,074.00 | 155,837,400 | |
| 世紀東急 | 15,800 | 1,599.00 | 25,264,200 | 貸付株式数 3,000 株 |
| 福田組 | 3,800 | 6,670.00 | 25,346,000 | |
| 住友林業 | 287,600 | 1,796.00 | 516,529,600 | |
| 大和ハウス | 334,500 | 5,507.00 | 1,842,091,500 | |
| ライト工業 | 21,100 | 3,310.00 | 69,841,000 | |
| 積水ハウス | 336,300 | 3,463.00 | 1,164,606,900 | |
| 日特建設 | 10,600 | 1,327.00 | 14,066,200 | |
| 北陸電気工事 | 7,600 | 1,475.00 | 11,210,000 | |
| ユアテック | 20,500 | 2,717.00 | 55,698,500 | |
| 日本リーテック | 8,700 | 2,016.00 | 17,539,200 | 貸付株式数 2,900 株 |
| 四電工 | 13,900 | 1,399.00 | 19,446,100 | |
| 中電工 | 17,200 | 3,880.00 | 66,736,000 | |
| 関電工 | 60,700 | 4,039.00 | 245,167,300 | |
| きんでん | 76,100 | 5,243.00 | 398,992,300 | |
| 東京エネシス | 11,800 | 1,656.00 | 19,540,800 | 貸付株式数 4,600 株 |
| トーエネック | 18,400 | 1,441.00 | 26,514,400 | |
| 住友電設 | 9,000 | 6,640.00 | 59,760,000 | 貸付株式数 300 株 |
| 日本電設工業 | 20,800 | 2,732.00 | 56,825,600 | |
| エクシオグループ | 114,600 | 2,197.50 | 251,833,500 | |
| 新日本空調 | 14,400 | 3,150.00 | 45,360,000 | 貸付株式数 3,400 株 |
| 九電工 | 24,000 | 7,191.00 | 172,584,000 | |
| 三機工業 | 23,100 | 5,200.00 | 120,120,000 | |
| 日揮ホールディングス | 109,700 | 1,492.00 | 163,672,400 | |
| 中外炉工業 | 3,600 | 4,045.00 | 14,562,000 | |
| 太平電業 | 7,300 | 6,280.00 | 45,844,000 | |
| 高砂熱学 | 26,700 | 8,835.00 | 235,894,500 | |
| 朝日工業社 | 10,300 | 3,165.00 | 32,599,500 | |
| 明星工業 | 18,600 | 1,690.00 | 31,434,000 | |
| 大氣社 | 28,400 | 2,951.00 | 83,808,400 | |
| ダイダン | 19,400 | 6,200.00 | 120,280,000 | |
| 日比谷総合設備 | 9,000 | 4,555.00 | 40,995,000 | 貸付株式数 1,800 株 |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 |
|-------------------|-----------|----------|-------------|----------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| ニップン | 39,400 | 2,371.00 | 93,417,400 | 貸付株式数 3,400 株 |
| 日清製粉G本社 | 110,600 | 1,861.00 | 205,826,600 | |
| 日東富士製粉 | 2,000 | 7,160.00 | 14,320,000 | |
| 昭和産業 | 9,400 | 3,060.00 | 28,764,000 | |
| 中部飼料 | 15,400 | 1,760.00 | 27,104,000 | |
| フィード・ワン | 16,300 | 1,150.00 | 18,745,000 | |
| 日本甜菜糖 | 5,800 | 2,821.00 | 16,361,800 | 貸付株式数 2,200 株 |
| DM 三井製糖 | 10,600 | 3,330.00 | 35,298,000 | |
| ウェルネオシュガー | 6,200 | 2,575.00 | 15,965,000 | |
| L I F U L L | 34,100 | 228.00 | 7,774,800 | |
| M I X I | 21,100 | 3,310.00 | 69,841,000 | |
| ジェイエイシーリクルートメント | 42,000 | 1,100.00 | 46,200,000 | |
| 日本M&Aセンターホールディングス | 170,900 | 795.90 | 136,019,310 | |
| メンバーズ | 4,500 | 1,230.00 | 5,535,000 | 貸付株式数 1,700 株 |
| UTグループ | 15,200 | 2,766.00 | 42,043,200 | |
| アイティメディア | 6,200 | 1,704.00 | 10,564,800 | 貸付株式数 500 株 |
| ケアネット | 19,800 | 1,127.00 | 22,314,600 | |
| E・Jホールディングス | 7,600 | 1,781.00 | 13,535,600 | |
| オープナップグループ | 38,800 | 1,820.00 | 70,616,000 | |
| コシダカホールディングス | 31,900 | 1,404.00 | 44,787,600 | 貸付株式数 12,300 株 |
| パソナグループ | 13,600 | 2,185.00 | 29,716,000 | |
| リンクアンドモチベーション | 27,600 | 559.00 | 15,428,400 | 貸付株式数 8,800 株 |
| エス・エム・エス | 44,400 | 1,625.00 | 72,150,000 | |
| パーソルホールディングス | 1,059,300 | 290.00 | 307,197,000 | |
| クックパッド | 22,700 | 170.00 | 3,859,000 | 貸付株式数 12,100 株 |
| 森永製菓 | 43,700 | 2,723.00 | 118,995,100 | |
| 中村屋 | 2,800 | 3,145.00 | 8,806,000 | |
| 江崎グリコ | 31,800 | 5,100.00 | 162,180,000 | |
| meito | 4,900 | 2,185.00 | 10,706,500 | 貸付株式数 1,900 株 |
| 井村屋グループ | 6,100 | 2,567.00 | 15,658,700 | |
| 不二家 | 7,600 | 2,590.00 | 19,684,000 | 貸付株式数 3,000 株 |
| 山崎製パン | 74,500 | 3,379.00 | 251,735,500 | |
| モロゾフ | 10,800 | 1,560.00 | 16,848,000 | 貸付株式数 4,200 株 |
| 亀田製菓 | 7,100 | 4,255.00 | 30,210,500 | 貸付株式数 2,700 株 |
| 寿スピリッツ | 65,800 | 1,845.50 | 121,433,900 | 貸付株式数 25,800 株 |
| カルビー | 50,900 | 2,754.00 | 140,178,600 | |
| 森永乳業 | 41,400 | 3,558.00 | 147,301,200 | |
| 六甲バター | 9,100 | 1,289.00 | 11,729,900 | 貸付株式数 3,400 株 |
| ヤクルト | 154,300 | 2,458.00 | 379,269,400 | 貸付株式数 60,600 株 |
| 明治ホールディングス | 143,100 | 3,209.00 | 459,207,900 | |
| 雪印メグミルク | 29,900 | 3,030.00 | 90,597,000 | |
| プリマハム | 14,900 | 2,429.00 | 36,192,100 | 貸付株式数 5,800 株 |
| 日本ハム | 46,100 | 5,793.00 | 267,057,300 | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 |
|---------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| 丸大食品 | 11,200 | 2,047.00 | 22,926,400 | 貸付株式数 3,900 株 |
| S F o o d s | 12,300 | 2,779.00 | 34,181,700 | |
| 柿安本店 | 4,700 | 2,741.00 | 12,882,700 | 貸付株式数 1,800 株 |
| 伊藤ハム米久 HLDGS | 17,000 | 5,840.00 | 99,280,000 | |
| 学情 | 5,300 | 1,920.00 | 10,176,000 | 貸付株式数 2,200 株 |
| スタジオアリス | 5,800 | 2,094.00 | 12,145,200 | 貸付株式数 2,200 株 (300 株) |
| クロスキャット | 6,500 | 1,149.00 | 7,468,500 | 貸付株式数 100 株 |
| システナ | 162,000 | 492.00 | 79,704,000 | |
| N J S | 2,500 | 6,340.00 | 15,850,000 | 貸付株式数 1,100 株 |
| デジタルアーツ | 7,200 | 7,990.00 | 57,528,000 | 貸付株式数 2,800 株 |
| 日鉄ソリューションズ | 38,700 | 3,533.00 | 136,727,100 | 貸付株式数 15,200 株 |
| A L S O K | 194,100 | 1,170.50 | 227,194,050 | |
| キューブシステム | 6,000 | 1,201.00 | 7,206,000 | 貸付株式数 2,300 株 |
| いちご | 94,200 | 443.00 | 41,730,600 | |
| 日本駐車場開発 | 132,500 | 298.00 | 39,485,000 | 貸付株式数 52,000 株 |
| コア | 5,000 | 2,060.00 | 10,300,000 | |
| カカクコム | 83,800 | 2,703.50 | 226,553,300 | |
| セントケア・ホールディング | 7,400 | 821.00 | 6,075,400 | 貸付株式数 2,800 株 |
| ルネサンス | 9,000 | 1,210.00 | 10,890,000 | 貸付株式数 3,400 株 |
| ディップ | 20,300 | 2,397.00 | 48,659,100 | 貸付株式数 8,000 株 |
| SBS ホールディングス | 10,100 | 3,765.00 | 38,026,500 | 貸付株式数 3,800 株 |
| デジタルホールディングス | 5,900 | 2,012.00 | 11,870,800 | 貸付株式数 2,300 株 |
| 新日本科学 | 12,300 | 1,741.00 | 21,414,300 | 貸付株式数 4,100 株 |
| エムスリー | 229,600 | 2,416.00 | 554,713,600 | |
| ワールドホールディングス | 5,300 | 2,585.00 | 13,700,500 | 貸付株式数 400 株 |
| ディー・エヌ・エー | 46,500 | 2,338.00 | 108,717,000 | 貸付株式数 18,200 株 |
| 博報堂 D Y HLDGS | 131,700 | 1,204.50 | 158,632,650 | |
| ぐるなび | 21,600 | 242.00 | 5,227,200 | 貸付株式数 8,500 株 |
| タカミヤ | 15,700 | 374.00 | 5,871,800 | 貸付株式数 6,200 株 |
| ファンコミュニケーションズ | 16,800 | 534.00 | 8,971,200 | 貸付株式数 1,800 株 |
| ライク | 6,100 | 1,496.00 | 9,125,600 | 貸付株式数 2,300 株 (2,000 株) |
| エスプール | 30,000 | 329.00 | 9,870,000 | |
| WDB ホールディングス | 5,900 | 1,805.00 | 10,649,500 | 貸付株式数 1,800 株 |
| 手間いらづ | 1,600 | 3,020.00 | 4,832,000 | 貸付株式数 500 株 |
| アドウェイズ | 12,400 | 303.00 | 3,757,200 | 貸付株式数 4,800 株 |
| バリューコマース | 10,200 | 823.00 | 8,394,600 | 貸付株式数 1,700 株 |
| インフォマート | 109,700 | 360.00 | 39,492,000 | 貸付株式数 42,500 株 |
| サッポロホールディングス | 33,300 | 7,378.00 | 245,687,400 | |
| アサヒグループホールディン | 835,700 | 1,879.50 | 1,570,698,150 | |
| キリンHD | 463,600 | 2,252.00 | 1,044,027,200 | |
| シマダヤ | 3,200 | 1,754.00 | 5,612,800 | 貸付株式数 1,200 株 |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 (円) | | 備考 |
|----------------|---------|-----------|-------------|--------------------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| 宝ホールディングス | 75,000 | 1,755.00 | 131,625,000 | |
| オエノンホールディングス | 33,300 | 600.00 | 19,980,000 | 貸付株式数 12,000 株 |
| 養命酒 | 3,600 | 3,975.00 | 14,310,000 | 貸付株式数 1,400 株 |
| 飛島ホールディングス | 11,400 | 2,252.00 | 25,672,800 | |
| コカ・コーラボトラーズ | 77,500 | 2,702.50 | 209,443,750 | |
| JHD | | | | |
| ライフドリンクカンパニー | 24,300 | 2,534.00 | 61,576,200 | 貸付株式数 9,500 株 |
| サントリー食品インター | 78,400 | 4,680.00 | 366,912,000 | |
| ダイドーグループHD | 12,600 | 2,591.00 | 32,646,600 | 貸付株式数 3,900 株 |
| 伊藤園 | 36,000 | 3,594.00 | 129,384,000 | 貸付株式数 14,000 株 |
| キーコーヒー | 12,500 | 2,001.00 | 25,012,500 | 貸付株式数 4,800 株 |
| 日清オイリオグループ | 15,700 | 5,370.00 | 84,309,000 | |
| 不二製油 | 22,200 | 3,677.00 | 81,629,400 | |
| J-オイルミルズ | 12,700 | 2,094.00 | 26,593,800 | |
| インターメスティック | 5,200 | 3,035.00 | 15,782,000 | 貸付株式数 3,400 株 |
| サンエー | 20,300 | 2,864.00 | 58,139,200 | 貸付株式数 7,800 株 |
| カワチ薬品 | 9,400 | 2,864.00 | 26,921,600 | |
| エービーシー・マート | 52,300 | 3,150.00 | 164,745,000 | |
| ハードオフコーポレーション | 4,700 | 1,826.00 | 8,582,200 | |
| 高千穂交易 | 9,500 | 1,942.00 | 18,449,000 | 貸付株式数 3,600 株 |
| アスクル | 28,000 | 1,563.00 | 43,764,000 | |
| ゲオホールディングス | 13,400 | 1,680.00 | 22,512,000 | |
| アンドエスティHD | 16,500 | 3,190.00 | 52,635,000 | 貸付株式数 6,300 株 |
| リガク・ホールディングス | 67,900 | 911.00 | 61,856,900 | 貸付株式数 30,000 株 |
| 伊藤忠食品 | 2,700 | 10,430.00 | 28,161,000 | 貸付株式数 1,000 株 |
| くら寿司 | 14,000 | 3,945.00 | 55,230,000 | 貸付株式数 5,600 株 |
| キャンドゥ | 4,300 | 3,605.00 | 15,501,500 | 貸付株式数 1,700 株 |
| パルグループHLDGS | 27,400 | 5,620.00 | 153,988,000 | |
| エディオン | 52,100 | 2,111.00 | 109,983,100 | 貸付株式数 20,100 株 |
| あらた | 18,300 | 3,175.00 | 58,102,500 | |
| サーラコーポレーション | 25,100 | 1,024.00 | 25,702,400 | |
| トーメンデバイス | 1,700 | 6,340.00 | 10,778,000 | 貸付株式数 600 株 |
| ハローズ | 4,800 | 5,080.00 | 24,384,000 | |
| JPホールディングス | 29,700 | 632.00 | 18,770,400 | 貸付株式数 11,300 株 |
| フジオフードG本社 | 19,500 | 1,166.00 | 22,737,000 | 貸付株式数 7,600 株 (100 株) |
| あみやき亭 | 8,700 | 1,561.00 | 13,580,700 | 貸付株式数 3,400 株 |
| 東京エレクトロンデバイス | 11,900 | 2,910.00 | 34,629,000 | 貸付株式数 4,600 株 |
| 円谷フィールズホールディ | 19,400 | 2,288.00 | 44,387,200 | 貸付株式数 7,700 株 |
| 双日 | 133,100 | 4,026.00 | 535,860,600 | |
| アルフレッサホールディングス | 105,100 | 2,281.00 | 239,733,100 | |
| 大黒天物産 | 4,300 | 7,700.00 | 33,110,000 | 貸付株式数 1,700 株 |
| ハニーズホールディングス | 10,600 | 1,562.00 | 16,557,200 | 貸付株式数 4,100 株 |
| キッコーマン | 368,800 | 1,332.50 | 491,426,000 | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 (円) | | 備考 |
|----------------|---------|-----------|---------------|-----------------------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| 味の素 | 510,000 | 4,293.00 | 2,189,430,000 | |
| ブルドツクソース | 5,900 | 2,163.00 | 12,761,700 | 貸付株式数 2,200 株 |
| キユーピー | 59,800 | 4,245.00 | 253,851,000 | |
| ハウス食品G本社 | 37,500 | 2,949.50 | 110,606,250 | |
| カゴメ | 59,500 | 2,984.50 | 177,577,750 | 貸付株式数 23,300 株 |
| アリアケジャパン | 11,100 | 6,230.00 | 69,153,000 | |
| エバラ食品工業 | 2,800 | 2,570.00 | 7,196,000 | |
| キオクシアホールディングス | 68,400 | 3,150.00 | 215,460,000 | 貸付株式数 27,300 株 |
| ニチレイ | 86,900 | 1,717.50 | 149,250,750 | |
| 横浜冷凍 | 30,100 | 1,219.00 | 36,691,900 | |
| 東洋水産 | 51,600 | 10,645.00 | 549,282,000 | |
| イートアンド HLDGS | 5,800 | 2,093.00 | 12,139,400 | 貸付株式数 2,200 株 |
| ヨシムラ・フード・HLDGS | 6,100 | 911.00 | 5,557,100 | 貸付株式数 2,300 株 |
| 日清食品HD | 138,400 | 2,867.00 | 396,792,800 | 貸付株式数 54,300 株 |
| フジッコ | 11,400 | 1,663.00 | 18,958,200 | 貸付株式数 600 株 |
| ロックフィールド | 12,500 | 1,501.00 | 18,762,500 | 貸付株式数 4,800 株 |
| 日本たばこ産業 | 676,200 | 4,783.00 | 3,234,264,600 | |
| ケンコーマヨネーズ | 7,000 | 1,915.00 | 13,405,000 | |
| わらべや日洋HD | 7,400 | 2,798.00 | 20,705,200 | |
| なとり | 7,000 | 2,009.00 | 14,063,000 | |
| ファーマフーズ | 14,700 | 971.00 | 14,273,700 | 貸付株式数 5,300 株 |
| 北の達人コーポ | 47,700 | 149.00 | 7,107,300 | 貸付株式数 18,700 株 (1,300 株) |
| ユーブレナ | 75,100 | 460.00 | 34,546,000 | 貸付株式数 29,100 株 |
| 紀文食品 | 9,600 | 1,206.00 | 11,577,600 | 貸付株式数 3,700 株 |
| ピックルスホールディングス | 6,500 | 1,045.00 | 6,792,500 | |
| スター・マイカ・HLDGS | 11,700 | 1,150.00 | 13,455,000 | 貸付株式数 4,600 株 |
| SRE ホールディングス | 4,100 | 3,370.00 | 13,817,000 | 貸付株式数 1,200 株 |
| 片倉工業 | 11,900 | 2,880.00 | 34,272,000 | |
| グンゼ | 16,100 | 3,845.00 | 61,904,500 | |
| ヒューリック | 324,600 | 1,622.00 | 526,501,200 | |
| ラサ商事 | 6,300 | 1,712.00 | 10,785,600 | 貸付株式数 900 株 |
| アルペン | 11,500 | 2,436.00 | 28,014,000 | 貸付株式数 4,400 株 |
| ラクーンホールディングス | 8,500 | 696.00 | 5,916,000 | 貸付株式数 3,200 株 |
| クオールホールディングス | 14,800 | 2,099.00 | 31,065,200 | |
| アルコニックス | 17,100 | 2,180.00 | 37,278,000 | |
| 神戸物産 | 104,100 | 4,102.00 | 427,018,200 | 貸付株式数 34,600 株 |
| ソリトンシステムズ | 5,800 | 1,405.00 | 8,149,000 | |
| ジンズホールディングス | 8,100 | 9,610.00 | 77,841,000 | 貸付株式数 3,100 株 |
| ビックカメラ | 63,600 | 1,657.50 | 105,417,000 | 貸付株式数 18,300 株 |
| DCM ホールディングス | 61,900 | 1,525.00 | 94,397,500 | |
| ペッパーフードサービス | 41,500 | 186.00 | 7,719,000 | 貸付株式数 16,300 株 |
| MonotaRO | 169,500 | 2,519.00 | 426,970,500 | |
| あい ホールディングス | 21,500 | 2,690.00 | 57,835,000 | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 (円) | | 備考 |
|----------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| J. フロントリテイリング | 137,200 | 2,479.00 | 340,118,800 | |
| ドトール・日レスHD | 21,200 | 2,647.00 | 56,116,400 | |
| マツキヨココカラ&カンパニー | 208,100 | 3,260.00 | 678,406,000 | |
| プロンコビリー | 7,000 | 4,000.00 | 28,000,000 | 貸付株式数 2,700 株 |
| ZOZO | 263,900 | 1,404.00 | 370,515,600 | |
| トレジャー・ファクトリー | 8,200 | 1,892.00 | 15,514,400 | 貸付株式数 3,200 株 |
| 物語コーポレーション | 23,200 | 4,330.00 | 100,456,000 | 貸付株式数 6,700 株 |
| 三越伊勢丹HD | 176,800 | 2,835.00 | 501,228,000 | |
| 東洋紡 | 48,900 | 1,157.00 | 56,577,300 | |
| ユニチカ | 36,600 | 217.00 | 7,942,200 | 貸付株式数 14,400 株 |
| 富士紡ホールディングス | 4,300 | 6,820.00 | 29,326,000 | |
| 日清紡ホールディングス | 85,900 | 1,183.50 | 101,662,650 | |
| 倉敷紡績 | 7,600 | 7,350.00 | 55,860,000 | |
| ダイワボウHD | 52,900 | 3,137.00 | 165,947,300 | |
| シキボウ | 8,100 | 1,042.00 | 8,440,200 | 貸付株式数 3,200 株 |
| 日東紡績 | 12,800 | 6,800.00 | 87,040,000 | |
| トヨタ紡織 | 47,600 | 2,501.00 | 119,047,600 | |
| マクニカホールディングス | 90,800 | 2,059.50 | 187,002,600 | |
| Ham e e | 5,500 | 1,377.00 | 7,573,500 | |
| ラクト・ジャパン | 5,100 | 4,200.00 | 21,420,000 | 貸付株式数 1,900 株 |
| ウエルシアHD | 62,100 | 2,942.00 | 182,698,200 | |
| クリエイトSDH | 16,900 | 3,445.00 | 58,220,500 | 貸付株式数 3,700 株 |
| グリムス | 5,000 | 2,553.00 | 12,765,000 | 貸付株式数 1,900 株 |
| バイタルKSKHD | 16,500 | 1,312.00 | 21,648,000 | |
| 八洲電機 | 9,700 | 2,304.00 | 22,348,800 | 貸付株式数 3,700 株 |
| メディアスホールディングス | 7,800 | 858.00 | 6,692,400 | 貸付株式数 2,900 株 |
| レスター | 10,200 | 2,653.00 | 27,060,600 | 貸付株式数 4,000 株 |
| TOKAI ホールディングス | 64,900 | 1,059.00 | 68,729,100 | 貸付株式数 25,500 株 |
| 三洋貿易 | 14,700 | 1,640.00 | 24,108,000 | |
| シュッピン | 11,300 | 1,264.00 | 14,283,200 | 貸付株式数 4,300 株 |
| ビューティガレージ | 3,200 | 1,714.00 | 5,484,800 | 貸付株式数 1,200 株 |
| オイシックス・ラ・大地 | 19,300 | 1,587.00 | 30,629,100 | 貸付株式数 7,700 株 |
| ワイン・パートナーズ | 8,700 | 1,336.00 | 11,623,200 | 貸付株式数 2,000 株 |
| ネクステージ | 27,300 | 2,290.00 | 62,517,000 | 貸付株式数 7,000 株 |
| ジョイフル本田 | 32,400 | 2,194.00 | 71,085,600 | 貸付株式数 12,000 株 |
| エターナルホスピタリティグル | 4,900 | 3,070.00 | 15,043,000 | 貸付株式数 1,800 株 |
| ホットランドホールディング | 9,200 | 2,025.00 | 18,630,000 | 貸付株式数 3,600 株 (200 株) |
| すかいらーくHD | 163,500 | 3,100.00 | 506,850,000 | 貸付株式数 64,200 株 |
| SFP ホールディングス | 6,800 | 2,179.00 | 14,817,200 | 貸付株式数 2,600 株 |
| 綿半ホールディングス | 9,300 | 1,638.00 | 15,233,400 | 貸付株式数 3,600 株 |
| 日本毛織 | 29,000 | 1,654.00 | 47,966,000 | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|------------------|-----------|----------|---------------|-------|---------------------|
| | | 単価 | 金額 | | |
| ヨシックスホールディングス | 3,900 | 2,650.00 | 10,335,000 | 貸付株式数 | 1,500 株 |
| ユナイテッド・スーパー・マーケ | 51,100 | 976.00 | 49,873,600 | 貸付株式数 | 19,600 株 |
| 野村不動産 HLDGS | 349,100 | 960.00 | 335,136,000 | | |
| 三重交通グループ HD | 23,800 | 554.00 | 13,185,200 | 貸付株式数 | 9,100 株 |
| 地主 | 9,100 | 3,050.00 | 27,755,000 | 貸付株式数 | 3,800 株 |
| フィル・カンパニー | 1,900 | 1,076.00 | 2,044,400 | 貸付株式数 | 100 株 |
| JPMC | 6,000 | 1,320.00 | 7,920,000 | | |
| フージャース HD | 17,200 | 1,347.00 | 23,168,400 | | |
| オープンハウスグループ | 35,700 | 7,969.00 | 284,493,300 | | |
| 東急不動産 HD | 334,700 | 1,247.00 | 417,370,900 | | |
| 飯田 GHD | 106,700 | 2,432.50 | 259,547,750 | | |
| 帝国繊維 | 11,700 | 3,095.00 | 36,211,500 | 貸付株式数 | 4,800 株 |
| 日本コードス工業 | 115,000 | 103.00 | 11,845,000 | 貸付株式数 | 45,200 株 |
| ゴルフダイジェスト・オンライン | 3,000 | 427.00 | 1,281,000 | | |
| あさひ | 10,000 | 1,423.00 | 14,230,000 | | |
| 日本調剤 | 7,700 | 3,925.00 | 30,222,500 | | |
| コスマス薬品 | 23,700 | 8,870.00 | 210,219,000 | 貸付株式数 | 7,200 株 |
| シップヘルスケア HD | 43,900 | 2,290.00 | 100,531,000 | | |
| ソフトクリエイト HD | 8,200 | 2,398.00 | 19,663,600 | 貸付株式数 | 3,200 株 |
| セブン&アイ・HLDGS | 1,321,000 | 1,964.00 | 2,594,444,000 | | |
| クリエイト・レストランツ・ホール | 179,800 | 791.00 | 142,221,800 | 貸付株式数 | 69,400 株 |
| 明治電機工業 | 5,900 | 2,126.00 | 12,543,400 | | |
| ツルハホールディングス | 105,000 | 2,567.00 | 269,535,000 | | |
| サンマルクホールディングス | 11,800 | 2,831.00 | 33,405,800 | | |
| トリドールホールディングス | 33,700 | 5,111.00 | 172,240,700 | 貸付株式数 | 13,200 株 (400 株) |
| 帝人 | 108,800 | 1,317.00 | 143,289,600 | | |
| 東レ | 827,500 | 998.00 | 825,845,000 | | |
| クラレ | 151,000 | 1,815.00 | 274,065,000 | | |
| 旭化成 | 750,400 | 1,217.00 | 913,236,800 | | |
| TOKYO BASE | 12,900 | 541.00 | 6,978,900 | 貸付株式数 | 4,900 株 |
| 稻葉製作所 | 6,500 | 1,697.00 | 11,030,500 | 貸付株式数 | 2,400 株 |
| 宮地エンジニアリング G | 14,000 | 2,134.00 | 29,876,000 | | |
| トーカロ | 33,600 | 2,124.00 | 71,366,400 | | |
| SUMCO | 222,000 | 1,289.00 | 286,158,000 | 貸付株式数 | 88,800 株 |
| 川田テクノロジーズ | 7,400 | 4,085.00 | 30,229,000 | | |
| RS TECHNOLOGIES | 7,800 | 3,685.00 | 28,743,000 | | |
| AND DO ホールディングス | 6,700 | 1,118.00 | 7,490,600 | 貸付株式数 | 2,400 株 |
| ケイアイスター不動産 | 6,000 | 5,560.00 | 33,360,000 | 貸付株式数 | 2,300 株 |
| ジェイ・エス・ビー | 4,600 | 3,815.00 | 17,549,000 | 貸付株式数 | 1,000 株 |
| ロードスター・キャピタル | 6,300 | 3,140.00 | 19,782,000 | | |
| アズーム | 1,000 | 9,580.00 | 9,580,000 | 貸付株式数 | 300 株 |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 |
|------------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| 霞ヶ関キャピタル | 9,200 | 9,130.00 | 83,996,000 | 貸付株式数 1,800 株 |
| JMホールディングス | 8,600 | 2,826.00 | 24,303,600 | 貸付株式数 3,200 株 |
| コメダホールディングス | 31,300 | 3,045.00 | 95,308,500 | |
| アレンザホールディングス | 8,900 | 1,042.00 | 9,273,800 | 貸付株式数 3,400 株 (1,200 株) |
| 串カツ田中 HLDGS | 3,600 | 2,810.00 | 10,116,000 | 貸付株式数 1,400 株 |
| バロックジャパン | 14,000 | 760.00 | 10,640,000 | 貸付株式数 5,300 株 |
| クスリのアオキ HLDGS | 31,100 | 3,996.00 | 124,275,600 | 貸付株式数 12,200 株 |
| 力の源 HD | 9,000 | 1,550.00 | 13,950,000 | 貸付株式数 3,600 株 |
| FOOD&LIFE COMPAN | 68,700 | 8,161.00 | 560,660,700 | |
| アセンテック | 4,500 | 1,784.00 | 8,028,000 | |
| セーレン | 21,900 | 3,175.00 | 69,532,500 | |
| 小松マテーレ | 16,400 | 837.00 | 13,726,800 | |
| ワコールホールディングス | 22,200 | 5,824.00 | 129,292,800 | |
| ホギメディカル | 15,200 | 5,380.00 | 81,776,000 | 貸付株式数 6,000 株 |
| T S I ホールディングス | 34,500 | 1,144.00 | 39,468,000 | 貸付株式数 200 株 |
| ワールド | 17,400 | 3,085.00 | 53,679,000 | 貸付株式数 6,800 株 |
| T I S | 119,800 | 4,999.00 | 598,880,200 | |
| グリーホールディングス | 38,000 | 452.00 | 17,176,000 | |
| GMOペパボ | 1,400 | 1,730.00 | 2,422,000 | 貸付株式数 500 株 |
| コーディテクモ HD | 85,200 | 1,912.50 | 162,945,000 | 貸付株式数 12,300 株 |
| 三菱総合研究所 | 5,400 | 4,855.00 | 26,217,000 | |
| ファインデックス | 7,900 | 846.00 | 6,683,400 | |
| ブレインパッド | 8,500 | 1,264.00 | 10,744,000 | 貸付株式数 3,400 株 |
| K L a b | 30,600 | 177.00 | 5,416,200 | 貸付株式数 12,000 株 |
| ポールトゥワインホールディングス | 16,100 | 375.00 | 6,037,500 | 貸付株式数 100 株 |
| ネクソン | 278,400 | 3,406.00 | 948,230,400 | |
| アイスタイル | 38,800 | 581.00 | 22,542,800 | 貸付株式数 15,500 株 |
| エムアップホールディングス | 13,900 | 2,232.00 | 31,024,800 | |
| エイチームホールディングス | 8,800 | 1,109.00 | 9,759,200 | 貸付株式数 3,400 株 |
| セルシス | 15,300 | 1,842.00 | 28,182,600 | 貸付株式数 6,000 株 |
| エニグモ | 12,600 | 302.00 | 3,805,200 | 貸付株式数 4,800 株 (4,700 株) |
| コロプラ | 38,500 | 530.00 | 20,405,000 | |
| ブロードリーフ | 41,400 | 720.00 | 29,808,000 | |
| デジタルハーツ HLDGS | 8,100 | 954.00 | 7,727,400 | |
| メディアドウ | 5,100 | 1,926.00 | 9,822,600 | 貸付株式数 1,900 株 |
| じげん | 27,900 | 535.00 | 14,926,500 | 貸付株式数 11,100 株 |
| ブイキューブ | 14,200 | 157.00 | 2,229,400 | 貸付株式数 6,000 株 |
| フィックスターズ | 15,600 | 1,813.00 | 28,282,800 | 貸付株式数 6,100 株 |
| CARTA HOLDINGS | 6,400 | 2,096.00 | 13,414,400 | |
| 北里コーポレーション | 8,900 | 1,525.00 | 13,572,500 | 貸付株式数 3,400 株 |
| オプティム | 11,700 | 587.00 | 6,867,900 | 貸付株式数 4,400 株 |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 (円) | | 備考 |
|-----------------|---------|----------|-------------|----------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| セレス | 5,100 | 2,450.00 | 12,495,000 | 貸付株式数 1,900 株 |
| S H I F T | 101,800 | 1,422.00 | 144,759,600 | |
| 特種東海製紙 | 5,500 | 4,360.00 | 23,980,000 | 貸付株式数 2,000 株 |
| セック | 1,900 | 4,470.00 | 8,493,000 | 貸付株式数 700 株 |
| テクマトリックス | 24,500 | 2,064.00 | 50,568,000 | |
| プロシップ | 5,000 | 3,215.00 | 16,075,000 | 貸付株式数 1,900 株 |
| ガンホー・オンライン・エンター | 26,300 | 2,829.00 | 74,402,700 | 貸付株式数 9,000 株 |
| GMOペイメントゲートウェイ | 22,700 | 8,393.00 | 190,521,100 | |
| システムリサーチ | 7,800 | 2,143.00 | 16,715,400 | 貸付株式数 3,000 株 |
| インターネットイニシアティブ | 61,900 | 2,755.00 | 170,534,500 | |
| さくらインターネット | 17,700 | 2,970.00 | 52,569,000 | 貸付株式数 7,000 株 |
| GMOグローバルサインHD | 3,500 | 2,197.00 | 7,689,500 | 貸付株式数 1,300 株 |
| SRAホールディングス | 6,400 | 4,825.00 | 30,880,000 | |
| 朝日ネット | 12,200 | 694.00 | 8,466,800 | |
| e B A S E | 16,000 | 507.00 | 8,112,000 | 貸付株式数 1,500 株 |
| アバントグループ | 15,900 | 1,511.00 | 24,024,900 | 貸付株式数 1,000 株 |
| アドソル日進 | 9,100 | 1,339.00 | 12,184,900 | |
| フリービット | 5,900 | 1,583.00 | 9,339,700 | |
| コムチュア | 15,000 | 1,701.00 | 25,515,000 | |
| アステリア | 8,900 | 1,668.00 | 14,845,200 | 貸付株式数 3,400 株 |
| アイル | 6,300 | 3,025.00 | 19,057,500 | |
| 王子ホールディングス | 428,700 | 835.70 | 358,264,590 | |
| 日本製紙 | 59,000 | 1,253.00 | 73,927,000 | |
| 北越コーポレーション | 63,600 | 1,049.00 | 66,716,400 | 貸付株式数 18,800 株 |
| 大王製紙 | 57,100 | 901.00 | 51,447,100 | 貸付株式数 22,200 株 |
| マークライズ | 6,700 | 2,128.00 | 14,257,600 | |
| メディカル・データ・ビジ | 11,800 | 597.00 | 7,044,600 | 貸付株式数 4,700 株 |
| g u m i | 20,900 | 611.00 | 12,769,900 | 貸付株式数 8,300 株 |
| テラスカイ | 4,400 | 2,138.00 | 9,407,200 | 貸付株式数 1,700 株 |
| デジタル・インフォメーション | 6,600 | 2,390.00 | 15,774,000 | |
| ネオジャパン | 3,000 | 2,019.00 | 6,057,000 | |
| P R T I M E S | 2,300 | 2,903.00 | 6,676,900 | 貸付株式数 800 株 |
| ラクス | 53,400 | 2,719.50 | 145,221,300 | |
| ダブルスタンダード | 4,000 | 1,780.00 | 7,120,000 | |
| オープンドア | 7,900 | 479.00 | 3,784,100 | 貸付株式数 3,100 株 |
| アカツキ | 5,500 | 2,890.00 | 15,895,000 | |
| UBICOMホールディングス | 3,600 | 1,108.00 | 3,988,800 | |
| カナミックネットワーク | 14,200 | 519.00 | 7,369,800 | |
| レンゴー | 103,100 | 957.70 | 98,738,870 | |
| トーモク | 6,500 | 3,415.00 | 22,197,500 | 貸付株式数 2,500 株 |
| ザ・パック | 22,700 | 1,134.00 | 25,741,800 | 貸付株式数 4,800 株 |
| チェンジホールディングス | 28,100 | 1,112.00 | 31,247,200 | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 (円) | | 備考 | |
|------------------|-----------|----------|---------------|-------|----------|
| | | 単価 | 金額 | | |
| オークネット | 10,500 | 1,910.00 | 20,055,000 | | |
| オロ | 4,700 | 2,779.00 | 13,061,300 | 貸付株式数 | 1,600 株 |
| ユーザーローカル | 5,500 | 2,072.00 | 11,396,000 | 貸付株式数 | 300 株 |
| PKSHA TECHNOLOGY | 13,500 | 3,690.00 | 49,815,000 | 貸付株式数 | 5,400 株 |
| マネーフォワード | 25,800 | 6,291.00 | 162,307,800 | 貸付株式数 | 10,800 株 |
| レゾナック・ホールディング | 109,400 | 4,173.00 | 456,526,200 | 貸付株式数 | 1,000 株 |
| 住友化学 | 910,500 | 477.90 | 435,127,950 | | |
| 住友精化 | 5,300 | 4,700.00 | 24,910,000 | | |
| 日産化学 | 57,800 | 5,365.00 | 310,097,000 | | |
| ラサ工業 | 4,000 | 4,510.00 | 18,040,000 | | |
| クレハ | 21,100 | 4,000.00 | 84,400,000 | 貸付株式数 | 8,200 株 |
| 多木化学 | 4,400 | 3,720.00 | 16,368,000 | 貸付株式数 | 1,100 株 |
| ティカ | 8,100 | 1,358.00 | 10,999,800 | | |
| 石原産業 | 18,800 | 2,512.00 | 47,225,600 | | |
| 日本曹達 | 24,000 | 3,495.00 | 83,880,000 | 貸付株式数 | 1,200 株 |
| 東ソー | 151,100 | 2,374.00 | 358,711,400 | | |
| トクヤマ | 36,600 | 3,495.00 | 127,917,000 | | |
| セントラル硝子 | 14,300 | 3,420.00 | 48,906,000 | | |
| 東亞合成 | 47,800 | 1,567.00 | 74,902,600 | | |
| 大阪ソーダ | 39,500 | 1,797.00 | 70,981,500 | | |
| 関東電化 | 24,300 | 869.00 | 21,116,700 | | |
| GMO フィナンシャルゲート | 1,900 | 6,170.00 | 11,723,000 | 貸付株式数 | 700 株 |
| SUN ASTERISK | 9,900 | 468.00 | 4,633,200 | 貸付株式数 | 3,100 株 |
| デンカ | 41,200 | 2,382.50 | 98,159,000 | | |
| イビデン | 65,500 | 7,267.00 | 475,988,500 | | |
| 信越化学 | 1,006,800 | 4,437.00 | 4,467,171,600 | | |
| 日本カーバイド | 6,000 | 2,222.00 | 13,332,000 | | |
| プラスアルファ・コンサル | 14,400 | 2,452.00 | 35,308,800 | | |
| テイン | | | | | |
| 電算システムHD | 5,000 | 3,515.00 | 17,575,000 | 貸付株式数 | 1,900 株 |
| 堺化學 | 7,900 | 2,973.00 | 23,486,700 | | |
| 第一稀元素化学工 | 12,400 | 707.00 | 8,766,800 | 貸付株式数 | 4,200 株 |
| エア・ウォーター | 106,800 | 2,645.00 | 282,486,000 | | |
| 日本酸素 HLDGS | 109,800 | 5,442.00 | 597,531,600 | 貸付株式数 | 10,900 株 |
| 日本化学工業 | 4,100 | 2,900.00 | 11,890,000 | | |
| 日本パーカライジング | 50,400 | 1,434.00 | 72,273,600 | | |
| 高圧ガス | 16,400 | 1,091.00 | 17,892,400 | 貸付株式数 | 5,900 株 |
| 四国化成ホールディング | 12,800 | 2,184.00 | 27,955,200 | 貸付株式数 | 3,800 株 |
| 戸田工業 | 2,600 | 1,404.00 | 3,650,400 | 貸付株式数 | 1,000 株 |
| ステラ ケミファ | 6,000 | 4,260.00 | 25,560,000 | | |
| 保土谷化学 | 7,100 | 1,773.00 | 12,588,300 | | |
| 日本触媒 | 72,500 | 1,922.00 | 139,345,000 | | |
| 大日精化 | 7,700 | 4,110.00 | 31,647,000 | | |
| カネカ | 27,900 | 4,400.00 | 122,760,000 | | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額（円） | | 備考 |
|---------------|---------|-----------|---------------|----------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| 協和キリン | 133,300 | 2,601.00 | 346,713,300 | |
| APPIER GROUP | 43,300 | 1,617.00 | 70,016,100 | 貸付株式数 17,000 株 |
| 三菱瓦斯化学 | 89,500 | 2,719.50 | 243,395,250 | |
| 三井化学 | 101,900 | 3,838.00 | 391,092,200 | |
| 東京応化工業 | 54,000 | 4,776.00 | 257,904,000 | |
| 大阪有機化学 | 9,500 | 3,025.00 | 28,737,500 | |
| 三菱ケミカルグループ | 827,600 | 885.70 | 733,005,320 | |
| KHネオケム | 18,800 | 2,830.00 | 53,204,000 | 貸付株式数 100 株 |
| ビジョナル | 13,600 | 11,320.00 | 153,952,000 | |
| ダイセル | 124,100 | 1,408.00 | 174,732,800 | |
| 住友ベークライト | 35,700 | 5,106.00 | 182,284,200 | |
| 積水化学 | 223,400 | 2,901.00 | 648,083,400 | |
| 日本ゼオン | 81,900 | 1,731.50 | 141,809,850 | |
| アイカ工業 | 28,600 | 3,862.00 | 110,453,200 | |
| U B E | 58,400 | 2,432.00 | 142,028,800 | |
| 積水樹脂 | 14,800 | 2,212.00 | 32,737,600 | |
| 旭有機材 | 7,500 | 4,590.00 | 34,425,000 | 貸付株式数 100 株 |
| ニチバン | 7,000 | 1,992.00 | 13,944,000 | 貸付株式数 2,800 株 |
| リケンテクノス | 19,500 | 1,231.00 | 24,004,500 | |
| 大倉工業 | 5,800 | 5,320.00 | 30,856,000 | |
| 積水化成品 | 15,900 | 373.00 | 5,930,700 | |
| 群栄化学 | 2,700 | 3,450.00 | 9,315,000 | |
| ダイキヨーニシカワ | 25,000 | 779.00 | 19,475,000 | |
| 森六 | 6,100 | 2,527.00 | 15,414,700 | |
| 恵和 | 7,300 | 1,145.00 | 8,358,500 | 貸付株式数 1,400 株 |
| 日本化薬 | 74,400 | 1,456.50 | 108,363,600 | |
| カーリット | 11,200 | 1,382.00 | 15,478,400 | |
| CL ホールディングス | 3,000 | 988.00 | 2,964,000 | 貸付株式数 1,000 株 |
| プレステージ・インター | 53,700 | 686.00 | 36,838,200 | |
| ハイマックス | 3,500 | 1,223.00 | 4,280,500 | |
| アミューズ | 7,100 | 2,020.00 | 14,342,000 | |
| 野村総合研究所 | 245,700 | 5,727.00 | 1,407,123,900 | |
| ドリームインキュベータ | 2,800 | 2,673.00 | 7,484,400 | 貸付株式数 1,100 株 |
| クイック | 8,000 | 2,466.00 | 19,728,000 | |
| 日本システム技術 | 10,500 | 2,133.00 | 22,396,500 | 貸付株式数 3,100 株 |
| 電通グループ | 112,300 | 3,100.00 | 348,130,000 | |
| インテージホールディングス | 8,500 | 1,824.00 | 15,504,000 | |
| テイクアンドギヴニーズ | 5,600 | 876.00 | 4,905,600 | 貸付株式数 800 株 |
| 東邦システムサイエンス | 5,300 | 1,243.00 | 6,587,900 | 貸付株式数 2,000 株 |
| ぴあ | 4,000 | 3,525.00 | 14,100,000 | 貸付株式数 800 株 |
| イオンファンタジー | 5,000 | 3,635.00 | 18,175,000 | 貸付株式数 1,900 株 |
| ソースネクスト | 58,800 | 178.00 | 10,466,400 | 貸付株式数 23,100 株 |
| シーティーエス | 16,000 | 915.00 | 14,640,000 | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 |
|------------------|-----------|----------|---------------|--------------------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| メディカルシステムネットワーク | 11,700 | 490.00 | 5,733,000 | |
| 日本精化 | 7,500 | 2,698.00 | 20,235,000 | |
| 扶桑化学工業 | 10,500 | 4,780.00 | 50,190,000 | |
| トリケミカル | 12,400 | 2,589.00 | 32,103,600 | 貸付株式数 4,900 株 |
| シンプレクスHD | 22,400 | 4,365.00 | 97,776,000 | |
| HEROZ | 4,500 | 1,127.00 | 5,071,500 | 貸付株式数 1,800 株 (300 株) |
| ラクスル | 22,600 | 1,361.00 | 30,758,600 | 貸付株式数 8,000 株 |
| メルカリ | 62,500 | 2,327.00 | 145,437,500 | 貸付株式数 25,000 株 |
| I P S | 3,300 | 3,105.00 | 10,246,500 | 貸付株式数 1,100 株 |
| システムサポートホールディングス | 4,000 | 2,841.00 | 11,364,000 | |
| ADEKA | 39,500 | 3,410.00 | 134,695,000 | |
| 日油 | 130,000 | 2,703.50 | 351,455,000 | |
| ハリマ化成グループ | 8,800 | 910.00 | 8,008,000 | 貸付株式数 3,400 株 |
| ボードルア | 3,100 | 2,928.00 | 9,076,800 | |
| イーソル | 7,600 | 549.00 | 4,172,400 | 貸付株式数 2,900 株 |
| ウイングアーク 1ST | 11,800 | 3,325.00 | 39,235,000 | |
| ヒト・コミュニケーションズHD | 4,500 | 1,122.00 | 5,049,000 | 貸付株式数 1,700 株 |
| サーバーワークス | 2,000 | 2,050.00 | 4,100,000 | |
| S a n s a n | 32,100 | 1,917.00 | 61,535,700 | |
| ギフティ | 8,800 | 1,214.00 | 10,683,200 | |
| 花 王 | 275,700 | 6,888.00 | 1,899,021,600 | |
| 第一工業製薬 | 4,100 | 5,840.00 | 23,944,000 | 貸付株式数 1,500 株 |
| 石原ケミカル | 4,800 | 1,951.00 | 9,364,800 | 貸付株式数 1,800 株 |
| 三洋化成 | 7,000 | 4,300.00 | 30,100,000 | 貸付株式数 1,800 株 |
| メドレー | 13,800 | 2,462.00 | 33,975,600 | 貸付株式数 5,400 株 |
| ベース | 4,800 | 3,590.00 | 17,232,000 | 貸付株式数 1,000 株 |
| J M D C | 13,800 | 4,417.00 | 60,954,600 | |
| 武田薬品 | 1,008,600 | 4,650.00 | 4,689,990,000 | |
| アステラス製薬 | 994,300 | 1,724.00 | 1,714,173,200 | |
| 住友ファーマ | 100,900 | 1,793.00 | 180,913,700 | |
| 塩野義製薬 | 376,000 | 2,693.50 | 1,012,756,000 | |
| 日本新薬 | 29,700 | 3,380.00 | 100,386,000 | |
| 中外製薬 | 354,800 | 6,678.00 | 2,369,354,400 | |
| 科研製薬 | 18,700 | 3,930.00 | 73,491,000 | |
| エーザイ | 147,900 | 5,322.00 | 787,123,800 | |
| 理研ビタミン | 8,800 | 2,999.00 | 26,391,200 | |
| ロート製薬 | 119,800 | 2,587.50 | 309,982,500 | |
| 小野薬品 | 231,900 | 1,776.50 | 411,970,350 | |
| 久光製薬 | 22,200 | 4,340.00 | 96,348,000 | |
| 持田製薬 | 13,800 | 3,290.00 | 45,402,000 | |
| 参天製薬 | 202,400 | 1,641.00 | 332,138,400 | |
| 扶桑薬品 | 4,400 | 2,207.00 | 9,710,800 | 貸付株式数 800 株 |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 |
|---------------|-----------|----------|---------------|-----------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| ツムラ | 38,900 | 3,812.00 | 148,286,800 | |
| テルモ | 750,900 | 2,657.50 | 1,995,516,750 | |
| HUグループHD | 34,000 | 3,887.00 | 132,158,000 | |
| キッセイ薬品工業 | 17,700 | 4,540.00 | 80,358,000 | |
| 生化学工業 | 21,600 | 677.00 | 14,623,200 | 貸付株式数 8,400 株 |
| 栄研化学 | 17,900 | 2,485.00 | 44,481,500 | 貸付株式数 7,000 株 |
| J C R ファーマ | 38,400 | 660.00 | 25,344,000 | 貸付株式数 14,800 株 |
| 東和薬品 | 15,200 | 3,050.00 | 46,360,000 | 貸付株式数 3,500 株 |
| 富士製薬工業 | 8,400 | 1,590.00 | 13,356,000 | 貸付株式数 3,300 株 |
| ゼリア新薬工業 | 18,000 | 2,124.00 | 38,232,000 | 貸付株式数 7,000 株 |
| ネクセラファーマ | 49,700 | 1,035.00 | 51,439,500 | 貸付株式数 19,500 株 |
| 第一三共 | 1,040,900 | 3,704.00 | 3,855,493,600 | |
| 杏林製薬 | 22,800 | 1,572.00 | 35,841,600 | 貸付株式数 2,000 株 |
| 大幸薬品 | 23,500 | 319.00 | 7,496,500 | 貸付株式数 9,800 株 |
| ダイト | 15,300 | 1,240.00 | 18,972,000 | |
| 大塚ホールディングス | 252,400 | 8,477.00 | 2,139,594,800 | |
| ペプチドリーム | 54,900 | 1,715.00 | 94,153,500 | |
| 大日本塗料 | 12,600 | 1,319.00 | 16,619,400 | |
| 日本ペイント HOLD | 601,100 | 1,041.00 | 625,745,100 | |
| 関西ペイント | 90,300 | 2,518.50 | 227,420,550 | 貸付株式数 16,800 株 |
| 中国塗料 | 25,600 | 3,565.00 | 91,264,000 | |
| 藤倉化成 | 14,300 | 615.00 | 8,794,500 | |
| 太陽ホールディングス | 19,700 | 7,740.00 | 152,478,000 | |
| D I C | 40,200 | 3,685.00 | 148,137,000 | |
| サカタインクス | 25,200 | 2,307.00 | 58,136,400 | |
| ARTIENCE | 21,300 | 3,185.00 | 67,840,500 | |
| アルプラス技研 | 9,600 | 2,923.00 | 28,060,800 | |
| サニックスホールディングス | 16,500 | 241.00 | 3,976,500 | 貸付株式数 2,200 株 |
| 日本空調サービス | 12,500 | 1,280.00 | 16,000,000 | 貸付株式数 4,900 株 |
| オリエンタルランド | 684,900 | 3,655.00 | 2,503,309,500 | 貸付株式数 171,900 株 |
| フォーカスシステムズ | 7,600 | 1,624.00 | 12,342,400 | 貸付株式数 2,700 株 |
| ダスキン | 24,300 | 3,965.00 | 96,349,500 | 貸付株式数 7,000 株 |
| パーク24 | 79,500 | 2,023.00 | 160,828,500 | |
| 明光ネットワークジャパン | 15,300 | 742.00 | 11,352,600 | 貸付株式数 5,800 株 |
| ファルコホールディングス | 4,600 | 2,521.00 | 11,596,600 | |
| クレスコ | 17,800 | 1,682.00 | 29,939,600 | |
| フジ・メディア・HD | 108,900 | 3,383.00 | 368,408,700 | 貸付株式数 43,500 株 |
| ラウンドワン | 109,800 | 1,349.00 | 148,120,200 | |
| リゾートトラスト | 91,700 | 1,854.00 | 170,011,800 | |
| オービック | 210,500 | 5,301.00 | 1,115,860,500 | |
| ジャストシステム | 16,300 | 4,770.00 | 77,751,000 | |
| T D C ソフト | 19,100 | 1,390.00 | 26,549,000 | 貸付株式数 4,600 株 |
| L I N E ヤフー | 1,815,000 | 479.30 | 869,929,500 | |
| ビー・エム・エル | 14,300 | 3,735.00 | 53,410,500 | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 (円) | | 備考 |
|-------------------|---------|-----------|---------------|--------------------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| トレンドマイクロ | 65,500 | 7,940.00 | 520,070,000 | |
| ID ホールディングス | 7,300 | 2,275.00 | 16,607,500 | |
| リソー教育グループ | 72,600 | 220.00 | 15,972,000 | |
| 日本オラクル | 21,700 | 15,160.00 | 328,972,000 | |
| 早稲田アカデミー | 6,400 | 2,777.00 | 17,772,800 | 貸付株式数 2,400 株 (200 株) |
| アルファシステムズ | 3,600 | 3,740.00 | 13,464,000 | |
| フューチャー | 24,200 | 2,226.00 | 53,869,200 | 貸付株式数 1,600 株 |
| CAC HOLDINGS | 6,900 | 2,140.00 | 14,766,000 | |
| ユー・エス・エス | 220,400 | 1,809.00 | 398,703,600 | |
| オービックビジネスC | 19,100 | 8,769.00 | 167,487,900 | |
| アイティフォー | 13,000 | 1,481.00 | 19,253,000 | |
| 東京個別指導学院 | 13,800 | 340.00 | 4,692,000 | 貸付株式数 100 株 |
| 東計電算 | 3,200 | 4,020.00 | 12,864,000 | |
| サイバーエージェント | 235,500 | 1,769.00 | 416,599,500 | |
| 楽天グループ | 914,800 | 909.70 | 832,193,560 | |
| クリーク・アンド・リバー 社 | 5,800 | 1,500.00 | 8,700,000 | 貸付株式数 2,200 株 |
| SBI グローバルアセット | 22,700 | 649.00 | 14,732,300 | |
| ティー・オー・ダブリュー | 20,700 | 381.00 | 7,886,700 | 貸付株式数 6,600 株 |
| 大塚商会 | 128,500 | 3,100.00 | 398,350,000 | |
| サイボウズ | 15,600 | 3,610.00 | 56,316,000 | |
| GMO インターネット | 2,800 | 1,183.00 | 3,312,400 | 貸付株式数 1,100 株 |
| 山田コンサルティング GP | 5,900 | 1,829.00 | 10,791,100 | 貸付株式数 2,300 株 |
| セントラルスポーツ | 4,400 | 2,557.00 | 11,250,800 | 貸付株式数 1,700 株 |
| パラカ | 3,100 | 2,042.00 | 6,330,200 | |
| 電通総研 | 13,800 | 6,580.00 | 90,804,000 | |
| デジタルガレージ | 18,100 | 3,720.00 | 67,332,000 | |
| イーエムシステムズ | 14,900 | 777.00 | 11,577,300 | 貸付株式数 1,200 株 |
| ウェザーニューズ | 9,000 | 4,765.00 | 42,885,000 | 貸付株式数 3,500 株 |
| C I J | 31,100 | 489.00 | 15,207,900 | |
| ビジネスエンジニアリング | 2,700 | 5,900.00 | 15,930,000 | |
| WOWOW | 8,500 | 1,727.00 | 14,679,500 | 貸付株式数 3,300 株 |
| スカラ | 10,500 | 422.00 | 4,431,000 | 貸付株式数 600 株 |
| フルキャストホールディングス | 8,900 | 1,784.00 | 15,877,600 | 貸付株式数 3,400 株 |
| エン・ジャパン | 18,900 | 1,798.00 | 33,982,200 | |
| セルソース | 6,700 | 607.00 | 4,066,900 | 貸付株式数 600 株 |
| あすか製薬HD | 9,700 | 2,501.00 | 24,259,700 | 貸付株式数 2,500 株 |
| サワイグループ HD | 58,600 | 2,033.50 | 119,163,100 | |
| 富士フィルム HLDGS | 683,400 | 3,670.00 | 2,508,078,000 | |
| コニカミノルタ | 254,900 | 549.50 | 140,067,550 | |
| 資生堂 | 219,800 | 2,426.50 | 533,344,700 | |
| ライオン | 130,100 | 1,635.00 | 212,713,500 | |
| 高砂香料 | 7,700 | 8,140.00 | 62,678,000 | |
| マンダム | 22,400 | 1,487.00 | 33,308,800 | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 |
|----------------|-----------|----------|---------------|----------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| ミルボン | 18,200 | 2,528.00 | 46,009,600 | |
| コーヤー | 25,600 | 5,834.00 | 149,350,400 | 貸付株式数 1,800 株 |
| コタ | 11,500 | 1,403.00 | 16,134,500 | 貸付株式数 4,500 株 |
| ポーラ・オルビス HD | 58,100 | 1,308.00 | 75,994,800 | 貸付株式数 18,400 株 |
| ノエビアホールディングス | 10,100 | 4,630.00 | 46,763,000 | 貸付株式数 3,900 株 |
| 新日本製薬 | 6,500 | 2,381.00 | 15,476,500 | 貸付株式数 2,200 株 |
| I - n e | 3,000 | 1,616.00 | 4,848,000 | 貸付株式数 1,200 株 |
| アクシージア | 7,100 | 466.00 | 3,308,600 | 貸付株式数 2,700 株 |
| エステー | 7,800 | 1,581.00 | 12,331,800 | |
| コニシ | 35,700 | 1,315.00 | 46,945,500 | |
| 長谷川香料 | 21,700 | 2,986.00 | 64,796,200 | |
| 小林製薬 | 29,700 | 5,454.00 | 161,983,800 | |
| 荒川化学工業 | 10,500 | 1,157.00 | 12,148,500 | |
| メック | 8,500 | 3,240.00 | 27,540,000 | |
| 日本高純度化学 | 2,800 | 3,110.00 | 8,708,000 | |
| タカラバイオ | 35,600 | 927.00 | 33,001,200 | 貸付株式数 3,700 株 |
| J C U | 12,300 | 4,620.00 | 56,826,000 | |
| O A Tアグリオ | 4,200 | 2,510.00 | 10,542,000 | |
| デクセリアルズ | 96,900 | 1,979.50 | 191,813,550 | |
| アース製薬 | 10,300 | 5,250.00 | 54,075,000 | |
| 北興化学 | 8,400 | 1,626.00 | 13,658,400 | |
| 大成ラミックグループ | 3,300 | 2,632.00 | 8,685,600 | |
| クミアイ化学 | 50,700 | 845.00 | 42,841,500 | |
| 日本農薬 | 17,300 | 1,039.00 | 17,974,700 | |
| ニチレキグループ | 12,100 | 2,806.00 | 33,952,600 | 貸付株式数 4,700 株 |
| ユシロ | 5,900 | 2,376.00 | 14,018,400 | |
| J X 金属 | 294,300 | 1,570.00 | 462,051,000 | |
| 富士石油 | 29,700 | 344.00 | 10,216,800 | 貸付株式数 11,600 株 |
| 出光興産 | 490,200 | 1,014.00 | 497,062,800 | |
| ENEOS ホールディングス | 1,716,000 | 900.80 | 1,545,772,800 | |
| コスモエネルギーHLDGS | 37,300 | 7,297.00 | 272,178,100 | |
| ANY COLOR | 15,500 | 4,750.00 | 73,625,000 | |
| テスホールディングス | 26,900 | 374.00 | 10,060,600 | 貸付株式数 10,300 株 |
| インフロニアHD | 116,200 | 1,523.50 | 177,030,700 | 貸付株式数 45,600 株 |
| 横浜ゴム | 63,300 | 5,855.00 | 370,621,500 | |
| TOYO TIRE | 71,600 | 3,949.00 | 282,748,400 | |
| ブリヂストン | 331,800 | 6,996.00 | 2,321,272,800 | |
| 住友ゴム | 122,300 | 1,821.00 | 222,708,300 | |
| 藤倉コンポジット | 10,900 | 1,966.00 | 21,429,400 | |
| オカモト | 6,000 | 5,150.00 | 30,900,000 | |
| アキレス | 6,200 | 1,146.00 | 7,105,200 | |
| フコク | 6,700 | 1,932.00 | 12,944,400 | 貸付株式数 2,200 株 |
| ニッタ | 11,100 | 4,175.00 | 46,342,500 | |
| 住友理工 | 22,000 | 2,258.00 | 49,676,000 | |
| 三ツ星ベルト | 15,800 | 3,815.00 | 60,277,000 | 貸付株式数 6,100 株 |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 |
|---------------|---------|-----------|---------------|---------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| バンドー化学 | 16,800 | 2,057.00 | 34,557,600 | |
| AGC | 110,300 | 4,800.00 | 529,440,000 | |
| 日本板硝子 | 58,000 | 531.00 | 30,798,000 | |
| 有沢製作所 | 17,000 | 1,676.00 | 28,492,000 | |
| 日本電気硝子 | 37,800 | 4,835.00 | 182,763,000 | |
| オハラ | 4,300 | 1,263.00 | 5,430,900 | 貸付株式数 1,600 株 |
| 住友大阪セメント | 19,700 | 4,057.00 | 79,922,900 | |
| 太平洋セメント | 69,900 | 4,189.00 | 292,811,100 | |
| 日本ヒューム | 9,900 | 4,080.00 | 40,392,000 | 貸付株式数 3,900 株 |
| 日本コンクリート | 22,000 | 361.00 | 7,942,000 | 貸付株式数 8,400 株 |
| 三谷セキサン | 4,000 | 8,870.00 | 35,480,000 | |
| アジアパイルHD | 16,100 | 1,319.00 | 21,235,900 | |
| 東海カーボン | 114,100 | 1,041.00 | 118,778,100 | |
| 日本カーボン | 6,500 | 4,255.00 | 27,657,500 | 貸付株式数 2,500 株 |
| 東洋炭素 | 9,800 | 4,090.00 | 40,082,000 | 貸付株式数 3,800 株 |
| ノリタケ | 12,300 | 4,745.00 | 58,363,500 | |
| TOTO | 82,300 | 4,130.00 | 339,899,000 | |
| 日本碍子 | 125,900 | 2,416.50 | 304,237,350 | |
| 日本特殊陶業 | 92,600 | 5,574.00 | 516,152,400 | |
| MARUWA | 4,700 | 40,340.00 | 189,598,000 | |
| 品川リフラクトリーズ | 14,000 | 1,944.00 | 27,216,000 | |
| 黒崎播磨 | 7,700 | 4,115.00 | 31,685,500 | |
| ヨータイ | 5,800 | 1,749.00 | 10,144,200 | |
| フジミインコーポレーテッド | 30,500 | 2,123.00 | 64,751,500 | |
| ニチアス | 28,700 | 5,812.00 | 166,804,400 | 貸付株式数 100 株 |
| 日本製鉄 | 590,500 | 3,443.00 | 2,033,091,500 | |
| 神戸製鋼所 | 234,500 | 1,912.50 | 448,481,250 | |
| 中山製鋼所 | 24,000 | 699.00 | 16,776,000 | |
| 合同製鐵 | 6,500 | 4,325.00 | 28,112,500 | 貸付株式数 2,200 株 |
| JFEホールディングス | 351,300 | 1,975.00 | 693,817,500 | |
| 東京製鐵 | 32,600 | 1,662.00 | 54,181,200 | |
| 共英製鋼 | 11,400 | 2,396.00 | 27,314,400 | |
| 大和工業 | 22,000 | 10,190.00 | 224,180,000 | 貸付株式数 7,200 株 |
| 東京鐵鋼 | 5,100 | 6,190.00 | 31,569,000 | 貸付株式数 1,000 株 |
| 大阪製鐵 | 5,400 | 2,770.00 | 14,958,000 | 貸付株式数 2,000 株 |
| 淀川製鋼所 | 53,800 | 1,436.00 | 77,256,800 | |
| 中部鋼鉄 | 9,500 | 2,291.00 | 21,764,500 | 貸付株式数 3,700 株 |
| 丸一鋼管 | 35,500 | 3,920.00 | 139,160,000 | |
| モリ工業 | 14,800 | 950.00 | 14,060,000 | 貸付株式数 4,300 株 |
| 大同特殊鋼 | 73,500 | 1,345.00 | 98,857,500 | |
| 日本冶金工 | 7,900 | 4,530.00 | 35,787,000 | |
| 愛知製鋼 | 25,800 | 2,975.00 | 76,755,000 | 貸付株式数 6,200 株 |
| 大太平洋金属 | 10,800 | 2,106.00 | 22,744,800 | |
| 新日本電工 | 63,900 | 345.00 | 22,045,500 | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 |
|---------------|---------|-----------|---------------|----------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| 栗本鉄工所 | 5,400 | 8,120.00 | 43,848,000 | |
| 日本製鋼所 | 34,600 | 8,923.00 | 308,735,800 | |
| 三菱製鋼 | 8,600 | 1,805.00 | 15,523,000 | |
| 日本精線 | 9,300 | 1,148.00 | 10,676,400 | |
| エンビプロHD | 11,500 | 490.00 | 5,635,000 | 貸付株式数 4,600 株 |
| 大紀アルミニウム | 16,600 | 1,164.00 | 19,322,400 | |
| 日本軽金属HD | 34,100 | 2,157.00 | 73,553,700 | |
| 三井金属 | 29,100 | 10,675.00 | 310,642,500 | |
| 東邦亜鉛 | 9,200 | 656.00 | 6,035,200 | 貸付株式数 3,600 株 |
| 三菱マテリアル | 83,400 | 2,600.00 | 216,840,000 | |
| 住友鉱山 | 147,500 | 4,264.00 | 628,940,000 | |
| DOWAホールディングス | 31,400 | 5,512.00 | 173,076,800 | |
| 古河機金 | 13,900 | 2,945.00 | 40,935,500 | |
| 大阪チタニウム | 20,200 | 2,779.00 | 56,135,800 | 貸付株式数 8,000 株 |
| 東邦チタニウム | 24,100 | 1,758.00 | 42,367,800 | 貸付株式数 9,600 株 |
| UACJ | 15,700 | 6,350.00 | 99,695,000 | |
| CKサンエツ | 2,800 | 4,150.00 | 11,620,000 | 貸付株式数 300 株 |
| 古河電工 | 38,800 | 8,880.00 | 344,544,000 | |
| 住友電工 | 402,700 | 4,236.00 | 1,705,837,200 | |
| フジクラ | 125,000 | 13,555.00 | 1,694,375,000 | |
| SWCC | 15,600 | 8,080.00 | 126,048,000 | |
| 平河ヒューテック | 7,800 | 1,972.00 | 15,381,600 | |
| いよぎんホールディング | 145,700 | 2,022.00 | 294,605,400 | |
| しづおかフィナンシャルク | 245,200 | 1,949.00 | 477,894,800 | |
| ちゅうぎんフィナンシャ | 93,700 | 2,124.50 | 199,065,650 | |
| 楽天銀行 | 51,600 | 7,774.00 | 401,138,400 | 貸付株式数 10,000 株 |
| 京都フィナンシャルG | 140,100 | 2,907.50 | 407,340,750 | |
| リヨービ | 13,800 | 2,904.00 | 40,075,200 | |
| AREホールディングス | 47,200 | 2,173.00 | 102,565,600 | |
| 東洋製罐グループHD | 69,000 | 3,583.00 | 247,227,000 | 貸付株式数 22,000 株 |
| ホッカントホールディングス | 6,300 | 2,277.00 | 14,345,100 | |
| コロナ | 6,500 | 951.00 | 6,181,500 | |
| 横河ブリッジHLDGS | 20,100 | 2,823.00 | 56,742,300 | |
| 三和ホールディングス | 113,100 | 4,822.00 | 545,368,200 | |
| 文化シャツター | 30,500 | 2,403.00 | 73,291,500 | |
| 三協立山 | 14,700 | 659.00 | 9,687,300 | |
| アルインコ | 8,900 | 1,092.00 | 9,718,800 | 貸付株式数 1,100 株 |
| LIXIL | 170,000 | 1,983.00 | 337,110,000 | |
| ノーリツ | 20,500 | 2,072.00 | 42,476,000 | 貸付株式数 6,300 株 |
| 長府製作所 | 11,600 | 1,899.00 | 22,028,400 | |
| リンナイ | 60,800 | 3,726.00 | 226,540,800 | |
| ユニプレス | 19,000 | 1,274.00 | 24,206,000 | |
| 日東精工 | 15,200 | 646.00 | 9,819,200 | |
| 岡部 | 20,800 | 957.00 | 19,905,600 | 貸付株式数 8,200 株 |
| ジーテクト | 13,000 | 2,045.00 | 26,585,000 | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 |
|----------------|---------|-----------|---------------|--------------------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| 東プレ | 20,600 | 2,253.00 | 46,411,800 | |
| 高周波熱鍊 | 16,000 | 1,262.00 | 20,192,000 | 貸付株式数 2,600 株 |
| 東京製綱 | 6,900 | 1,539.00 | 10,619,100 | |
| サンコール | 13,000 | 858.00 | 11,154,000 | 貸付株式数 5,200 株 |
| パイオラックス | 15,700 | 1,869.00 | 29,343,300 | 貸付株式数 300 株 |
| エイチワン | 12,000 | 1,517.00 | 18,204,000 | |
| 日本発条 | 97,700 | 1,994.00 | 194,813,800 | |
| 中央発條 | 7,600 | 3,355.00 | 25,498,000 | 貸付株式数 2,900 株 |
| 三浦工業 | 53,000 | 2,960.00 | 156,880,000 | |
| タクマ | 37,400 | 2,291.00 | 85,683,400 | |
| テクノプロ・ホールディング | 70,700 | 4,827.00 | 341,268,900 | |
| アイ・アールジャパン HD | 6,000 | 783.00 | 4,698,000 | 貸付株式数 500 株 |
| KeePer技研 | 7,200 | 3,410.00 | 24,552,000 | 貸付株式数 2,800 株 |
| Gunosy | 9,200 | 744.00 | 6,844,800 | 貸付株式数 3,600 株 |
| イー・ガーディアン | 3,500 | 2,060.00 | 7,210,000 | |
| ジャパンマテリアル | 35,600 | 1,518.00 | 54,040,800 | |
| ベクトル | 15,900 | 1,149.00 | 18,269,100 | |
| チャームケアコーポレーション | 9,700 | 1,048.00 | 10,165,600 | 貸付株式数 3,700 株 |
| キャリアリンク | 4,300 | 2,400.00 | 10,320,000 | |
| I B J | 8,900 | 843.00 | 7,502,700 | 貸付株式数 3,400 株 |
| アサンテ | 5,700 | 1,701.00 | 9,695,700 | 貸付株式数 2,200 株 |
| バリューHR | 10,400 | 1,559.00 | 16,213,600 | 貸付株式数 3,800 株 (700 株) |
| M&A キャピタルパートナー | 9,400 | 3,170.00 | 29,798,000 | 貸付株式数 2,100 株 |
| ライドオンエクスプレス HD | 4,600 | 1,008.00 | 4,636,800 | |
| シグマクシス・ホールディング | 33,900 | 945.00 | 32,035,500 | |
| ウィルグループ | 9,800 | 970.00 | 9,506,000 | 貸付株式数 3,700 株 |
| メドピア | 8,900 | 697.00 | 6,203,300 | |
| リクルートホールディングス | 859,300 | 8,454.00 | 7,264,522,200 | ※ |
| エラン | 10,200 | 826.00 | 8,425,200 | 貸付株式数 4,000 株 |
| ツガミ | 24,300 | 2,258.00 | 54,869,400 | |
| オーフマ | 20,000 | 3,515.00 | 70,300,000 | |
| 芝浦機械 | 14,700 | 4,220.00 | 62,034,000 | 貸付株式数 5,700 株 |
| アマダ | 152,600 | 1,902.50 | 290,321,500 | |
| アイダエンジニア | 25,600 | 930.00 | 23,808,000 | |
| F U J I | 49,600 | 2,778.50 | 137,813,600 | |
| 牧野フライス | 12,600 | 11,560.00 | 145,656,000 | |
| オーエスジー | 41,900 | 2,052.00 | 85,978,800 | |
| 旭ダイヤモンド | 28,500 | 848.00 | 24,168,000 | |
| DMG 森精機 | 78,200 | 3,056.00 | 238,979,200 | 貸付株式数 24,200 株 |
| ソディツク | 27,800 | 884.00 | 24,575,200 | |
| ディスコ | 55,000 | 37,730.00 | 2,075,150,000 | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 (円) | | 備考 |
|----------------|-----------|-----------|---------------|--------------------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| 日東工器 | 4,000 | 1,832.00 | 7,328,000 | 貸付株式数 1,500 株 |
| 日進工具 | 9,500 | 815.00 | 7,742,500 | |
| 富士ダイス | 8,500 | 859.00 | 7,301,500 | 貸付株式数 3,300 株 |
| 日本郵政 | 1,153,400 | 1,548.50 | 1,786,039,900 | |
| ベルシステム 24HLDGS | 12,600 | 1,320.00 | 16,632,000 | |
| 鎌倉新書 | 9,900 | 628.00 | 6,217,200 | |
| エアトリ | 9,500 | 999.00 | 9,490,500 | 貸付株式数 1,100 株 |
| アトラエ | 9,000 | 820.00 | 7,380,000 | |
| ストライク | 5,700 | 4,570.00 | 26,049,000 | |
| ソラスト | 32,000 | 490.00 | 15,680,000 | |
| セラク | 3,500 | 1,744.00 | 6,104,000 | |
| インソース | 25,200 | 981.00 | 24,721,200 | |
| 豊田自動織機 | 96,400 | 16,595.00 | 1,599,758,000 | |
| リケンN P R | 14,300 | 3,050.00 | 43,615,000 | 貸付株式数 1,300 株 |
| 島精機製作所 | 18,200 | 1,078.00 | 19,619,600 | 貸付株式数 7,100 株 |
| オプトラン | 18,700 | 1,655.00 | 30,948,500 | 貸付株式数 7,300 株 |
| イワキポンプ | 7,600 | 2,483.00 | 18,870,800 | 貸付株式数 3,000 株 |
| フリュー | 10,800 | 1,120.00 | 12,096,000 | |
| ヤマシンフィルタ | 24,100 | 690.00 | 16,629,000 | 貸付株式数 8,600 株 |
| 日阪製作所 | 12,100 | 1,392.00 | 16,843,200 | |
| やまびこ | 18,600 | 2,472.00 | 45,979,200 | |
| 野村マイクロ・サイエンス | 18,900 | 3,350.00 | 63,315,000 | 貸付株式数 6,900 株 (100 株) |
| 平田機工 | 16,400 | 1,850.00 | 30,340,000 | 貸付株式数 6,400 株 |
| P E G A S U S | 12,600 | 670.00 | 8,442,000 | |
| マルマエ | 4,400 | 1,726.00 | 7,594,400 | 貸付株式数 1,800 株 |
| タツモ | 7,500 | 2,053.00 | 15,397,500 | 貸付株式数 3,100 株 |
| ナブテスコ | 66,500 | 3,223.00 | 214,329,500 | |
| 三井海洋開発 | 28,900 | 7,880.00 | 227,732,000 | |
| レオン自動機 | 12,000 | 1,411.00 | 16,932,000 | |
| S M C | 32,400 | 44,230.00 | 1,433,052,000 | |
| ホソカワミクロン | 8,600 | 5,630.00 | 48,418,000 | 貸付株式数 3,400 株 |
| ユニオンツール | 5,000 | 8,680.00 | 43,400,000 | 貸付株式数 1,900 株 |
| 瑞光 | 9,700 | 1,002.00 | 9,719,400 | 貸付株式数 3,800 株 |
| オイレス工業 | 15,500 | 2,296.00 | 35,588,000 | |
| 日精エーエスピー | 4,500 | 7,220.00 | 32,490,000 | |
| サトー | 14,200 | 2,326.00 | 33,029,200 | |
| 技研製作所 | 10,700 | 1,480.00 | 15,836,000 | 貸付株式数 4,000 株 |
| 日本エアーテック | 5,300 | 1,253.00 | 6,640,900 | |
| 日精樹脂工業 | 7,500 | 889.00 | 6,667,500 | 貸付株式数 2,700 株 |
| ワイエイシイホールディングス | 11,500 | 845.00 | 9,717,500 | 貸付株式数 4,500 株 |
| 小松製作所 | 562,700 | 5,205.00 | 2,928,853,500 | |
| 住友重機械 | 67,500 | 3,502.00 | 236,385,000 | |
| 日立建機 | 45,500 | 4,924.00 | 224,042,000 | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 (円) | | 備考 |
|---------------|---------|-----------|---------------|----------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| 日工 | 16,900 | 806.00 | 13,621,400 | |
| 巴工業 | 13,400 | 1,722.00 | 23,074,800 | |
| 井関農機 | 10,700 | 2,383.00 | 25,498,100 | 貸付株式数 4,100 株 |
| TOWA | 34,900 | 1,821.00 | 63,552,900 | 貸付株式数 13,900 株 |
| 北川鉄工所 | 4,500 | 1,680.00 | 7,560,000 | |
| ローツェ | 59,600 | 1,698.00 | 101,200,800 | 貸付株式数 23,400 株 |
| クボタ | 583,700 | 1,856.00 | 1,083,347,200 | |
| 荏原実業 | 6,000 | 4,410.00 | 26,460,000 | |
| 東洋エンジニア | 16,300 | 1,695.00 | 27,628,500 | 貸付株式数 6,300 株 |
| 三菱化工機 | 12,000 | 2,916.00 | 34,992,000 | |
| 月島ホールディングス | 14,900 | 3,445.00 | 51,330,500 | |
| 帝国電機製作所 | 7,100 | 3,230.00 | 22,933,000 | 貸付株式数 2,700 株 |
| 新東工業 | 25,400 | 1,016.00 | 25,806,400 | 貸付株式数 9,800 株 |
| 渋谷工業 | 10,700 | 3,420.00 | 36,594,000 | |
| アイチ コーポレーション | 18,900 | 1,369.00 | 25,874,100 | |
| 小森コーポレーション | 27,100 | 1,565.00 | 42,411,500 | |
| 鶴見製作所 | 8,100 | 3,940.00 | 31,914,000 | |
| 酒井重工業 | 4,500 | 2,173.00 | 9,778,500 | |
| 荏原製作所 | 234,400 | 3,155.00 | 739,532,000 | |
| 西島製作所 | 9,800 | 2,074.00 | 20,325,200 | |
| AIRMAN | 11,500 | 2,063.00 | 23,724,500 | 貸付株式数 4,500 株 |
| ダイキン工業 | 148,700 | 18,665.00 | 2,775,485,500 | |
| オルガノ | 17,600 | 11,820.00 | 208,032,000 | 貸付株式数 600 株 |
| トヨーカネツ | 4,100 | 4,500.00 | 18,450,000 | |
| 栗田工業 | 63,800 | 5,181.00 | 330,547,800 | |
| 椿本チエイン | 49,400 | 2,202.00 | 108,778,800 | |
| 日機装 | 26,300 | 1,527.00 | 40,160,100 | |
| 木村化工機 | 8,700 | 1,047.00 | 9,108,900 | |
| レイズネクスト | 16,000 | 1,925.00 | 30,800,000 | 貸付株式数 6,200 株 |
| アネスト岩田 | 19,400 | 1,606.00 | 31,156,400 | |
| ダイフク | 192,600 | 4,815.00 | 927,369,000 | |
| サムコ | 3,100 | 2,921.00 | 9,055,100 | 貸付株式数 1,100 株 |
| タダノ | 60,200 | 1,092.00 | 65,738,400 | |
| フジテック | 36,700 | 5,632.00 | 206,694,400 | |
| CKD | 31,600 | 2,464.00 | 77,862,400 | |
| 平和 | 38,000 | 2,217.00 | 84,246,000 | 貸付株式数 14,900 株 |
| 理想科学工業 | 18,300 | 1,214.00 | 22,216,200 | 貸付株式数 7,100 株 |
| SANKYO | 131,900 | 3,005.00 | 396,359,500 | |
| 日本金錢機械 | 13,800 | 1,012.00 | 13,965,600 | 貸付株式数 1,900 株 |
| マースグループ HLDGS | 7,700 | 3,235.00 | 24,909,500 | |
| ガリレイ | 16,800 | 3,650.00 | 61,320,000 | |
| ダイコク電機 | 5,000 | 2,682.00 | 13,410,000 | 貸付株式数 1,900 株 |
| 竹内製作所 | 20,700 | 5,320.00 | 110,124,000 | 貸付株式数 4,900 株 |
| アマノ | 32,400 | 4,340.00 | 140,616,000 | |
| JUKI | 17,700 | 454.00 | 8,035,800 | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 (円) | | 備考 |
|------------------|-----------|-----------|----------------|---------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| ジャノメ | 9,200 | 1,200.00 | 11,040,000 | |
| プラザー工業 | 152,500 | 2,659.00 | 405,497,500 | |
| マックス | 13,800 | 5,760.00 | 79,488,000 | 貸付株式数 4,200 株 |
| モリタホールディングス | 17,800 | 2,320.00 | 41,296,000 | |
| グローリー | 29,900 | 3,853.00 | 115,204,700 | |
| 新晃工業 | 32,700 | 1,352.00 | 44,210,400 | |
| 大和冷機工業 | 17,500 | 1,711.00 | 29,942,500 | |
| セガサミーホールディングス | 93,500 | 3,154.00 | 294,899,000 | |
| T P R | 14,500 | 2,438.00 | 35,351,000 | 貸付株式数 1,000 株 |
| ツバキ・ナカシマ | 26,400 | 370.00 | 9,768,000 | 貸付株式数 9,800 株 |
| ホシザキ | 73,500 | 5,815.00 | 427,402,500 | |
| 大豊工業 | 9,900 | 709.00 | 7,019,100 | |
| 日本精工 | 211,300 | 797.90 | 168,596,270 | |
| N T N | 270,000 | 347.90 | 93,933,000 | |
| ジェイテクト | 94,300 | 1,531.00 | 144,373,300 | |
| 不二越 | 8,400 | 3,580.00 | 30,072,000 | 貸付株式数 3,300 株 |
| ミネベアミツミ | 198,600 | 2,695.50 | 535,326,300 | |
| 日本トムソン | 31,100 | 671.00 | 20,868,100 | |
| T H K | 65,900 | 4,055.00 | 267,224,500 | |
| Y U S H I N | 10,600 | 631.00 | 6,688,600 | 貸付株式数 100 株 |
| 前澤給装工業 | 8,200 | 1,501.00 | 12,308,200 | |
| イーグル工業 | 12,600 | 2,660.00 | 33,516,000 | |
| P I L L A R | 10,600 | 4,080.00 | 43,248,000 | 貸付株式数 2,800 株 |
| キツツ | 40,700 | 1,650.00 | 67,155,000 | |
| 日立 | 2,903,800 | 3,931.00 | 11,414,837,800 | ※ |
| 三菱電機 | 1,161,100 | 3,659.00 | 4,248,464,900 | |
| 富士電機 | 69,400 | 9,770.00 | 678,038,000 | |
| 安川電機 | 124,000 | 2,993.50 | 371,194,000 | |
| シンフォニア テクノロジー | 11,300 | 7,500.00 | 84,750,000 | |
| 明電舎 | 19,200 | 5,880.00 | 112,896,000 | |
| 山洋電気 | 4,900 | 10,000.00 | 49,000,000 | 貸付株式数 1,900 株 |
| デンヨー | 8,300 | 2,852.00 | 23,671,600 | 貸付株式数 3,300 株 |
| PHC ホールディングス | 21,400 | 1,109.00 | 23,732,600 | 貸付株式数 8,200 株 |
| KOKUSAI ELECTRIC | 80,500 | 2,745.50 | 221,012,750 | |
| ソシオネクスト | 114,000 | 2,810.50 | 320,397,000 | |
| ベイカレント | 85,400 | 8,276.00 | 706,770,400 | |
| ORCHESTRA HLDGS | 2,500 | 774.00 | 1,935,000 | |
| アイモバイル | 17,200 | 663.00 | 11,403,600 | |
| MS-Japan | 6,300 | 1,002.00 | 6,312,600 | 貸付株式数 2,400 株 |
| ジャパンエレベーターSHD | 45,200 | 3,830.00 | 173,116,000 | |
| エル・ティー・エス | 1,600 | 2,026.00 | 3,241,600 | 貸付株式数 600 株 |
| ミダックホールディングス | 7,000 | 1,974.00 | 13,818,000 | 貸付株式数 100 株 |
| キュービーネット HLDGS | 6,700 | 1,320.00 | 8,844,000 | 貸付株式数 2,500 株 |
| オープングループ | 18,500 | 405.00 | 7,492,500 | 貸付株式数 7,200 株 |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 (円) | | 備考 |
|-----------------|-----------|-----------|---------------|--------------------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| 三桜工業 | 15,700 | 899.00 | 14,114,300 | 貸付株式数 3,800 株 |
| マキタ | 142,000 | 5,139.00 | 729,738,000 | |
| 東芝テック | 17,100 | 2,987.00 | 51,077,700 | |
| 芝浦メカトロニクス | 8,300 | 10,380.00 | 86,154,000 | |
| マブチモーター | 55,100 | 2,557.00 | 140,890,700 | |
| ニデック | 504,000 | 2,536.50 | 1,278,396,000 | |
| ユーエムシーエレクトロニクス | 7,100 | 305.00 | 2,165,500 | 貸付株式数 2,800 株 |
| トレックス・セミコンダクター | 5,400 | 1,634.00 | 8,823,600 | 貸付株式数 900 株 |
| 東光高岳 | 6,200 | 3,175.00 | 19,685,000 | |
| ダブル・スコープ | 35,000 | 254.00 | 8,890,000 | 貸付株式数 13,700 株 |
| 宮越ホールディングス | 5,100 | 969.00 | 4,941,900 | 貸付株式数 2,000 株 |
| ダイヘン | 10,700 | 7,920.00 | 84,744,000 | |
| ヤーマン | 22,200 | 812.00 | 18,026,400 | 貸付株式数 8,700 株 (200 株) |
| JVCケンウッド | 90,100 | 1,216.00 | 109,561,600 | |
| ミマキエンジニアリング | 9,500 | 1,819.00 | 17,280,500 | 貸付株式数 3,700 株 |
| 大崎電気 | 24,500 | 1,306.00 | 31,997,000 | 貸付株式数 3,500 株 |
| オムロン | 104,600 | 3,949.00 | 413,065,400 | |
| 日東工業 | 15,400 | 3,575.00 | 55,055,000 | |
| IDEC | 15,900 | 2,457.00 | 39,066,300 | |
| ジーエス・ユアサ コーポ | 50,900 | 3,427.00 | 174,434,300 | |
| BUFFALO | 2,200 | 3,675.00 | 8,085,000 | 貸付株式数 800 株 |
| テクノメディカ | 2,200 | 2,047.00 | 4,503,400 | 貸付株式数 800 株 |
| ダイヤモンドエレクトリックHD | 4,600 | 578.00 | 2,658,800 | 貸付株式数 1,800 株 |
| 日本電気 | 807,200 | 4,458.00 | 3,598,497,600 | |
| 富士通 | 1,050,400 | 3,646.00 | 3,829,758,400 | |
| 沖電気 | 55,300 | 1,686.00 | 93,235,800 | |
| 電気興業 | 4,600 | 2,086.00 | 9,595,600 | |
| サンケン電気 | 11,700 | 7,760.00 | 90,792,000 | 貸付株式数 4,600 株 |
| アイホン | 6,900 | 2,850.00 | 19,665,000 | |
| ルネサスエレクトロニクス | 1,106,900 | 1,702.00 | 1,883,943,800 | |
| セイコーエプソン | 142,100 | 1,997.00 | 283,773,700 | |
| ワコム | 74,200 | 770.00 | 57,134,000 | |
| アルバック | 25,000 | 6,330.00 | 158,250,000 | |
| アクセル | 5,600 | 1,200.00 | 6,720,000 | |
| EIZO | 14,900 | 2,284.00 | 34,031,600 | |
| ジャパンディスプレイ | 61,700 | 19.00 | 1,172,300 | |
| 日本信号 | 26,000 | 1,225.00 | 31,850,000 | |
| 京三製作所 | 26,600 | 540.00 | 14,364,000 | |
| 能美防災 | 15,400 | 3,895.00 | 59,983,000 | |
| ホーチキ | 6,700 | 3,870.00 | 25,929,000 | |
| エレコム | 27,300 | 1,856.00 | 50,668,800 | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 (円) | | 備考 |
|-----------------|-----------|-----------|----------------|----------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| パナソニック ホールディングス | 1,348,600 | 1,543.00 | 2,080,889,800 | |
| シャープ | 164,900 | 872.00 | 143,792,800 | 貸付株式数 64,800 株 |
| アンリツ | 80,400 | 1,716.00 | 137,966,400 | |
| ソニーグループ | 3,898,900 | 4,184.00 | 16,312,997,600 | |
| T D K | 985,900 | 2,081.00 | 2,051,657,900 | |
| 帝国通信工業 | 5,000 | 2,457.00 | 12,285,000 | 貸付株式数 1,900 株 |
| タムラ製作所 | 45,500 | 504.00 | 22,932,000 | 貸付株式数 17,800 株 |
| アルプスアルパイン | 92,700 | 1,850.00 | 171,495,000 | |
| 日本電波工業 | 10,800 | 935.00 | 10,098,000 | |
| 鈴木 | 6,100 | 2,119.00 | 12,925,900 | |
| マイコー | 11,300 | 9,910.00 | 111,983,000 | 貸付株式数 2,200 株 |
| 日本トリム | 2,600 | 4,660.00 | 12,116,000 | |
| フォスター電機 | 11,600 | 2,323.00 | 26,946,800 | |
| S M K | 2,700 | 2,273.00 | 6,137,100 | 貸付株式数 1,000 株 |
| ヨコオ | 10,100 | 1,472.00 | 14,867,200 | |
| ホシデン | 28,000 | 2,320.00 | 64,960,000 | |
| ヒロセ電機 | 16,600 | 19,335.00 | 320,961,000 | |
| 日本航空電子 | 29,700 | 2,546.00 | 75,616,200 | |
| T O A | 11,500 | 1,154.00 | 13,271,000 | |
| マクセル | 21,800 | 2,153.00 | 46,935,400 | |
| 古野電気 | 13,500 | 5,780.00 | 78,030,000 | 貸付株式数 5,200 株 |
| スミダコーポレーション | 19,600 | 1,066.00 | 20,893,600 | |
| アイコム | 4,400 | 2,971.00 | 13,072,400 | |
| リオン | 4,700 | 2,663.00 | 12,516,100 | |
| 横河電機 | 124,900 | 4,390.00 | 548,311,000 | |
| 新電元工業 | 4,400 | 3,115.00 | 13,706,000 | |
| アズビル | 297,500 | 1,469.50 | 437,176,250 | |
| 日本光電工業 | 101,200 | 1,728.50 | 174,924,200 | |
| チノ一 | 4,700 | 2,620.00 | 12,314,000 | 貸付株式数 1,800 株 |
| 日本電子材料 | 6,900 | 2,890.00 | 19,941,000 | 貸付株式数 2,700 株 |
| 堀場製作所 | 21,400 | 11,730.00 | 251,022,000 | |
| アドバンテスト | 356,200 | 11,940.00 | 4,253,028,000 | |
| エスペック | 10,100 | 3,345.00 | 33,784,500 | |
| キーエンス | 113,100 | 55,890.00 | 6,321,159,000 | |
| 日置電機 | 5,900 | 6,090.00 | 35,931,000 | |
| シスメックス | 292,700 | 1,962.00 | 574,277,400 | |
| 日本マイクロニクス | 18,600 | 4,575.00 | 85,095,000 | 貸付株式数 7,300 株 |
| メガチップス | 8,700 | 6,090.00 | 52,983,000 | |
| OBARA GROUP | 6,200 | 4,325.00 | 26,815,000 | 貸付株式数 1,800 株 |
| デンソー | 1,107,300 | 2,204.50 | 2,441,042,850 | |
| コーセル | 13,900 | 1,240.00 | 17,236,000 | |
| イリゾ電子工業 | 11,400 | 3,045.00 | 34,713,000 | |
| オプテックスグループ | 19,100 | 1,971.00 | 37,646,100 | |
| 千代田インテグレ | 3,400 | 3,180.00 | 10,812,000 | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 (円) | | 備考 |
|------------------|-----------|-----------|---------------|----------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| レーザーテック | 43,800 | 16,000.00 | 700,800,000 | 貸付株式数 17,500 株 |
| スタンレー電気 | 64,200 | 2,976.00 | 191,059,200 | |
| ウシオ電機 | 43,000 | 2,232.00 | 95,976,000 | 貸付株式数 1,500 株 |
| 日本セラミック | 9,200 | 3,400.00 | 31,280,000 | |
| 古河電池 | 8,300 | 1,395.00 | 11,578,500 | 貸付株式数 2,400 株 |
| 山一電機 | 9,200 | 3,305.00 | 30,406,000 | |
| 図研 | 10,300 | 5,080.00 | 52,324,000 | |
| 日本電子 | 26,100 | 4,965.00 | 129,586,500 | |
| カシオ | 90,400 | 1,280.00 | 115,712,000 | |
| ファナック | 539,800 | 4,175.00 | 2,253,665,000 | |
| 日本シイエムケイ | 33,100 | 358.00 | 11,849,800 | 貸付株式数 12,400 株 |
| エンプラス | 3,300 | 5,290.00 | 17,457,000 | 貸付株式数 1,200 株 |
| 大真空 | 12,200 | 593.00 | 7,234,600 | 貸付株式数 4,800 株 |
| ローム | 204,800 | 2,109.00 | 431,923,200 | 貸付株式数 80,400 株 |
| 浜松ホトニクス | 188,900 | 1,568.00 | 296,195,200 | |
| 三井ハイテック | 50,000 | 868.00 | 43,400,000 | 貸付株式数 19,300 株 |
| 京セラ | 702,300 | 2,042.00 | 1,434,096,600 | |
| 太陽誘電 | 49,500 | 3,097.00 | 153,301,500 | 貸付株式数 19,400 株 |
| 村田製作所 | 995,600 | 2,524.50 | 2,513,392,200 | |
| 双葉電子工業 | 21,500 | 661.00 | 14,211,500 | 貸付株式数 8,400 株 |
| 日東電工 | 358,500 | 3,495.00 | 1,252,957,500 | |
| 東海理化電機 | 30,200 | 2,777.00 | 83,865,400 | |
| ニチコン | 26,600 | 1,394.00 | 37,080,400 | |
| 日本ケミコン | 13,900 | 1,439.00 | 20,002,100 | |
| K O A | 17,400 | 1,188.00 | 20,671,200 | |
| 三井E&S | 61,000 | 4,230.00 | 258,030,000 | 貸付株式数 24,400 株 |
| カナデビア | 93,500 | 1,041.00 | 97,333,500 | |
| 三菱重工業 | 1,996,200 | 3,727.00 | 7,439,837,400 | |
| 川崎重工業 | 85,200 | 9,082.00 | 773,786,400 | 貸付株式数 34,000 株 |
| I H I | 91,500 | 15,855.00 | 1,450,732,500 | |
| 名村造船所 | 32,300 | 3,275.00 | 105,782,500 | 貸付株式数 1,700 株 |
| マネジメントソリューションズ | 6,400 | 1,519.00 | 9,721,600 | 貸付株式数 2,500 株 |
| プロレド・パートナーズ | 2,800 | 797.00 | 2,231,600 | 貸付株式数 1,000 株 |
| フロンティア・マネジメント | 4,500 | 701.00 | 3,154,500 | 貸付株式数 1,700 株 |
| アンビスホールディングス | 24,900 | 612.00 | 15,238,800 | |
| カーブスホールディングス | 31,700 | 838.00 | 26,564,600 | |
| フォーラムエンジニアリング | 13,500 | 1,333.00 | 17,995,500 | |
| FAST FITNESS JAP | 4,000 | 1,884.00 | 7,536,000 | |
| MACBEE PLANET | 4,300 | 2,493.00 | 10,719,900 | 貸付株式数 1,700 株 |
| 日本車輌 | 4,300 | 2,850.00 | 12,255,000 | |
| 三菱ロジスネクスト | 18,100 | 1,839.00 | 33,285,900 | 貸付株式数 6,900 株 |
| フルサト・マルカ HD | 10,600 | 2,338.00 | 24,782,800 | 貸付株式数 4,100 株 |
| ヤマエグループ HD | 12,900 | 2,839.00 | 36,623,100 | 貸付株式数 3,200 株 |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 (円) | | 備考 |
|-----------------|-----------|----------|----------------|-----------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| F P G | 35,400 | 2,480.00 | 87,792,000 | |
| ライフネット生命保険 | 20,400 | 2,107.00 | 42,982,800 | |
| 全国保証 | 58,200 | 3,465.00 | 201,663,000 | |
| めぶきフィナンシャルG | 542,300 | 910.50 | 493,764,150 | |
| ジャパンインベストメントA | 18,100 | 1,930.00 | 34,933,000 | 貸付株式数 800 株 |
| 東京きらぼしFG | 14,300 | 7,190.00 | 102,817,000 | |
| 九州フィナンシャルG | 195,800 | 879.00 | 172,108,200 | |
| かんぽ生命保険 | 125,700 | 4,194.00 | 527,185,800 | |
| ゆうちょ銀行 | 906,800 | 1,888.50 | 1,712,491,800 | |
| 富山第一銀行 | 35,300 | 1,273.00 | 44,936,900 | 貸付株式数 13,600 株 |
| コンコルディア・フィナンシャル | 580,500 | 1,120.50 | 650,450,250 | |
| ジェイリース | 8,400 | 1,687.00 | 14,170,800 | |
| 西日本フィナンシャルHD | 68,100 | 2,482.00 | 169,024,200 | |
| S B I アルヒ | 11,300 | 839.00 | 9,480,700 | 貸付株式数 4,300 株 |
| プレミアグループ | 18,800 | 2,237.00 | 42,055,600 | |
| 日産自動車 | 1,412,800 | 353.20 | 499,000,960 | 貸付株式数 565,100 株 |
| いすゞ自動車 | 331,700 | 2,001.00 | 663,731,700 | |
| トヨタ自動車 | 6,008,200 | 2,970.00 | 17,844,354,000 | ※ |
| 日野自動車 | 170,000 | 390.80 | 66,436,000 | |
| 三菱自動車工業 | 432,100 | 423.90 | 183,167,190 | 貸付株式数 169,700 株 |
| 武藏精密工業 | 27,700 | 3,165.00 | 87,670,500 | 貸付株式数 10,800 株 |
| 日産車体 | 17,200 | 1,224.00 | 21,052,800 | |
| 新明和工業 | 32,500 | 1,797.00 | 58,402,500 | |
| 極東開発工業 | 15,300 | 2,773.00 | 42,426,900 | |
| トピー工業 | 9,200 | 3,060.00 | 28,152,000 | |
| ティラド | 2,500 | 6,810.00 | 17,025,000 | |
| タチエス | 20,900 | 2,070.00 | 43,263,000 | |
| N O K | 43,900 | 2,697.50 | 118,420,250 | |
| フタバ産業 | 34,100 | 990.00 | 33,759,000 | |
| カヤバ | 19,200 | 4,000.00 | 76,800,000 | |
| 市光工業 | 24,500 | 458.00 | 11,221,000 | |
| 大同メタル工業 | 22,100 | 944.00 | 20,862,400 | 貸付株式数 8,600 株 |
| プレス工業 | 42,300 | 674.00 | 28,510,200 | |
| 太平洋工業 | 25,400 | 2,446.00 | 62,128,400 | |
| アイシン | 224,600 | 2,659.50 | 597,323,700 | |
| マツダ | 347,100 | 1,176.00 | 408,189,600 | |
| 本田技研 | 2,677,900 | 1,694.00 | 4,536,362,600 | 貸付株式数 753,900 株 |
| スズキ | 913,400 | 2,054.00 | 1,876,123,600 | |
| SUBARU | 340,800 | 3,120.00 | 1,063,296,000 | |
| ヤマハ発動機 | 559,400 | 1,133.50 | 634,079,900 | |
| 小糸製作所 | 117,100 | 2,230.50 | 261,191,550 | |
| エクセディ | 18,500 | 5,490.00 | 101,565,000 | |
| ミツバ | 21,200 | 997.00 | 21,136,400 | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 |
|----------------|---------|-----------|-------------|----------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| 豊田合成 | 32,400 | 3,816.00 | 123,638,400 | |
| 愛三工業 | 21,400 | 2,002.00 | 42,842,800 | 貸付株式数 2,600 株 |
| ヨロズ | 11,700 | 1,003.00 | 11,735,100 | 貸付株式数 4,500 株 |
| エフ・シー・シー | 19,800 | 3,245.00 | 64,251,000 | |
| シマノ | 48,200 | 16,920.00 | 815,544,000 | |
| ティ・エス・テック | 41,900 | 1,936.00 | 81,118,400 | |
| 33FG | 10,000 | 3,540.00 | 35,400,000 | |
| 第四北越フィナンシャルG | 35,000 | 4,075.00 | 142,625,000 | |
| ひろぎん HLDGS | 154,900 | 1,418.00 | 219,648,200 | 貸付株式数 11,900 株 |
| おきなわFG | 8,800 | 3,655.00 | 32,164,000 | |
| ダイレクトマケティングミクス | 11,900 | 300.00 | 3,570,000 | |
| ポピinz | 1,700 | 1,458.00 | 2,478,600 | |
| LITALICO | 10,600 | 1,318.00 | 13,970,800 | 貸付株式数 500 株 |
| 十六FG | 15,600 | 5,510.00 | 85,956,000 | |
| 北國FHD | 10,700 | 6,310.00 | 67,517,000 | |
| ネットプロHD | 37,800 | 846.00 | 31,978,800 | 貸付株式数 14,400 株 |
| プロクレアホールディングス | 12,700 | 1,714.00 | 21,767,800 | |
| FPパートナー | 4,900 | 2,195.00 | 10,755,500 | 貸付株式数 1,900 株 |
| あいちフィナンシャルグループ | 20,800 | 3,090.00 | 64,272,000 | 貸付株式数 2,600 株 |
| 小野建 | 12,700 | 1,459.00 | 18,529,300 | 貸付株式数 4,900 株 |
| ノジマ | 39,000 | 3,605.00 | 140,595,000 | |
| 佐鳥電機 | 7,600 | 1,917.00 | 14,569,200 | |
| カッパ・クリエイト | 18,800 | 1,640.00 | 30,832,000 | 貸付株式数 7,500 株 |
| 伯東 | 6,300 | 4,075.00 | 25,672,500 | 貸付株式数 2,400 株 |
| コンドーテック | 9,200 | 1,695.00 | 15,594,000 | 貸付株式数 3,000 株 |
| ナガイレーベン | 15,100 | 2,056.00 | 31,045,600 | 貸付株式数 5,800 株 |
| 良品計画 | 261,000 | 3,066.00 | 800,226,000 | |
| 松田産業 | 9,100 | 4,050.00 | 36,855,000 | |
| 第一興商 | 46,300 | 1,722.00 | 79,728,600 | 貸付株式数 7,200 株 |
| メディパルHD | 129,700 | 2,707.50 | 351,162,750 | |
| アドヴァングループ | 9,600 | 943.00 | 9,052,800 | 貸付株式数 3,600 株 |
| SPK | 4,800 | 2,406.00 | 11,548,800 | |
| 萩原電気HLDGS | 5,100 | 3,645.00 | 18,589,500 | |
| アルビス | 3,900 | 3,125.00 | 12,187,500 | |
| アズワン | 35,000 | 2,585.50 | 90,492,500 | |
| スズデン | 6,800 | 1,718.00 | 11,682,400 | 貸付株式数 2,600 株 |
| シモジマ | 8,000 | 1,311.00 | 10,488,000 | |
| ドウシシャ | 11,100 | 2,824.00 | 31,346,400 | |
| 高速 | 7,100 | 2,947.00 | 20,923,700 | 貸付株式数 2,700 株 |
| G-7ホールディングス | 13,000 | 1,353.00 | 17,589,000 | |
| たけびし | 5,100 | 2,102.00 | 10,720,200 | 貸付株式数 1,500 株 |
| イオン北海道 | 29,500 | 926.00 | 27,317,000 | 貸付株式数 11,500 株 |
| コジマ | 19,800 | 1,125.00 | 22,275,000 | 貸付株式数 7,600 株 |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 (円) | | 備考 |
|---------------|---------|----------|---------------|----------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| コーナン商事 | 13,200 | 4,090.00 | 53,988,000 | |
| エコス | 4,400 | 2,770.00 | 12,188,000 | 貸付株式数 1,700 株 |
| ワタミ | 14,400 | 999.00 | 14,385,600 | 貸付株式数 5,400 株 |
| リックス | 2,700 | 3,435.00 | 9,274,500 | |
| システムソフト | 38,900 | 62.00 | 2,411,800 | 貸付株式数 15,500 株 |
| パンパシフィック HD | 241,700 | 5,522.00 | 1,334,667,400 | |
| 丸文 | 10,700 | 1,223.00 | 13,086,100 | 貸付株式数 4,100 株 |
| 西松屋チェーン | 26,500 | 2,204.00 | 58,406,000 | 貸付株式数 5,600 株 |
| ゼンショーホールディングス | 67,900 | 9,300.00 | 631,470,000 | |
| ハピネット | 9,100 | 6,690.00 | 60,879,000 | |
| 幸楽苑 | 10,400 | 1,063.00 | 11,055,200 | 貸付株式数 3,500 株 |
| 橋本総業 HLDGS | 4,700 | 1,296.00 | 6,091,200 | 貸付株式数 1,000 株 |
| 日本ライフライン | 30,100 | 1,536.00 | 46,233,600 | |
| サイゼリヤ | 15,500 | 5,260.00 | 81,530,000 | |
| タカショ一 | 9,700 | 446.00 | 4,326,200 | 貸付株式数 3,500 株 |
| VTホールディングス | 46,600 | 496.00 | 23,113,600 | 貸付株式数 9,700 株 |
| アルゴグラフィックス | 10,400 | 4,790.00 | 49,816,000 | |
| 魚力 | 4,200 | 2,614.00 | 10,978,800 | 貸付株式数 1,600 株 |
| I DOM | 40,700 | 1,027.00 | 41,798,900 | |
| 日本エム・ディ・エム | 9,000 | 516.00 | 4,644,000 | |
| フジ・コーポレーション | 4,600 | 2,817.00 | 12,958,200 | |
| ユナイテッドアローズ | 12,800 | 2,226.00 | 28,492,800 | |
| 進和 | 7,000 | 3,360.00 | 23,520,000 | 貸付株式数 2,300 株 |
| ダイトロン | 4,900 | 4,220.00 | 20,678,000 | |
| ハイディ日高 | 19,300 | 3,760.00 | 72,568,000 | 貸付株式数 4,300 株 |
| シークス | 19,200 | 1,355.00 | 26,016,000 | |
| コロワイド | 67,500 | 1,924.00 | 129,870,000 | 貸付株式数 27,000 株 |
| オーハシテクニカ | 5,600 | 2,327.00 | 13,031,200 | 貸付株式数 1,200 株 |
| 壱番屋 | 47,200 | 930.00 | 43,896,000 | 貸付株式数 18,300 株 |
| 白銅 | 3,400 | 2,318.00 | 7,881,200 | 貸付株式数 1,000 株 |
| スギホールディングス | 64,200 | 3,862.00 | 247,940,400 | |
| 薬王堂ホールディングス | 5,800 | 2,280.00 | 13,224,000 | |
| ダブルエー | 3,200 | 1,300.00 | 4,160,000 | 貸付株式数 1,200 株 |
| 島津製作所 | 162,700 | 3,642.00 | 592,553,400 | |
| J M S | 10,400 | 451.00 | 4,690,400 | |
| 長野計器 | 7,400 | 2,095.00 | 15,503,000 | 貸付株式数 2,900 株 |
| ブイ・テクノロジー | 5,500 | 3,055.00 | 16,802,500 | |
| スター精密 | 18,400 | 1,692.00 | 31,132,800 | |
| 東京計器 | 7,900 | 4,205.00 | 33,219,500 | 貸付株式数 3,100 株 |
| 愛知時計 | 5,400 | 2,904.00 | 15,681,600 | |
| インターラクション | 6,800 | 1,402.00 | 9,533,600 | |
| 東京精密 | 23,200 | 8,435.00 | 195,692,000 | |
| マニー | 45,200 | 1,310.00 | 59,212,000 | |
| ニコン | 169,200 | 1,701.50 | 287,893,800 | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 |
|------------------|---------|-----------|---------------|----------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| トプコン | 63,000 | 3,294.00 | 207,522,000 | |
| オリンパス | 625,900 | 1,875.50 | 1,173,875,450 | |
| 理研計器 | 16,000 | 3,090.00 | 49,440,000 | |
| SCREEN ホールディングス | 47,200 | 11,215.00 | 529,348,000 | |
| キヤノン電子 | 12,500 | 2,683.00 | 33,537,500 | |
| タムロン | 57,700 | 1,044.00 | 60,238,800 | |
| HOYA | 217,500 | 20,755.00 | 4,514,212,500 | |
| ノーリツ鋼機 | 32,200 | 1,770.00 | 56,994,000 | |
| A&D ホロンホールディングス | 14,100 | 2,010.00 | 28,341,000 | |
| 朝日インテック | 137,800 | 2,707.00 | 373,024,600 | |
| キヤノン | 507,300 | 4,477.00 | 2,271,182,100 | |
| リコー | 289,000 | 1,391.00 | 401,999,000 | |
| シチズン時計 | 104,000 | 1,067.00 | 110,968,000 | |
| メニコン | 42,200 | 1,235.00 | 52,117,000 | |
| パラマウントベッドHD | 24,300 | 2,723.00 | 66,168,900 | |
| トランザクション | 12,400 | 1,191.00 | 14,768,400 | 貸付株式数 5,400 株 |
| ニホンフラッシュ | 9,500 | 815.00 | 7,742,500 | |
| 前田工織 | 23,000 | 1,855.00 | 42,665,000 | |
| アートネイチャー | 11,600 | 811.00 | 9,407,600 | 貸付株式数 4,500 株 |
| フルヤ金属 | 9,700 | 2,725.00 | 26,432,500 | 貸付株式数 3,800 株 |
| バンダイナムコ HLDGS | 302,200 | 5,000.00 | 1,511,000,000 | |
| SHOEI | 29,500 | 1,870.00 | 55,165,000 | 貸付株式数 200 株 |
| フランスベッド HLDGS | 14,700 | 1,296.00 | 19,051,200 | 貸付株式数 5,700 株 |
| マーベラス | 21,000 | 571.00 | 11,991,000 | 貸付株式数 8,200 株 |
| パイロットコーポレーション | 17,300 | 4,598.00 | 79,545,400 | |
| 萩原工業 | 7,600 | 1,681.00 | 12,775,600 | 貸付株式数 2,900 株 |
| エイベックス | 21,300 | 1,304.00 | 27,775,200 | |
| フジシールインターナショナル | 25,400 | 2,925.00 | 74,295,000 | |
| タカラトミー | 47,500 | 3,321.00 | 157,747,500 | |
| 広済堂ホールディングス | 42,700 | 434.00 | 18,531,800 | 貸付株式数 16,800 株 |
| レック | 14,500 | 1,216.00 | 17,632,000 | |
| 三光合成 | 14,300 | 916.00 | 13,098,800 | |
| プロネクサス | 11,700 | 1,146.00 | 13,408,200 | 貸付株式数 4,600 株 |
| TOPPAN ホールディングス | 137,000 | 3,936.00 | 539,232,000 | |
| 大日本印刷 | 221,700 | 2,621.00 | 581,075,700 | |
| 共同印刷 | 12,700 | 1,578.00 | 20,040,600 | |
| NISSHA | 21,500 | 1,429.00 | 30,723,500 | |
| ZACROS | 9,000 | 4,205.00 | 37,845,000 | |
| TAKARA & COMPANY | 6,100 | 4,020.00 | 24,522,000 | 貸付株式数 2,000 株 |
| 前澤化成工業 | 8,000 | 2,279.00 | 18,232,000 | 貸付株式数 3,000 株 |
| 未来工業 | 5,400 | 3,925.00 | 21,195,000 | 貸付株式数 1,200 株 |
| アシックス | 434,600 | 4,114.00 | 1,787,944,400 | |
| ツツミ | 2,600 | 2,269.00 | 5,899,400 | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 (円) | | 備考 |
|---------------|-----------|-----------|---------------|--------------------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| ジェイ エス ピー | 9,300 | 2,001.00 | 18,609,300 | 貸付株式数 3,400 株 |
| ニチハ | 14,200 | 2,926.00 | 41,549,200 | 貸付株式数 4,300 株 |
| ローランド | 9,000 | 3,420.00 | 30,780,000 | |
| エフピコ | 25,000 | 2,659.00 | 66,475,000 | |
| 小松ウオール工業 | 7,500 | 2,674.00 | 20,055,000 | |
| ヤマハ | 191,300 | 1,022.00 | 195,508,600 | |
| 河合楽器 | 3,400 | 2,601.00 | 8,843,400 | |
| クリナップ | 11,100 | 777.00 | 8,624,700 | |
| ピジョン | 66,800 | 1,866.00 | 124,648,800 | |
| キングジム | 10,000 | 848.00 | 8,480,000 | 貸付株式数 3,800 株 (200 株) |
| 象印マホービン | 30,700 | 1,688.00 | 51,821,600 | 貸付株式数 4,700 株 |
| リンテック | 21,400 | 3,580.00 | 76,612,000 | |
| 信越ポリマー | 24,400 | 1,886.00 | 46,018,400 | |
| イトーキ | 24,800 | 2,385.00 | 59,148,000 | |
| 任天堂 | 713,600 | 13,790.00 | 9,840,544,000 | |
| 三菱鉛筆 | 15,500 | 2,136.00 | 33,108,000 | 貸付株式数 6,000 株 |
| 松風 | 11,300 | 1,992.00 | 22,509,600 | |
| タカラスタンダード | 25,600 | 2,705.00 | 69,248,000 | |
| コクヨ | 234,800 | 928.20 | 217,941,360 | |
| ナカバヤシ | 12,200 | 588.00 | 7,173,600 | |
| ニフコ | 42,400 | 4,457.00 | 188,976,800 | |
| 立川ブラインド | 5,900 | 1,845.00 | 10,885,500 | 貸付株式数 1,800 株 |
| グローブライド | 11,200 | 2,422.00 | 27,126,400 | 貸付株式数 4,300 株 |
| オカムラ | 34,000 | 2,430.00 | 82,620,000 | |
| バルカー | 8,700 | 3,845.00 | 33,451,500 | 貸付株式数 3,400 株 |
| 伊藤忠 | 803,800 | 8,726.00 | 7,013,958,800 | |
| 丸紅 | 982,700 | 3,543.00 | 3,481,706,100 | |
| スクロール | 17,500 | 1,159.00 | 20,282,500 | |
| ヨンドシーホールディングス | 11,300 | 1,745.00 | 19,718,500 | 貸付株式数 4,400 株 |
| 三陽商会 | 5,900 | 3,380.00 | 19,942,000 | |
| 長瀬産業 | 51,100 | 3,329.00 | 170,111,900 | |
| 蝶理 | 6,400 | 3,970.00 | 25,408,000 | 貸付株式数 1,600 株 |
| 豊田通商 | 359,100 | 4,054.00 | 1,455,791,400 | |
| オンワードホールディングス | 73,400 | 691.00 | 50,719,400 | |
| 三共生興 | 15,600 | 688.00 | 10,732,800 | |
| 兼松 | 50,000 | 3,170.00 | 158,500,000 | |
| 美津濃 | 33,700 | 2,638.00 | 88,900,600 | 貸付株式数 13,200 株 |
| ルックホールディングス | 3,600 | 2,700.00 | 9,720,000 | 貸付株式数 1,300 株 |
| 三井物産 | 1,719,100 | 3,720.00 | 6,395,052,000 | |
| 日本紙パルプ | 57,100 | 720.00 | 41,112,000 | |
| 東京エレクトロン | 239,200 | 20,600.00 | 4,927,520,000 | |
| カメイ | 11,200 | 2,924.00 | 32,748,800 | |
| スターゼン | 24,800 | 1,225.00 | 30,380,000 | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 (円) | | 備考 |
|--------------------|-----------|-----------|---------------|----------------------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| セイコーグループ | 17,500 | 6,900.00 | 120,750,000 | |
| 山 善 | 40,300 | 1,403.00 | 56,540,900 | 貸付株式数 16,100 株 |
| 椿本興業 | 6,600 | 2,973.00 | 19,621,800 | 貸付株式数 2,500 株 |
| 住友商事 | 716,600 | 4,370.00 | 3,131,542,000 | |
| B I P R O G Y | 38,300 | 6,344.00 | 242,975,200 | |
| 内田洋行 | 4,400 | 11,360.00 | 49,984,000 | |
| 三菱商事 | 2,210,100 | 3,497.00 | 7,728,719,700 | ※ |
| 第一実業 | 11,100 | 2,765.00 | 30,691,500 | |
| キヤノンマーケティング JPN | 28,200 | 5,873.00 | 165,618,600 | |
| 西華産業 | 5,700 | 5,980.00 | 34,086,000 | |
| 佐藤商事 | 8,300 | 1,750.00 | 14,525,000 | |
| 東京産業 | 12,100 | 948.00 | 11,470,800 | |
| ユアサ商事 | 10,300 | 5,100.00 | 52,530,000 | |
| 神鋼商事 | 7,900 | 2,333.00 | 18,430,700 | |
| 阪和興業 | 19,700 | 6,520.00 | 128,444,000 | |
| 正栄食品 | 8,000 | 4,185.00 | 33,480,000 | 貸付株式数 2,500 株 (1,100 株) |
| カナデン | 8,600 | 2,043.00 | 17,569,800 | |
| R Y O D E N | 9,100 | 3,195.00 | 29,074,500 | |
| ニプロ | 94,200 | 1,565.00 | 147,423,000 | |
| 岩谷産業 | 118,800 | 1,669.50 | 198,336,600 | |
| 極東貿易 | 6,900 | 1,799.00 | 12,413,100 | |
| アステナホールディングス | 22,600 | 520.00 | 11,752,000 | |
| 三愛オブリ | 27,900 | 2,119.00 | 59,120,100 | 貸付株式数 4,200 株 |
| 稻畑産業 | 32,400 | 3,555.00 | 115,182,000 | |
| G S I クレオス | 6,400 | 2,427.00 | 15,532,800 | 貸付株式数 2,500 株 |
| 明和産業 | 17,000 | 840.00 | 14,280,000 | |
| ゴールドワイン | 20,100 | 7,577.00 | 152,297,700 | |
| ユニ・チャーム | 708,500 | 993.20 | 703,682,200 | |
| ワキタ | 17,600 | 1,880.00 | 33,088,000 | 貸付株式数 6,800 株 |
| 東邦ホールディングス | 30,900 | 5,660.00 | 174,894,000 | 貸付株式数 12,000 株 |
| サンゲツ | 30,000 | 3,175.00 | 95,250,000 | |
| ミツウロコグループ | 14,500 | 2,201.00 | 31,914,500 | 貸付株式数 5,300 株 |
| シナネンホールディングス | 3,000 | 6,550.00 | 19,650,000 | 貸付株式数 1,100 株 |
| 伊藤忠エネクス | 29,600 | 1,973.00 | 58,400,800 | |
| サンリオ | 97,200 | 7,627.00 | 741,344,400 | 貸付株式数 38,800 株 |
| サンワ テクノス | 5,400 | 2,650.00 | 14,310,000 | 貸付株式数 2,100 株 |
| 新光商事 | 16,100 | 1,020.00 | 16,422,000 | 貸付株式数 3,100 株 |
| トーホー | 5,100 | 3,585.00 | 18,283,500 | |
| 三信電気 | 4,800 | 2,805.00 | 13,464,000 | |
| 東陽テクニカ | 11,000 | 1,594.00 | 17,534,000 | |
| モスフード サービス | 17,600 | 4,010.00 | 70,576,000 | 貸付株式数 6,900 株 |
| 加賀電子 | 24,300 | 3,590.00 | 87,237,000 | |
| 都築電気 | 6,400 | 3,170.00 | 20,288,000 | 貸付株式数 2,400 株 |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 (円) | | 備考 |
|-----------------|-----------|-----------|----------------|--------------------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| ソーダニツカ | 11,600 | 1,117.00 | 12,957,200 | 貸付株式数 4,200 株 |
| 立花エレテック | 7,100 | 3,025.00 | 21,477,500 | |
| 木曽路 | 18,100 | 2,544.00 | 46,046,400 | 貸付株式数 7,100 株 (200 株) |
| SRS ホールディングス | 19,700 | 1,280.00 | 25,216,000 | 貸付株式数 7,600 株 |
| 千趣会 | 24,200 | 247.00 | 5,977,400 | 貸付株式数 8,700 株 (400 株) |
| リテールパートナーズ | 17,700 | 1,472.00 | 26,054,400 | 貸付株式数 6,800 株 |
| 上新電機 | 11,800 | 2,575.00 | 30,385,000 | 貸付株式数 4,600 株 |
| 日本瓦斯 | 57,200 | 2,889.00 | 165,250,800 | |
| ロイヤルホールディングス | 23,200 | 2,733.00 | 63,405,600 | 貸付株式数 8,100 株 |
| チヨダ | 10,500 | 1,289.00 | 13,534,500 | |
| ライフコーポレーション | 22,900 | 2,513.00 | 57,547,700 | |
| リンガーハット | 15,400 | 2,271.00 | 34,973,400 | 貸付株式数 6,100 株 |
| M r M a x H D | 15,100 | 866.00 | 13,076,600 | |
| AOKI ホールディングス | 25,600 | 1,812.00 | 46,387,200 | |
| オークワ | 17,700 | 971.00 | 17,186,700 | 貸付株式数 4,700 株 |
| コメリ | 16,100 | 3,345.00 | 53,854,500 | |
| 青山商事 | 25,600 | 2,566.00 | 65,689,600 | 貸付株式数 10,200 株 |
| しまむら | 28,100 | 11,235.00 | 315,703,500 | |
| 高島屋 | 160,100 | 1,406.00 | 225,100,600 | |
| 松屋 | 20,300 | 1,397.00 | 28,359,100 | |
| エイチ・ツー・オーリテイリング | 58,200 | 2,248.50 | 130,862,700 | |
| 近鉄百貨店 | 6,800 | 2,031.00 | 13,810,800 | 貸付株式数 2,500 株 |
| 丸井グループ | 69,900 | 3,289.00 | 229,901,100 | |
| クレディセゾン | 70,500 | 3,881.00 | 273,610,500 | |
| アクシアル リテイリング | 32,600 | 1,162.00 | 37,881,200 | |
| イオン | 1,458,000 | 1,797.00 | 2,620,026,000 | |
| イズミ | 18,200 | 3,242.00 | 59,004,400 | |
| フォーバル | 4,700 | 1,399.00 | 6,575,300 | 貸付株式数 1,000 株 |
| 平和堂 | 19,600 | 2,885.00 | 56,546,000 | |
| フジ | 22,000 | 2,019.00 | 44,418,000 | 貸付株式数 8,400 株 |
| ヤオコー | 14,200 | 9,082.00 | 128,964,400 | |
| ゼビオホールディングス | 16,200 | 1,163.00 | 18,840,600 | 貸付株式数 6,300 株 |
| ケーズホールディングス | 74,000 | 1,579.50 | 116,883,000 | |
| P A L T A C | 18,600 | 4,690.00 | 87,234,000 | |
| 三谷産業 | 20,900 | 428.00 | 8,945,200 | |
| あおぞら銀行 | 76,800 | 2,279.50 | 175,065,600 | 貸付株式数 30,700 株 |
| 三菱UFJ フィナンシャル G | 7,140,700 | 2,285.50 | 16,320,069,850 | |
| りそなホールディングス | 1,365,200 | 1,476.00 | 2,015,035,200 | |
| 三井住友トラストグルー | 391,900 | 4,259.00 | 1,669,102,100 | |
| 三井住友フィナンシャル G | 2,298,500 | 4,090.00 | 9,400,865,000 | |
| 千葉銀行 | 340,500 | 1,522.00 | 518,241,000 | |
| 群馬銀行 | 188,700 | 1,587.00 | 299,466,900 | |
| 武蔵野銀行 | 16,900 | 3,885.00 | 65,656,500 | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 (円) | | 備考 |
|---------------|-----------|-----------|---------------|-----------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| 千葉興業銀行 | 26,300 | 1,557.00 | 40,949,100 | 貸付株式数 8,400 株 |
| 筑波銀行 | 48,800 | 299.00 | 14,591,200 | |
| 七十七銀行 | 35,600 | 5,694.00 | 202,706,400 | |
| 秋田銀行 | 7,500 | 3,560.00 | 26,700,000 | |
| 山形銀行 | 12,300 | 1,640.00 | 20,172,000 | 貸付株式数 4,800 株 |
| 岩手銀行 | 7,000 | 3,810.00 | 26,670,000 | 貸付株式数 1,300 株 |
| 東邦銀行 | 128,100 | 419.00 | 53,673,900 | 貸付株式数 12,800 株 |
| ふくおかフィナンシャル G | 96,900 | 4,466.00 | 432,755,400 | |
| スルガ銀行 | 63,000 | 1,525.00 | 96,075,000 | |
| 八十二銀行 | 250,400 | 1,451.00 | 363,330,400 | |
| 山梨中央銀行 | 12,500 | 3,105.00 | 38,812,500 | |
| 大垣共立銀行 | 21,200 | 3,190.00 | 67,628,000 | |
| 福井銀行 | 10,000 | 2,005.00 | 20,050,000 | 貸付株式数 3,800 株 |
| 清水銀行 | 4,400 | 1,968.00 | 8,659,200 | |
| 滋賀銀行 | 16,800 | 6,640.00 | 111,552,000 | |
| 南都銀行 | 16,800 | 4,970.00 | 83,496,000 | |
| 百五銀行 | 104,700 | 865.00 | 90,565,500 | |
| 紀陽銀行 | 39,800 | 2,980.00 | 118,604,000 | |
| ほくほくフィナンシャル G | 62,600 | 3,752.00 | 234,875,200 | |
| 山陰合同銀行 | 69,700 | 1,366.00 | 95,210,200 | |
| 百十四銀行 | 10,900 | 5,020.00 | 54,718,000 | |
| 四国銀行 | 16,100 | 1,450.00 | 23,345,000 | |
| 阿波銀行 | 15,200 | 3,490.00 | 53,048,000 | |
| 大分銀行 | 6,500 | 4,885.00 | 31,752,500 | |
| 宮崎銀行 | 7,100 | 4,385.00 | 31,133,500 | 貸付株式数 2,700 株 |
| 佐賀銀行 | 6,400 | 2,952.00 | 18,892,800 | |
| 琉球銀行 | 25,500 | 1,372.00 | 34,986,000 | 貸付株式数 3,000 株 |
| セブン銀行 | 398,800 | 287.60 | 114,694,880 | 貸付株式数 156,600 株 |
| みずほフィナンシャル G | 1,487,400 | 4,891.00 | 7,274,873,400 | |
| 山口フィナンシャル G | 109,100 | 1,782.50 | 194,470,750 | |
| 芙蓉総合リース | 30,700 | 4,460.00 | 136,922,000 | |
| みずほリース | 83,600 | 1,307.00 | 109,265,200 | |
| 東京センチュリー | 83,200 | 1,910.00 | 158,912,000 | |
| SBI ホールディングス | 179,300 | 6,643.00 | 1,191,089,900 | |
| 日本証券金融 | 40,900 | 1,892.00 | 77,382,800 | |
| アイフル | 184,300 | 490.00 | 90,307,000 | |
| 名古屋銀行 | 7,000 | 10,530.00 | 73,710,000 | |
| 北洋銀行 | 143,800 | 720.00 | 103,536,000 | |
| 愛媛銀行 | 16,200 | 1,225.00 | 19,845,000 | 貸付株式数 6,400 株 |
| 京葉銀行 | 50,000 | 1,220.00 | 61,000,000 | |
| 栃木銀行 | 51,000 | 483.00 | 24,633,000 | |
| 北日本銀行 | 3,800 | 3,860.00 | 14,668,000 | |
| 東和銀行 | 20,400 | 968.00 | 19,747,200 | 貸付株式数 7,900 株 |
| リコーリース | 10,600 | 5,830.00 | 61,798,000 | 貸付株式数 4,100 株 |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-----------------|-----------|----------|---------------|-------|---------|
| | | 単価 | 金額 | | |
| イオンフィナンシャルサービス | 63,900 | 1,546.00 | 98,789,400 | 貸付株式数 | 25,500株 |
| アコム | 264,900 | 478.40 | 126,728,160 | | |
| ジャックス | 13,300 | 4,435.00 | 58,985,500 | 貸付株式数 | 2,000株 |
| オリコ | 36,300 | 1,043.00 | 37,860,900 | 貸付株式数 | 5,300株 |
| オリックス | 639,000 | 3,903.00 | 2,494,017,000 | | |
| 三菱HCキャピタル | 558,000 | 1,226.00 | 684,108,000 | | |
| ジャフコグループ | 33,200 | 2,614.00 | 86,784,800 | 貸付株式数 | 1,900株 |
| トモニホールディングス | 106,300 | 656.00 | 69,732,800 | | |
| 大和証券G本社 | 796,000 | 1,207.00 | 960,772,000 | | |
| 野村ホールディングス | 1,871,900 | 1,083.50 | 2,028,203,650 | | |
| 岡三証券グループ | 88,000 | 691.00 | 60,808,000 | 貸付株式数 | 32,800株 |
| 丸三証券 | 37,000 | 977.00 | 36,149,000 | 貸付株式数 | 13,500株 |
| 東洋証券 | 28,100 | 547.00 | 15,370,700 | | |
| 東海東京HD | 132,200 | 592.00 | 78,262,400 | | |
| 水戸証券 | 30,500 | 556.00 | 16,958,000 | | |
| いちはじ証券 | 22,400 | 816.00 | 18,278,400 | 貸付株式数 | 8,400株 |
| 松井証券 | 76,700 | 802.00 | 61,513,400 | | |
| SOMPOホールディングス | 513,300 | 4,801.00 | 2,464,353,300 | | |
| 日本取引所グループ | 662,200 | 1,541.50 | 1,020,781,300 | | |
| マネックスG | 107,200 | 806.00 | 86,403,200 | | |
| 極東証券 | 13,900 | 1,619.00 | 22,504,100 | 貸付株式数 | 5,300株 |
| 岩井コスモホールディング | 12,700 | 2,716.00 | 34,493,200 | | |
| アイザワ証券グループ | 13,400 | 1,445.00 | 19,363,000 | 貸付株式数 | 4,200株 |
| フィデアホール | 11,500 | 1,612.00 | 18,538,000 | | |
| 池田泉州HD | 154,400 | 645.00 | 99,588,000 | | |
| アニコムホールディングス | 34,800 | 906.00 | 31,528,800 | 貸付株式数 | 13,600株 |
| MS&AD | 815,800 | 3,506.00 | 2,860,194,800 | | |
| スパークス・グループ | 12,300 | 1,608.00 | 19,778,400 | | |
| 第一生命HLDGS | 2,033,100 | 1,239.50 | 2,520,027,450 | | |
| 東京海上HD | 1,062,600 | 6,514.00 | 6,921,776,400 | | |
| イー・ギャランティ | 18,200 | 1,486.00 | 27,045,200 | 貸付株式数 | 6,900株 |
| NECキャピタルソリューション | 5,500 | 3,905.00 | 21,477,500 | | |
| T&Dホールディングス | 298,900 | 3,937.00 | 1,176,769,300 | | |
| アドバンスクリエイト | 8,600 | 335.00 | 2,881,000 | 貸付株式数 | 3,400株 |
| 三井不動産 | 1,528,700 | 1,634.00 | 2,497,895,800 | | |
| 三菱地所 | 634,400 | 3,355.00 | 2,128,412,000 | | |
| 平和不動産 | 36,100 | 2,358.00 | 85,123,800 | 貸付株式数 | 9,900株 |
| 東京建物 | 106,100 | 2,867.50 | 304,241,750 | | |
| 京阪神ビルディング | 18,600 | 1,628.00 | 30,280,800 | 貸付株式数 | 6,200株 |
| 住友不動産 | 181,100 | 6,374.00 | 1,154,331,400 | | |
| テーオーシー | 19,800 | 819.00 | 16,216,200 | | |
| スタートコーポレーション | 18,300 | 4,995.00 | 91,408,500 | | |
| フジ住宅 | 14,000 | 814.00 | 11,396,000 | | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 (円) | | 備考 | |
|-----------------|---------|----------|---------------|-------|-----------|
| | | 単価 | 金額 | | |
| 空港施設 | 15,700 | 1,091.00 | 17,128,700 | 貸付株式数 | 6,100 株 |
| 明和地所 | 8,900 | 1,110.00 | 9,879,000 | 貸付株式数 | 2,200 株 |
| ゴールドクレスト | 7,600 | 3,440.00 | 26,144,000 | 貸付株式数 | 1,200 株 |
| リログループ | 64,700 | 1,760.00 | 113,872,000 | | |
| エスリード | 5,200 | 5,350.00 | 27,820,000 | | |
| 日神グループ HLDGS | 17,900 | 585.00 | 10,471,500 | 貸付株式数 | 6,800 株 |
| エスコン | 29,200 | 1,047.00 | 30,572,400 | 貸付株式数 | 11,400 株 |
| MIRARTH ホールディング | 65,200 | 402.00 | 26,210,400 | 貸付株式数 | 25,600 株 |
| ランド | 718,300 | 10.00 | 7,183,000 | 貸付株式数 | 278,200 株 |
| カチタス | 29,900 | 2,786.00 | 83,301,400 | 貸付株式数 | 11,200 株 |
| 東祥 | 9,700 | 719.00 | 6,974,300 | | |
| トーセイ | 16,500 | 3,335.00 | 55,027,500 | | |
| サンフロンティア不動産 | 18,500 | 2,344.00 | 43,364,000 | | |
| グランディハウス | 10,400 | 576.00 | 5,990,400 | 貸付株式数 | 1,300 株 |
| 東武鉄道 | 119,100 | 2,780.00 | 331,098,000 | | |
| 相鉄ホールディングス | 37,300 | 2,662.50 | 99,311,250 | | |
| 東急 | 316,900 | 1,911.00 | 605,595,900 | | |
| 京浜急行 | 139,900 | 1,595.00 | 223,140,500 | 貸付株式数 | 34,100 株 |
| 小田急電鉄 | 186,900 | 1,755.00 | 328,009,500 | | |
| 京王電鉄 | 55,700 | 3,905.00 | 217,508,500 | | |
| 京成電鉄 | 196,800 | 1,430.50 | 281,522,400 | | |
| 富士急行 | 13,900 | 2,358.00 | 32,776,200 | 貸付株式数 | 5,500 株 |
| 東日本旅客鉄道 | 623,300 | 3,795.00 | 2,365,423,500 | | |
| 西日本旅客鉄道 | 278,700 | 3,372.00 | 939,776,400 | | |
| 東海旅客鉄道 | 435,300 | 4,156.00 | 1,809,106,800 | | |
| 東京地下鉄 | 252,000 | 1,746.00 | 439,992,000 | 貸付株式数 | 100,800 株 |
| 西武ホールディングス | 123,000 | 5,478.00 | 673,794,000 | | |
| 鴻池運輸 | 19,300 | 3,390.00 | 65,427,000 | | |
| 西日本鉄道 | 32,700 | 2,323.50 | 75,978,450 | | |
| ハマキヨウレックス | 38,600 | 1,558.00 | 60,138,800 | | |
| サカイ引越センター | 14,300 | 2,989.00 | 42,742,700 | 貸付株式数 | 5,600 株 |
| 近鉄グループ HLDGS | 120,900 | 3,079.00 | 372,251,100 | | |
| 阪急阪神 HLDGS | 149,700 | 4,416.00 | 661,075,200 | | |
| 南海電鉄 | 50,300 | 2,760.00 | 138,828,000 | 貸付株式数 | 1,700 株 |
| 京阪ホールディングス | 58,700 | 3,466.00 | 203,454,200 | | |
| 神戸電鉄 | 3,100 | 2,590.00 | 8,029,000 | 貸付株式数 | 1,200 株 |
| 名古屋鉄道 | 124,700 | 1,753.50 | 218,661,450 | 貸付株式数 | 49,000 株 |
| 山陽電鉄 | 8,500 | 2,112.00 | 17,952,000 | 貸付株式数 | 3,200 株 |
| ヤマトホールディングス | 137,100 | 2,506.50 | 343,641,150 | | |
| 山 九 | 25,800 | 8,179.00 | 211,018,200 | | |
| 日 新 | 2,600 | 8,060.00 | 20,956,000 | | |
| 丸全昭和運輸 | 7,000 | 7,330.00 | 51,310,000 | 貸付株式数 | 700 株 |
| センコーグループ HLDGS | 74,300 | 2,092.00 | 155,435,600 | | |
| ニッコンホールディングス | 64,100 | 3,253.00 | 208,517,300 | 貸付株式数 | 24,700 株 |
| 福山通運 | 12,100 | 3,745.00 | 45,314,500 | | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 (円) | | 備考 |
|------------------|---------|----------|---------------|----------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| セイノーホールディングス | 55,500 | 2,313.50 | 128,399,250 | 貸付株式数 20,700 株 |
| 神奈川中央交通 | 3,200 | 3,690.00 | 11,808,000 | |
| AZ-COM 丸和ホールディ | 35,000 | 1,101.00 | 38,535,000 | 貸付株式数 14,000 株 |
| 日本郵船 | 220,200 | 5,544.00 | 1,220,788,800 | |
| 商船三井 | 214,700 | 4,861.00 | 1,043,656,700 | |
| 川崎汽船 | 243,100 | 2,341.00 | 569,097,100 | |
| NS ユナイテッド海運 | 7,100 | 5,360.00 | 38,056,000 | |
| 飯野海運 | 41,400 | 1,237.00 | 51,211,800 | 貸付株式数 14,100 株 |
| 九州旅客鉄道 | 86,400 | 4,168.00 | 360,115,200 | |
| SG ホールディングス | 189,500 | 1,618.50 | 306,705,750 | |
| NIPPON EXPRESS | 121,300 | 3,453.00 | 418,848,900 | |
| 日本航空 | 258,700 | 3,152.00 | 815,422,400 | |
| ANA ホールディングス | 307,000 | 2,966.50 | 910,715,500 | |
| ビーウィズ | 3,000 | 1,507.00 | 4,521,000 | 貸付株式数 1,200 株 |
| サンウェルズ | 6,000 | 740.00 | 4,440,000 | 貸付株式数 2,300 株 |
| TRE ホールディングス | 26,700 | 1,603.00 | 42,800,100 | |
| 人・夢・技術グループ | 4,800 | 1,834.00 | 8,803,200 | |
| シルバーライフ | 3,200 | 791.00 | 2,531,200 | 貸付株式数 500 株 |
| GENKY DRUGSTORES | 10,500 | 4,860.00 | 51,030,000 | 貸付株式数 1,900 株 |
| コーア商事 HLDGS | 10,700 | 780.00 | 8,346,000 | 貸付株式数 4,100 株 |
| KPP グループホールディン | 22,700 | 837.00 | 18,999,900 | |
| ブックオフG HD | 8,700 | 1,586.00 | 13,798,200 | 貸付株式数 3,400 株 |
| ギフトホールディングス | 6,800 | 3,035.00 | 20,638,000 | 貸付株式数 2,600 株 |
| 三菱倉庫 | 112,100 | 1,238.50 | 138,835,850 | |
| 三井倉庫 HOLD | 34,800 | 4,280.00 | 148,944,000 | |
| 住友倉庫 | 32,900 | 3,155.00 | 103,799,500 | |
| 渋沢倉庫 | 5,100 | 4,580.00 | 23,358,000 | 貸付株式数 2,000 株 |
| ヤマタネ | 9,600 | 2,893.00 | 27,772,800 | 貸付株式数 3,700 株 |
| 乾汽船 | 14,300 | 1,659.00 | 23,723,700 | 貸付株式数 5,700 株 |
| 日本トランシスティ | 22,700 | 1,181.00 | 26,808,700 | |
| 中央倉庫 | 6,700 | 1,447.00 | 9,694,900 | 貸付株式数 2,300 株 |
| 安田倉庫 | 7,700 | 2,116.00 | 16,293,200 | 貸付株式数 900 株 |
| N I S S O H D | 10,100 | 653.00 | 6,595,300 | 貸付株式数 3,700 株 |
| 大栄環境 | 25,300 | 3,495.00 | 88,423,500 | 貸付株式数 4,600 株 |
| GENOVA | 5,300 | 688.00 | 3,646,400 | 貸付株式数 2,100 株 |
| 日本管財ホールディング | 12,200 | 2,809.00 | 34,269,800 | 貸付株式数 4,800 株 |
| 上組 | 49,500 | 4,545.00 | 224,977,500 | |
| キユーソー流通システム | 6,400 | 3,450.00 | 22,080,000 | 貸付株式数 2,500 株 |
| エーアイティー | 7,100 | 2,109.00 | 14,973,900 | |
| 日本コンセプト | 4,000 | 3,040.00 | 12,160,000 | |
| TBS ホールディングス | 56,000 | 5,523.00 | 309,288,000 | |
| 日本テレビ HLDS | 100,400 | 4,038.00 | 405,415,200 | 貸付株式数 36,100 株 |
| 朝日放送グループ HD | 14,100 | 777.00 | 10,955,700 | 貸付株式数 5,400 株 |
| テレビ朝日 HD | 27,500 | 3,255.00 | 89,512,500 | |
| スカパーJSATHD | 88,100 | 1,346.00 | 118,582,600 | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額(円) | | 備考 | |
|-----------------|------------|-----------|---------------|-------|----------|
| | | 単価 | 金額 | | |
| テレビ東京HD | 7,000 | 4,715.00 | 33,005,000 | 貸付株式数 | 2,200株 |
| ビジョン | 23,700 | 1,253.00 | 29,696,100 | 貸付株式数 | 800株 |
| U-NEXT HOLDINGS | 38,100 | 2,058.00 | 78,409,800 | 貸付株式数 | 1,500株 |
| 日本通信 | 91,100 | 146.00 | 13,300,600 | 貸付株式数 | 20,200株 |
| NTT | 33,717,900 | 158.80 | 5,354,402,520 | | |
| KDDI | 1,593,000 | 2,513.50 | 4,004,005,500 | | |
| ソフトバンク | 18,188,000 | 227.40 | 4,135,951,200 | | |
| 光通信 | 13,100 | 39,200.00 | 513,520,000 | | |
| エムティーアイ | 7,600 | 834.00 | 6,338,400 | 貸付株式数 | 3,000株 |
| GMOインターネットグループ | 36,600 | 3,880.00 | 142,008,000 | | |
| ファイバーゲート | 4,300 | 707.00 | 3,040,100 | 貸付株式数 | 1,700株 |
| KADOKAWA | 58,000 | 3,295.00 | 191,110,000 | | |
| 学研ホールディングス | 20,700 | 1,050.00 | 21,735,000 | | |
| ゼンリン | 19,400 | 1,125.00 | 21,825,000 | 貸付株式数 | 7,400株 |
| 東京電力HD | 950,900 | 761.50 | 724,110,350 | 貸付株式数 | 373,400株 |
| 中部電力 | 416,500 | 2,086.00 | 868,819,000 | | |
| 関西電力 | 551,300 | 2,116.00 | 1,166,550,800 | | |
| 中国電力 | 196,400 | 883.90 | 173,597,960 | | |
| 北陸電力 | 115,600 | 931.40 | 107,669,840 | 貸付株式数 | 1,900株 |
| 東北電力 | 297,600 | 1,145.00 | 340,752,000 | | |
| 四国電力 | 105,300 | 1,389.00 | 146,261,700 | | |
| 九州電力 | 260,500 | 1,564.50 | 407,552,250 | 貸付株式数 | 27,300株 |
| 北海道電力 | 118,300 | 1,191.50 | 140,954,450 | 貸付株式数 | 46,400株 |
| 沖縄電力 | 28,900 | 1,018.00 | 29,420,200 | 貸付株式数 | 2,100株 |
| 電源開発 | 85,100 | 2,868.00 | 244,066,800 | | |
| エフオン | 8,100 | 437.00 | 3,539,700 | | |
| イーレックス | 22,000 | 739.00 | 16,258,000 | 貸付株式数 | 8,600株 |
| レノバ | 30,800 | 953.00 | 29,352,400 | 貸付株式数 | 12,100株 |
| 東京瓦斯 | 203,900 | 5,715.00 | 1,165,288,500 | | |
| 大阪瓦斯 | 218,600 | 4,327.00 | 945,882,200 | | |
| 東邦瓦斯 | 41,500 | 4,477.00 | 185,795,500 | | |
| 北海道瓦斯 | 33,700 | 675.00 | 22,747,500 | 貸付株式数 | 5,000株 |
| 広島ガス | 23,900 | 386.00 | 9,225,400 | | |
| 西部ガス HLDGS | 11,800 | 1,999.00 | 23,588,200 | | |
| 静岡ガス | 25,800 | 1,147.00 | 29,592,600 | | |
| メタウォーター | 15,000 | 3,060.00 | 45,900,000 | | |
| M&A総研ホールディング | 15,000 | 1,350.00 | 20,250,000 | 貸付株式数 | 5,800株 |
| アイネット | 6,500 | 1,721.00 | 11,186,500 | 貸付株式数 | 2,400株 |
| 松竹 | 6,500 | 12,420.00 | 80,730,000 | 貸付株式数 | 2,200株 |
| 東宝 | 66,900 | 9,259.00 | 619,427,100 | 貸付株式数 | 2,600株 |
| エイチ・アイ・エス | 33,800 | 1,477.00 | 49,922,600 | 貸付株式数 | 14,200株 |
| 東映 | 18,700 | 5,240.00 | 97,988,000 | | |
| ラックランド | 5,300 | 1,293.00 | 6,852,900 | 貸付株式数 | 1,800株 |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 (円) | | 備考 | |
|-------------------|---------|-----------|---------------|-------|-----------------------|
| | | 単価 | 金額 | | |
| 共立メンテナンス | 36,500 | 3,390.00 | 123,735,000 | 貸付株式数 | 14,100 株 (1,300 株) |
| イチネンホールディングス | 11,000 | 1,857.00 | 20,427,000 | | |
| 建設技術研究所 | 12,000 | 2,950.00 | 35,400,000 | 貸付株式数 | 4,700 株 |
| スペース | 8,400 | 1,371.00 | 11,516,400 | | |
| AINホールディングス | 12,000 | 6,196.00 | 74,352,000 | | |
| 燐ホールディングス | 9,700 | 1,464.00 | 14,200,800 | | |
| ピー・シー・エー | 7,400 | 1,962.00 | 14,518,800 | | |
| スバル興業 | 4,500 | 3,635.00 | 16,357,500 | 貸付株式数 | 1,500 株 |
| タナベコンサルティンググループ | 9,700 | 721.00 | 6,993,700 | 貸付株式数 | 3,800 株 |
| ビジネスB太田昭和 | 4,800 | 2,936.00 | 14,092,800 | 貸付株式数 | 900 株 |
| ナガワ | 3,100 | 6,760.00 | 20,956,000 | 貸付株式数 | 900 株 |
| 東京都競馬 | 8,500 | 5,250.00 | 44,625,000 | 貸付株式数 | 2,700 株 |
| カナモト | 16,400 | 3,520.00 | 57,728,000 | | |
| D T S | 19,300 | 5,140.00 | 99,202,000 | | |
| スクウェア・エニックス・HD | 57,000 | 10,015.00 | 570,855,000 | | |
| シーイーシー | 13,700 | 2,318.00 | 31,756,600 | | |
| カプコン | 225,300 | 4,011.00 | 903,678,300 | | |
| ニシオホールディングス | 9,600 | 4,320.00 | 41,472,000 | | |
| アイ・エス・ビー | 5,300 | 1,677.00 | 8,888,100 | 貸付株式数 | 1,200 株 |
| 日本空港ビルディング | 39,400 | 4,970.00 | 195,818,000 | | |
| トランス・コスモス | 14,800 | 3,670.00 | 54,316,000 | | |
| 乃村工藝社 | 50,700 | 1,071.00 | 54,299,700 | | |
| S C S K | 92,600 | 4,790.00 | 443,554,000 | | |
| 藤田観光 | 4,600 | 10,550.00 | 48,530,000 | 貸付株式数 | 2,000 株 |
| KNT-CT ホールディングス | 6,900 | 1,542.00 | 10,639,800 | 貸付株式数 | 900 株 |
| トーカイ | 10,300 | 2,241.00 | 23,082,300 | | |
| セコム | 236,700 | 5,551.00 | 1,313,921,700 | | |
| N S W | 5,000 | 2,612.00 | 13,060,000 | | |
| セントラル警備保障 | 6,300 | 2,525.00 | 15,907,500 | | |
| アイネス | 8,800 | 1,958.00 | 17,230,400 | | |
| 丹青社 | 24,600 | 1,461.00 | 35,940,600 | | |
| マイテックグループホールディングス | 42,900 | 3,330.00 | 142,857,000 | | |
| T K C | 17,700 | 4,375.00 | 77,437,500 | | |
| 応用地質 | 10,500 | 2,962.00 | 31,101,000 | | |
| 船井総研ホールディングス | 23,200 | 2,574.00 | 59,716,800 | | |
| N S D | 43,600 | 3,243.00 | 141,394,800 | | |
| コナミグループ | 42,500 | 21,835.00 | 927,987,500 | | |
| 学究社 | 4,600 | 2,350.00 | 10,810,000 | | |
| ナック | 11,800 | 552.00 | 6,513,600 | 貸付株式数 | 4,500 株 |
| 福井コンピュータ HLDS | 7,900 | 3,350.00 | 26,465,000 | 貸付株式数 | 3,000 株 |
| ダイセキ | 28,000 | 3,665.00 | 102,620,000 | 貸付株式数 | 5,400 株 |
| ステップ | 4,200 | 2,402.00 | 10,088,400 | | |

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 (円) | | 備考 |
|------------------|---------|-----------|-----------------|-----------------------------|
| | | 単価 | 金額 | |
| 泉州電業 | 7,600 | 4,325.00 | 32,870,000 | |
| GENKI GLOBAL DIN | 6,800 | 3,545.00 | 24,106,000 | 貸付株式数 2,600 株 |
| トラスコ中山 | 25,100 | 2,455.00 | 61,620,500 | |
| ヤマダホールディングス | 367,800 | 489.90 | 180,185,220 | 貸付株式数 144,400 株 |
| オートバックスセブン | 41,600 | 1,610.00 | 66,976,000 | |
| モリト | 9,500 | 1,563.00 | 14,848,500 | |
| アークランズ | 35,600 | 1,858.00 | 66,144,800 | 貸付株式数 13,900 株 |
| ニトリホールディングス | 43,500 | 14,230.00 | 619,005,000 | |
| グルメ杵屋 | 9,700 | 1,013.00 | 9,826,100 | 貸付株式数 3,700 株 |
| ケーユーホールディングス | 7,000 | 1,203.00 | 8,421,000 | |
| 吉野家ホールディングス | 46,800 | 3,078.00 | 144,050,400 | 貸付株式数 18,700 株 (4,400 株) |
| 加藤産業 | 14,800 | 5,820.00 | 86,136,000 | |
| イノテック | 8,100 | 1,555.00 | 12,595,500 | |
| イエローハット | 37,700 | 1,730.00 | 65,221,000 | |
| 松屋フーズ HLDGS | 5,600 | 6,520.00 | 36,512,000 | |
| JBCC ホールディングス | 30,000 | 1,382.00 | 41,460,000 | |
| JK ホールディングス | 9,200 | 1,315.00 | 12,098,000 | |
| サガミホールディングス | 19,200 | 1,885.00 | 36,192,000 | 貸付株式数 7,500 株 |
| 日伝 | 6,700 | 2,839.00 | 19,021,300 | 貸付株式数 2,600 株 |
| ミロク情報サービス | 9,600 | 1,868.00 | 17,932,800 | 貸付株式数 3,700 株 |
| 杉本商事 | 10,600 | 1,881.00 | 19,938,600 | 貸付株式数 4,100 株 |
| 因幡電機産業 | 33,600 | 4,231.00 | 142,161,600 | |
| 王将フードサービス | 21,900 | 3,895.00 | 85,300,500 | 貸付株式数 8,600 株 |
| ミニストップ | 9,900 | 1,999.00 | 19,790,100 | 貸付株式数 3,700 株 (1,200 株) |
| アークス | 20,100 | 3,120.00 | 62,712,000 | |
| バローホールディングス | 22,800 | 2,956.00 | 67,396,800 | |
| 東テク | 12,000 | 3,265.00 | 39,180,000 | |
| ミスミグループ本社 | 180,700 | 2,352.50 | 425,096,750 | |
| ベルク | 6,000 | 7,500.00 | 45,000,000 | |
| 大庄 | 8,100 | 1,219.00 | 9,873,900 | 貸付株式数 3,000 株 (300 株) |
| ファーストリテイリング | 80,700 | 49,180.00 | 3,968,826,000 | |
| ソフトバンクグループ | 559,200 | 15,865.00 | 8,871,708,000 | |
| スズケン | 36,600 | 6,074.00 | 222,308,400 | |
| サンドラッグ | 40,400 | 4,663.00 | 188,385,200 | |
| サックスバーホールディング | 11,400 | 814.00 | 9,279,600 | 貸付株式数 4,400 株 |
| ジェコス | 7,100 | 1,435.00 | 10,188,500 | |
| ベルーナ | 28,800 | 1,039.00 | 29,923,200 | 貸付株式数 11,500 株 |
| 合計 | | | 501,745,134,810 | |

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

リクルートホールディングス 35,000 株

| | |
|--------|----------|
| 日立 | 80,000 株 |
| トヨタ自動車 | 60,000 株 |
| 三菱商事 | 60,000 株 |

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

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

貸借対照表

| | 2024年9月9日現在 金額(円) | 2025年9月8日現在 金額(円) |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 2,406,309,279 | 1,766,114,327 |
| コール・ローン | 17,582,607,405 | 9,900,584,511 |
| 株式 | 523,045,340,869 | 757,500,641,996 |
| 投資証券 | 11,493,815,458 | 13,309,446,858 |
| 派生商品評価勘定 | 84,815,852 | 617,190,846 |
| 未収入金 | 5,497,286 | 5,217,441 |
| 未収配当金 | 717,628,521 | 996,828,909 |
| 差入委託証拠金 | 10,197,038,669 | 11,670,067,668 |
| 流動資産合計 | 565,533,053,339 | 795,766,092,556 |
| 資産合計 | 565,533,053,339 | 795,766,092,556 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 949,726,919 | 16,395,215 |
| 未払解約金 | 222,732,100 | 233,739,600 |
| 流動負債合計 | 1,172,459,019 | 250,134,815 |
| 負債合計 | 1,172,459,019 | 250,134,815 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ※1 93,061,760,460 | 104,047,824,431 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△) | 471,298,833,860 | 691,468,133,310 |
| 元本等合計 | 564,360,594,320 | 795,515,957,741 |
| 純資産合計 | 564,360,594,320 | 795,515,957,741 |
| 負債純資産合計 | 565,533,053,339 | 795,766,092,556 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | 自 2024 年 9 月 10 日 至 2025 年 9 月 8 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 | 受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 |

| 区分 | 自 2024 年 9 月 10 日 至 2025 年 9 月 8 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 | 外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計算処理を採用しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 2024 年 9 月 9 日現在 | 2025 年 9 月 8 日現在 |
|---|------------------|------------------|
| 1. ※1 期首 | | |
| 期首元本額 | 2023 年 9 月 8 日 | 2024 年 9 月 10 日 |
| 期中追加設定元本額 | 76,227,957,902 円 | 93,061,760,460 円 |
| 期中一部解約元本額 | 23,020,134,056 円 | 21,371,093,246 円 |
| 期末元本額の内訳 | 6,186,331,498 円 | 10,385,029,275 円 |
| ファンド名 | | |
| ダイワ外国株式インデックス V A | 225,230,635 円 | 192,198,754 円 |
| ダイワ国内重視バランスファン ド 30 VA (一般投資家私募) | 1,402,785 円 | 1,234,305 円 |
| ダイワ国内重視バランスファン ド 50 VA (一般投資家私募) | 18,086,551 円 | 11,989,943 円 |
| ダイワ国際分散バランスファン ド 30 VA (一般投資家私募) | 3,444,397 円 | 2,754,773 円 |
| ダイワ国際分散バランスファン ド 50 VA (一般投資家私募) | 100,489,854 円 | 67,623,886 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) | 114,106,768 円 | 130,117,188 円 |
| ダイワバランスファンド 2023-01 (適格機関投資家専用) | 78,362,997 円 | - 円 |
| 外国株式インデックスファンド VA (適格機関投資家専用) | 6,770,830,091 円 | 10,267,068,143 円 |
| ダイワファンドラップ 外国株式 インデックス エマージングプラ ス (為替ヘッジなし) | 768,590,433 円 | 801,580,315 円 |
| ダイワファンドラップ 外国株式 インデックス (為替ヘッジな し) | 5,609,050,842 円 | 7,198,599,110 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) | 566,472,797 円 | 623,922,392 円 |

| 区分 | 2024年9月9日現在 | 2025年9月8日現在 |
|-----------------------------------|------------------|------------------|
| D—I's 外国株式インデックス | 16,325,240 円 | 16,032,487 円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2050 | 49,059,003 円 | 46,323,427 円 |
| i Free 外国株式インデックス (為替ヘッジなし) | 9,171,696,796 円 | 11,398,215,544 円 |
| i Free 8資産バランス | 1,497,529,348 円 | 1,654,770,220 円 |
| i Free 年金バランス | 353,932,925 円 | 376,810,408 円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2060 | 19,363,392 円 | 28,366,515 円 |
| DCダイワ外国株式インデックス | 50,556,549,718 円 | 51,206,730,357 円 |
| ダイワ・ライフ・バランス30 | 460,963,110 円 | 416,840,512 円 |
| ダイワ・ライフ・バランス50 | 1,034,239,767 円 | 1,041,465,511 円 |
| ダイワ・ライフ・バランス70 | 1,027,431,638 円 | 1,026,598,684 円 |
| 大和DC海外株式インデックスファンド | 1,242,109,512 円 | 1,001,937,576 円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2030 | 10,009,386 円 | 8,336,933 円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2040 | 11,822,069 円 | 12,817,010 円 |
| ダイワつみたてインデックス外国株式 | 2,670,717,096 円 | 3,302,481,265 円 |
| ダイワつみたてインデックスバランス30 | 1,865,562 円 | 1,847,918 円 |
| ダイワつみたてインデックスバランス50 | 2,794,350 円 | 2,909,261 円 |
| ダイワつみたてインデックスバランス70 | 5,889,309 円 | 49,014,860 円 |
| ダイワ先進国株式インデックス (為替ヘッジなし) (投資一任専用) | 14,825,536 円 | 26,974,602 円 |
| ダイワ世界バランスファンド40VA | 42,895,445 円 | 35,348,939 円 |
| ダイワ世界バランスファンド60VA | 30,065,390 円 | 26,443,512 円 |
| ダイワ・バランスファンド35VA | 701,581,123 円 | 533,143,468 円 |
| ダイワ・バランスファンド25VA (適格機関投資家専用) | 39,452,864 円 | 31,278,177 円 |
| ダイワバランスファンド2021-02 (適格機関投資家専用) | 123,320,896 円 | 101,775,161 円 |
| スタイル9 (4資産分散・保守型) | 221,681 円 | 583,729 円 |
| スタイル9 (4資産分散・バランス型) | 1,758,388 円 | 4,162,742 円 |
| スタイル9 (4資産分散・積極型) | 2,513,560 円 | 6,468,033 円 |
| スタイル9 (6資産分散・保守型) | 109,963 円 | 234,282 円 |

| 区分 | 2024年9月9日現在 | 2025年9月8日現在 |
|------------------------------------|------------------|-------------------|
| スタイル9 (6 資産分散・バランス型) | 3,149,074 円 | 7,549,429 円 |
| スタイル9 (6 資産分散・積極型) | 3,708,744 円 | 8,901,409 円 |
| スタイル9 (8 資産分散・保守型) | 155,698 円 | 327,040 円 |
| スタイル9 (8 資産分散・バランス型) | 2,264,732 円 | 6,033,151 円 |
| スタイル9 (8 資産分散・積極型) | 7,098,499 円 | 16,898,996 円 |
| 全世界株式インデックス・ファンド (オール・カントリー) | -円 | 735,360,420 円 |
| ダイワ・インデックスセレクト外国株式 | 1,260,299,293 円 | 1,067,249,741 円 |
| ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド | 429,563,603 円 | 397,969,549 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) | 4,486,545,620 円 | 6,583,036,742 円 |
| ダイワ投信俱楽部外国株式インデックス | 3,226,456,468 円 | 3,382,181,383 円 |
| ダイワライフスタイル25 | 7,236,293 円 | 6,079,272 円 |
| ダイワライフスタイル50 | 33,086,936 円 | 30,353,563 円 |
| ダイワライフスタイル75 | 28,903,662 円 | 27,233,403 円 |
| ダイワバランスファンド 2023-08 (適格機関投資家専用) | 78,106,048 円 | -円 |
| ダイワバランスファンド 2024-01 (適格機関投資家専用) | 75,686,081 円 | 62,203,629 円 |
| ダイワバランスファンド 2024-05 (適格機関投資家専用) | 74,388,492 円 | 61,446,762 円 |
| 計 | 93,061,760,460 円 | 104,047,824,431 円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 93,061,760,460 口 | 104,047,824,431 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 2024年9月10日 至 2025年9月8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 2024 年 9 月 10 日 至 2025 年 9 月 8 日 |
|----------------------------|---|
| 2. 金融商品の内容及びリスク | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品は、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。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用してあります。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いをして、投資信託約款に従って為替予約取引を利用してあります。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>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。</p> <p>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。</p> |

II 金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | 2025 年 9 月 8 日現在 |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 金融商品の時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 2024 年 9 月 9 日現在 | 2025 年 9 月 8 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 | 63, 172, 648, 855 | 55, 681, 365, 221 |
| 投資証券 | 1, 573, 922, 346 | △689, 918, 293 |
| 合計 | 64, 746, 571, 201 | 54, 991, 446, 928 |

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

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

1. 株式関連

| 種類 | 2024年9月9日現在 | | | 2025年9月8日現在 | | |
|-----------|----------------|-----------|----------------|--------------|----------------|-------------|
| | 契約額等 (円) | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 (円) | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| うち 1年超 | | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引 | | | | | | |
| 株価指数先物取引 | | | | | | |
| 買建 | 30,336,842,208 | - | 29,698,800,021 | △638,042,187 | 23,843,762,547 | - |
| 合計 | 30,336,842,208 | - | 29,698,800,021 | △638,042,187 | 23,843,762,547 | - |
| | | | | | | |
| | | | | | | |

(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。

1. 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。
2. 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。
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。

2. 通貨関連

| 種類 | 2024年9月9日現在 | | | 2025年9月8日現在 | | |
|------------|----------------|-----------|----------------|--------------|---------------|-------------|
| | 契約額等 (円) | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 (円) | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| うち 1年超 | | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | |
| 買建 | 17,336,313,480 | - | 17,109,444,600 | △226,868,880 | 9,651,828,570 | - |
| アメリカ・ドル | 10,837,406,950 | - | 10,733,910,500 | △103,496,450 | 5,057,889,070 | - |
| イギリス・ポンド | 1,158,743,640 | - | 1,139,211,600 | △19,532,040 | 614,974,180 | - |
| オーストラリア・ドル | 754,949,600 | - | 730,976,400 | △23,973,200 | 529,028,190 | - |
| カナダ・ドル | 1,796,310,930 | - | 1,752,035,410 | △44,275,520 | 1,391,779,060 | - |
| スイス・フラン | 1,336,818,600 | - | 1,317,464,460 | △19,354,140 | 938,822,340 | - |
| ユーロ | 1,452,083,760 | - | 1,435,846,230 | △16,237,530 | 1,119,335,730 | - |
| 合計 | 17,336,313,480 | - | 17,109,444,600 | △226,868,880 | 9,651,828,570 | - |
| | | | | | | |
| | | | | | | |

(注) 1. 時価の算定方法

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

(1 口当たり情報)

| | 2024 年 9 月 9 日現在 | 2025 年 9 月 8 日現在 |
|-----------------------------|------------------------|------------------------|
| 1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額) | 6.0644 円 (60,644 円) | 7.6457 円 (76,457 円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|---------|------------------------------------|-----------|-----------|-----------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| アメリカ・ドル | BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC | 8,300 | 251.020 | 2,083,466.000 | |
| | PALO ALTO NETWORKS INC | 47,100 | 194.460 | 9,159,066.000 | |
| | FIRST SOLAR INC | 7,200 | 205.140 | 1,477,008.000 | |
| | KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC | 12,200 | 167.900 | 2,048,380.000 | |
| | BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS INC | 8,800 | 102.450 | 901,560.000 | |
| | SYNCHRONY FINANCIAL INC | 26,900 | 75.610 | 2,033,909.000 | |
| | ABBOTT LABORATORIES INC | 122,766 | 132.940 | 16,320,512.040 | |
| | HOWMET AEROSPACE INC | 27,083 | 178.200 | 4,826,190.600 | |
| | VERISK ANALYTICS INC | 9,900 | 270.310 | 2,676,069.000 | |
| | LAS VEGAS SANDS CORP | 25,000 | 53.700 | 1,342,500.000 | |
| | AMPHENOL CORP-CL A | 85,400 | 110.450 | 9,432,430.000 | |
| | MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 3,400 | 865.860 | 2,943,924.000 | |
| | FIDELITY NATIONAL INFO SERV | 37,100 | 68.740 | 2,550,254.000 | |
| | AFLAC INC | 36,300 | 106.930 | 3,881,559.000 | |
| | DARDEN RESTAURANTS INC | 8,300 | 210.140 | 1,744,162.000 | |
| | LIVE NATION ENTERTAINMENT INC | 11,500 | 163.420 | 1,879,330.000 | |
| | ADOBE INC | 29,920 | 348.970 | 10,441,182.400 | |
| | CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 11,600 | 84.480 | 979,968.000 | |
| | LULULEMON ATHLETICA INC | 7,700 | 167.800 | 1,292,060.000 | |
| | GARMIN LTD | 11,600 | 237.390 | 2,753,724.000 | |
| | AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 15,700 | 289.860 | 4,550,802.000 | |
| | HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 45,400 | 214.250 | 9,726,950.000 | |
| | WR BERKLEY CORP | 21,413 | 71.960 | 1,540,879.480 | |
| | AUTOZONE INC | 1,220 | 4,219.410 | 5,147,680.200 | |
| | DOLLAR TREE INC | 13,971 | 101.120 | 1,412,747.520 | |
| | TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR | 83,800 | 18.950 | 1,588,010.000 | |
| | DR HORTON INC | 19,516 | 181.800 | 3,548,008.800 | |
| | AUTODESK INC | 15,100 | 326.370 | 4,928,187.000 | |
| | MOODY'S CORP | 11,500 | 499.030 | 5,738,845.000 | |
| | DEVON ENERGY CORP | 42,700 | 34.760 | 1,484,252.000 | |
| | ATMOS ENERGY CORP | 11,300 | 166.480 | 1,881,224.000 | |
| | ALLIANT ENERGY CORP | 18,200 | 64.620 | 1,176,084.000 | |
| | CITIGROUP INC | 129,773 | 95.400 | 12,380,344.200 | |
| | AUTOMATIC DATA PROCESSING | 28,700 | 295.970 | 8,494,339.000 | |
| | AMERICAN ELECTRIC POWER | 37,700 | 108.110 | 4,075,747.000 | |
| | DOMINO'S PIZZA INC | 2,330 | 463.830 | 1,080,723.900 | |
| | DAVITA INC | 2,950 | 137.870 | 406,716.500 | |
| | DANAHER CORP | 45,450 | 200.210 | 9,099,544.500 | |
| | FORTIVE CORP | 24,000 | 47.870 | 1,148,880.000 | |
| | INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 40,500 | 174.270 | 7,057,935.000 | |
| | ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 33,900 | 62.940 | 2,133,666.000 | |
| | APPLE INC | 1,054,800 | 239.690 | 252,825,012.000 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----|------------------------------|---------|-----------|-----------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| | BOEING CO/THE | 53,200 | 229.610 | 12,215,252.000 | |
| | CINCINNATI FINANCIAL CORP | 11,115 | 153.360 | 1,704,596.400 | |
| | BECTON DICKINSON AND CO | 20,299 | 192.390 | 3,905,324.610 | |
| | LEIDOS HOLDINGS INC | 8,700 | 179.000 | 1,557,300.000 | |
| | NISOURCE INC | 33,300 | 40.330 | 1,342,989.000 | |
| | C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 8,400 | 126.130 | 1,059,492.000 | |
| | BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 50,471 | 103.690 | 5,233,337.990 | |
| | VERIZON COMMUNICATIONS INC | 297,504 | 44.380 | 13,203,227.520 | |
| | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 95,650 | 499.770 | 47,803,000.500 | |
| | TRUIST FINANCIAL CORP | 92,417 | 46.520 | 4,299,238.840 | |
| | BLACKSTONE GROUP INC/THE | 51,500 | 169.990 | 8,754,485.000 | |
| | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 143,600 | 47.140 | 6,769,304.000 | |
| | JPMORGAN CHASE & CO | 196,070 | 294.380 | 57,719,086.600 | |
| | T ROWE PRICE GROUP INC | 15,600 | 108.160 | 1,687,296.000 | |
| | BROWN-FORMAN CORP-CLASS B | 12,912 | 28.910 | 373,285.920 | |
| | CADENCE DESIGN SYS INC | 19,300 | 351.010 | 6,774,493.000 | |
| | AMERIPRISE FINANCIAL INC | 6,800 | 489.280 | 3,327,104.000 | |
| | DOLLAR GENERAL CORP | 15,600 | 109.280 | 1,704,768.000 | |
| | SERVICENOW INC | 14,700 | 913.800 | 13,432,860.000 | |
| | CATERPILLAR INC | 33,200 | 423.080 | 14,046,256.000 | |
| | BROWN & BROWN INC | 21,000 | 94.790 | 1,990,590.000 | |
| | ESSENTIAL UTILITIES INC | 19,900 | 39.350 | 783,065.000 | |
| | CMS ENERGY CORP | 21,200 | 71.550 | 1,516,860.000 | |
| | DELTA AIR LINES INC | 11,600 | 61.180 | 709,688.000 | |
| | CORNING INC | 57,400 | 71.190 | 4,086,306.000 | |
| | CISCO SYSTEMS INC | 280,650 | 66.900 | 18,775,485.000 | |
| | MORGAN STANLEY | 84,552 | 148.090 | 12,521,305.680 | |
| | DECKERS OUTDOOR CORP | 10,600 | 120.400 | 1,276,240.000 | |
| | MSCI INC | 5,500 | 555.150 | 3,053,325.000 | |
| | FAIR ISAAC CORP | 1,800 | 1,531.990 | 2,757,582.000 | |
| | LENNOX INTERNATIONAL INC | 2,300 | 578.050 | 1,329,515.000 | |
| | SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS | 15,700 | 88.800 | 1,394,160.000 | |
| | BROADCOM INC | 315,220 | 334.890 | 105,564,025.800 | |
| | UNITED THERAPEUTICS CORP | 3,100 | 400.520 | 1,241,612.000 | |
| | CNH INDUSTRIAL NV | 61,700 | 11.460 | 707,082.000 | |
| | DICK'S SPORTING GOODS INC | 4,000 | 221.240 | 884,960.000 | |
| | ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 9,200 | 452.000 | 4,158,400.000 | |
| | DTE ENERGY COMPANY | 14,700 | 136.600 | 2,008,020.000 | |
| | CENTENE CORP | 35,107 | 28.980 | 1,017,400.860 | |
| | CBOE GLOBAL MARKETS INC | 7,400 | 232.580 | 1,721,092.000 | |
| | CITIZENS FINANCIAL GROUP | 30,600 | 51.710 | 1,582,326.000 | |
| | ARTHUR J GALLAGHER & CO | 18,100 | 299.180 | 5,415,158.000 | |
| | GARTNER INC | 5,450 | 245.910 | 1,340,209.500 | |
| | DOMINION ENERGY INC | 60,241 | 58.190 | 3,505,423.790 | |
| | MONSTER BEVERAGE CORP | 51,600 | 62.460 | 3,222,936.000 | |
| | DEERE & CO | 18,200 | 473.260 | 8,613,332.000 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----|------------------------------|---------|-----------|----------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| | QUANTA SERVICES INC | 10,500 | 372.500 | 3,911,250.000 | |
| | POOL CORP | 2,600 | 333.090 | 866,034.000 | |
| | GLOBAL PAYMENTS INC | 17,284 | 87.780 | 1,517,189.520 | |
| | BURLINGTON STORES INC | 4,500 | 291.200 | 1,310,400.000 | |
| | NASDAQ INC | 30,400 | 93.480 | 2,841,792.000 | |
| | TARGA RESOURCES CORP | 15,300 | 162.350 | 2,483,955.000 | |
| | AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 4,800 | 138.650 | 665,520.000 | |
| | CONSOLIDATED EDISON INC | 25,500 | 98.050 | 2,500,275.000 | |
| | HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC | 5,500 | 143.730 | 790,515.000 | |
| | WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 5,100 | 250.730 | 1,278,723.000 | |
| | VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A | 11,000 | 272.930 | 3,002,230.000 | |
| | MOLINA HEALTHCARE INC | 3,900 | 174.650 | 681,135.000 | |
| | CARLISLE COS INC | 3,100 | 396.200 | 1,228,220.000 | |
| | IDEX CORP | 5,400 | 164.930 | 890,622.000 | |
| | COLGATE-PALMOLIVE CO | 54,400 | 85.130 | 4,631,072.000 | |
| | ROLLINS INC | 20,607 | 56.520 | 1,164,707.640 | |
| | AECOM | 9,400 | 126.620 | 1,190,228.000 | |
| | WATSCO INC | 2,500 | 408.980 | 1,022,450.000 | |
| | GRACO INC | 11,700 | 85.870 | 1,004,679.000 | |
| | AMETEK INC | 16,300 | 187.450 | 3,055,435.000 | |
| | CHURCH & DWIGHT CO INC | 17,400 | 95.800 | 1,666,920.000 | |
| | HEICO CORP | 3,200 | 321.620 | 1,029,184.000 | |
| | FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 2,700 | 371.010 | 1,001,727.000 | |
| | LYONDELLBASELL INDU-CL A | 18,200 | 55.080 | 1,002,456.000 | |
| | TYLER TECHNOLOGIES INC | 3,100 | 559.960 | 1,735,876.000 | |
| | COSTCO WHOLESALE CORP | 31,360 | 963.480 | 30,214,732.800 | |
| | RPM INTERNATIONAL INC | 9,100 | 126.620 | 1,152,242.000 | |
| | RELIANCE INC | 3,800 | 298.990 | 1,136,162.000 | |
| | CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 95,100 | 41.060 | 3,904,806.000 | |
| | CUMMINS INC | 9,800 | 399.850 | 3,918,530.000 | |
| | CDW CORP/DE | 9,300 | 169.730 | 1,578,489.000 | |
| | COSTAR GROUP INC | 29,800 | 89.460 | 2,665,908.000 | |
| | OLD DOMINION FREIGHT LINE | 13,500 | 150.710 | 2,034,585.000 | |
| | INTERACTIVE BROKERS GRO-CL A | 30,800 | 60.160 | 1,852,928.000 | |
| | MERCADOLIBRE INC | 3,290 | 2,417.490 | 7,953,542.100 | |
| | JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 5,200 | 162.240 | 843,648.000 | |
| | HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 16,816 | 272.300 | 4,578,996.800 | |
| | DEXCOM INC | 27,700 | 80.510 | 2,230,127.000 | |
| | NORDSON CORP | 3,790 | 225.030 | 852,863.700 | |
| | COPART INC | 64,800 | 48.570 | 3,147,336.000 | |
| | DIAMONDBACK ENERGY INC | 13,400 | 138.710 | 1,858,714.000 | |
| | ALIGN TECHNOLOGY INC | 4,900 | 139.120 | 681,688.000 | |
| | LPL FINANCIAL HOLDINGS INC | 5,700 | 332.990 | 1,898,043.000 | |
| | TRANSDIGM GROUP INC | 3,990 | 1,271.040 | 5,071,449.600 | |
| | NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | 7,000 | 144.100 | 1,008,700.000 | |
| | KINDER MORGAN INC | 141,081 | 26.590 | 3,751,343.790 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----|------------------------------|---------|-----------|-----------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| | HCA HEALTHCARE INC | 12,800 | 420.770 | 5,385,856.000 | |
| | COTERRA ENERGY INC | 53,900 | 23.980 | 1,292,522.000 | |
| | T-MOBILE US INC | 36,227 | 252.760 | 9,156,736.520 | |
| | ZILLOW GROUP INC - C | 11,650 | 87.890 | 1,023,918.500 | |
| | EMCOR GROUP INC | 3,200 | 625.400 | 2,001,280.000 | |
| | COCA-COLA CO/THE | 288,450 | 67.960 | 19,603,062.000 | |
| | COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE | 15,900 | 88.880 | 1,413,192.000 | |
| | EXPEDITORS INTL WASH INC | 9,750 | 120.910 | 1,178,872.500 | |
| | CSX CORP | 132,500 | 32.530 | 4,310,225.000 | |
| | EXPEDIA GROUP INC | 8,625 | 214.950 | 1,853,943.750 | |
| | AMAZON.COM INC | 674,100 | 232.330 | 156,613,653.000 | |
| | EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 41,400 | 80.940 | 3,350,916.000 | |
| | EXXON MOBIL CORP | 304,009 | 109.230 | 33,206,903.070 | |
| | EVEREST GROUP LTD | 3,000 | 340.000 | 1,020,000.000 | |
| | EOG RESOURCES INC | 38,500 | 117.930 | 4,540,305.000 | |
| | EQT CORP | 41,900 | 51.600 | 2,162,040.000 | |
| | AKAMAI TECHNOLOGIES INC | 10,400 | 78.560 | 817,024.000 | |
| | FIRST CITIZENS BCSHS -CL A | 700 | 1,925.260 | 1,347,682.000 | |
| | CENCORA INC | 13,000 | 292.500 | 3,802,500.000 | |
| | AGILENT TECHNOLOGIES INC | 20,100 | 128.750 | 2,587,875.000 | |
| | FORD MOTOR CO | 275,523 | 11.740 | 3,234,640.020 | |
| | ENTEGRIS INC | 10,700 | 81.980 | 877,186.000 | |
| | STRATEGY INC CLASS A | 18,500 | 335.870 | 6,213,595.000 | |
| | AERCAP HOLDINGS NV | 12,200 | 123.530 | 1,507,066.000 | |
| | FORTINET INC | 45,900 | 78.830 | 3,618,297.000 | |
| | MARKEL CORP | 900 | 1,912.130 | 1,720,917.000 | |
| | NEXTERA ENERGY INC | 145,280 | 70.900 | 10,300,352.000 | |
| | FREEPORT-MCMORAN INC | 101,308 | 46.340 | 4,694,612.720 | |
| | INSULET CORP | 5,000 | 348.430 | 1,742,150.000 | |
| | US BANCORP | 110,000 | 48.800 | 5,368,000.000 | |
| | UNITED RENTALS INC | 4,600 | 975.230 | 4,486,058.000 | |
| | F5 NETWORKS INC | 4,100 | 315.890 | 1,295,149.000 | |
| | SUPER MICRO COMPUTER INC | 35,800 | 40.410 | 1,446,678.000 | |
| | FASTENAL CO | 81,000 | 47.990 | 3,887,190.000 | |
| | FISERV INC | 39,133 | 135.050 | 5,284,911.650 | |
| | GENERAL ELECTRIC CO | 75,306 | 279.230 | 21,027,694.380 | |
| | AXON ENTERPRISE INC | 5,300 | 728.410 | 3,860,573.000 | |
| | GENERAL MOTORS CO | 67,900 | 58.270 | 3,956,533.000 | |
| | GENERAL DYNAMICS CORP | 16,100 | 322.860 | 5,198,046.000 | |
| | GOLDMAN SACHS GROUP INC | 21,650 | 738.210 | 15,982,246.500 | |
| | ALPHABET INC-CL A | 410,600 | 235.000 | 96,491,000.000 | |
| | ALPHABET INC-CL C | 346,540 | 235.170 | 81,495,811.800 | |
| | OWENS CORNING | 6,000 | 155.590 | 933,540.000 | |
| | GENERAL MILLS INC | 38,300 | 50.580 | 1,937,214.000 | |
| | FIRSTENERGY CORP | 38,718 | 43.480 | 1,683,458.640 | |
| | GENUINE PARTS CO | 9,850 | 139.500 | 1,374,075.000 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----|-----------------------------|----------|----------|--------------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| | FIFTH THIRD BANCORP | 47, 100 | 45. 620 | 2, 148, 702. 000 | |
| | L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 13, 250 | 272. 390 | 3, 609, 167. 500 | |
| | HALLIBURTON CO | 60, 700 | 22. 100 | 1, 341, 470. 000 | |
| | HOME DEPOT INC | 70, 250 | 418. 950 | 29, 431, 237. 500 | |
| | HUNTINGTON BANCSHARES INC | 102, 800 | 17. 630 | 1, 812, 364. 000 | |
| | HERSHEY CO/THE | 10, 500 | 185. 480 | 1, 947, 540. 000 | |
| | HUMANA INC | 8, 600 | 307. 920 | 2, 648, 112. 000 | |
| | NXP SEMICONDUCTORS NV | 17, 900 | 226. 740 | 4, 058, 646. 000 | |
| | HP INC | 66, 300 | 29. 340 | 1, 945, 242. 000 | |
| | HEWLETT PACKARD ENTERPRISE | 92, 600 | 23. 520 | 2, 177, 952. 000 | |
| | ARCH CAPITAL GROUP LTD | 26, 500 | 91. 290 | 2, 419, 185. 000 | |
| | KRAFT HEINZ CO/THE | 62, 603 | 27. 290 | 1, 708, 435. 870 | |
| | INTL BUSINESS MACHINES CORP | 65, 600 | 248. 530 | 16, 303, 568. 000 | |
| | HUBBELL INC | 3, 800 | 436. 040 | 1, 656, 952. 000 | |
| | INTERNATIONAL PAPER CO | 35, 400 | 48. 690 | 1, 723, 626. 000 | |
| | ZOETIS INC | 31, 500 | 153. 320 | 4, 829, 580. 000 | |
| | TRANE TECHNOLOGIES PLC | 15, 799 | 413. 830 | 6, 538, 100. 170 | |
| | CHENIERE ENERGY INC | 15, 700 | 235. 780 | 3, 701, 746. 000 | |
| | HYATT HOTELS CORP - CL A | 3, 000 | 144. 950 | 434, 850. 000 | |
| | ALLEGION PLC | 6, 150 | 171. 860 | 1, 056, 939. 000 | |
| | BUILDERS FIRSTSOURCE INC | 7, 900 | 149. 210 | 1, 178, 759. 000 | |
| | WASTE CONNECTIONS INC | 18, 237 | 179. 300 | 3, 269, 894. 100 | |
| | JM SMUCKER CO/THE | 7, 600 | 112. 510 | 855, 076. 000 | |
| | JOHNSON & JOHNSON | 169, 800 | 178. 430 | 30, 297, 414. 000 | |
| | ABBVIE INC | 124, 672 | 212. 560 | 26, 500, 280. 320 | |
| | HOLOGIC INC | 15, 800 | 66. 760 | 1, 054, 808. 000 | |
| | KIMBERLY-CLARK CORP | 23, 500 | 129. 890 | 3, 052, 415. 000 | |
| | KROGER CO | 44, 400 | 67. 750 | 3, 008, 100. 000 | |
| | KLA CORP | 9, 400 | 905. 090 | 8, 507, 846. 000 | |
| | LOCKHEED MARTIN CORP | 14, 900 | 463. 900 | 6, 912, 110. 000 | |
| | CORPAY INC | 4, 800 | 316. 650 | 1, 519, 920. 000 | |
| | LOWE'S COS INC | 39, 600 | 269. 970 | 10, 690, 812. 000 | |
| | ELI LILLY & CO | 56, 885 | 727. 210 | 41, 367, 340. 850 | |
| | LAM RESEARCH CORP | 90, 300 | 102. 950 | 9, 296, 385. 000 | |
| | LOEWS CORP | 12, 600 | 96. 640 | 1, 217, 664. 000 | |
| | MCDONALD'S CORP | 50, 450 | 314. 380 | 15, 860, 471. 000 | |
| | 3M CO | 37, 990 | 155. 300 | 5, 899, 847. 000 | |
| | META PLATFORMS INC CLASS A | 153, 200 | 752. 450 | 115, 275, 340. 000 | |
| | S&P GLOBAL INC | 22, 239 | 538. 060 | 11, 965, 916. 340 | |
| | MARTIN MARIETTA MATERIALS | 4, 300 | 622. 640 | 2, 677, 352. 000 | |
| | PHILLIPS 66 | 28, 800 | 131. 550 | 3, 788, 640. 000 | |
| | ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A | 11, 800 | 172. 430 | 2, 034, 674. 000 | |
| | MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | 17, 900 | 70. 910 | 1, 269, 289. 000 | |
| | METLIFE INC | 40, 300 | 79. 510 | 3, 204, 253. 000 | |
| | MARVELL TECHNOLOGY INC | 60, 900 | 63. 330 | 3, 856, 797. 000 | |
| | ARISTA NETWORKS INC | 75, 300 | 142. 850 | 10, 756, 605. 000 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----|------------------------------|---------|-----------|----------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| | MOTOROLA SOLUTIONS INC | 11,798 | 478.980 | 5,651,006.040 | |
| | METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL | 1,500 | 1,305.710 | 1,958,565.000 | |
| | BAKER HUGHES CO | 69,923 | 45.580 | 3,187,090.340 | |
| | ROCKWELL AUTOMATION INC | 8,000 | 339.760 | 2,718,080.000 | |
| | MERCK & CO. INC. | 177,121 | 84.710 | 15,003,919.910 | |
| | DUPONT DE NEMOURS INC | 29,551 | 77.820 | 2,299,658.820 | |
| | MASCO CORP | 14,900 | 76.070 | 1,133,443.000 | |
| | M & T BANK CORP | 11,399 | 199.570 | 2,274,898.430 | |
| | MARSH & MCLENNAN COS | 34,770 | 203.740 | 7,084,039.800 | |
| | HEICO CORP-CLASS A | 5,420 | 252.340 | 1,367,682.800 | |
| | MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A | 16,502 | 264.700 | 4,368,079.400 | |
| | WORKDAY INC-CLASS A | 15,300 | 231.080 | 3,535,524.000 | |
| | BLOCK INC CLASS A | 39,212 | 74.940 | 2,938,547.280 | |
| | TRANSUNION | 13,800 | 90.020 | 1,242,276.000 | |
| | VISTRA CORP | 24,000 | 188.000 | 4,512,000.000 | |
| | NETAPP INC | 14,300 | 118.750 | 1,698,125.000 | |
| | NIKE INC -CL B | 83,200 | 73.910 | 6,149,312.000 | |
| | NORFOLK SOUTHERN CORP | 15,900 | 277.750 | 4,416,225.000 | |
| | MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 38,100 | 65.920 | 2,511,552.000 | |
| | RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 13,605 | 165.500 | 2,251,627.500 | |
| | NORTHROP GRUMMAN CORP | 9,700 | 580.800 | 5,633,760.000 | |
| | NEWMONT CORP | 77,611 | 76.170 | 5,911,629.870 | |
| | MCKESSON CORP | 8,900 | 687.400 | 6,117,860.000 | |
| | XYLEM INC | 17,200 | 140.560 | 2,417,632.000 | |
| | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 109,800 | 161.550 | 17,738,190.000 | |
| | NUCOR CORP | 16,300 | 147.260 | 2,400,338.000 | |
| | SPOTIFY TECHNOLOGY SA | 11,200 | 707.190 | 7,920,528.000 | |
| | GODADDY INC - CLASS A | 10,100 | 145.240 | 1,466,924.000 | |
| | EVERGY INC | 16,250 | 71.600 | 1,163,500.000 | |
| | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 52,224 | 45.910 | 2,397,603.840 | |
| | ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A | 1,850 | 335.070 | 619,879.500 | |
| | OKTA INC | 11,800 | 91.480 | 1,079,464.000 | |
| | WIX.COM LTD | 4,110 | 153.100 | 629,241.000 | |
| | EQUITABLE HOLDINGS INC | 21,300 | 53.370 | 1,136,781.000 | |
| | KKR & CO INC | 44,000 | 135.530 | 5,963,320.000 | |
| | PAYCHEX INC | 22,900 | 135.440 | 3,101,576.000 | |
| | O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 60,300 | 104.840 | 6,321,852.000 | |
| | ALTRIA GROUP INC | 118,900 | 66.550 | 7,912,795.000 | |
| | P G & E CORP | 155,100 | 15.090 | 2,340,459.000 | |
| | PFIZER INC | 401,113 | 24.880 | 9,979,691.440 | |
| | CIGNA CORP | 18,900 | 305.310 | 5,770,359.000 | |
| | DELL TECHNOLOGIES -C | 22,901 | 124.830 | 2,858,731.830 | |
| | XCEL ENERGY INC | 40,700 | 72.680 | 2,958,076.000 | |
| | STERIS PLC | 7,000 | 245.300 | 1,717,100.000 | |
| | SEA LTD-ADR | 28,000 | 191.620 | 5,365,360.000 | |
| | FOX CORP - CLASS B | 9,833 | 55.970 | 550,353.010 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----|---------------------------------|---------|-----------|----------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| | FOX CORP - CLASS A | 15,099 | 61.500 | 928,588.500 | |
| | STRYKER CORP | 24,280 | 392.310 | 9,525,286.800 | |
| | DOW INC | 49,918 | 24.500 | 1,222,991.000 | |
| | TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A | 8,300 | 119.090 | 988,447.000 | |
| | ZOOM COMMUNICATIONS INC CLASS A | 17,400 | 83.680 | 1,456,032.000 | |
| | PARKER HANNIFIN CORP | 9,100 | 758.560 | 6,902,896.000 | |
| | UBER TECHNOLOGIES INC | 140,400 | 90.990 | 12,774,996.000 | |
| | PROCTER & GAMBLE CO/THE | 165,467 | 160.020 | 26,478,029.340 | |
| | EXELON CORP | 71,222 | 43.430 | 3,093,171.460 | |
| | INGERSOLL-RAND INC | 28,508 | 80.950 | 2,307,722.600 | |
| | NVR INC | 200 | 8,502.000 | 1,700,400.000 | |
| | CONOCOPHILLIPS | 89,103 | 92.950 | 8,282,123.850 | |
| | TWILIO INC - A | 10,800 | 108.670 | 1,173,636.000 | |
| | DOCUSIGN INC | 14,300 | 79.860 | 1,141,998.000 | |
| | PAYCOM SOFTWARE INC | 3,700 | 224.120 | 829,244.000 | |
| | PURE STORAGE INC - CLASS A | 22,000 | 79.230 | 1,743,060.000 | |
| | PEPSICO INC | 96,800 | 146.390 | 14,170,552.000 | |
| | CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 3,520 | 462.770 | 1,628,950.400 | |
| | MONGODB INC | 5,800 | 324.740 | 1,883,492.000 | |
| | SNAP INC - A | 74,900 | 7.310 | 547,519.000 | |
| | CORTEVA INC | 48,168 | 72.300 | 3,482,546.400 | |
| | PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 25,000 | 105.710 | 2,642,750.000 | |
| | AMCOR PLC | 161,800 | 8.300 | 1,342,940.000 | |
| | CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 17,600 | 417.630 | 7,350,288.000 | |
| | AMERICAN WATER WORKS CO INC | 13,800 | 143.600 | 1,981,680.000 | |
| | ACCENTURE PLC-CL A | 44,000 | 254.950 | 11,217,800.000 | |
| | PENTAIR PLC | 11,675 | 110.640 | 1,291,722.000 | |
| | QUALCOMM INC | 76,300 | 159.840 | 12,195,792.000 | |
| | PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 15,900 | 79.980 | 1,271,682.000 | |
| | DATADOG INC - CLASS A | 20,300 | 136.080 | 2,762,424.000 | |
| | PINTEREST INC- CLASS A | 42,000 | 37.940 | 1,593,480.000 | |
| | REGENERON PHARMACEUTICALS | 7,500 | 573.380 | 4,300,350.000 | |
| | REPUBLIC SERVICES INC | 15,500 | 229.730 | 3,560,815.000 | |
| | BOOKING HOLDINGS INC | 2,300 | 5,505.800 | 12,663,340.000 | |
| | ROSS STORES INC | 23,100 | 150.950 | 3,486,945.000 | |
| | PACKAGING CORP OF AMERICA | 6,430 | 220.250 | 1,416,207.500 | |
| | RESMED INC | 10,400 | 277.050 | 2,881,320.000 | |
| | QUEST DIAGNOSTICS INC | 7,930 | 183.490 | 1,455,075.700 | |
| | HUBSPOT INC | 3,580 | 487.530 | 1,745,357.400 | |
| | REVVITY INC | 8,400 | 86.640 | 727,776.000 | |
| | CARRIER GLOBAL CORP | 54,487 | 65.510 | 3,569,443.370 | |
| | OTIS WORLDWIDE CORP | 27,838 | 87.000 | 2,421,906.000 | |
| | CARLYLE GROUP INC/THE | 16,600 | 63.750 | 1,058,250.000 | |
| | DYNATRACE INC | 21,300 | 50.000 | 1,065,000.000 | |
| | TRADE DESK INC/THE -CLASS A | 31,400 | 52.070 | 1,634,998.000 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----|------------------------------------|---------|---------|----------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| | REGIONS FINANCIAL CORP | 63,485 | 27.030 | 1,715,999.550 | |
| | ROYALTY PHARMA PLC- CL A | 26,800 | 36.070 | 966,676.000 | |
| | CHEVRON CORP | 138,318 | 153.660 | 21,253,943.880 | |
| | ZSCALER INC | 7,200 | 274.200 | 1,974,240.000 | |
| | EDISON INTERNATIONAL | 27,200 | 54.450 | 1,481,040.000 | |
| | TESLA INC | 204,550 | 350.840 | 71,764,322.000 | |
| | SNOWFLAKE INC-CLASS A | 22,400 | 225.580 | 5,052,992.000 | |
| | GEN DIGITAL INC | 37,200 | 29.500 | 1,097,400.000 | |
| | SYNOPSYS INC | 13,139 | 598.140 | 7,858,961.460 | |
| | CARVANA CO | 8,600 | 368.880 | 3,172,368.000 | |
| | CLOUDFLARE INC - CLASS A | 22,000 | 214.430 | 4,717,460.000 | |
| | CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 6,305 | 261.500 | 1,648,757.500 | |
| | DOORDASH INC - A | 25,350 | 246.850 | 6,257,647.500 | |
| | ROBLOX CORP -CLASS A | 40,100 | 127.690 | 5,120,369.000 | |
| | AIRBNB INC-CLASS A | 30,500 | 123.810 | 3,776,205.000 | |
| | CBRE GROUP INC - A | 21,100 | 164.380 | 3,468,418.000 | |
| | SOUTHERN CO/THE | 77,600 | 91.780 | 7,122,128.000 | |
| | SYSCO CORP | 34,200 | 82.450 | 2,819,790.000 | |
| | TRAVELERS COS INC/THE | 16,003 | 275.220 | 4,404,345.660 | |
| | FUTU HOLDINGS LTD-ADR | 4,500 | 187.280 | 842,760.000 | |
| | STEEL DYNAMICS INC | 9,950 | 134.630 | 1,339,568.500 | |
| | SCHLUMBERGER LTD | 105,852 | 35.820 | 3,791,618.640 | |
| | AFFIRM HOLDINGS INC | 19,600 | 87.350 | 1,712,060.000 | |
| | AT&T INC | 507,691 | 29.590 | 15,022,576.690 | |
| | ON SEMICONDUCTOR CORP | 29,300 | 49.105 | 1,438,776.500 | |
| | SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 16,800 | 372.430 | 6,256,824.000 | |
| | SEMPRA ENERGY | 46,100 | 81.110 | 3,739,171.000 | |
| | BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B | 11,400 | 53.800 | 613,320.000 | |
| | PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A | 160,100 | 153.110 | 24,512,911.000 | |
| | SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS | 15,050 | 188.160 | 2,831,808.000 | |
| | COINBASE GLOBAL INC -CLASS A | 14,200 | 299.070 | 4,246,794.000 | |
| | TEXAS INSTRUMENTS INC | 64,100 | 187.930 | 12,046,313.000 | |
| | SALESFORCE INC | 67,466 | 250.760 | 16,917,774.160 | |
| | APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS | 28,309 | 131.550 | 3,724,048.950 | |
| | JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 46,434 | 106.230 | 4,932,683.820 | |
| | TERADYNE INC | 11,400 | 120.200 | 1,370,280.000 | |
| | UNION PACIFIC CORP | 42,180 | 220.310 | 9,292,675.800 | |
| | MARATHON PETROLEUM CORP | 21,688 | 180.280 | 3,909,912.640 | |
| | RTX CORP | 94,279 | 157.520 | 14,850,828.080 | |
| | UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 51,800 | 85.040 | 4,405,072.000 | |
| | IQVIA HOLDINGS INC | 12,204 | 187.680 | 2,290,446.720 | |
| | AMEREN CORPORATION | 19,500 | 100.630 | 1,962,285.000 | |
| | UNITEDHEALTH GROUP INC | 64,066 | 315.390 | 20,205,775.740 | |
| | APPLOVIN CORP CLASS A | 16,300 | 490.240 | 7,990,912.000 | |
| | TOAST INC CLASS A | 31,700 | 41.220 | 1,306,674.000 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----|-------------------------------------|-----------|-----------|-----------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| | VERISIGN INC | 6,000 | 280.090 | 1,680,540.000 | |
| | RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO) | 54,400 | 14.210 | 773,024.000 | |
| | ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO) | 51,400 | 101.250 | 5,204,250.000 | |
| | VALERO ENERGY CORP | 22,142 | 156.770 | 3,471,201.340 | |
| | SOFI TECHNOLOGIES INC | 80,700 | 25.600 | 2,065,920.000 | |
| | ULTA BEAUTY INC | 3,200 | 514.860 | 1,647,552.000 | |
| | FIDELITY NATIONAL FINANCIAL | 18,488 | 60.570 | 1,119,818.160 | |
| | UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 4,130 | 190.120 | 785,195.600 | |
| | ELEVANCE HEALTH INC | 16,000 | 313.640 | 5,018,240.000 | |
| | WALT DISNEY CO/THE | 126,862 | 117.910 | 14,958,298.420 | |
| | WELLS FARGO & CO | 227,122 | 78.960 | 17,933,553.120 | |
| | WASTE MANAGEMENT INC | 28,400 | 220.060 | 6,249,704.000 | |
| | WILLIAMS COS INC | 86,200 | 57.200 | 4,930,640.000 | |
| | TRACTOR SUPPLY COMPANY | 37,400 | 60.520 | 2,263,448.000 | |
| | WALMART INC | 309,600 | 100.510 | 31,117,896.000 | |
| | ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 14,000 | 105.730 | 1,480,220.000 | |
| | GRAB HOLDINGS CORP CLASS A | 173,200 | 5.160 | 893,712.000 | |
| | WABTEC CORP | 12,111 | 193.180 | 2,339,602.980 | |
| | TJX COMPANIES INC | 78,700 | 139.260 | 10,959,762.000 | |
| | WATERS CORP | 4,200 | 306.320 | 1,286,544.000 | |
| | UNITED AIRLINES HOLDINGS INC | 5,700 | 106.590 | 607,563.000 | |
| | ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 3,600 | 313.800 | 1,129,680.000 | |
| | WILLIS TOWERS WATSON PLC | 7,063 | 329.270 | 2,325,634.010 | |
| | WILLIAMS-SONOMA INC | 8,700 | 202.420 | 1,761,054.000 | |
| | WESTERN DIGITAL CORP | 24,700 | 92.040 | 2,273,388.000 | |
| | WEC ENERGY GROUP INC | 22,600 | 107.790 | 2,436,054.000 | |
| | PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 35,200 | 81.120 | 2,855,424.000 | |
| | VISA INC-CLASS A SHARES | 120,750 | 343.220 | 41,443,815.000 | |
| | PPL CORP | 52,200 | 35.960 | 1,877,112.000 | |
| | CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS | 22,124 | 301.580 | 6,672,155.920 | |
| | PULTEGROUP INC | 14,150 | 140.570 | 1,989,065.500 | |
| | WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES | 165,853 | 12.110 | 2,008,479.830 | |
| | PPG INDUSTRIES INC | 16,100 | 109.980 | 1,770,678.000 | |
| | NORTHERN TRUST CORP | 13,800 | 127.270 | 1,756,326.000 | |
| | NVIDIA CORP | 1,723,100 | 167.020 | 287,792,162.000 | |
| | PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 27,913 | 204.400 | 5,705,417.200 | |
| | DRAFTKINGS INC CLASS A | 31,500 | 46.560 | 1,466,640.000 | |
| | TYSON FOODS INC-CL A | 20,200 | 56.200 | 1,135,240.000 | |
| | NETFLIX INC | 30,090 | 1,243.820 | 37,426,543.800 | |
| | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 26,700 | 492.600 | 13,152,420.000 | |
| | NRG ENERGY INC | 13,850 | 147.660 | 2,045,091.000 | |
| | TEXTRON INC | 12,800 | 81.450 | 1,042,560.000 | |
| | NEWS CORP - CLASS A | 26,187 | 29.440 | 770,945.280 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----|------------------------------------|----------|----------|-------------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| | TEXAS PACIFIC LAND CORP | 1, 450 | 889. 190 | 1, 289, 325. 500 | |
| | OMNICOM GROUP | 13, 700 | 79. 430 | 1, 088, 191. 000 | |
| | JACOBS SOLUTIONS INC | 8, 520 | 145. 420 | 1, 238, 978. 400 | |
| | ORACLE CORP | 119, 533 | 232. 800 | 27, 827, 282. 400 | |
| | MASTERCARD INC - A | 60, 500 | 584. 220 | 35, 345, 310. 000 | |
| | ONEOK INC | 44, 100 | 72. 630 | 3, 202, 983. 000 | |
| | ROPER TECHNOLOGIES INC | 7, 600 | 518. 440 | 3, 940, 144. 000 | |
| | U HAUL NON VOTING SERIES N | 6, 900 | 53. 570 | 369, 633. 000 | |
| | ARES MANAGEMENT CORP CLASS A | 15, 300 | 177. 310 | 2, 712, 843. 000 | |
| | EXPAND ENERGY CORP | 16, 000 | 95. 510 | 1, 528, 160. 000 | |
| | YUM! BRANDS INC | 19, 700 | 144. 580 | 2, 848, 226. 000 | |
| | TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 13, 000 | 239. 680 | 3, 115, 840. 000 | |
| | MOLSON COORS BEVERAGE CO - B | 12, 600 | 50. 390 | 634, 914. 000 | |
| | BANK OF AMERICA CORP | 504, 601 | 49. 770 | 25, 113, 991. 770 | |
| | TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | 3, 400 | 549. 030 | 1, 866, 702. 000 | |
| | BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 13, 600 | 57. 770 | 785, 672. 000 | |
| | AMERICAN EXPRESS CO | 39, 600 | 326. 220 | 12, 918, 312. 000 | |
| | GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES | 32, 335 | 75. 730 | 2, 448, 729. 550 | |
| | LINDE PLC | 33, 246 | 469. 520 | 15, 609, 661. 920 | |
| | ANALOG DEVICES INC | 35, 091 | 247. 070 | 8, 669, 933. 370 | |
| | ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A | 26, 100 | 19. 060 | 497, 466. 000 | |
| | MONDAYCOM LTD | 3, 000 | 185. 730 | 557, 190. 000 | |
| | ADVANCED MICRO DEVICES | 114, 427 | 151. 140 | 17, 294, 496. 780 | |
| | COREBRIDGE FINANCIAL INC | 19, 100 | 33. 680 | 643, 288. 000 | |
| | NATERA INC | 9, 200 | 168. 020 | 1, 545, 784. 000 | |
| | LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER | 15, 000 | 100. 750 | 1, 511, 250. 000 | |
| | KENVUE INC | 135, 500 | 18. 620 | 2, 523, 010. 000 | |
| | VERALTO CORP | 17, 516 | 105. 710 | 1, 851, 616. 360 | |
| | AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 40, 672 | 79. 210 | 3, 221, 629. 120 | |
| | BUNGE GLOBAL LTD | 9, 900 | 84. 330 | 834, 867. 000 | |
| | VERTIV HOLDINGS CLASS A | 25, 600 | 124. 000 | 3, 174, 400. 000 | |
| | NUTANIX INC CLASS A | 18, 000 | 69. 920 | 1, 258, 560. 000 | |
| | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 18, 300 | 352. 270 | 6, 446, 541. 000 | |
| | avery Dennison CORP | 5, 530 | 168. 060 | 929, 371. 800 | |
| | COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A | 34, 800 | 71. 820 | 2, 499, 336. 000 | |
| | EMERSON ELECTRIC CO | 39, 700 | 132. 550 | 5, 262, 235. 000 | |
| | AON PLC-CLASS A | 14, 500 | 370. 540 | 5, 372, 830. 000 | |
| | AMGEN INC | 38, 000 | 283. 640 | 10, 778, 320. 000 | |
| | SAMSARA INC CLASS A | 20, 100 | 42. 090 | 846, 009. 000 | |
| | TAPESTRY INC | 15, 200 | 104. 180 | 1, 583, 536. 000 | |
| | EATON CORP PLC | 27, 636 | 349. 030 | 9, 645, 793. 080 | |
| | COOPER INC | 14, 100 | 68. 090 | 960, 069. 000 | |
| | CONSTELLATION BRANDS INC-A | 10, 600 | 148. 430 | 1, 573, 358. 000 | |
| | APPLIED MATERIALS INC | 56, 600 | 162. 750 | 9, 211, 650. 000 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----|------------------------------|---------|-----------|-----------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| | CME GROUP INC | 25,500 | 261.940 | 6,679,470.000 | |
| | ECOLAB INC | 18,000 | 273.560 | 4,924,080.000 | |
| | EQUIFAX INC | 8,800 | 249.670 | 2,197,096.000 | |
| | GILEAD SCIENCES INC | 87,800 | 115.050 | 10,101,390.000 | |
| | KEURIG DR PEPPER INC | 91,100 | 28.650 | 2,610,015.000 | |
| | HORMEL FOODS CORP | 21,000 | 25.660 | 538,860.000 | |
| | STATE STREET CORP | 20,013 | 112.950 | 2,260,468.350 | |
| | SOLVENTUM CORP | 11,072 | 72.720 | 805,155.840 | |
| | GE VERNONA | 19,326 | 582.080 | 11,249,278.080 | |
| | SCHWAB (CHARLES) CORP | 121,840 | 92.050 | 11,215,372.000 | |
| | CRH PUBLIC LIMITED PLC | 47,700 | 112.360 | 5,359,572.000 | |
| | LABCORP HOLDINGS | 6,000 | 278.670 | 1,672,020.000 | |
| | BAXTER INTERNATIONAL INC | 36,200 | 24.420 | 884,004.000 | |
| | SMURFIT WESTROCK PLC | 36,900 | 46.910 | 1,730,979.000 | |
| | FERGUSON ENTERPRISES LTD | 14,000 | 238.340 | 3,336,760.000 | |
| | FLUTTER ENTERTAINMENT PLC | 12,500 | 295.280 | 3,691,000.000 | |
| | CROWN HOLDINGS INC | 8,180 | 94.230 | 770,801.400 | |
| | REDDIT INC CLASS A | 7,500 | 240.000 | 1,800,000.000 | |
| | TE CONNECTIVITY LTD | 20,995 | 208.740 | 4,382,496.300 | |
| | BLACKROCK INC | 10,400 | 1,099.150 | 11,431,160.000 | |
| | CARDINAL HEALTH INC | 16,900 | 149.560 | 2,527,564.000 | |
| | APTIV HOLDINGS LTD | 15,400 | 80.440 | 1,238,776.000 | |
| | FEDEX CORP | 16,100 | 227.720 | 3,666,292.000 | |
| | CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 45,174 | 221.530 | 10,007,396.220 | |
| | ROCKET LAB INC | 31,500 | 45.840 | 1,443,960.000 | |
| | INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 18,113 | 66.030 | 1,196,001.390 | |
| | INTEL CORP | 307,700 | 24.490 | 7,535,573.000 | |
| | HARTFORD INSURANCE GROUP INC | 20,050 | 131.670 | 2,639,983.500 | |
| | ILLINOIS TOOL WORKS | 19,700 | 266.240 | 5,244,928.000 | |
| | ILLUMINA INC | 11,200 | 98.930 | 1,108,016.000 | |
| | INTUITIVE SURGICAL INC | 25,300 | 466.860 | 11,811,558.000 | |
| | CHECK POINT SOFTWARE TECH | 6,350 | 193.090 | 1,226,121.500 | |
| | SNAP-ON INC | 3,700 | 328.700 | 1,216,190.000 | |
| | DUKE ENERGY CORP | 54,828 | 120.610 | 6,612,805.080 | |
| | TARGET CORP | 32,100 | 93.170 | 2,990,757.000 | |
| | DOVER CORP | 9,700 | 177.750 | 1,724,175.000 | |
| | WW GRAINGER INC | 3,300 | 993.470 | 3,278,451.000 | |
| | JABIL INC | 7,600 | 210.100 | 1,596,760.000 | |
| | CINTAS CORP | 25,700 | 204.500 | 5,255,650.000 | |
| | CLOROX COMPANY | 8,600 | 127.030 | 1,092,458.000 | |
| | ENTERGY CORP | 31,600 | 87.750 | 2,772,900.000 | |
| | MICROSOFT CORP | 498,700 | 495.000 | 246,856,500.000 | |
| | INCYTE CORP | 11,700 | 86.640 | 1,013,688.000 | |
| | CVS HEALTH CORP | 89,269 | 73.780 | 6,586,266.820 | |
| | MEDTRONIC PLC | 90,398 | 92.900 | 8,397,974.200 | |
| | MICRON TECHNOLOGY INC | 79,000 | 131.370 | 10,378,230.000 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|------------|------------------------------|-----------|---------|--|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| USD | CENTERPOINT ENERGY INC | 46,100 | 37.780 | 1,741,658.000 | |
| | KELLOGG CO | 19,600 | 79.870 | 1,565,452.000 | |
| | KEYCORP | 65,800 | 18.940 | 1,246,252.000 | |
| | MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A | 91,411 | 61.740 | 5,643,715.140 | |
| | CHUBB LTD | 26,899 | 277.380 | 7,461,244.620 | |
| | ALLSTATE CORP | 18,700 | 201.530 | 3,768,611.000 | |
| | EBAY INC | 32,600 | 92.660 | 3,020,716.000 | |
| | PAYPAL HOLDINGS INC | 65,050 | 68.260 | 4,440,313.000 | |
| | ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 16,600 | 89.200 | 1,480,720.000 | |
| | TRIMBLE INC | 16,900 | 80.740 | 1,364,506.000 | |
| | LENNAR CORP-A | 16,100 | 141.880 | 2,284,268.000 | |
| | PROGRESSIVE CORP | 41,400 | 243.860 | 10,095,804.000 | |
| | PACCAR INC | 37,055 | 99.050 | 3,670,297.750 | |
| | BIOGEN INC | 10,400 | 140.670 | 1,462,968.000 | |
| | IDEXX LABORATORIES INC | 5,700 | 642.990 | 3,665,043.000 | |
| | STARBUCKS CORP | 80,200 | 85.430 | 6,851,486.000 | |
| | PTC INC | 8,500 | 213.900 | 1,818,150.000 | |
| | EVERSOURCE ENERGY | 26,000 | 63.530 | 1,651,780.000 | |
| | INTUIT INC | 19,680 | 672.820 | 13,241,097.600 | |
| | BEST BUY CO INC | 14,250 | 76.170 | 1,085,422.500 | |
| | BALL CORP | 18,604 | 50.940 | 947,687.760 | |
| | BOSTON SCIENTIFIC CORP | 104,397 | 107.220 | 11,193,446.340 | |
| | ELECTRONIC ARTS INC | 16,900 | 168.620 | 2,849,678.000 | |
| | VULCAN MATERIALS CO | 9,400 | 294.810 | 2,771,214.000 | |
| | VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 18,200 | 396.120 | 7,209,384.000 | |
| | CARNIVAL CORP | 74,100 | 31.570 | 2,339,337.000 | |
| | COMCAST CORP-CLASS A | 262,690 | 33.910 | 8,907,817.900 | |
| | JARDINE MATHESON HLDGS LTD | 11,900 | 59.990 | 713,881.000 | |
| | HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 79,800 | 6.380 | 509,124.000 | |
| アメリカ・ドル 小計 | | | | 3,943,347,635.220 (585,468,823,402) | |
| GBP | SHELL PLC | 404,906 | 26.275 | 10,638,905.150 | |
| | HALEON PLC | 617,607 | 3.657 | 2,258,588.790 | |
| | WISE PLC CLASS A | 45,084 | 11.420 | 514,859.280 | |
| | BP PLC | 1,089,909 | 4.156 | 4,530,206.750 | |
| | UNILEVER PLC | 168,370 | 47.690 | 8,029,565.300 | |
| | BARCLAYS PLC | 971,758 | 3.610 | 3,508,532.250 | |
| | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 580,819 | 10.755 | 6,246,708.340 | |
| | MARKS & SPENCER GROUP PLC | 141,556 | 3.422 | 484,404.630 | |
| | PRUDENTIAL PLC | 176,551 | 9.756 | 1,722,431.550 | |
| | NATWEST GROUP PLC | 556,996 | 5.060 | 2,818,399.760 | |
| | BAE SYSTEMS PLC | 207,134 | 17.770 | 3,680,771.180 | |
| | AVIVA PLC | 210,133 | 6.564 | 1,379,313.010 | |
| | GSK | 280,676 | 14.760 | 4,142,777.760 | |
| | INFORMA PLC | 89,236 | 8.902 | 794,378.870 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----|------------------------------|-----------|---------|----------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| | MELROSE INDUSTRIES PLC | 86,323 | 6.160 | 531,749.680 | |
| | AUTO TRADER GROUP PLC | 59,528 | 8.038 | 478,486.060 | |
| | DCC PLC | 6,761 | 47.560 | 321,553.160 | |
| | SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 5,007 | 71.950 | 360,253.650 | |
| | HALMA PLC | 26,104 | 32.420 | 846,291.680 | |
| | ENTAIN PLC | 41,144 | 8.644 | 355,648.730 | |
| | JD SPORTS FASHION PLC | 172,738 | 0.944 | 163,168.310 | |
| | PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC | 47,535 | 6.700 | 318,484.500 | |
| | M&G PLC | 154,620 | 2.606 | 402,939.720 | |
| | RELX PLC | 126,136 | 34.820 | 4,392,055.520 | |
| | DIAGEO PLC | 153,010 | 20.340 | 3,112,223.400 | |
| | RIO TINTO PLC | 77,606 | 46.810 | 3,632,736.860 | |
| | STANDARD CHARTERED PLC | 135,683 | 13.660 | 1,853,429.780 | |
| | TESCO PLC | 450,719 | 4.410 | 1,987,670.790 | |
| | FRESNILLO PLC | 16,136 | 21.180 | 341,760.480 | |
| | SMITH & NEPHEW PLC | 57,221 | 14.160 | 810,249.360 | |
| | GLENCORE PLC | 693,869 | 2.869 | 1,990,710.160 | |
| | SMITHS GROUP PLC | 22,378 | 23.560 | 527,225.680 | |
| | PEARSON PLC | 40,375 | 10.455 | 422,120.620 | |
| | SAINSBURY (J) PLC | 116,988 | 3.126 | 365,704.480 | |
| | NEXT PLC | 8,027 | 122.000 | 979,294.000 | |
| | WHITBREAD PLC | 11,775 | 31.030 | 365,378.250 | |
| | BUNZL PLC | 22,170 | 25.880 | 573,759.600 | |
| | VODAFONE GROUP PLC | 1,336,897 | 0.878 | 1,174,597.700 | |
| | KINGFISHER PLC | 118,387 | 2.532 | 299,755.880 | |
| | WPP PLC | 73,027 | 3.988 | 291,231.670 | |
| | UNITED UTILITIES GROUP PLC | 46,155 | 11.240 | 518,782.200 | |
| | SEVERN TRENT PLC | 18,341 | 25.540 | 468,429.140 | |
| | RENTOKIL INITIAL PLC | 173,687 | 3.771 | 654,973.670 | |
| | RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 46,689 | 57.100 | 2,665,941.900 | |
| | SCHRODERS PLC | 50,139 | 3.678 | 184,411.240 | |
| | SSE PLC | 76,086 | 16.515 | 1,256,560.290 | |
| | BARRATT REDROW PLC | 92,981 | 3.679 | 342,077.090 | |
| | ASTRAZENECA PLC | 106,621 | 120.900 | 12,890,478.900 | |
| | LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 397,269 | 2.349 | 933,184.880 | |
| | 3I GROUP PLC | 66,931 | 39.220 | 2,625,033.820 | |
| | ASHTead GROUP PLC | 29,268 | 55.380 | 1,620,861.840 | |
| | SAGE GROUP PLC/THE | 66,433 | 10.850 | 720,798.050 | |
| | NATIONAL GRID PLC | 337,065 | 10.340 | 3,485,252.100 | |
| | LLOYDS BANKING GROUP PLC | 4,117,646 | 0.793 | 3,267,763.860 | |
| | IMPERIAL BRANDS PLC | 52,954 | 31.440 | 1,664,873.760 | |
| | CENTRICA PLC | 333,159 | 1.545 | 514,730.650 | |
| | BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 143,772 | 41.330 | 5,942,096.760 | |
| | ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 22,010 | 22.220 | 489,062.200 | |
| | HSBC HOLDINGS PLC | 1,198,375 | 9.630 | 11,540,351.250 | |
| | ANGLO AMERICAN PLC | 76,952 | 22.770 | 1,752,197.040 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|---------------|------------------------------|----------|-------------|---|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| MONDI PLC | MONDI PLC | 29, 910 | 10. 120 | 302, 689. 200 | |
| | COMPASS GROUP PLC | 116, 715 | 25. 570 | 2, 984, 402. 550 | |
| | BT GROUP PLC | 411, 207 | 2. 047 | 841, 740. 720 | |
| | COCA-COLA HBC AG-DI | 14, 786 | 37. 800 | 558, 910. 800 | |
| | INTERCONTINENTAL HOTELS GROU | 10, 046 | 90. 880 | 912, 980. 480 | |
| | INTERTEK GROUP PLC | 10, 850 | 46. 960 | 509, 516. 000 | |
| | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP | 32, 667 | 92. 700 | 3, 028, 230. 900 | |
| | HIKMA PHARMACEUTICALS PLC | 11, 467 | 17. 200 | 197, 232. 400 | |
| | ADMIRAL GROUP PLC | 17, 902 | 33. 420 | 598, 284. 840 | |
| | ANTOFAGASTA PLC | 26, 663 | 21. 330 | 568, 721. 790 | |
| | EXPERIAN PLC | 63, 182 | 39. 210 | 2, 477, 366. 220 | |
| イギリス・ポンド 小計 | | | | 144, 166, 258. 880 (28, 879, 384, 979) | |
| イスラエル・シユケル | ISRAEL DISCOUNT BANK-A | 89, 469 | 32. 700 | 2, 925, 636. 300 | |
| | AZRIELI GROUP LTD | 3, 098 | 329. 600 | 1, 021, 100. 800 | |
| | PHOENIX FINANCIAL LTD | 16, 493 | 118. 300 | 1, 951, 121. 900 | |
| | NOVA MEASURING INSTRUMENTS | 2, 139 | 863. 900 | 1, 847, 882. 100 | |
| | ICL GROUP LTD | 56, 522 | 20. 300 | 1, 147, 396. 600 | |
| | ELBIT SYSTEMS LTD | 2, 030 | 1, 622. 700 | 3, 294, 081. 000 | |
| | BANK HAPOALIM BM | 91, 238 | 65. 300 | 5, 957, 841. 400 | |
| | BANK LEUMI LE-ISRAEL | 109, 024 | 63. 400 | 6, 912, 121. 600 | |
| | NICE LTD | 4, 617 | 468. 800 | 2, 164, 449. 600 | |
| | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 11, 384 | 219. 800 | 2, 502, 203. 200 | |
| イスラエル・シユケル 小計 | | | | 29, 723, 834. 500 (1, 321, 316, 587) | |
| オーストラリア・ドル | THE LOTTERY CORPORATION LTD | 144, 638 | 5. 920 | 856, 256. 960 | |
| | TELSTRA GROUP LTD | 261, 489 | 4. 830 | 1, 262, 991. 870 | |
| | ANZ GROUP HOLDINGS LTD | 198, 174 | 33. 290 | 6, 597, 212. 460 | |
| | SGH LTD | 13, 549 | 49. 410 | 669, 456. 090 | |
| | MEDIBANK PRIVATE LTD | 178, 895 | 5. 080 | 908, 786. 600 | |
| | BHP GROUP LTD | 337, 031 | 41. 610 | 14, 023, 859. 910 | |
| | SOUTH32 LTD | 293, 178 | 2. 640 | 773, 989. 920 | |
| | WOODSIDE ENERGY GROUP LTD | 126, 073 | 25. 680 | 3, 237, 554. 640 | |
| | FORTESCUE METALS GROUP LTD | 112, 438 | 18. 870 | 2, 121, 705. 060 | |
| | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 203, 378 | 43. 170 | 8, 779, 828. 260 | |
| | WESTPAC BANKING CORP | 227, 202 | 38. 170 | 8, 672, 300. 340 | |
| | SANTOS LTD | 215, 611 | 7. 800 | 1, 681, 765. 800 | |
| | RIO TINTO LTD | 24, 644 | 117. 230 | 2, 889, 016. 120 | |
| | ORIGIN ENERGY LTD | 114, 371 | 12. 420 | 1, 420, 487. 820 | |
| | XERO LTD | 10, 924 | 158. 890 | 1, 735, 714. 360 | |
| | PRO MEDICUS LTD | 3, 817 | 298. 230 | 1, 138, 343. 910 | |
| | WASHINGTON H. SOUL PATTINSON | 15, 927 | 43. 960 | 700, 150. 920 | |
| | COLES GROUP LTD | 89, 062 | 23. 960 | 2, 133, 925. 520 | |
| | WISETECH GLOBAL LTD | 13, 328 | 93. 560 | 1, 246, 967. 680 | |
| | NORTHERN STAR RESOURCES LTD | 90, 129 | 19. 940 | 1, 797, 172. 260 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|---------------|---------------------------------------|---------|-----------|-------------------------------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| | EVOLUTION MINING LTD | 131,920 | 9.060 | 1,195,195.200 | |
| | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 111,108 | 168.140 | 18,681,699.120 | |
| | QBE INSURANCE GROUP LTD | 100,261 | 21.620 | 2,167,642.820 | |
| | WOOLWORTHS GROUP LTD | 81,112 | 27.590 | 2,237,880.080 | |
| | QANTAS AIRWAYS LTD | 49,383 | 11.850 | 585,188.550 | |
| | JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI | 38,510 | 29.930 | 1,152,604.300 | |
| | MACQUARIE GROUP LTD | 24,037 | 221.790 | 5,331,166.230 | |
| | ARISTOCRAT LEISURE LTD | 37,261 | 69.690 | 2,596,719.090 | |
| | CSL LTD | 32,150 | 209.250 | 6,727,387.500 | |
| | WESFARMERS LTD | 75,351 | 92.560 | 6,974,488.560 | |
| | COCHLEAR LTD | 4,346 | 298.530 | 1,297,411.380 | |
| | BLUESCOPE STEEL LTD | 28,548 | 22.910 | 654,034.680 | |
| | SUNCORP GROUP LTD | 71,893 | 21.210 | 1,524,850.530 | |
| | ASX LTD | 12,589 | 61.470 | 773,845.830 | |
| | COMPUTERSHARE LTD | 34,210 | 37.460 | 1,281,506.600 | |
| | INSURANCE AUSTRALIA GROUP | 157,027 | 8.690 | 1,364,564.630 | |
| | SONIC HEALTHCARE LTD | 31,257 | 22.940 | 717,035.580 | |
| | BRAMBLES LTD | 90,721 | 26.560 | 2,409,549.760 | |
| | CARSALES.COM LTD | 25,090 | 39.460 | 990,051.400 | |
| | SIGMA HEALTHCARE LTD | 304,204 | 3.040 | 924,780.160 | |
| | REA GROUP LTD | 3,510 | 241.620 | 848,086.200 | |
| オーストラリア・ドル 小計 | | | | 123,083,174.700 (11,977,223,730) | |
| カナダ・ドル | ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT | 49,700 | 76.240 | 3,789,128.000 | |
| | BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING | 26,881 | 80.660 | 2,168,221.460 | |
| | BROOKFIELD RENEWABLE SUBORDINATE V | 8,900 | 45.990 | 409,311.000 | |
| | CELESTICA INC | 7,600 | 336.260 | 2,555,576.000 | |
| | BOMBARDIER INC CLASS B | 6,500 | 155.010 | 1,007,565.000 | |
| | ATKINSREALIS GROUP INC | 12,200 | 94.710 | 1,155,462.000 | |
| | IMPERIAL OIL LTD | 11,700 | 120.900 | 1,414,530.000 | |
| | CONSTELLATION SOFTWARE INC | 1,400 | 4,599.690 | 6,439,566.000 | |
| | RESTAURANT BRANDS INTERN | 20,387 | 87.360 | 1,781,008.320 | |
| | WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 29,700 | 144.440 | 4,289,868.000 | |
| | INTACT FINANCIAL CORP | 11,750 | 278.330 | 3,270,377.500 | |
| | BCE INC | 4,830 | 34.230 | 165,330.900 | |
| | FRANCO-NEVADA CORP | 12,600 | 268.650 | 3,384,990.000 | |
| | SUNCOR ENERGY INC | 80,230 | 55.400 | 4,444,742.000 | |
| | METRO INC/CN | 13,500 | 97.310 | 1,313,685.000 | |
| | NATIONAL BANK OF CANADA | 25,700 | 145.910 | 3,749,887.000 | |
| | BANK OF NOVA SCOTIA | 81,500 | 87.860 | 7,160,590.000 | |
| | CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 61,000 | 108.420 | 6,613,620.000 | |
| | TORONTO-DOMINION BANK | 112,400 | 103.160 | 11,595,184.000 | |
| | GREAT-WEST LIFECO INC | 18,100 | 54.180 | 980,658.000 | |
| | ROYAL BANK OF CANADA | 92,250 | 200.220 | 18,470,295.000 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----|------------------------------|----------|-------------|-------------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| | TOURMALINE OIL CORP | 24, 200 | 57. 990 | 1, 403, 358. 000 | |
| | TC ENERGY CORP | 68, 050 | 71. 830 | 4, 888, 031. 500 | |
| | PEMBINA PIPELINE CORP | 38, 029 | 52. 570 | 1, 999, 184. 530 | |
| | BARRICK MINING CORP | 111, 500 | 39. 370 | 4, 389, 755. 000 | |
| | CAE INC | 19, 600 | 36. 860 | 722, 456. 000 | |
| | THOMSON REUTERS CORP | 10, 341 | 241. 930 | 2, 501, 798. 130 | |
| | EMPIRE CO LTD 'A' | 8, 100 | 52. 490 | 425, 169. 000 | |
| | CCL INDUSTRIES INC - CL B | 9, 550 | 80. 430 | 768, 106. 500 | |
| | ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR | 26, 100 | 36. 740 | 958, 914. 000 | |
| | HYDRO ONE LTD | 21, 300 | 49. 990 | 1, 064, 787. 000 | |
| | LOBLAW COMPANIES LTD | 39, 040 | 56. 620 | 2, 210, 444. 800 | |
| | STANTEC INC | 7, 400 | 149. 870 | 1, 109, 038. 000 | |
| | WSP GLOBAL INC | 8, 600 | 281. 470 | 2, 420, 642. 000 | |
| | TOROMONT INDUSTRIES LTD | 5, 400 | 144. 870 | 782, 298. 000 | |
| | EMERA INC | 19, 500 | 64. 810 | 1, 263, 795. 000 | |
| | TFI INTERNATIONAL INC | 5, 200 | 133. 640 | 694, 928. 000 | |
| | CANADIAN UTILITIES LTD-A | 8, 800 | 38. 070 | 335, 016. 000 | |
| | WHITECAP RESOURCES INC | 79, 700 | 10. 080 | 803, 376. 000 | |
| | ROGERS COMMUNICATIONS INC-B | 23, 900 | 49. 700 | 1, 187, 830. 000 | |
| | IVANHOE MINES LTD-CL A | 48, 100 | 12. 560 | 604, 136. 000 | |
| | AGNICO EAGLE MINES LTD | 32, 917 | 210. 420 | 6, 926, 395. 140 | |
| | ALAMOS GOLD INC-CLASS A | 27, 300 | 44. 580 | 1, 217, 034. 000 | |
| | KINROSS GOLD CORP | 80, 300 | 30. 630 | 2, 459, 589. 000 | |
| | BANK OF MONTREAL | 47, 000 | 174. 720 | 8, 211, 840. 000 | |
| | POWER CORP OF CANADA | 36, 500 | 57. 960 | 2, 115, 540. 000 | |
| | LUNDIN GOLD INC | 7, 100 | 93. 800 | 665, 980. 000 | |
| | SHOPIFY INC - CLASS A | 79, 900 | 203. 340 | 16, 246, 866. 000 | |
| | NUTRIEN LTD | 31, 919 | 78. 160 | 2, 494, 789. 040 | |
| | CAMECO CORP | 28, 500 | 105. 130 | 2, 996, 205. 000 | |
| | FIRSTSERVICE CORP | 2, 700 | 279. 260 | 754, 002. 000 | |
| | GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT | 16, 500 | 66. 370 | 1, 095, 105. 000 | |
| | TELUS CORP | 10, 800 | 22. 970 | 248, 076. 000 | |
| | TECK RESOURCES LTD-CLS B | 30, 400 | 47. 560 | 1, 445, 824. 000 | |
| | CANADIAN TIRE CORP-CLASS A | 3, 400 | 169. 970 | 577, 898. 000 | |
| | CANADIAN NATURAL RESOURCES | 136, 900 | 42. 060 | 5, 758, 014. 000 | |
| | FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 1, 300 | 2, 376. 850 | 3, 089, 905. 000 | |
| | MAGNA INTERNATIONAL INC | 17, 300 | 63. 550 | 1, 099, 415. 000 | |
| | WESTON (GEORGE) LTD | 11, 511 | 88. 580 | 1, 019, 644. 380 | |
| | PAN AMERICAN SILVER CORP | 23, 400 | 47. 910 | 1, 121, 094. 000 | |
| | DESCARTES SYSTEMS GRP/THE | 5, 600 | 149. 450 | 836, 920. 000 | |
| | SUN LIFE FINANCIAL INC | 37, 000 | 79. 980 | 2, 959, 260. 000 | |
| | ENBRIDGE INC | 142, 700 | 66. 870 | 9, 542, 349. 000 | |
| | BROOKFIELD CORP | 89, 525 | 92. 160 | 8, 250, 624. 000 | |
| | MANULIFE FINANCIAL CORP | 111, 700 | 42. 480 | 4, 745, 016. 000 | |
| | CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY | 60, 220 | 106. 170 | 6, 393, 557. 400 | |
| | IA FINANCIAL CORP INC | 6, 100 | 149. 180 | 909, 998. 000 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|--------------|------------------------------|---------|-------------|-------------------------------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| CAD | GILDAN ACTIVEWEAR INC | 9,200 | 76.870 | 707,204.000 | |
| | CANADIAN NATL RAILWAY CO | 34,950 | 133.760 | 4,674,912.000 | |
| | CGI INC - CLASS A | 13,000 | 133.930 | 1,741,090.000 | |
| | IGM FINANCIAL INC | 5,200 | 49.970 | 259,844.000 | |
| | TMX GROUP LTD | 18,000 | 54.300 | 977,400.000 | |
| | OPEN TEXT CORP | 16,800 | 46.020 | 773,136.000 | |
| | SAPUTO INC | 15,900 | 34.670 | 551,253.000 | |
| | FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 45,800 | 24.580 | 1,125,764.000 | |
| | FORTIS INC | 32,900 | 68.180 | 2,243,122.000 | |
| | RB GLOBAL INC | 12,200 | 159.360 | 1,944,192.000 | |
| | LUNDIN MINING CORP | 44,700 | 16.560 | 740,232.000 | |
| | CENOVUS ENERGY INC | 88,200 | 22.110 | 1,950,102.000 | |
| | DOLLARAMA INC | 18,200 | 188.430 | 3,429,426.000 | |
| | ALTAGAS LTD | 19,300 | 41.460 | 800,178.000 | |
| | KEYERA CORP | 14,800 | 44.320 | 655,936.000 | |
| | ARC RESOURCES LTD | 37,900 | 25.600 | 970,240.000 | |
| カナダ・ドル 小計 | | | | 233,417,629.600 (25,043,377,479) | |
| SGD | CAPITALAND INVESTMENT LTD | 170,900 | 2.770 | 473,393.000 | |
| | UNITED OVERSEAS BANK LTD | 92,100 | 35.840 | 3,300,864.000 | |
| | DBS GROUP HOLDINGS LTD | 155,340 | 50.810 | 7,892,825.400 | |
| | SINGAPORE AIRLINES LTD | 110,575 | 6.570 | 726,477.750 | |
| | KEPPEL CORP LTD | 106,400 | 8.630 | 918,232.000 | |
| | YANGZIJIANG SHIPBUILDING | 188,600 | 3.100 | 584,660.000 | |
| | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 247,200 | 16.850 | 4,165,320.000 | |
| | GENTING SINGAPORE LTD | 441,400 | 0.765 | 337,671.000 | |
| | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 542,450 | 4.390 | 2,381,355.500 | |
| | SINGAPORE TECH ENGINEERING | 114,000 | 7.920 | 902,880.000 | |
| | SEMCORP INDUSTRIES LTD | 65,300 | 6.120 | 399,636.000 | |
| | SINGAPORE EXCHANGE LTD | 62,600 | 16.250 | 1,017,250.000 | |
| | WILMAR INTERNATIONAL LTD | 140,300 | 2.970 | 416,691.000 | |
| シンガポール・ドル 小計 | | | | 23,517,255.650 (2,716,478,200) | |
| EUR | SANDOZ GROUP AG | 27,796 | 48.880 | 1,358,668.480 | |
| | BELIMO N AG | 719 | 831.500 | 597,848.500 | |
| | GALDERMA GROUP N AG | 8,767 | 144.700 | 1,268,584.900 | |
| | AMRIZE AG | 33,922 | 42.340 | 1,436,257.480 | |
| | AVOLTA AG | 5,644 | 44.680 | 252,173.920 | |
| | UBS GROUP AG-REG | 210,342 | 32.100 | 6,751,978.200 | |
| | ROCHE HOLDING AG-BR | 2,103 | 289.200 | 608,187.600 | |
| | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | 469 | 610.000 | 286,090.000 | |
| | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 46,716 | 274.200 | 12,809,527.200 | |
| | SIKA AG-REG | 10,136 | 185.400 | 1,879,214.400 | |
| | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG | 8 | 124,600.000 | 996,800.000 | |
| | ABB LTD-REG | 104,129 | 55.080 | 5,735,425.320 | |
| | SWISS RE AG | 19,845 | 140.950 | 2,797,152.750 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|-----------------|------------------------------|----------|--------------|---------------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| | NESTLE SA-REG | 171, 040 | 75. 410 | 12, 898, 126. 400 | |
| | PARTNERS GROUP HOLDING AG | 1, 505 | 1, 068. 000 | 1, 607, 340. 000 | |
| | SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 2, 708 | 303. 200 | 821, 065. 600 | |
| | JULIUS BAER GROUP LTD | 13, 700 | 57. 020 | 781, 174. 000 | |
| | SGS SA-REG | 11, 038 | 85. 380 | 942, 424. 440 | |
| | SCHINDLER HOLDING AG-REG | 1, 571 | 291. 000 | 457, 161. 000 | |
| | HELVETIA HOLDING AG-REG | 2, 428 | 198. 700 | 482, 443. 600 | |
| | VAT GROUP AG | 1, 798 | 276. 300 | 496, 787. 400 | |
| | BKW AG | 1, 374 | 163. 400 | 224, 511. 600 | |
| | ALCON INC | 33, 225 | 64. 080 | 2, 129, 058. 000 | |
| | SIG GROUP N AG | 19, 984 | 12. 830 | 256, 394. 720 | |
| | SWATCH GROUP AG/THE-BR | 1, 920 | 148. 100 | 284, 352. 000 | |
| | ZURICH INSURANCE GROUP AG | 9, 729 | 575. 400 | 5, 598, 066. 600 | |
| | BALOISE HOLDING AG - REG | 2, 724 | 200. 800 | 546, 979. 200 | |
| | NOVARTIS AG-REG | 126, 419 | 103. 980 | 13, 145, 047. 620 | |
| | BARRY CALLEBAUT AG-REG | 240 | 1, 128. 000 | 270, 720. 000 | |
| | CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 35, 743 | 144. 550 | 5, 166, 650. 650 | |
| | SWISSCOM AG-REG | 1, 721 | 587. 500 | 1, 011, 087. 500 | |
| | BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG | 1, 896 | 93. 050 | 176, 422. 800 | |
| | GEBERIT AG-REG | 2, 258 | 598. 200 | 1, 350, 735. 600 | |
| | GIVAUDAN-REG | 616 | 3, 504. 000 | 2, 158, 464. 000 | |
| | STRAUMANN HOLDING AG-REG | 7, 421 | 94. 940 | 704, 549. 740 | |
| | SONOVA HOLDING AG-REG | 3, 374 | 239. 500 | 808, 073. 000 | |
| | LOGITECH INTERNATIONAL-REG | 10, 112 | 85. 260 | 862, 149. 120 | |
| | LONZA GROUP AG-REG | 4, 655 | 577. 400 | 2, 687, 797. 000 | |
| | HOLCIM LTD | 33, 922 | 66. 860 | 2, 268, 024. 920 | |
| | SWISS LIFE HOLDING AG-REG | 1, 905 | 834. 000 | 1, 588, 770. 000 | |
| | KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG | 3, 215 | 163. 800 | 526, 617. 000 | |
| | SWISS PRIME SITE-REG | 5, 248 | 112. 500 | 590, 400. 000 | |
| | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC | 63 | 12, 650. 000 | 796, 950. 000 | |
| スイス・フラン 小計 | | | | 98, 416, 252. 260 | |
| | | | | (18, 296, 565, 457) | |
| スウェーデン・ クローナ | SAGAX CLASS B | 16, 042 | 202. 400 | 3, 246, 900. 800 | |
| | ERICSSON LM-B SHS | 203, 867 | 75. 380 | 15, 367, 494. 460 | |
| | VOLVO AB-B SHS | 114, 147 | 276. 900 | 31, 607, 304. 300 | |
| | SKF AB-B SHARES | 24, 823 | 238. 800 | 5, 927, 732. 400 | |
| | TELE2 AB-B SHS | 39, 841 | 166. 850 | 6, 647, 470. 850 | |
| | SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 109, 995 | 175. 600 | 19, 315, 122. 000 | |
| | SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS | 106, 045 | 119. 250 | 12, 645, 866. 250 | |
| | SWEDBANK AB - A SHARES | 61, 784 | 265. 200 | 16, 385, 116. 800 | |
| | HENNES & MAURITZ AB-B SHS | 41, 131 | 145. 550 | 5, 986, 617. 050 | |
| | SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B | 44, 003 | 127. 050 | 5, 590, 581. 150 | |
| | SKANSKA AB-B SHS | 24, 765 | 230. 700 | 5, 713, 285. 500 | |
| | SANDVIK AB | 77, 095 | 241. 800 | 18, 641, 571. 000 | |
| | INVESTOR AB-B SHS | 125, 608 | 290. 550 | 36, 495, 404. 400 | |

| 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 | ATLAS COPCO AB-A SHS | 194,409 | 155.800 | 30,288,922.200 | |
| | HOLMEN AB-B SHARES | 5,564 | 365.600 | 2,034,198.400 | |
| | SECURITAS AB-B SHS | 35,897 | 146.000 | 5,240,962.000 | |
| | TELIA CO AB | 172,199 | 35.800 | 6,164,724.200 | |
| | ALFA LAVAL AB | 21,118 | 433.700 | 9,158,876.600 | |
| | ATLAS COPCO AB-B SHS | 113,926 | 139.750 | 15,921,158.500 | |
| | ASSA ABLOY AB-B | 73,157 | 342.100 | 25,027,009.700 | |
| | TRELLEBORG AB-B SHS | 14,805 | 369.800 | 5,474,889.000 | |
| | SAAB AB-B | 23,379 | 514.500 | 12,028,495.500 | |
| | INDSTRIVARDEN AB-A SHS | 8,651 | 371.200 | 3,211,251.200 | |
| | FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS | 52,407 | 67.920 | 3,559,483.440 | |
| | INDUTRADE AB | 19,944 | 236.200 | 4,710,772.800 | |
| | SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB | 14,292 | 276.200 | 3,947,450.400 | |
| | LUNDBERGS AB-B SHS | 5,548 | 478.600 | 2,655,272.800 | |
| | INVESTMENT AB LATOUR-B SHS | 10,807 | 235.900 | 2,549,371.300 | |
| | LIFCO AB-B SHS | 17,015 | 332.800 | 5,662,592.000 | |
| | NIBE INDUSTRIER AB-B SHS | 110,614 | 38.160 | 4,221,030.240 | |
| | BEIJER REF AB | 28,094 | 163.000 | 4,579,322.000 | |
| | ESSITY AKTIEBOLAG-B | 43,967 | 257.700 | 11,330,295.900 | |
| | BOLIDEN AB | 20,746 | 333.100 | 6,910,492.600 | |
| | EPIROC AB-A | 48,101 | 200.400 | 9,639,440.400 | |
| | EPIROC AB-B | 28,464 | 180.400 | 5,134,905.600 | |
| | EQT AB | 27,034 | 331.800 | 8,969,881.200 | |
| | EVOLUTION AB | 10,447 | 800.000 | 8,357,600.000 | |
| | HEXAGON AB-B SHS | 151,538 | 110.100 | 16,684,333.800 | |
| | ADDTECH AB-B SHARES | 18,972 | 323.400 | 6,135,544.800 | |
| | INDSTRIVARDEN AB-C SHS | 11,378 | 371.100 | 4,222,375.800 | |
| スウェーデン・クローナ 小計 | | | | 407,391,119.340 (6,444,927,508) | |
| デンマーク・クローネ | NOVO NORDISK A/S-B | 235,068 | 350.000 | 82,273,800.000 | |
| | DANSKE BANK A/S | 48,756 | 258.900 | 12,622,928.400 | |
| | AP MOLLER-MAERSK A/S-A | 214 | 13,410.000 | 2,869,740.000 | |
| | VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 73,709 | 125.700 | 9,265,221.300 | |
| | CARLSBERG AS-B | 6,814 | 784.200 | 5,343,538.800 | |
| | NOVOZYMES A/S-B SHARES | 25,720 | 409.700 | 10,537,484.000 | |
| | COLOPLAST-B | 9,206 | 628.600 | 5,786,891.600 | |
| | DSV PANALPINA A/S | 14,918 | 1,352.500 | 20,176,595.000 | |
| | ROCKWOOL INTL A/S-B SHS | 7,038 | 241.600 | 1,700,380.800 | |
| | DEMANT A/S | 6,239 | 248.800 | 1,552,263.200 | |
| | AP MOLLER-MAERSK A/S-B | 289 | 13,500.000 | 3,901,500.000 | |
| | TRYG A/S | 24,543 | 166.000 | 4,074,138.000 | |
| | PANDORA A/S | 5,767 | 859.600 | 4,957,313.200 | |
| | GENMAB A/S | 4,449 | 1,751.500 | 7,792,423.500 | |
| | ORSTED A/S | 12,274 | 204.500 | 2,510,033.000 | |
| デンマーク・クローネ 小計 | | | | 175,364,250.800 (4,084,233,401) | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----------------|---------------------------------------|---------|-----------|-----------------------------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| ニュージーランド・ドル | MERIDIAN ENERGY LTD | 95,450 | 5.750 | 548,837.500 | |
| | INFRATIL LTD | 67,924 | 12.080 | 820,521.920 | |
| | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 123,213 | 7.630 | 940,115.190 | |
| | CONTACT ENERGY LTD | 61,127 | 9.190 | 561,757.130 | |
| | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 42,791 | 37.890 | 1,621,350.990 | |
| ニュージーランド・ドル 小計 | | | | 4,492,582.730 (393,011,137) | |
| ノルウェー・クローネ | DNB BANK | 64,709 | 263.200 | 17,031,408.800 | |
| | NORSK HYDRO ASA | 101,085 | 66.800 | 6,752,478.000 | |
| | ORKLA ASA | 51,165 | 113.300 | 5,796,994.500 | |
| | TELENOR ASA | 44,944 | 168.600 | 7,577,558.400 | |
| | EQUINOR ASA | 55,986 | 239.400 | 13,403,048.400 | |
| | YARA INTERNATIONAL ASA | 12,085 | 359.900 | 4,349,391.500 | |
| | MOWI ASA | 33,969 | 206.400 | 7,011,201.600 | |
| | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 14,598 | 276.800 | 4,040,726.400 | |
| | AKER BP ASA | 23,066 | 244.200 | 5,632,717.200 | |
| | KONGSBERG GRUPPEN ASA | 32,101 | 298.650 | 9,586,963.650 | |
| ノルウェー・クローネ 小計 | | | | 83,691,836.450 (1,237,802,261) | |
| ユーロ | UNIVERSAL MUSIC GROUP NV | 75,818 | 24.300 | 1,842,377.400 | |
| | DAIMLER TRUCK HOLDING AG | 32,730 | 38.210 | 1,250,613.300 | |
| | EXOR NV | 6,897 | 84.800 | 584,865.600 | |
| | DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED) | 7,728 | 44.060 | 340,495.680 | |
| | DSM FIRMENICH AG | 12,811 | 82.020 | 1,050,758.220 | |
| | FERROVIAL | 35,396 | 46.960 | 1,662,196.160 | |
| | LOTUS BAKERIES NV | 29 | 8,500.000 | 246,500.000 | |
| | SYENSQO SA | 5,019 | 74.620 | 374,517.780 | |
| | CVC CAPITAL PARTNERS PLC | 14,682 | 15.420 | 226,396.440 | |
| | COVESTRO V AG | 11,566 | 55.200 | 638,443.200 | |
| | TELECOM ITALIA | 716,514 | 0.001 | 931.460 | |
| | HENSOLDT AG | 4,637 | 90.400 | 419,184.800 | |
| | BAYER AG-REG | 67,682 | 28.155 | 1,905,586.710 | |
| | EVONIK INDUSTRIES AG | 17,696 | 16.100 | 284,905.600 | |
| | DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED | 127,506 | 29.870 | 3,808,604.220 | |
| | COMMERZBANK AG | 52,564 | 32.580 | 1,712,535.120 | |
| | VOLKSWAGEN AG-PREF | 14,208 | 99.920 | 1,419,663.360 | |
| | SIEMENS AG-REG | 52,361 | 226.000 | 11,833,586.000 | |
| | E.ON SE | 154,667 | 15.175 | 2,347,071.720 | |
| | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 19,293 | 88.440 | 1,706,272.920 | |
| | GEA GROUP AG | 10,095 | 63.300 | 639,013.500 | |
| | CONTINENTAL AG | 7,471 | 72.820 | 544,038.220 | |
| | BASF SE | 61,487 | 43.810 | 2,693,745.470 | |
| ALLIANZ SE-REG | | 26,604 | 351.400 | 9,348,645.600 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----|------------------------------|---------|-----------|----------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| | HENKEL AG & CO KGAA VORZUG | 11,012 | 74.080 | 815,768.960 | |
| | RHEINMETALL AG | 3,166 | 1,744.500 | 5,523,087.000 | |
| | RWE AG | 43,559 | 35.020 | 1,525,436.180 | |
| | DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 41,388 | 7.560 | 312,893.280 | |
| | BRENNTAG SE | 8,367 | 51.800 | 433,410.600 | |
| | FRESENIUS SE & CO KGAA | 29,101 | 46.820 | 1,362,508.820 | |
| | SAP SE | 71,937 | 228.250 | 16,419,620.250 | |
| | MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 8,990 | 531.800 | 4,780,882.000 | |
| | ZALANDO SE | 15,225 | 24.690 | 375,905.250 | |
| | HEIDELBERG MATERIALS AG | 9,217 | 198.350 | 1,828,191.950 | |
| | RATIONAL AG | 336 | 642.000 | 215,712.000 | |
| | CTS EVENTIM AG & CO KGAA | 4,270 | 84.450 | 360,601.500 | |
| | SARTORIUS AG-VORZUG | 1,807 | 193.200 | 349,112.400 | |
| | TALANX AG | 4,411 | 110.800 | 488,738.800 | |
| | PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF | 10,397 | 36.150 | 375,851.550 | |
| | DELIVERY HERO SE | 12,982 | 25.110 | 325,978.020 | |
| | NEMETSCHER SE | 3,964 | 114.900 | 455,463.600 | |
| | SCOUT24 AG | 5,099 | 110.300 | 562,419.700 | |
| | SIEMENS HEALTHINEERS AG | 23,328 | 47.240 | 1,102,014.720 | |
| | KNORR-BREMSE AG | 4,932 | 85.800 | 423,165.600 | |
| | SIEMENS ENERGY AG | 46,809 | 87.580 | 4,099,532.220 | |
| | BEIERSDORF AG | 6,764 | 97.320 | 658,272.480 | |
| | MERCK KGAA | 8,906 | 109.550 | 975,652.300 | |
| | ADIDAS AG | 11,782 | 175.700 | 2,070,097.400 | |
| | HENKEL AG & CO KGAA | 7,071 | 67.750 | 479,060.250 | |
| | DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 240,464 | 31.650 | 7,610,685.600 | |
| | FRESENIUS MEDICAL CARE AG & | 15,174 | 41.990 | 637,156.260 | |
| | MERCEDES-BENZ GROUP N AG | 49,751 | 52.920 | 2,632,822.920 | |
| | QIAGEN N.V. | 14,661 | 40.390 | 592,157.790 | |
| | INFINEON TECHNOLOGIES AG | 89,970 | 31.575 | 2,840,802.750 | |
| | HANNOVER RUECK SE | 4,130 | 244.400 | 1,009,372.000 | |
| | DHL GROUP | 66,138 | 39.000 | 2,579,382.000 | |
| | DEUTSCHE BOERSE AG | 12,972 | 245.800 | 3,188,517.600 | |
| | MTU AERO ENGINES AG | 3,711 | 361.800 | 1,342,639.800 | |
| | SYMRISE AG | 9,150 | 82.320 | 753,228.000 | |
| | BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF | 3,862 | 81.400 | 314,366.800 | |
| | VONOVIA SE | 51,858 | 26.770 | 1,388,238.660 | |
| | LEG IMMOBILIEN SE | 5,056 | 70.400 | 355,942.400 | |
| | KONINKLIJKE PHILIPS NV | 52,816 | 23.800 | 1,257,020.800 | |
| | NN GROUP NV | 18,532 | 57.900 | 1,073,002.800 | |
| | ARCELORMITTAL | 32,314 | 28.860 | 932,582.040 | |
| | HEINEKEN NV | 19,843 | 66.800 | 1,325,512.400 | |
| | AEGON LTD | 91,201 | 6.476 | 590,617.670 | |
| | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N | 62,520 | 34.740 | 2,171,944.800 | |
| | AKZO NOBEL N.V. | 11,768 | 60.360 | 710,316.480 | |
| | WOLTERS KLUWER | 16,433 | 108.200 | 1,778,050.600 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----|----------------------------------|---------|-----------|----------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| | ING GROEP NV | 207,639 | 20.555 | 4,268,019.640 | |
| | KONINKLIJKE KPN NV | 267,914 | 4.160 | 1,114,522.240 | |
| | ASML HOLDING NV | 27,134 | 660.200 | 17,913,866.800 | |
| | ABN AMRO BANK NV-CVA | 40,684 | 25.040 | 1,018,727.360 | |
| | IMCD NV | 4,081 | 92.820 | 378,798.420 | |
| | BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES | 4,998 | 108.700 | 543,282.600 | |
| | ASR NEDERLAND NV | 10,032 | 57.740 | 579,247.680 | |
| | ADYEN NV | 1,738 | 1,386.400 | 2,409,563.200 | |
| | PROSUS NV | 90,137 | 52.430 | 4,725,882.910 | |
| | JDE PEET'S NV | 11,789 | 31.260 | 368,524.140 | |
| | INPOST SA | 17,322 | 11.460 | 198,510.120 | |
| | ASM INTERNATIONAL NV | 3,230 | 415.700 | 1,342,711.000 | |
| | RANDSTAD NV | 7,252 | 38.500 | 279,202.000 | |
| | HEINEKEN HOLDING NV | 8,748 | 59.050 | 516,569.400 | |
| | TOTALENERGIES SE | 141,479 | 51.820 | 7,331,441.780 | |
| | MICHELIN (CGDE) | 46,190 | 30.950 | 1,429,580.500 | |
| | AIR LIQUIDE SA | 39,852 | 175.380 | 6,989,243.760 | |
| | KERING | 5,128 | 237.350 | 1,217,130.800 | |
| | SCHNEIDER ELECTRIC SE | 37,777 | 218.300 | 8,246,719.100 | |
| | BOUYGUES SA | 13,194 | 36.030 | 475,379.820 | |
| | BNP PARIBAS | 70,114 | 76.520 | 5,365,123.280 | |
| | THALES SA | 6,387 | 222.200 | 1,419,191.400 | |
| | DANONE | 44,600 | 75.080 | 3,348,568.000 | |
| | CARREFOUR SA | 40,771 | 12.300 | 501,483.300 | |
| | L'OREAL | 16,565 | 402.650 | 6,669,897.250 | |
| | COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN | 30,941 | 91.460 | 2,829,863.860 | |
| | LEGRAND SA | 18,065 | 131.050 | 2,367,418.250 | |
| | PERNOD RICARD SA | 13,905 | 96.120 | 1,336,548.600 | |
| | REXEL SA | 15,472 | 27.590 | 426,872.480 | |
| | SOCIETE GENERALE SA | 49,624 | 53.040 | 2,632,056.960 | |
| | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON | 17,125 | 496.250 | 8,498,281.250 | |
| | ACCOR SA | 13,305 | 40.910 | 544,307.550 | |
| | CAPGEMINI SE | 11,214 | 125.000 | 1,401,750.000 | |
| | PUBLICIS GROUPE | 15,768 | 82.320 | 1,298,021.760 | |
| | BUREAU VERITAS SA | 21,509 | 26.400 | 567,837.600 | |
| | EIFFAGE | 4,659 | 107.850 | 502,473.150 | |
| | SODEXO SA | 5,916 | 52.350 | 309,702.600 | |
| | IPSEN | 2,605 | 120.000 | 312,600.000 | |
| | AMUNDI SA | 4,253 | 62.500 | 265,812.500 | |
| | TELEPERFORMANCE | 3,631 | 65.780 | 238,847.180 | |
| | EURONEXT NV | 5,386 | 140.200 | 755,117.200 | |
| | EUROFINS SCIENTIFIC | 8,015 | 63.840 | 511,677.600 | |
| | SARTORIUS STEDIM BIOTECH | 2,010 | 173.750 | 349,237.500 | |
| | ESSILORLUXOTTICA | 20,752 | 259.600 | 5,387,219.200 | |
| | DASSAULT AVIATION SA | 1,353 | 269.200 | 364,227.600 | |
| | FDJ UNITED | 7,358 | 27.920 | 205,435.360 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----|------------------------------|----------|-------------|------------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| | AXA SA | 122, 106 | 39. 510 | 4, 824, 408. 060 | |
| | EDENRED | 16, 373 | 23. 810 | 389, 841. 130 | |
| | RENAULT SA | 13, 030 | 33. 010 | 430, 120. 300 | |
| | HERMES INTERNATIONAL | 2, 181 | 2, 039. 000 | 4, 447, 059. 000 | |
| | STMICROELECTRONICS NV | 47, 108 | 22. 800 | 1, 074, 062. 400 | |
| | DASSAULT SYSTEMES SE | 46, 315 | 26. 800 | 1, 241, 242. 000 | |
| | ORANGE | 128, 277 | 13. 625 | 1, 747, 774. 120 | |
| | ALSTOM | 23, 463 | 20. 030 | 469, 963. 890 | |
| | SANOFI | 76, 104 | 79. 500 | 6, 050, 268. 000 | |
| | VINCI SA | 34, 069 | 115. 550 | 3, 936, 672. 950 | |
| | AIRBUS SE | 40, 938 | 183. 840 | 7, 526, 041. 920 | |
| | VEOLIA ENVIRONNEMENT | 43, 379 | 28. 420 | 1, 232, 831. 180 | |
| | CREDIT AGRICOLE SA | 72, 959 | 15. 690 | 1, 144, 726. 710 | |
| | BIOMERIEUX | 2, 802 | 118. 300 | 331, 476. 600 | |
| | ENGIE | 125, 827 | 17. 640 | 2, 219, 588. 280 | |
| | SAFRAN SA | 24, 810 | 278. 200 | 6, 902, 142. 000 | |
| | ARKEMA | 3, 939 | 57. 350 | 225, 901. 650 | |
| | ADP | 2, 392 | 111. 800 | 267, 425. 600 | |
| | GETLINK SE | 20, 861 | 15. 680 | 327, 100. 480 | |
| | BOLLORE | 46, 528 | 4. 860 | 226, 126. 080 | |
| | UCB SA | 8, 712 | 206. 900 | 1, 802, 512. 800 | |
| | KBC GROUP NV | 15, 821 | 99. 500 | 1, 574, 189. 500 | |
| | GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 5, 611 | 75. 700 | 424, 752. 700 | |
| | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 68, 096 | 51. 320 | 3, 494, 686. 720 | |
| | AGEAS | 10, 282 | 58. 550 | 602, 011. 100 | |
| | D' IETEREN GROUP | 1, 502 | 159. 400 | 239, 418. 800 | |
| | ELIA GROUP SA/NV | 2, 979 | 94. 300 | 280, 919. 700 | |
| | SOFINA | 1, 064 | 252. 600 | 268, 766. 400 | |
| | ARGENX SE | 4, 217 | 639. 800 | 2, 698, 036. 600 | |
| | PRYSMIAN SPA | 19, 400 | 76. 480 | 1, 483, 712. 000 | |
| | GENERALI | 58, 494 | 33. 210 | 1, 942, 585. 740 | |
| | MEDIOBANCA SPA | 32, 588 | 19. 385 | 631, 718. 380 | |
| | TENARIS SA | 25, 755 | 14. 965 | 385, 423. 570 | |
| | UNICREDIT SPA | 96, 579 | 64. 920 | 6, 269, 908. 680 | |
| | UNIPOL GRUPPO SPA | 24, 380 | 17. 215 | 419, 701. 700 | |
| | TELECOM ITALIA SPA | 795, 819 | 0. 433 | 344, 748. 790 | |
| | INTESA SANPAOLO | 977, 560 | 5. 291 | 5, 172, 269. 960 | |
| | POSTE ITALIANE SPA | 31, 033 | 19. 725 | 612, 125. 920 | |
| | MONCLER SPA | 16, 093 | 47. 050 | 757, 175. 650 | |
| | RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA | 7, 934 | 54. 050 | 428, 832. 700 | |
| | ENI SPA | 140, 264 | 14. 626 | 2, 051, 501. 260 | |
| | BPER BANCA | 102, 653 | 8. 674 | 890, 412. 120 | |
| | DAVIDE CAMPARI-MILANO NV | 41, 820 | 6. 120 | 255, 938. 400 | |
| | BANCO BPM SPA | 83, 944 | 11. 495 | 964, 936. 280 | |
| | INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL | 18, 401 | 10. 240 | 188, 426. 240 | |
| | NEXI SPA | 38, 461 | 5. 256 | 202, 151. 010 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----|------------------------------|-----------|---------|---------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| | BANCA MEDOLANUM SPA | 15,600 | 16.980 | 264,888.000 | |
| | LEONARDO SPA | 27,883 | 47.140 | 1,314,404.620 | |
| | ENEL SPA | 560,314 | 7.841 | 4,393,422.070 | |
| | SNAM SPA | 136,735 | 5.172 | 707,193.420 | |
| | TERNA SPA | 96,930 | 8.536 | 827,394.480 | |
| | FINECOBANK SPA | 42,133 | 18.475 | 778,407.170 | |
| | STELLANTIS NV | 138,905 | 7.750 | 1,076,513.750 | |
| | FERRARI NV | 8,686 | 418.400 | 3,634,222.400 | |
| | TELEFONICA SA | 253,904 | 4.554 | 1,156,278.810 | |
| | ENDESA SA | 21,525 | 25.740 | 554,053.500 | |
| | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 397,039 | 15.605 | 6,195,793.590 | |
| | IBERDROLA SA | 438,883 | 15.720 | 6,899,240.760 | |
| | BANCO DE SABADELL SA | 344,594 | 3.219 | 1,109,248.080 | |
| | BANKINTER SA | 47,200 | 12.515 | 590,708.000 | |
| | REPSOL SA | 79,736 | 14.190 | 1,131,453.840 | |
| | GRIFOLS SA | 20,213 | 12.300 | 248,619.900 | |
| | BANCO SANTANDER SA | 1,024,367 | 8.089 | 8,286,104.660 | |
| | AMADEUS IT GROUP SA | 31,033 | 68.560 | 2,127,622.480 | |
| | CAIXABANK SA | 267,370 | 8.576 | 2,292,965.120 | |
| | INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI | 87,000 | 4.505 | 391,935.000 | |
| | ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 12,317 | 64.900 | 799,373.300 | |
| | AENA SME SA | 51,671 | 24.410 | 1,261,289.110 | |
| | CELLNEX TELECOM SA | 34,067 | 30.620 | 1,043,131.540 | |
| | ACCIONA SA | 1,712 | 167.700 | 287,102.400 | |
| | INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL | 75,149 | 42.070 | 3,161,518.430 | |
| | RED ELECTRICA CORPORACION SA | 27,487 | 16.680 | 458,483.160 | |
| | UPM-KYMMENE OYJ | 36,188 | 23.790 | 860,912.520 | |
| | NOKIA OYJ | 356,483 | 3.882 | 1,383,867.000 | |
| | WARTSILA OYJ ABP | 34,650 | 24.740 | 857,241.000 | |
| | STORA ENSO OYJ-R SHS | 39,502 | 9.728 | 384,275.450 | |
| | ELISA OYJ | 9,684 | 45.860 | 444,108.240 | |
| | SAMPO OYJ-A SHS | 166,804 | 9.750 | 1,626,339.000 | |
| | FORTUM OYJ | 30,379 | 14.740 | 447,786.460 | |
| | KESKO OYJ-B SHS | 18,838 | 19.200 | 361,689.600 | |
| | KONE OYJ-B | 23,414 | 55.680 | 1,303,691.520 | |
| | NESTE OYJ | 28,715 | 16.775 | 481,694.120 | |
| | ORION OYJ-CLASS B | 7,366 | 65.900 | 485,419.400 | |
| | METSO CORPORATION | 45,854 | 11.565 | 530,301.510 | |
| | NORDEA BANK ABP | 215,067 | 13.340 | 2,868,993.780 | |
| | VERBUND AG | 4,639 | 61.900 | 287,154.100 | |
| | OMV AG | 10,014 | 46.100 | 461,645.400 | |
| | ERSTE GROUP BANK AG | 21,210 | 81.050 | 1,719,070.500 | |
| | RYANAIR HOLDINGS PLC | 58,354 | 24.040 | 1,402,830.160 | |
| | AIB GROUP PLC | 147,367 | 7.145 | 1,052,937.210 | |
| | BANK OF IRELAND GROUP PLC | 66,750 | 12.920 | 862,410.000 | |
| | KINGSPAN GROUP PLC | 10,662 | 69.400 | 739,942.800 | |

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----------|------------------------------|----------|----------|--|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| | JERONIMO MARTINS | 19, 184 | 21. 900 | 420, 129. 600 | |
| | EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 216, 179 | 3. 749 | 810, 455. 070 | |
| | BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R | 606, 730 | 0. 710 | 431, 263. 680 | |
| | GALP ENERGIA SGPS SA | 28, 255 | 15. 765 | 445, 440. 070 | |
| | EDP RENOVAVEIS SA | 21, 782 | 10. 000 | 217, 820. 000 | |
| | KERRY GROUP PLC-A | 11, 282 | 78. 850 | 889, 585. 700 | |
| ユーロ 小計 | | | | 390, 211, 186. 730 (67, 842, 116, 925) | |
| 香港・ドル | POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 101, 500 | 51. 300 | 5, 206, 950. 000 | |
| | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 160, 000 | 41. 280 | 6, 604, 800. 000 | |
| | MTR CORP | 114, 000 | 26. 400 | 3, 009, 600. 000 | |
| | SUN HUNG KAI PROPERTIES | 106, 000 | 92. 150 | 9, 767, 900. 000 | |
| | SINO LAND CO | 268, 000 | 9. 670 | 2, 591, 560. 000 | |
| | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 196, 169 | 51. 300 | 10, 063, 469. 700 | |
| | WHARF HOLDINGS LTD | 77, 000 | 23. 060 | 1, 775, 620. 000 | |
| | SWIRE PACIFIC LTD - CL A | 26, 000 | 67. 400 | 1, 752, 400. 000 | |
| | CLP HOLDINGS LTD | 120, 000 | 64. 600 | 7, 752, 000. 000 | |
| | HENDERSON LAND DEVELOPMENT | 106, 507 | 26. 520 | 2, 824, 565. 640 | |
| | HONG KONG & CHINA GAS | 817, 475 | 6. 890 | 5, 632, 402. 750 | |
| | HANG SENG BANK LTD | 55, 000 | 114. 000 | 6, 270, 000. 000 | |
| | WH GROUP LTD | 609, 000 | 8. 340 | 5, 079, 060. 000 | |
| | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 88, 000 | 435. 600 | 38, 332, 800. 000 | |
| | CK ASSET HOLDINGS LTD | 140, 669 | 36. 980 | 5, 201, 939. 620 | |
| | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L | 45, 000 | 52. 950 | 2, 382, 750. 000 | |
| | AIA GROUP LTD | 776, 000 | 71. 650 | 55, 600, 400. 000 | |
| | SITC INTERNATIONAL HOLDINGS | 99, 000 | 28. 260 | 2, 797, 740. 000 | |
| | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 122, 000 | 22. 620 | 2, 759, 640. 000 | |
| | SANDS CHINA LTD | 177, 600 | 19. 710 | 3, 500, 496. 000 | |
| | TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | 107, 000 | 96. 700 | 10, 346, 900. 000 | |
| | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 270, 500 | 37. 280 | 10, 084, 240. 000 | |
| 香港・ドル 小計 | | | | 199, 337, 233. 710 (3, 795, 380, 930) | |
| 合計 | | | | 757, 500, 641, 996 [757, 500, 641, 996] | |

(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 | 10, 137 | 1, 980, 871. 170 | |
| | | SIMON PROPERTY GROUP INC | 23, 107 | 4, 211, 250. 750 | |
| | | BXP INC | 10, 500 | 806, 715. 000 | |
| | | SBA COMMUNICATIONS CORP | 7, 600 | 1, 502, 824. 000 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL | 25, 600 | 1, 710, 336. 000 | |
| | | EQUINIX INC | 6, 908 | 5, 344, 581. 440 | |
| | | AMERICAN TOWER CORP | 33, 100 | 6, 564, 392. 000 | |
| | | AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 23, 500 | 818, 975. 000 | |
| | | KIMCO REALTY CORP | 47, 800 | 1, 087, 928. 000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------------|------------------------------|------------------------------|---------|------------------------------------|----|
| | | GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 19,400 | 939,542.000 | |
| | | INVITATION HOMES INC | 41,100 | 1,243,275.000 | |
| | | VICI PROPERTIES INC | 74,600 | 2,506,560.000 | |
| | | VENTAS INC | 31,900 | 2,166,329.000 | |
| | | WEYERHAEUSER CO | 51,214 | 1,339,246.100 | |
| | | CROWN CASTLE INTL CORP | 30,800 | 2,961,420.000 | |
| | | IRON MOUNTAIN INC | 20,900 | 1,926,562.000 | |
| | | SUN COMMUNITIES INC | 9,100 | 1,181,362.000 | |
| | | PROLOGIS INC | 65,554 | 7,450,212.100 | |
| | | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 11,000 | 931,700.000 | |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 7,600 | 846,336.000 | |
| | | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 4,600 | 1,233,352.000 | |
| | | WELLTOWER INC | 46,200 | 7,753,284.000 | |
| | | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 48,400 | 890,076.000 | |
| | | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 8,300 | 1,206,820.000 | |
| | | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 12,900 | 796,188.000 | |
| | | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN | 42,700 | 943,243.000 | |
| | | REALTY INCOME CORP | 63,795 | 3,782,405.550 | |
| | | PUBLIC STORAGE | 11,200 | 3,335,360.000 | |
| | | REGENCY CENTERS CORP | 12,200 | 898,896.000 | |
| | | UDR INC | 22,300 | 871,707.000 | |
| | | WP CAREY INC | 15,500 | 1,055,860.000 | |
| | | DIGITAL REALTY TRUST INC | 23,800 | 3,885,112.000 | |
| | | EXTRA SPACE STORAGE INC | 15,000 | 2,209,200.000 | |
| | アメリカ・ドル | 小計 | | 76,381,921.110 (11,340,423,827) | |
| イギリス・ポンド | LAND SECURITIES GROUP PLC | | 48,766 | 263,092.570 | |
| | SEGRO PLC | | 87,095 | 546,782.410 | |
| イギリス・ポンド | 小計 | | | 809,874.980 (162,234,156) | |
| オーストラリア・ドル | TRANSURBAN GROUP | | 206,386 | 2,965,766.820 | |
| | APA GROUP | | 86,730 | 770,162.400 | |
| | SCENTRE GROUP | | 345,787 | 1,403,895.220 | |
| | STOCKLAND | | 156,047 | 970,612.340 | |
| | GOODMAN GROUP | | 134,871 | 4,515,481.080 | |
| | VICINITY CENTRES | | 252,023 | 645,178.880 | |
| オーストラリア・ドル | 小計 | | | 11,271,096.740 (1,096,790,424) | |
| シンガポール・ドル | CAPITALAND ASCENDAS REIT | | 285,800 | 791,666.000 | |
| | CAPITALAND INTEGRATED COMMER | | 427,291 | 965,677.660 | |
| シンガポール・ドル | 小計 | | | 1,757,343.660 (202,990,766) | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----------|---------------------------|---------|------------------------------------|----|
| | ユーロ | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 8,397 | 735,409.260 | |
| | | GECINA SA | 3,108 | 260,295.000 | |
| | | KLEPIERRE | 14,542 | 487,738.680 | |
| | | COVIVIO | 3,853 | 216,731.250 | |
| | ユーロ 小計 | | | 1,700,174.190 (295,592,285) | |
| | 香港・ドル | LINK REIT | 189,800 | 7,876,700.000 | |
| | | HKT TRUST AND HKT LTD-SS | 277,000 | 3,227,050.000 | |
| | 香港・ドル 小計 | | | 11,103,750.000 (211,415,400) | |
| | 投資証券 合計 | | | 13,309,446,858 [13,309,446,858] | |
| | 合計 | | | 13,309,446,858 [13,309,446,858] | |

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 524 銘柄 投資証券 33 銘柄 | 98.1% | 1.9% | 77.4% |
| イギリス・ポンド | 株式 71 銘柄 投資証券 2 銘柄 | 99.4% | 0.6% | 3.8% |
| イスラエル・シュケル | 株式 10 銘柄 | 100% | -% | 0.2% |
| オーストラリア・ドル | 株式 41 銘柄 投資証券 6 銘柄 | 91.6% | 8.4% | 1.7% |
| カナダ・ドル | 株式 83 銘柄 | 100% | -% | 3.2% |
| シンガポール・ドル | 株式 13 銘柄 投資証券 2 銘柄 | 93% | 7.0% | 0.4% |
| スイス・フラン | 株式 43 銘柄 | 100% | -% | 2.4% |
| スウェーデン・クローナ | 株式 40 銘柄 | 100% | -% | 0.8% |
| デンマーク・クローネ | 株式 15 銘柄 | 100% | -% | 0.5% |
| ニュージーランド・ドル | 株式 5 銘柄 | 100% | -% | 0.1% |
| 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 4 銘柄 | 99.6% | 0.4% | 8.8% |
| 香港・ドル | 株式 22 銘柄 投資証券 2 銘柄 | 94.7% | 5.3% | 0.5% |

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

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

貸借対照表

| | 2024年9月9日現在 金額(円) | 2025年9月8日現在 金額(円) |
|------------------|----------------------|----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 2,519,089,461 | 2,152,208,971 |
| コール・ローン | 999,645,481 | 1,122,549,170 |
| 国債証券 | 308,161,268,383 | 346,096,709,260 |
| 派生商品評価勘定 | 1,015 | 8,971,611 |
| 未収入金 | — | 153,721 |
| 未収利息 | 2,211,509,089 | 2,660,509,188 |
| 前払費用 | 149,220,358 | 141,199,896 |
| 流動資産合計 | 314,040,733,787 | 352,182,301,817 |
| 資産合計 | 314,040,733,787 | 352,182,301,817 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 19,406,553 | 74,650 |
| 未払金 | 455,507 | — |
| 未払解約金 | 126,946,817 | 203,406,421 |
| 流動負債合計 | 146,808,877 | 203,481,071 |
| 負債合計 | 146,808,877 | 203,481,071 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ※1 88,440,035,633 | 92,254,082,920 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金 (△) | 225,453,889,277 | 259,724,737,826 |
| 元本等合計 | 313,893,924,910 | 351,978,820,746 |
| 純資産合計 | 313,893,924,910 | 351,978,820,746 |
| 負債純資産合計 | 314,040,733,787 | 352,182,301,817 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | 自 2024 年 9 月 10 日 至 2025 年 9 月 8 日 |
|----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、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> |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p> |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年總理府令第 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算処理を採用しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 2024 年 9 月 9 日現在 | 2025 年 9 月 8 日現在 |
|-----------------|------------------|------------------|
| 1. ※1 期首 | | |
| 期首元本額 | 2023 年 9 月 8 日 | 2024 年 9 月 10 日 |
| 期中追加設定元本額 | 81,490,428,967 円 | 88,440,035,633 円 |
| 期中一部解約元本額 | 13,845,307,021 円 | 16,361,140,295 円 |
| 期末元本額の内訳 | 6,895,700,355 円 | 12,547,093,008 円 |
| ファンド名 | | |
| ダイワ外国債券インデックス V | 334,284,052 円 | 253,100,710 円 |
| A | | |

| 区分 | 2024年9月9日現在 | 2025年9月8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) | 4,950,980 円 | 4,660,760 円 |
| ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私募) | 31,902,746 円 | 23,818,760 円 |
| ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私募) | 14,267,455 円 | 12,354,424 円 |
| ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私募) | 178,441,285 円 | 135,633,584 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) | 796,100,609 円 | 1,009,718,287 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) | 613,146,390 円 | 678,351,579 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) | 969,436,086 円 | 1,044,634,371 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) | 5,638,316,159 円 | 7,624,731,897 円 |
| ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマ ージングプラス (為替ヘッジな し) | 1,128,937,747 円 | 1,075,867,916 円 |
| D—I's 外国債券インデック ス | 1,826,625 円 | 1,332,817 円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー 2050 | 21,719,982 円 | 27,644,639 円 |
| iFree 外国債券インデック ス | 2,039,529,754 円 | 1,266,940,397 円 |
| iFree 8資産バランス | 2,647,928,780 円 | 3,253,312,085 円 |
| iFree 年金バランス | 623,529,591 円 | 747,366,962 円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー 2060 | 2,275,241 円 | 3,773,606 円 |
| DCダイワ外国債券インデック ス | 51,775,310,181 円 | 51,019,021,694 円 |
| ダイワ・ライフ・バランス30 | 1,194,490,715 円 | 1,255,361,290 円 |
| ダイワ・ライフ・バランス50 | 918,786,615 円 | 995,015,612 円 |
| ダイワ・ライフ・バランス70 | 730,856,465 円 | 813,112,694 円 |
| DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース) | 721,177,932 円 | 792,717,183 円 |
| DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース) | 592,006,270 円 | 648,836,524 円 |
| DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース) | 241,749,041 円 | 312,243,472 円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー 2030 | 34,439,660 円 | 35,152,531 円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー 2040 | 21,631,919 円 | 30,692,734 円 |
| ダイワつみたてインデックス外 国債券 | 2,393,028,554 円 | 2,801,867,546 円 |

| 区分 | 2024年9月9日現在 | 2025年9月8日現在 |
|----------------------------------|----------------|----------------|
| ダイワつみたてインデックスバランス30 | 4,983,279円 | 5,292,316円 |
| ダイワつみたてインデックスバランス50 | 2,478,881円 | 2,934,544円 |
| ダイワつみたてインデックスバランス70 | 4,158,514円 | 39,465,904円 |
| ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ラップ専用) | 2,194,163,571円 | 3,073,514,089円 |
| ダイワ世界バランスファンド40VA | 90,046,824円 | 82,854,322円 |
| ダイワ世界バランスファンド60VA | 27,047,472円 | 26,563,761円 |
| ダイワ・バランスファンド35VA | 2,512,298,728円 | 2,134,138,021円 |
| ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用) | 162,551,333円 | 144,025,583円 |
| スタイル9(4資産分散・保守型) | 147,695円 | 354,111円 |
| スタイル9(4資産分散・バランス型) | 1,833,793円 | 4,393,184円 |
| スタイル9(4資産分散・積極型) | 1,674,011円 | 4,791,857円 |
| スタイル9(6資産分散・保守型) | 38,982円 | 140,946円 |
| スタイル9(6資産分散・バランス型) | 1,220,989円 | 4,125,988円 |
| スタイル9(6資産分散・積極型) | 431,674円 | 1,973,561円 |
| スタイル9(8資産分散・保守型) | 61,560円 | 210,415円 |
| スタイル9(8資産分散・バランス型) | 1,210,582円 | 2,706,852円 |
| スタイル9(8資産分散・積極型) | 1,348,851円 | 2,896,224円 |
| ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)(投資一任専用) | -円 | 4,772,355円 |
| ダイワ・インデックスセレクト外国債券 | 135,760,414円 | 115,125,199円 |
| ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド | 68,716,898円 | 67,426,427円 |
| ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用) | 3,504,769,883円 | 4,415,656,622円 |
| ダイワ投信俱楽部外国債券インデックス | 5,953,669,728円 | 6,153,353,537円 |
| ダイワライフスタイル25 | 25,738,639円 | 23,808,345円 |
| ダイワライフスタイル50 | 58,505,542円 | 58,465,895円 |
| ダイワライフスタイル75 | 17,106,956円 | 17,828,788円 |

| 区分 | 2024年9月9日現在 | 2025年9月8日現在 |
|------------------|------------------|------------------|
| 計 | 88,440,035,633 円 | 92,254,082,920 円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 88,440,035,633 口 | 92,254,082,920 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 2024年9月10日 至 2025年9月8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 | 2025年9月8日現在 |
|--------------------------|--|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 2024年9月9日現在 | 2025年9月8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 | 11,323,285,016 | △1,323,582,924 |
| 合計 | 11,323,285,016 | △1,323,582,924 |

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

| 種類 | 2024年9月9日現在 | | | 2025年9月8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) |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | |
| 買建 | 900,446,984 | - | 881,041,446 | △19,405,538 | 896,416,225 | - |
| アメリカ・ド ル | 92,558,185 | - | 91,327,710 | △1,230,475 | 249,575,645 | - |
| イギリス・ ポンド | 11,956,631 | - | 11,772,180 | △184,451 | - | - |
| イスラエル・ シェケル | 64,850,317 | - | 61,840,696 | △3,009,621 | 34,665,836 | - |
| オランダ・ 人民元 | 583,897,032 | - | 571,393,720 | △12,503,312 | 299,343,202 | - |
| シンガポー ル・ドル | 13,368,888 | - | 13,113,204 | △255,684 | 32,239,227 | - |
| スウェーデ ン | - | - | - | - | 9,894,403 | - |
| ・クローナ デンマーク・ クローネ ニュージー | 1,917,798 | - | 1,883,240 | △34,558 | 9,611,032 | - |
| ラ ンド・ドル | - | - | - | - | 71,461,483 | - |
| ノルウェー・ クローネ ポーランド・ ズロチ | 15,253,779 | - | 14,792,026 | △461,753 | 2,882,721 | - |
| メキシコ・ペ ソ | 52,778,680 | - | 51,779,991 | △998,689 | 47,660,302 | - |
| ユーロ | 63,865,674 | - | 63,138,679 | △726,995 | 45,747,285 | - |
| 合計 | 900,446,984 | - | 881,041,446 | △19,405,538 | 896,416,225 | - |
| | | | | | 905,313,186 | 8,896,961 |

(注) 1. 時価の算定方法

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

① 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

(1 口当たり情報)

| | 2024 年 9 月 9 日現在 | 2025 年 9 月 8 日現在 |
|-----------------------------|------------------------|------------------------|
| 1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額) | 3,5492 円 (35,492 円) | 3,8153 円 (38,153 円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------|---------|--|---------------|---------------|----|
| 国債証券 | アメリカ・ドル | 6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115 | 709,000.000 | 748,349.500 | |
| | | 5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115 | 738,000.000 | 776,280.060 | |
| | | 6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515 | 714,000.000 | 795,324.600 | |
| | | 5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215 | 2,391,000.000 | 2,593,111.230 | |
| | | 4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215 | 976,000.000 | 1,013,009.920 | |
| | | 5% United States Treasury Note/Bond 20370515 | 847,000.000 | 911,482.110 | |
| | | 4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215 | 548,000.000 | 553,967.720 | |
| | | 4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515 | 519,000.000 | 531,585.750 | |
| | | 3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215 | 1,049,000.000 | 960,611.260 | |
| | | 4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515 | 1,121,000.000 | 1,104,835.180 | |
| | | 4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815 | 1,060,000.000 | 1,069,370.400 | |
| | | 4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115 | 1,210,000.000 | 1,201,675.200 | |
| | | 4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215 | 1,010,000.000 | 1,028,775.900 | |
| | | 4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515 | 1,178,000.000 | 1,165,843.040 | |
| | | 3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815 | 1,091,000.000 | 1,016,964.740 | |
| | | 4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115 | 1,469,000.000 | 1,426,927.840 | |
| | | 4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215 | 1,254,000.000 | 1,286,917.500 | |
| | | 4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515 | 1,365,000.000 | 1,339,351.650 | |
| | | 3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815 | 1,517,000.000 | 1,377,208.450 | |
| | | 3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115 | 1,450,000.000 | 1,205,196.500 | |
| | | 3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215 | 1,623,000.000 | 1,342,204.770 | |
| | | 3% United States Treasury Note/Bond 20420515 | 1,353,000.000 | 1,094,333.460 | |
| | | 2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815 | 5,231,000.000 | 4,056,640.500 | |
| | | 2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115 | 1,630,000.000 | 1,257,382.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---|------------------|------------------|----|
| | | 3. 125% United States Treasury Note/Bond 20430215 | 2, 626, 000. 000 | 2, 136, 907. 500 | |
| | | 2. 875% United States Treasury Note/Bond 20430515 | 2, 298, 000. 000 | 1, 794, 140. 520 | |
| | | 3. 625% United States Treasury Note/Bond 20430815 | 3, 214, 000. 000 | 2, 796, 662. 100 | |
| | | 3. 75% United States Treasury Note/Bond 20431115 | 2, 081, 000. 000 | 1, 837, 523. 000 | |
| | | 3. 625% United States Treasury Note/Bond 20440215 | 4, 307, 000. 000 | 3, 726, 545. 610 | |
| | | 3. 375% United States Treasury Note/Bond 20440515 | 1, 327, 000. 000 | 1, 103, 785. 330 | |
| | | 3. 125% United States Treasury Note/Bond 20440815 | 1, 929, 000. 000 | 1, 539, 187. 680 | |
| | | 3% United States Treasury Note/Bond 20441115 | 2, 746, 000. 000 | 2, 139, 600. 820 | |
| | | 2. 5% United States Treasury Note/Bond 20450215 | 2, 063, 000. 000 | 1, 469, 804. 980 | |
| | | 3% United States Treasury Note/Bond 20450515 | 2, 935, 000. 000 | 2, 274, 038. 000 | |
| | | 2. 875% United States Treasury Note/Bond 20450815 | 1, 873, 000. 000 | 1, 416, 306. 410 | |
| | | 3% United States Treasury Note/Bond 20451115 | 659, 000. 000 | 507, 785. 860 | |
| | | 2. 5% United States Treasury Note/Bond 20460215 | 1, 148, 000. 000 | 805, 344. 960 | |
| | | 2. 5% United States Treasury Note/Bond 20460515 | 2, 823, 000. 000 | 1, 973, 869. 830 | |
| | | 2. 25% United States Treasury Note/Bond 20460815 | 2, 780, 000. 000 | 1, 843, 140. 000 | |
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20261115 | 5, 300, 000. 000 | 5, 197, 498. 000 | |
| | | 2. 875% United States Treasury Note/Bond 20461115 | 1, 000, 000. 000 | 744, 760. 000 | |
| | | 2. 25% United States Treasury Note/Bond 20270215 | 3, 640, 000. 000 | 3, 571, 167. 600 | |
| | | 3% United States Treasury Note/Bond 20470215 | 2, 345, 000. 000 | 1, 781, 191. 650 | |
| | | 2. 375% United States Treasury Note/Bond 20270515 | 6, 400, 000. 000 | 6, 276, 480. 000 | |
| | | 3% United States Treasury Note/Bond 20470515 | 2, 000, 000. 000 | 1, 515, 140. 000 | |
| | | 2. 25% United States Treasury Note/Bond 20270815 | 5, 900, 000. 000 | 5, 758, 931. 000 | |
| | | 2. 75% United States Treasury Note/Bond 20470815 | 2, 450, 000. 000 | 1, 766, 376. 500 | |
| | | 2. 25% United States Treasury Note/Bond 20271115 | 5, 500, 000. 000 | 5, 354, 965. 000 | |
| | | 2. 75% United States Treasury Note/Bond 20471115 | 2, 500, 000. 000 | 1, 797, 850. 000 | |
| | | 2. 75% United States Treasury Note/Bond 20280215 | 6, 350, 000. 000 | 6, 239, 319. 500 | |
| | | 3% United States Treasury Note/Bond 20480215 | 3, 000, 000. 000 | 2, 254, 680. 000 | |
| | | 3. 125% United States Treasury Note/Bond 20480515 | 3, 800, 000. 000 | 2, 915, 892. 000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---|----------------|----------------|----|
| | | 2. 875% United States Treasury Note/Bond 20280515 | 11,500,000.000 | 11,316,920.000 | |
| | | 2. 875% United States Treasury Note/Bond 20280815 | 3,700,000.000 | 3,635,805.000 | |
| | | 3% United States Treasury Note/Bond 20480815 | 3,220,000.000 | 2,408,946.400 | |
| | | 3. 125% United States Treasury Note/Bond 20281115 | 3,700,000.000 | 3,657,339.000 | |
| | | 3. 375% United States Treasury Note/Bond 20481115 | 3,020,000.000 | 2,415,033.600 | |
| | | 2. 625% United States Treasury Note/Bond 20290215 | 6,600,000.000 | 6,411,768.000 | |
| | | 3% United States Treasury Note/Bond 20490215 | 4,700,000.000 | 3,500,936.000 | |
| | | 2. 875% United States Treasury Note/Bond 20490515 | 4,150,000.000 | 3,010,659.000 | |
| | | 2. 375% United States Treasury Note/Bond 20290515 | 3,900,000.000 | 3,746,262.000 | |
| | | 1. 625% United States Treasury Note/Bond 20290815 | 4,700,000.000 | 4,379,883.000 | |
| | | 2. 25% United States Treasury Note/Bond 20490815 | 2,200,000.000 | 1,394,250.000 | |
| | | 1. 375% United States Treasury Note/Bond 20260831 | 2,800,000.000 | 2,737,252.000 | |
| | | 1. 625% United States Treasury Note/Bond 20260930 | 2,500,000.000 | 2,446,775.000 | |
| | | 1. 625% United States Treasury Note/Bond 20261031 | 3,000,000.000 | 2,931,030.000 | |
| | | 1. 75% United States Treasury Note/Bond 20291115 | 5,350,000.000 | 4,986,146.500 | |
| | | 2. 375% United States Treasury Note/Bond 20491115 | 4,500,000.000 | 2,923,920.000 | |
| | | 1. 625% United States Treasury Note/Bond 20261130 | 2,000,000.000 | 1,951,780.000 | |
| | | 1. 75% United States Treasury Note/Bond 20261231 | 2,500,000.000 | 2,439,825.000 | |
| | | 1. 5% United States Treasury Note/Bond 20300215 | 5,000,000.000 | 4,581,600.000 | |
| | | 1. 5% United States Treasury Note/Bond 20270131 | 6,500,000.000 | 6,312,605.000 | |
| | | 2% United States Treasury Note/Bond 20500215 | 4,400,000.000 | 2,610,740.000 | |
| | | 1. 125% United States Treasury Note/Bond 20270228 | 1,300,000.000 | 1,253,954.000 | |
| | | 0. 625% United States Treasury Note/Bond 20270331 | 1,600,000.000 | 1,528,896.000 | |
| | | 0. 625% United States Treasury Note/Bond 20300515 | 6,800,000.000 | 5,939,188.000 | |
| | | 0. 5% United States Treasury Note/Bond 20270430 | 2,400,000.000 | 2,283,552.000 | |
| | | 1. 25% United States Treasury Note/Bond 20500515 | 1,900,000.000 | 923,229.000 | |
| | | 1. 125% United States Treasury Note/Bond 20400515 | 3,400,000.000 | 2,163,046.000 | |
| | | 0. 5% United States Treasury Note/Bond 20270531 | 3,500,000.000 | 3,322,795.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---|-------------------|------------------|----|
| | | 0. 5% United States Treasury Note/Bond 20270630 | 3, 500, 000. 000 | 3, 314, 990. 000 | |
| | | 0. 625% United States Treasury Note/Bond 20300815 | 8, 000, 000. 000 | 6, 931, 360. 000 | |
| | | 0. 375% United States Treasury Note/Bond 20270731 | 5, 000, 000. 000 | 4, 713, 250. 000 | |
| | | 1. 375% United States Treasury Note/Bond 20500815 | 6, 200, 000. 000 | 3, 089, 336. 000 | |
| | | 1. 125% United States Treasury Note/Bond 20400815 | 3, 400, 000. 000 | 2, 139, 008. 000 | |
| | | 0. 5% United States Treasury Note/Bond 20270831 | 3, 500, 000. 000 | 3, 299, 345. 000 | |
| | | 0. 375% United States Treasury Note/Bond 20270930 | 4, 000, 000. 000 | 3, 752, 400. 000 | |
| | | 0. 875% United States Treasury Note/Bond 20301115 | 9, 800, 000. 000 | 8, 542, 758. 000 | |
| | | 0. 5% United States Treasury Note/Bond 20271031 | 4, 000, 000. 000 | 3, 752, 880. 000 | |
| | | 1. 625% United States Treasury Note/Bond 20501115 | 6, 000, 000. 000 | 3, 190, 140. 000 | |
| | | 1. 375% United States Treasury Note/Bond 20401115 | 4, 300, 000. 000 | 2, 798, 268. 000 | |
| | | 0. 625% United States Treasury Note/Bond 20271130 | 5, 000, 000. 000 | 4, 694, 600. 000 | |
| | | 0. 625% United States Treasury Note/Bond 20271231 | 5, 000, 000. 000 | 4, 682, 800. 000 | |
| | | 0. 75% United States Treasury Note/Bond 20280131 | 7, 000, 000. 000 | 6, 560, 400. 000 | |
| | | 1. 875% United States Treasury Note/Bond 20510215 | 5, 900, 000. 000 | 3, 340, 875. 000 | |
| | | 1. 125% United States Treasury Note/Bond 20310215 | 10, 700, 000. 000 | 9, 402, 197. 000 | |
| | | 1. 125% United States Treasury Note/Bond 20280229 | 5, 000, 000. 000 | 4, 721, 050. 000 | |
| | | 1. 875% United States Treasury Note/Bond 20410215 | 4, 700, 000. 000 | 3, 296, 486. 000 | |
| | | 1. 25% United States Treasury Note/Bond 20280331 | 4, 000, 000. 000 | 3, 781, 480. 000 | |
| | | 1. 625% United States Treasury Note/Bond 20310515 | 8, 000, 000. 000 | 7, 166, 240. 000 | |
| | | 1. 25% United States Treasury Note/Bond 20280430 | 1, 500, 000. 000 | 1, 415, 730. 000 | |
| | | 2. 375% United States Treasury Note/Bond 20510515 | 6, 400, 000. 000 | 4, 086, 592. 000 | |
| | | 2. 25% United States Treasury Note/Bond 20410515 | 3, 800, 000. 000 | 2, 810, 062. 000 | |
| | | 1. 25% United States Treasury Note/Bond 20280531 | 6, 000, 000. 000 | 5, 651, 340. 000 | |
| | | 1. 25% United States Treasury Note/Bond 20280630 | 5, 000, 000. 000 | 4, 701, 450. 000 | |
| | | 1. 25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815 | 10, 300, 000. 000 | 8, 963, 575. 000 | |
| | | 2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815 | 3, 900, 000. 000 | 2, 264, 496. 000 | |
| | | 1. 75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815 | 5, 700, 000. 000 | 3, 855, 822. 000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---|----------------|---------------|----|
| | | 1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731 | 5,000,000.000 | 4,658,950.000 | |
| | | 1. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831 | 5,000,000.000 | 4,666,400.000 | |
| | | 0. 75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831 | 5,000,000.000 | 4,858,800.000 | |
| | | 1. 25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930 | 5,000,000.000 | 4,675,550.000 | |
| | | 0. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930 | 3,500,000.000 | 3,397,800.000 | |
| | | 1. 375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115 | 10,000,000.000 | 8,704,600.000 | |
| | | 1. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115 | 6,600,000.000 | 3,698,574.000 | |
| | | 2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115 | 4,000,000.000 | 2,801,840.000 | |
| | | 1. 375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031 | 6,000,000.000 | 5,622,600.000 | |
| | | 1. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031 | 7,000,000.000 | 6,799,100.000 | |
| | | 1. 25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130 | 5,000,000.000 | 4,855,850.000 | |
| | | 1. 5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130 | 5,600,000.000 | 5,259,576.000 | |
| | | 1. 375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231 | 6,500,000.000 | 6,070,870.000 | |
| | | 1. 25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231 | 4,000,000.000 | 3,877,720.000 | |
| | | 1. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215 | 7,900,000.000 | 7,051,619.000 | |
| | | 1. 75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131 | 4,300,000.000 | 4,058,856.000 | |
| | | 2. 25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215 | 5,200,000.000 | 3,199,196.000 | |
| | | 2. 375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215 | 2,500,000.000 | 1,847,250.000 | |
| | | 1. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228 | 5,000,000.000 | 4,733,300.000 | |
| | | 1. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228 | 5,000,000.000 | 4,875,750.000 | |
| | | 2. 375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331 | 3,000,000.000 | 2,885,730.000 | |
| | | 2. 5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331 | 5,000,000.000 | 4,917,550.000 | |
| | | 2. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515 | 6,300,000.000 | 5,961,690.000 | |
| | | 2. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515 | 5,000,000.000 | 3,542,550.000 | |
| | | 3. 25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515 | 1,500,000.000 | 1,258,125.000 | |
| | | 2. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430 | 3,000,000.000 | 2,933,370.000 | |
| | | 2. 75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430 | 3,000,000.000 | 2,960,490.000 | |
| | | 2. 75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531 | 5,000,000.000 | 4,864,250.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---|---------------|---------------|----|
| | | 2. 625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531 | 2,000,000.000 | 1,968,460.000 | |
| | | 3. 25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630 | 4,000,000.000 | 3,958,960.000 | |
| | | 3. 25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630 | 3,000,000.000 | 2,984,520.000 | |
| | | 2. 75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731 | 4,070,000.000 | 4,010,985.000 | |
| | | 2. 75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815 | 9,500,000.000 | 8,888,960.000 | |
| | | 3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815 | 5,200,000.000 | 3,776,500.000 | |
| | | 3. 375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815 | 2,000,000.000 | 1,701,280.000 | |
| | | 2. 625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731 | 3,360,000.000 | 3,248,952.000 | |
| | | 3. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831 | 2,500,000.000 | 2,480,800.000 | |
| | | 3. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831 | 3,500,000.000 | 3,445,785.000 | |
| | | 3. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930 | 2,500,000.000 | 2,530,750.000 | |
| | | 4. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930 | 3,500,000.000 | 3,541,895.000 | |
| | | 4. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031 | 3,000,000.000 | 3,037,260.000 | |
| | | 4. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115 | 6,700,000.000 | 6,825,692.000 | |
| | | 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115 | 3,700,000.000 | 3,256,851.000 | |
| | | 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031 | 3,000,000.000 | 3,051,420.000 | |
| | | 3. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130 | 2,500,000.000 | 2,530,500.000 | |
| | | 3. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130 | 3,000,000.000 | 3,023,070.000 | |
| | | 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20421115 | 2,500,000.000 | 2,306,975.000 | |
| | | 3. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231 | 5,000,000.000 | 5,061,300.000 | |
| | | 3. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271231 | 1,500,000.000 | 1,512,210.000 | |
| | | 3. 5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131 | 3,000,000.000 | 2,991,360.000 | |
| | | 3. 5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215 | 8,000,000.000 | 7,816,960.000 | |
| | | 3. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215 | 2,500,000.000 | 2,264,675.000 | |
| | | 3. 625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215 | 4,500,000.000 | 3,698,055.000 | |
| | | 3. 5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131 | 3,700,000.000 | 3,699,630.000 | |
| | | 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300228 | 7,500,000.000 | 7,633,575.000 | |
| | | 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280229 | 3,000,000.000 | 3,035,430.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---|----------------|----------------|----|
| | | 3. 625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331 | 1,800,000.000 | 1,803,258.000 | |
| | | 3. 625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280331 | 3,700,000.000 | 3,712,062.000 | |
| | | 3. 5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430 | 3,000,000.000 | 2,989,260.000 | |
| | | 3. 5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280430 | 2,000,000.000 | 2,000,180.000 | |
| | | 3. 375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515 | 6,300,000.000 | 6,091,155.000 | |
| | | 3. 625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515 | 5,600,000.000 | 4,596,760.000 | |
| | | 3. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515 | 2,500,000.000 | 2,259,900.000 | |
| | | 3. 625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280531 | 3,700,000.000 | 3,711,766.000 | |
| | | 3. 75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531 | 1,500,000.000 | 1,510,425.000 | |
| | | 3. 75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630 | 3,000,000.000 | 3,020,490.000 | |
| | | 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630 | 3,500,000.000 | 3,547,285.000 | |
| | | 4. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731 | 3,500,000.000 | 3,559,990.000 | |
| | | 3. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815 | 9,000,000.000 | 8,988,210.000 | |
| | | 4. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815 | 5,000,000.000 | 4,493,750.000 | |
| | | 4. 375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430815 | 2,300,000.000 | 2,216,625.000 | |
| | | 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731 | 3,000,000.000 | 3,052,890.000 | |
| | | 4. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300831 | 3,100,000.000 | 3,172,106.000 | |
| | | 4. 375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831 | 3,000,000.000 | 3,073,980.000 | |
| | | 4. 625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260915 | 3,000,000.000 | 3,027,240.000 | |
| | | 4. 625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930 | 1,500,000.000 | 1,569,285.000 | |
| | | 4. 625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930 | 4,200,000.000 | 4,336,416.000 | |
| | | 4. 625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261015 | 1,000,000.000 | 1,009,960.000 | |
| | | 4. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031 | 6,000,000.000 | 6,241,980.000 | |
| | | 4. 5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20331115 | 10,000,000.000 | 10,406,000.000 | |
| | | 4. 625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261115 | 3,800,000.000 | 3,840,508.000 | |
| | | 4. 75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20431115 | 2,300,000.000 | 2,322,540.000 | |
| | | 4. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301031 | 3,100,000.000 | 3,280,792.000 | |
| | | 4. 75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20531115 | 5,300,000.000 | 5,283,199.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---|----------------|----------------|----|
| | | 4. 375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301130 | 3,000,000.000 | 3,105,270.000 | |
| | | 4. 375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130 | 4,000,000.000 | 4,104,360.000 | |
| | | 4. 375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261215 | 2,000,000.000 | 2,017,500.000 | |
| | | 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310131 | 2,000,000.000 | 2,034,760.000 | |
| | | 3. 75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301231 | 4,500,000.000 | 4,524,075.000 | |
| | | 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131 | 8,500,000.000 | 8,630,135.000 | |
| | | 3. 75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231 | 1,000,000.000 | 1,007,260.000 | |
| | | 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270115 | 7,000,000.000 | 7,032,480.000 | |
| | | 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340215 | 10,200,000.000 | 10,238,046.000 | |
| | | 4. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270215 | 4,000,000.000 | 4,027,160.000 | |
| | | 4. 25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540215 | 4,400,000.000 | 4,038,100.000 | |
| | | 4. 5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440215 | 3,000,000.000 | 2,931,660.000 | |
| | | 4. 25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310228 | 3,600,000.000 | 3,706,488.000 | |
| | | 4. 25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228 | 5,200,000.000 | 5,323,552.000 | |
| | | 4. 25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270315 | 5,000,000.000 | 5,047,350.000 | |
| | | 4. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331 | 5,000,000.000 | 5,100,150.000 | |
| | | 4. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310331 | 2,000,000.000 | 2,046,860.000 | |
| | | 4. 5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270415 | 5,000,000.000 | 5,070,000.000 | |
| | | 4. 375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340515 | 8,500,000.000 | 8,750,325.000 | |
| | | 4. 5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270515 | 4,000,000.000 | 4,059,520.000 | |
| | | 4. 625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430 | 2,500,000.000 | 2,593,100.000 | |
| | | 4. 625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310430 | 1,600,000.000 | 1,677,328.000 | |
| | | 4. 625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540515 | 5,200,000.000 | 5,078,684.000 | |
| | | 4. 625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440515 | 3,500,000.000 | 3,470,320.000 | |
| | | 4. 5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531 | 5,600,000.000 | 5,787,096.000 | |
| | | 4. 625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310531 | 2,300,000.000 | 2,411,251.000 | |
| | | 4. 625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270615 | 4,500,000.000 | 4,581,540.000 | |
| | | 4. 25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310630 | 2,500,000.000 | 2,572,800.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---|----------------|----------------|----|
| | | 4. 25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630 | 100,000.000 | 102,521.000 | |
| | | 4. 375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270715 | 2,200,000.000 | 2,232,164.000 | |
| | | 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731 | 8,300,000.000 | 8,436,618.000 | |
| | | 4. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310731 | 5,000,000.000 | 5,112,200.000 | |
| | | 3. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340815 | 10,500,000.000 | 10,398,465.000 | |
| | | 3. 75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270815 | 7,000,000.000 | 7,027,020.000 | |
| | | 4. 25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540815 | 5,300,000.000 | 4,862,538.000 | |
| | | 3. 75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310831 | 4,000,000.000 | 4,009,120.000 | |
| | | 4. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440815 | 1,800,000.000 | 1,667,952.000 | |
| | | 3. 75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831 | 4,500,000.000 | 4,501,755.000 | |
| | | 3. 625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831 | 5,000,000.000 | 5,014,700.000 | |
| | | 3. 375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270915 | 1,000,000.000 | 997,360.000 | |
| | | 3. 5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930 | 4,500,000.000 | 4,490,550.000 | |
| | | 3. 5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930 | 800,000.000 | 798,544.000 | |
| | | 3. 625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310930 | 2,300,000.000 | 2,288,523.000 | |
| | | 3. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271015 | 1,310,000.000 | 1,319,301.000 | |
| | | 4. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031 | 5,000,000.000 | 5,108,650.000 | |
| | | 4. 25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20341115 | 9,000,000.000 | 9,151,290.000 | |
| | | 4. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271115 | 4,200,000.000 | 4,253,382.000 | |
| | | 4. 5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20541115 | 6,100,000.000 | 5,837,883.000 | |
| | | 4. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031 | 5,700,000.000 | 5,726,448.000 | |
| | | 4. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311031 | 3,300,000.000 | 3,371,775.000 | |
| | | 4. 25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130 | 6,000,000.000 | 6,040,140.000 | |
| | | 4. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130 | 5,500,000.000 | 5,620,505.000 | |
| | | 4. 625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20441115 | 2,400,000.000 | 2,374,584.000 | |
| | | 4. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311130 | 3,500,000.000 | 3,575,040.000 | |
| | | 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271215 | 4,000,000.000 | 4,043,560.000 | |
| | | 4. 375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231 | 4,000,000.000 | 4,128,400.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---|---------------|---------------|----|
| | | 4. 5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311231 | 3,500,000.000 | 3,647,105.000 | |
| | | 4. 25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231 | 1,500,000.000 | 1,511,160.000 | |
| | | 4. 25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280115 | 3,000,000.000 | 3,049,440.000 | |
| | | 4. 25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131 | 6,500,000.000 | 6,677,970.000 | |
| | | 4. 625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350215 | 8,600,000.000 | 8,986,312.000 | |
| | | 4. 25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280215 | 5,500,000.000 | 5,594,600.000 | |
| | | 4. 625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550215 | 5,600,000.000 | 5,470,472.000 | |
| | | 4. 75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20450215 | 3,500,000.000 | 3,515,295.000 | |
| | | 4. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270131 | 6,500,000.000 | 6,541,860.000 | |
| | | 4. 375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320131 | 4,000,000.000 | 4,139,600.000 | |
| | | 4. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320229 | 4,000,000.000 | 4,083,040.000 | |
| | | 4. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228 | 4,000,000.000 | 4,028,800.000 | |
| | | 3. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280315 | 3,000,000.000 | 3,027,870.000 | |
| | | 3. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331 | 5,000,000.000 | 5,020,500.000 | |
| | | 4. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320331 | 3,500,000.000 | 3,571,960.000 | |
| | | 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331 | 7,000,000.000 | 7,122,990.000 | |
| | | 3. 75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280415 | 3,000,000.000 | 3,018,210.000 | |
| | | 3. 75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430 | 2,500,000.000 | 2,506,625.000 | |
| | | 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320430 | 3,500,000.000 | 3,545,710.000 | |
| | | 4. 75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550515 | 5,300,000.000 | 5,282,192.000 | |
| | | 4. 25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350515 | 9,500,000.000 | 9,634,330.000 | |
| | | 3. 75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280515 | 4,000,000.000 | 4,025,600.000 | |
| | | 3. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430 | 4,500,000.000 | 4,556,565.000 | |
| | | 5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20450515 | 1,200,000.000 | 1,243,776.000 | |
| | | 3. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531 | 5,800,000.000 | 5,828,768.000 | |
| | | 4. 125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320531 | 3,500,000.000 | 3,569,580.000 | |
| | | 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531 | 5,800,000.000 | 5,905,328.000 | |
| | | 3. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280615 | 2,000,000.000 | 2,020,060.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----------|---|------------------|---|----|
| | | 3. 75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630 | 5, 800, 000. 000 | 5, 819, 662. 000 | |
| | | 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320630 | 3, 300, 000. 000 | 3, 340, 722. 000 | |
| | | 3. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630 | 3, 200, 000. 000 | 3, 240, 000. 000 | |
| | | 3. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280715 | 2, 000, 000. 000 | 2, 020, 060. 000 | |
| | | 3. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731 | 6, 000, 000. 000 | 6, 075, 000. 000 | |
| | | 4. 25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350815 | 3, 800, 000. 000 | 3, 849, 552. 000 | |
| | | 3. 625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280815 | 6, 000, 000. 000 | 6, 022, 260. 000 | |
| | | 3. 875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731 | 8, 000, 000. 000 | 8, 047, 440. 000 | |
| | | 4. 75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550815 | 2, 700, 000. 000 | 2, 691, 333. 000 | |
| | | 4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320731 | 4, 600, 000. 000 | 4, 654, 602. 000 | |
| | アメリカ・ドル | 小計 | | 1, 077, 312, 593. 630 (159, 948, 600, 776) | |
| | イギリス・ポンド | 2. 5% United Kingdom Gilt 20650722 | 1, 282, 000. 000 | 679, 716. 400 | |
| | | 1. 5% United Kingdom Gilt 20470722 | 1, 760, 000. 000 | 883, 484. 800 | |
| | | 1. 75% United Kingdom Gilt 20370907 | 1, 450, 000. 000 | 1, 044, 768. 500 | |
| | | 1. 75% United Kingdom Gilt 20570722 | 1, 810, 000. 000 | 804, 599. 300 | |
| | | 1. 25% United Kingdom Gilt 20270722 | 2, 610, 000. 000 | 2, 492, 863. 200 | |
| | | 1. 625% United Kingdom Gilt 20281022 | 1, 500, 000. 000 | 1, 406, 550. 000 | |
| | | 1. 625% United Kingdom Gilt 20711022 | 1, 740, 000. 000 | 675, 781. 200 | |
| | | 1. 75% United Kingdom Gilt 20490122 | 1, 210, 000. 000 | 624, 287. 400 | |
| | | 1. 625% United Kingdom Gilt 20541022 | 1, 600, 000. 000 | 709, 648. 000 | |
| | | 0. 875% United Kingdom Gilt 20291022 | 2, 100, 000. 000 | 1, 863, 687. 000 | |
| | | 1. 25% United Kingdom Gilt 20411022 | 2, 190, 000. 000 | 1, 263, 213. 900 | |
| | | 0. 375% United Kingdom Gilt 20301022 | 1, 300, 000. 000 | 1, 086, 800. 000 | |
| | | 0. 5% United Kingdom Gilt 20611022 | 3, 000, 000. 000 | 745, 860. 000 | |
| | | 0. 125% United Kingdom Gilt 20280131 | 2, 200, 000. 000 | 2, 022, 196. 000 | |
| | | 0. 625% United Kingdom Gilt 20501022 | 1, 700, 000. 000 | 598, 910. 000 | |
| | | 0. 625% United Kingdom Gilt 20350731 | 3, 700, 000. 000 | 2, 529, 098. 000 | |
| | | 0. 25% United Kingdom Gilt 20310731 | 2, 500, 000. 000 | 2, 007, 350. 000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---|------------------|------------------|----|
| | | 0. 875% United Kingdom Gilt 20460131 | 1, 550, 000. 000 | 693, 036. 000 | |
| | | 0. 375% United Kingdom Gilt 20261022 | 2, 700, 000. 000 | 2, 603, 448. 000 | |
| | | 1. 25% United Kingdom Gilt 20510731 | 2, 200, 000. 000 | 921, 294. 000 | |
| | | 1. 125% UNITED KINGDOM GILT 20390131 | 3, 100, 000. 000 | 1, 951, 233. 000 | |
| | | 0. 5% UNITED KINGDOM GILT 20290131 | 2, 700, 000. 000 | 2, 416, 770. 000 | |
| | | 0. 875% UNITED KINGDOM GILT 20330731 | 3, 100, 000. 000 | 2, 372, 554. 000 | |
| | | 1. 5% UNITED KINGDOM GILT 20530731 | 1, 300, 000. 000 | 564, 616. 000 | |
| | | 1% UNITED KINGDOM GILT 20320131 | 4, 100, 000. 000 | 3, 369, 298. 000 | |
| | | 1. 125% UNITED KINGDOM GILT 20731022 | 1, 220, 000. 000 | 377, 590. 000 | |
| | | 4. 125% UNITED KINGDOM GILT 20270129 | 2, 000, 000. 000 | 2, 004, 600. 000 | |
| | | 3. 75% UNITED KINGDOM GILT 20380129 | 1, 000, 000. 000 | 890, 690. 000 | |
| | | 3. 25% UNITED KINGDOM GILT 20330131 | 2, 600, 000. 000 | 2, 415, 114. 000 | |
| | | 3. 75% UNITED KINGDOM GILT 20531022 | 2, 500, 000. 000 | 1, 857, 000. 000 | |
| | | 4% UNITED KINGDOM GILT 20631022 | 1, 000, 000. 000 | 765, 000. 000 | |
| | | 4. 5% UNITED KINGDOM GILT 20280607 | 3, 400, 000. 000 | 3, 451, 204. 000 | |
| | | 4. 625% UNITED KINGDOM GILT 20340131 | 3, 300, 000. 000 | 3, 325, 542. 000 | |
| | | 4. 75% UNITED KINGDOM GILT 20431022 | 1, 500, 000. 000 | 1, 399, 500. 000 | |
| | | 3. 75% UNITED KINGDOM GILT 20270307 | 2, 300, 000. 000 | 2, 294, 664. 000 | |
| | | 4. 375% UNITED KINGDOM GILT 20540731 | 1, 280, 000. 000 | 1, 071, 744. 000 | |
| | | 4% UNITED KINGDOM GILT 20311022 | 2, 200, 000. 000 | 2, 173, 600. 000 | |
| | | 4. 125% UNITED KINGDOM GILT 20290722 | 2, 800, 000. 000 | 2, 813, 860. 000 | |
| | | 4. 25% UNITED KINGDOM GILT 20340731 | 3, 100, 000. 000 | 3, 027, 243. 000 | |
| | | 4. 375% UNITED KINGDOM GILT 20400131 | 2, 300, 000. 000 | 2, 134, 032. 000 | |
| | | 4. 375% UNITED KINGDOM GILT 20280307 | 2, 000, 000. 000 | 2, 021, 000. 000 | |
| | | 4. 375% UNITED KINGDOM GILT 20300307 | 2, 300, 000. 000 | 2, 330, 038. 000 | |
| | | 4. 5% UNITED KINGDOM GILT 20350307 | 1, 800, 000. 000 | 1, 779, 696. 000 | |
| | | 5. 375% UNITED KINGDOM GILT 20560131 | 350, 000. 000 | 343, 840. 000 | |
| | | 6% United Kingdom Gilt 20281207 | 949, 000. 000 | 1, 013, 180. 870 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|------------|---|---------------|------------------------------------|----|
| | | 4.25% United Kingdom Gilt 20320607 | 1,440,000.000 | 1,443,009.600 | |
| | | 4.25% United Kingdom Gilt 20360307 | 1,862,000.000 | 1,787,054.500 | |
| | | 4.75% United Kingdom Gilt 20381207 | 1,757,000.000 | 1,723,283.170 | |
| | | 4.25% United Kingdom Gilt 20551207 | 1,708,000.000 | 1,398,476.240 | |
| | | 4.25% United Kingdom Gilt 20461207 | 1,366,000.000 | 1,167,438.240 | |
| | | 4.25% United Kingdom Gilt 20271207 | 1,232,000.000 | 1,245,983.200 | |
| | | 4.5% United Kingdom Gilt 20421207 | 2,116,000.000 | 1,937,811.640 | |
| | | 4.75% United Kingdom Gilt 20301207 | 2,300,000.000 | 2,381,144.000 | |
| | | 4.25% United Kingdom Gilt 20491207 | 1,143,000.000 | 960,085.710 | |
| | | 4.25% United Kingdom Gilt 20390907 | 846,000.000 | 779,961.240 | |
| | | 4.5% United Kingdom Gilt 20340907 | 1,560,000.000 | 1,554,774.000 | |
| | | 4% United Kingdom Gilt 20600122 | 1,174,000.000 | 908,042.040 | |
| | | 4.25% United Kingdom Gilt 20401207 | 1,577,000.000 | 1,430,118.220 | |
| | | 3.75% United Kingdom Gilt 20520722 | 1,552,000.000 | 1,176,679.840 | |
| | | 3.25% United Kingdom Gilt 20440122 | 2,466,000.000 | 1,866,515.400 | |
| | | 3.5% United Kingdom Gilt 20680722 | 1,386,000.000 | 953,526.420 | |
| | | 3.5% United Kingdom Gilt 20450122 | 1,724,000.000 | 1,339,668.680 | |
| | イギリス・ポンド | 小計 | | 97,873,772.710 (19,606,074,150) | |
| | イスラエル・シユケル | 6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030 | 1,800,000.000 | 1,846,350.000 | |
| | | 5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131 | 2,200,000.000 | 2,485,120.000 | |
| | | 2% Israel Government Bond - Fixed 20270331 | 1,800,000.000 | 1,748,394.000 | |
| | | 3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331 | 2,400,000.000 | 2,143,104.000 | |
| | | 2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928 | 1,200,000.000 | 1,142,640.000 | |
| | | 1% Israel Government Bond - Fixed 20300331 | 2,400,000.000 | 2,108,328.000 | |
| | | 1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531 | 3,000,000.000 | 2,249,790.000 | |
| | | 1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430 | 2,700,000.000 | 2,274,318.000 | |
| | | 2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129 | 1,720,000.000 | 1,227,185.600 | |
| | | 3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290228 | 3,800,000.000 | 3,777,580.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---------------|------------|---|---------------|-----------------------------------|----|
| | | 4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20350330 | 2,700,000.000 | 2,674,647.000 | |
| | | 3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20270930 | 2,500,000.000 | 2,490,900.000 | |
| | | 4.6% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290831 | 1,600,000.000 | 1,638,144.000 | |
| イスラエル・シュケル 小計 | | | | 27,806,500.600 (1,236,085,152) | |
| | オーストラリア・ドル | 4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421 | 1,989,000.000 | 2,031,127.020 | |
| | | 3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421 | 1,354,000.000 | 1,341,935.860 | |
| | | 4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421 | 2,258,000.000 | 2,321,901.400 | |
| | | 3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421 | 1,113,000.000 | 1,042,235.460 | |
| | | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621 | 2,207,000.000 | 1,930,065.640 | |
| | | 3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621 | 792,000.000 | 683,385.120 | |
| | | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121 | 1,672,000.000 | 1,649,127.040 | |
| | | 2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521 | 1,178,000.000 | 1,142,341.940 | |
| | | 3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321 | 1,252,000.000 | 928,858.800 | |
| | | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121 | 1,500,000.000 | 1,467,540.000 | |
| | | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121 | 1,900,000.000 | 1,839,846.000 | |
| | | 2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521 | 2,870,000.000 | 2,731,838.200 | |
| | | 2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521 | 1,390,000.000 | 1,088,244.900 | |
| | | 1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621 | 2,840,000.000 | 2,505,249.200 | |
| | | 1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521 | 2,700,000.000 | 2,274,723.000 | |
| | | 1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221 | 2,000,000.000 | 1,742,120.000 | |
| | | 1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621 | 1,400,000.000 | 730,562.000 | |
| | | 1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121 | 2,500,000.000 | 2,108,400.000 | |
| | | 0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921 | 1,200,000.000 | 1,164,624.000 | |
| | | 1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121 | 1,600,000.000 | 1,373,984.000 | |
| | | 3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121 | 1,700,000.000 | 1,564,136.000 | |
| | | 3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521 | 2,000,000.000 | 1,932,920.000 | |
| | | 3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221 | 2,300,000.000 | 2,163,794.000 | |
| | | 4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20540621 | 900,000.000 | 855,216.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|---------------|--|-------------------|---|----|
| | | 4. 25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340621 | 1, 100, 000. 000 | 1, 102, 706. 000 | |
| | | 4. 25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20351221 | 1, 700, 000. 000 | 1, 685, 210. 000 | |
| | | 4. 25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20360321 | 1, 500, 000. 000 | 1, 484, 355. 000 | |
| | | 4. 25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20361021 | 1, 400, 000. 000 | 1, 379, 364. 000 | |
| | オーストラリア・ドル | 小計 | | 44, 265, 810. 580 (4, 307, 506, 028) | |
| | オフショア・人 民元 | 3. 25% China Government Bond 20281122 | 5, 000, 000. 000 | 5, 301, 950. 000 | |
| | | 3. 29% China Government Bond 20290523 | 5, 000, 000. 000 | 5, 349, 950. 000 | |
| | | 3. 12% China Government Bond 20261205 | 12, 000, 000. 000 | 12, 290, 760. 000 | |
| | | 3. 13% China Government Bond 20291121 | 25, 000, 000. 000 | 26, 732, 250. 000 | |
| | | 2. 85% China Government Bond 20270604 | 13, 000, 000. 000 | 13, 343, 460. 000 | |
| | | 2. 68% China Government Bond 20300521 | 29, 500, 000. 000 | 30, 942, 255. 000 | |
| | | 3. 28% China Government Bond 20271203 | 29, 000, 000. 000 | 30, 309, 060. 000 | |
| | | 3. 27% China Government Bond 20301119 | 12, 500, 000. 000 | 13, 630, 625. 000 | |
| | | 3. 81% China Government Bond 20500914 | 16, 300, 000. 000 | 21, 612, 659. 000 | |
| | | 3. 01% China Government Bond 20280513 | 27, 000, 000. 000 | 28, 171, 530. 000 | |
| | | 3. 72% China Government Bond 20510412 | 17, 000, 000. 000 | 22, 514, 120. 000 | |
| | | 3. 02% China Government Bond 20310527 | 15, 800, 000. 000 | 17, 039, 668. 000 | |
| | | 3. 59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803 | 5, 500, 000. 000 | 5, 757, 840. 000 | |
| | | 3. 69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517 | 5, 000, 000. 000 | 5, 338, 000. 000 | |
| | | 3. 54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816 | 4, 500, 000. 000 | 4, 805, 325. 000 | |
| | | 4. 08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022 | 7, 000, 000. 000 | 9, 586, 920. 000 | |
| | | 3. 86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722 | 8, 800, 000. 000 | 11, 738, 496. 000 | |
| | | 3. 39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316 | 23, 000, 000. 000 | 28, 643, 740. 000 | |
| | | 2. 91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014 | 15, 500, 000. 000 | 16, 193, 625. 000 | |
| | | 3. 53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018 | 11, 500, 000. 000 | 14, 795, 555. 000 | |
| | | 2. 89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118 | 16, 000, 000. 000 | 17, 169, 600. 000 | |
| | | 2. 37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120 | 17, 000, 000. 000 | 17, 224, 740. 000 | |
| | | 2. 75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217 | 15, 200, 000. 000 | 16, 177, 968. 000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---------------------------------------|----------------|----------------|----|
| | | 2. 8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324 | 15,000,000.000 | 15,672,900.000 | |
| | | 2. 48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415 | 15,000,000.000 | 15,257,250.000 | |
| | | 3. 32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415 | 5,500,000.000 | 6,857,675.000 | |
| | | 2. 76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515 | 5,000,000.000 | 5,332,200.000 | |
| | | 2. 75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615 | 19,000,000.000 | 19,858,040.000 | |
| | | 2. 69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815 | 19,000,000.000 | 20,153,680.000 | |
| | | 2. 6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901 | 32,000,000.000 | 33,848,960.000 | |
| | | 2. 62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925 | 9,500,000.000 | 9,891,495.000 | |
| | | 2. 44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015 | 17,200,000.000 | 17,542,968.000 | |
| | | 3. 12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025 | 19,500,000.000 | 23,635,950.000 | |
| | | 2. 8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115 | 5,500,000.000 | 5,901,115.000 | |
| | | 2. 79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215 | 19,000,000.000 | 19,965,960.000 | |
| | | 2. 64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115 | 20,000,000.000 | 20,560,800.000 | |
| | | 2. 88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225 | 15,000,000.000 | 16,236,750.000 | |
| | | 2. 8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325 | 15,000,000.000 | 15,809,700.000 | |
| | | 2. 62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415 | 25,000,000.000 | 25,755,250.000 | |
| | | 3. 19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415 | 21,700,000.000 | 26,665,177.000 | |
| | | 2. 67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525 | 35,000,000.000 | 37,346,400.000 | |
| | | 2. 62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625 | 33,000,000.000 | 34,536,480.000 | |
| | | 2. 4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715 | 35,000,000.000 | 35,944,300.000 | |
| | | 2. 52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825 | 28,000,000.000 | 29,541,680.000 | |
| | | 2. 48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925 | 25,000,000.000 | 25,755,250.000 | |
| | | 2. 6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915 | 30,000,000.000 | 31,429,500.000 | |
| | | 3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015 | 26,000,000.000 | 31,267,080.000 | |
| | | 2. 55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015 | 20,000,000.000 | 20,653,800.000 | |
| | | 2. 39% CHINA GOVERNMENT BOND 20261115 | 60,000,000.000 | 60,715,800.000 | |
| | | 2. 67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125 | 36,000,000.000 | 38,464,200.000 | |
| | | 2. 54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225 | 50,000,000.000 | 52,258,000.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---------------------------------------|----------------|----------------|----|
| | | 2. 37% CHINA GOVERNMENT BOND 20290115 | 58,000,000.000 | 59,646,040.000 | |
| | | 2. 04% CHINA GOVERNMENT BOND 20270225 | 35,000,000.000 | 35,316,400.000 | |
| | | 2. 35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225 | 16,000,000.000 | 16,707,680.000 | |
| | | 2. 28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325 | 35,000,000.000 | 36,150,450.000 | |
| | | 2. 05% CHINA GOVERNMENT BOND 20290415 | 73,000,000.000 | 74,336,630.000 | |
| | | 1. 85% CHINA GOVERNMENT BOND 20270515 | 85,000,000.000 | 85,617,950.000 | |
| | | 2. 27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525 | 21,000,000.000 | 21,807,240.000 | |
| | | 2. 12% CHINA GOVERNMENT BOND 20310625 | 20,000,000.000 | 20,493,000.000 | |
| | | 1. 91% CHINA GOVERNMENT BOND 20290715 | 28,000,000.000 | 28,367,360.000 | |
| | | 1. 62% CHINA GOVERNMENT BOND 20270815 | 45,000,000.000 | 45,182,700.000 | |
| | | 2. 11% CHINA GOVERNMENT BOND 20340825 | 44,000,000.000 | 45,156,760.000 | |
| | | 1. 87% CHINA GOVERNMENT BOND 20310915 | 33,000,000.000 | 33,359,700.000 | |
| | | 1. 35% CHINA GOVERNMENT BOND 20260925 | 10,000,000.000 | 9,993,400.000 | |
| | | 1. 74% CHINA GOVERNMENT BOND 20291015 | 1,000,000.000 | 1,006,910.000 | |
| | | 1. 42% CHINA GOVERNMENT BOND 20271115 | 13,000,000.000 | 12,999,480.000 | |
| | | 2. 04% CHINA GOVERNMENT BOND 20341125 | 11,000,000.000 | 11,237,600.000 | |
| | | 1. 06% CHINA GOVERNMENT BOND 20261215 | 5,000,000.000 | 4,979,150.000 | |
| | | 1. 49% CHINA GOVERNMENT BOND 20311225 | 9,100,000.000 | 8,983,338.000 | |
| | | 1. 43% CHINA GOVERNMENT BOND 20300125 | 20,000,000.000 | 19,871,600.000 | |
| | | 1. 92% CHINA GOVERNMENT BOND 20550115 | 4,000,000.000 | 3,864,640.000 | |
| | | 1. 61% CHINA GOVERNMENT BOND 20350215 | 29,000,000.000 | 28,556,300.000 | |
| | | 1. 45% CHINA GOVERNMENT BOND 20280225 | 5,000,000.000 | 5,004,100.000 | |
| | | 1. 59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270315 | 10,000,000.000 | 10,028,500.000 | |
| | | 1. 79% CHINA GOVERNMENT BOND 20320325 | 52,000,000.000 | 52,313,040.000 | |
| | | 1. 65% CHINA GOVERNMENT BOND 20350515 | 17,000,000.000 | 16,805,010.000 | |
| | | 1. 46% CHINA GOVERNMENT BOND 20280525 | 30,000,000.000 | 30,024,300.000 | |
| | | 1. 67% CHINA GOVERNMENT BOND 20350525 | 37,000,000.000 | 36,658,860.000 | |
| | | 1. 38% CHINA GOVERNMENT BOND 20270615 | 20,000,000.000 | 19,988,600.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|--------------|--------|--|----------------|---------------------------------------|----|
| | | 1. 55% CHINA GOVERNMENT BOND 20300725 | 8,000,000.000 | 7,976,160.000 | |
| | | 1. 42% CHINA GOVERNMENT BOND 20280815 | 10,000,000.000 | 9,981,600.000 | |
| | | 1. 83% CHINA GOVERNMENT BOND 20350825 | 19,000,000.000 | 19,019,380.000 | |
| オフショア・人民元 小計 | | | | 1,882,962,334.000 (39,208,736,385) | |
| | カナダ・ドル | 2. 75% Canada Government International Bond 20641201 | 555,000.000 | 443,972.250 | |
| | | 5. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601 | 1,383,000.000 | 1,532,405.490 | |
| | | 5. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601 | 1,117,000.000 | 1,317,613.200 | |
| | | 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601 | 1,012,000.000 | 1,168,687.960 | |
| | | 4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601 | 913,000.000 | 965,150.560 | |
| | | 3. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201 | 961,000.000 | 944,807.150 | |
| | | 2. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201 | 1,337,000.000 | 1,142,840.860 | |
| | | 1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601 | 1,240,000.000 | 1,207,946.000 | |
| | | 2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601 | 650,000.000 | 640,100.500 | |
| | | 2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201 | 3,710,000.000 | 2,637,327.700 | |
| | | 2. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601 | 1,220,000.000 | 1,202,432.000 | |
| | | 1. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601 | 3,450,000.000 | 3,215,503.500 | |
| | | 0. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201 | 2,000,000.000 | 1,772,620.000 | |
| | | 1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901 | 300,000.000 | 295,671.000 | |
| | | 1. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601 | 3,400,000.000 | 3,148,842.000 | |
| | | 1. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201 | 2,650,000.000 | 1,734,928.500 | |
| | | 1. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301 | 2,200,000.000 | 2,159,454.000 | |
| | | 1. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201 | 2,700,000.000 | 2,476,899.000 | |
| | | 2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601 | 1,500,000.000 | 1,407,735.000 | |
| | | 2. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201 | 100,000.000 | 98,119.000 | |
| | | 2. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901 | 1,200,000.000 | 1,204,704.000 | |
| | | 2. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201 | 2,270,000.000 | 2,188,075.700 | |
| | | 3. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301 | 1,300,000.000 | 1,328,522.000 | |
| | | 2. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601 | 1,700,000.000 | 1,658,979.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|-----------|--|------------------|---|----|
| | | 2. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201 | 1, 180, 000. 000 | 969, 547. 000 | |
| | | 3. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280901 | 1, 200, 000. 000 | 1, 221, 192. 000 | |
| | | 3. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20331201 | 1, 000, 000. 000 | 1, 007, 610. 000 | |
| | | 4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290301 | 1, 800, 000. 000 | 1, 879, 272. 000 | |
| | | 3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340601 | 1, 700, 000. 000 | 1, 675, 486. 000 | |
| | | 3. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340301 | 1, 500, 000. 000 | 1, 537, 185. 000 | |
| | | 3. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290901 | 800, 000. 000 | 823, 544. 000 | |
| | | 3. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20341201 | 2, 600, 000. 000 | 2, 602, 678. 000 | |
| | | 3. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20261101 | 1, 700, 000. 000 | 1, 713, 736. 000 | |
| | | 2. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300301 | 2, 000, 000. 000 | 1, 998, 580. 000 | |
| | | 3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270201 | 1, 700, 000. 000 | 1, 710, 727. 000 | |
| | | 3. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20350601 | 2, 100, 000. 000 | 2, 096, 325. 000 | |
| | | 3. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20571201 | 950, 000. 000 | 906, 091. 000 | |
| | | 2. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270501 | 3, 200, 000. 000 | 3, 210, 592. 000 | |
| | | 2. 75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300901 | 2, 400, 000. 000 | 2, 392, 488. 000 | |
| | | 2. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270801 | 500, 000. 000 | 499, 640. 000 | |
| | | 3. 25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20351201 | 700, 000. 000 | 696, 178. 000 | |
| | | 2. 5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20271101 | 900, 000. 000 | 899, 118. 000 | |
| | カナダ・ドル 小計 | | | 63, 733, 325. 370 (6, 837, 948, 478) | |
| | シンガポール・ドル | 3. 5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301 | 772, 000. 000 | 795, 623. 200 | |
| | | 2. 875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901 | 809, 000. 000 | 860, 589. 930 | |
| | | 2. 75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401 | 400, 000. 000 | 444, 000. 000 | |
| | | 3. 375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901 | 568, 000. 000 | 635, 876. 000 | |
| | | 2. 875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701 | 625, 000. 000 | 656, 312. 500 | |
| | | 2. 75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301 | 818, 000. 000 | 925, 836. 940 | |
| | | 2. 25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801 | 750, 000. 000 | 776, 250. 000 | |
| | | 2. 625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501 | 550, 000. 000 | 566, 610. 000 | |
| | | 2. 375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701 | 650, 000. 000 | 682, 500. 000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|-------------|---|----------------|-----------------------------------|----|
| | | 1. 875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301 | 540,000.000 | 529,200.000 | |
| | | 1. 625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701 | 600,000.000 | 600,600.000 | |
| | | 1. 875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001 | 500,000.000 | 484,750.000 | |
| | | 1. 25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101 | 200,000.000 | 199,740.000 | |
| | | 2. 625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801 | 240,000.000 | 254,520.000 | |
| | | 3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801 | 620,000.000 | 749,890.000 | |
| | | 2. 875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901 | 500,000.000 | 514,060.000 | |
| | | 2. 875% SINGAPORE GOVERNMENT 20280801 | 400,000.000 | 415,960.000 | |
| | | 3% SINGAPORE GOVERNMENT 20290401 | 600,000.000 | 631,260.000 | |
| | | 3. 375% SINGAPORE GOVERNMENT 20340501 | 300,000.000 | 337,500.000 | |
| | | 3. 25% SINGAPORE GOVERNMENT 20540601 | 100,000.000 | 126,081.000 | |
| | | 2. 75% SINGAPORE GOVERNMENT 20350301 | 230,000.000 | 247,923.900 | |
| | | 2. 5% SINGAPORE GOVERNMENT 20300401 | 160,000.000 | 167,120.000 | |
| | | 2. 25% SINGAPORE GOVERNMENT 20400701 | 90,000.000 | 93,575.700 | |
| | | シンガポール・ドル 小計 | | 11,695,779.170 (1,350,979,452) | |
| | スウェーデン・クローナ | 3. 5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330 | 3,655,000.000 | 3,997,948.650 | |
| | | 1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112 | 7,180,000.000 | 7,109,707.800 | |
| | | 0. 75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512 | 5,050,000.000 | 4,910,216.000 | |
| | | 2. 25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601 | 3,300,000.000 | 3,310,098.000 | |
| | | 0. 75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112 | 6,400,000.000 | 6,095,680.000 | |
| | | 0. 125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512 | 5,000,000.000 | 4,477,300.000 | |
| | | 1. 75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20331111 | 4,000,000.000 | 3,824,280.000 | |
| | | 2. 25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20350511 | 2,700,000.000 | 2,647,323.000 | |
| | | スウェーデン・クローナ 小計 | | 36,372,553.450 (575,413,796) | |
| | デンマーク・クローネ | 4. 5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115 | 13,662,000.000 | 16,611,625.800 | |
| | | 0. 5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115 | 5,100,000.000 | 4,976,070.000 | |
| | | 0. 5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115 | 4,090,000.000 | 3,861,491.700 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|-------------|---|------------------|--------------------------------------|----|
| | | 0. 25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115 | 3, 500, 000. 000 | 1, 784, 685. 000 | |
| | | DANISH GOVERNMENT BOND 20311115 | 2, 900, 000. 000 | 2, 545, 939. 000 | |
| | | 2. 25% DANISH GOVERNMENT BOND 20331115 | 2, 000, 000. 000 | 1, 990, 780. 000 | |
| | | 2. 25% DANISH GOVERNMENT BOND 20261115 | 50, 000. 000 | 50, 400. 000 | |
| | | 2. 25% DANISH GOVERNMENT BOND 20351115 | 500, 000. 000 | 489, 435. 000 | |
| | | デンマーク・クローネ 小計 | | 32, 310, 426. 500 (752, 509, 834) | |
| | ニュージーランド・ドル | 4. 5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415 | 600, 000. 000 | 614, 136. 000 | |
| | | 3. 5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414 | 1, 500, 000. 000 | 1, 436, 205. 000 | |
| | | 2. 75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415 | 490, 000. 000 | 407, 983. 800 | |
| | | 3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420 | 1, 100, 000. 000 | 1, 085, 337. 000 | |
| | | 1. 5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515 | 530, 000. 000 | 467, 465. 300 | |
| | | 1. 75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515 | 350, 000. 000 | 228, 308. 500 | |
| | | 0. 25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515 | 1, 100, 000. 000 | 1, 017, 159. 000 | |
| | | 2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515 | 940, 000. 000 | 829, 954. 200 | |
| | | 2. 75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515 | 380, 000. 000 | 247, 319. 200 | |
| | | 4. 25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20340515 | 500, 000. 000 | 498, 065. 000 | |
| | | 4. 5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20300515 | 1, 100, 000. 000 | 1, 141, 855. 000 | |
| | | 5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20540515 | 700, 000. 000 | 672, 098. 000 | |
| | | 4. 5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20350515 | 500, 000. 000 | 503, 755. 000 | |
| | | 4. 25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20360515 | 1, 300, 000. 000 | 1, 271, 465. 000 | |
| | | ニュージーランド・ドル 小計 | | 10, 421, 106. 000 (911, 638, 353) | |
| | ノルウェー・クローネ | 1. 75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217 | 4, 450, 000. 000 | 4, 335, 724. 000 | |
| | | 2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426 | 3, 500, 000. 000 | 3, 361, 225. 000 | |
| | | 1. 75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906 | 3, 850, 000. 000 | 3, 576, 688. 500 | |
| | | 1. 375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819 | 4, 800, 000. 000 | 4, 297, 008. 000 | |
| | | 1. 25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917 | 3, 500, 000. 000 | 3, 031, 175. 000 | |
| | | 2. 125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518 | 3, 200, 000. 000 | 2, 887, 232. 000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|-------------|--|------------------|---|----|
| | | 3. 5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20421006 | 1, 600, 000. 000 | 1, 515, 376. 000 | |
| | | 3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20330815 | 4, 000, 000. 000 | 3, 772, 840. 000 | |
| | | 3. 625% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20340413 | 3, 500, 000. 000 | 3, 438, 155. 000 | |
| | | 3. 625% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20390531 | 2, 000, 000. 000 | 1, 928, 960. 000 | |
| | | 3. 75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20350612 | 3, 900, 000. 000 | 3, 843, 645. 000 | |
| | | ノルウェー・クローネ 小計 | | 35, 988, 028. 500 (532, 262, 942) | |
| | ポーランド・ズロチ | 2. 5% Poland Government Bond 20270725 | 3, 170, 000. 000 | 3, 072, 712. 700 | |
| | | 2. 75% Poland Government Bond 20291025 | 4, 840, 000. 000 | 4, 501, 587. 200 | |
| | | 1. 25% Poland Government Bond 20301025 | 3, 000, 000. 000 | 2, 522, 790. 000 | |
| | | 0. 25% Poland Government Bond 20261025 | 2, 200, 000. 000 | 2, 114, 090. 000 | |
| | | 1. 75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425 | 5, 000, 000. 000 | 4, 091, 900. 000 | |
| | | 3. 75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525 | 3, 700, 000. 000 | 3, 674, 248. 000 | |
| | | 7. 5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725 | 5, 000, 000. 000 | 5, 407, 300. 000 | |
| | | 6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025 | 5, 000, 000. 000 | 5, 260, 500. 000 | |
| | | 4. 75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725 | 7, 000, 000. 000 | 7, 027, 720. 000 | |
| | | 5% POLAND GOVERNMENT BOND 20341025 | 4, 500, 000. 000 | 4, 396, 410. 000 | |
| | | 5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300125 | 4, 000, 000. 000 | 4, 037, 160. 000 | |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND 20270125 | 1, 000, 000. 000 | 946, 620. 000 | |
| | | 4. 5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300725 | 2, 900, 000. 000 | 2, 857, 573. 000 | |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND 20280125 | 100, 000. 000 | 90, 004. 000 | |
| | | 5% POLAND GOVERNMENT BOND 20351025 | 100, 000. 000 | 97, 065. 000 | |
| | | 5. 75% Poland Government Bond 20290425 | 827, 000. 000 | 859, 037. 980 | |
| | | 2. 75% Poland Government Bond 20280425 | 3, 650, 000. 000 | 3, 512, 066. 500 | |
| | ポーランド・ズロチ | 小計 | | 54, 468, 784. 380 (2, 226, 683, 905) | |
| | マレーシア・リンギット | 3. 502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531 | 2, 373, 000. 000 | 2, 393, 858. 670 | |
| | | 4. 498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415 | 3, 378, 000. 000 | 3, 572, 809. 260 | |
| | | 4. 232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630 | 1, 800, 000. 000 | 1, 894, 230. 000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|--|---------------|-----------------------------------|----|
| | | 3. 892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315 | 731,000.000 | 741,314.410 | |
| | | 3. 844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415 | 1,427,000.000 | 1,474,091.000 | |
| | | 3. 733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615 | 1,886,000.000 | 1,915,817.660 | |
| | | 4. 935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930 | 1,300,000.000 | 1,503,671.000 | |
| | | 4. 254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531 | 1,220,000.000 | 1,304,058.000 | |
| | | 4. 736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315 | 930,000.000 | 1,051,681.200 | |
| | | 3. 9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130 | 1,550,000.000 | 1,569,266.500 | |
| | | 3. 899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116 | 1,190,000.000 | 1,212,693.300 | |
| | | 4. 762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407 | 1,950,000.000 | 2,173,450.500 | |
| | | 4. 642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107 | 2,200,000.000 | 2,397,824.000 | |
| | | 4. 893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608 | 2,000,000.000 | 2,264,040.000 | |
| | | 3. 885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815 | 2,310,000.000 | 2,373,109.200 | |
| | | 4. 921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706 | 1,200,000.000 | 1,394,832.000 | |
| | | 3. 828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705 | 2,000,000.000 | 2,066,020.000 | |
| | | 3. 757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522 | 2,550,000.000 | 2,592,355.500 | |
| | | 4. 065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615 | 2,650,000.000 | 2,736,628.500 | |
| | | 2. 632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415 | 1,800,000.000 | 1,744,074.000 | |
| | | 3. 582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715 | 1,400,000.000 | 1,422,260.000 | |
| | | 4. 696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015 | 1,900,000.000 | 2,132,997.000 | |
| | | 4. 504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430 | 500,000.000 | 523,555.000 | |
| | | 4. 457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331 | 2,200,000.000 | 2,401,432.000 | |
| | | 3. 519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420 | 1,000,000.000 | 1,012,180.000 | |
| | | 4. 054% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390418 | 1,200,000.000 | 1,256,196.000 | |
| | | 4. 18% MALAYSIAN GOVERNMENT 20440516 | 1,500,000.000 | 1,586,025.000 | |
| | | 3. 336% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300515 | 1,000,000.000 | 1,009,310.000 | |
| | | 3. 476% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350702 | 50,000.000 | 50,292.500 | |
| | | 3. 917% MALAYSIAN GOVERNMENT 20550715 | 30,000.000 | 30,167.400 | |
| | | マレーシア・リングギット 小計 | | 49,800,239.600 (1,750,822,043) | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---------|----|---|----------------|------------------------------------|----|
| メキシコ・ペソ | | 8% Mexican Bonos 20471107 | 21,300,000.000 | 18,506,718.000 | |
| | | 5.5% MEXICAN BONOS 20270304 | 14,000,000.000 | 13,583,360.000 | |
| | | 8% MEXICAN BONOS 20530731 | 37,000,000.000 | 31,843,680.000 | |
| | | 7.5% MEXICAN BONOS 20330526 | 30,000,000.000 | 28,185,300.000 | |
| | | 7% MEXICAN BONOS 20260903 | 23,000,000.000 | 22,852,110.000 | |
| | | 8% MEXICAN BONOS 20350524 | 5,000,000.000 | 4,742,100.000 | |
| | | 8.5% MEXICAN BONOS 20290301 | 20,000,000.000 | 20,243,000.000 | |
| | | 8.5% MEXICAN BONOS 20280302 | 10,000,000.000 | 10,135,700.000 | |
| | | 8.5% MEXICAN BONOS 20300228 | 10,000,000.000 | 10,102,500.000 | |
| | | 8% MEXICAN BONOS 20360221 | 1,000,000.000 | 942,590.000 | |
| | | 7.5% Mexican Bonos 20270603 | 27,968,000.000 | 27,882,697.600 | |
| | | 10% Mexican Bonos 20361120 | 8,874,000.000 | 9,614,712.780 | |
| | | 8.5% Mexican Bonos 20290531 | 29,544,000.000 | 29,900,891.520 | |
| | | 8.5% Mexican Bonos 20381118 | 18,894,000.000 | 18,035,078.760 | |
| | | 7.75% Mexican Bonos 20310529 | 44,515,000.000 | 43,374,080.550 | |
| | | 7.75% Mexican Bonos 20421113 | 29,654,000.000 | 25,581,319.640 | |
| | | 7.75% Mexican Bonos 20341123 | 35,944,000.000 | 33,826,538.960 | |
| | | メキシコ・ペソ 小計 | | 349,352,377.810 (2,770,154,745) | |
| ユーロ | | 0.75% Finland Government Bond 20310415 | 364,000.000 | 330,828.680 | |
| | | 1.375% Finland Government Bond 20470415 | 360,000.000 | 239,598.000 | |
| | | 0.5% Finland Government Bond 20270915 | 800,000.000 | 776,560.000 | |
| | | 1.125% Finland Government Bond 20340415 | 470,000.000 | 406,564.100 | |
| | | 0.5% Finland Government Bond 20280915 | 500,000.000 | 476,415.000 | |
| | | 0.5% Finland Government Bond 20290915 | 500,000.000 | 465,955.000 | |
| | | 0.125% Finland Government Bond 20360415 | 310,000.000 | 226,417.800 | |
| | | 0.25% Finland Government Bond 20400915 | 400,000.000 | 251,696.000 | |
| | | Finland Government Bond 20300915 | 500,000.000 | 442,895.000 | |
| | | 0.125% Finland Government Bond 20520415 | 400,000.000 | 162,320.000 | |
| | | 0.125% Finland Government Bond 20310915 | 600,000.000 | 518,382.000 | |
| | | FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915 | 200,000.000 | 196,160.000 | |
| | | 0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415 | 450,000.000 | 272,925.000 | |
| | | 1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915 | 800,000.000 | 738,040.000 | |
| | | 1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415 | 270,000.000 | 267,402.600 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|--|---------------|---------------|----|
| | | 2. 75% FINLAND GOVERNMENT BOND 20380415 | 400,000.000 | 378,300.000 | |
| | | 3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20330915 | 600,000.000 | 606,942.000 | |
| | | 2. 875% FINLAND GOVERNMENT BOND 20290415 | 1,000,000.000 | 1,021,950.000 | |
| | | 2. 95% FINLAND GOVERNMENT BOND 20550415 | 400,000.000 | 341,716.000 | |
| | | 3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20340915 | 600,000.000 | 602,670.000 | |
| | | 2. 5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20300415 | 500,000.000 | 502,415.000 | |
| | | 3. 2% FINLAND GOVERNMENT BOND 20450415 | 350,000.000 | 331,411.500 | |
| | | 3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20350915 | 500,000.000 | 498,335.000 | |
| | | 2. 625% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320415 | 100,000.000 | 99,743.000 | |
| | | 0. 75% Austria Government Bond 20261020 | 626,000.000 | 617,918.340 | |
| | | 1. 5% Austria Government Bond 20470220 | 784,000.000 | 540,920.800 | |
| | | 1. 5% Austria Government Bond 20861102 | 240,000.000 | 114,096.000 | |
| | | 0. 5% Austria Government Bond 20270420 | 1,280,000.000 | 1,250,700.800 | |
| | | 2. 1% Austria Government Bond 21170920 | 540,000.000 | 320,430.600 | |
| | | 0. 75% Austria Government Bond 20280220 | 1,200,000.000 | 1,163,340.000 | |
| | | 0. 5% Austria Government Bond 20290220 | 1,280,000.000 | 1,207,936.000 | |
| | | Austria Government Bond 20300220 | 980,000.000 | 883,195.600 | |
| | | 0. 75% Austria Government Bond 20510320 | 1,200,000.000 | 627,708.000 | |
| | | Austria Government Bond 20401020 | 400,000.000 | 240,044.000 | |
| | | 0. 85% Austria Government Bond 21200630 | 750,000.000 | 229,305.000 | |
| | | Austria Government Bond 20310220 | 1,200,000.000 | 1,048,944.000 | |
| | | 0. 25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020 | 600,000.000 | 438,720.000 | |
| | | 0. 7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420 | 300,000.000 | 105,123.000 | |
| | | AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020 | 1,800,000.000 | 1,684,242.000 | |
| | | 0. 9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220 | 1,500,000.000 | 1,346,700.000 | |
| | | 1. 85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523 | 1,000,000.000 | 720,070.000 | |
| | | 2. 9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220 | 1,300,000.000 | 1,313,039.000 | |
| | | 3. 15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20531020 | 500,000.000 | 447,615.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---|---------------|---------------|----|
| | | 2. 9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20290523 | 200,000.000 | 204,772.000 | |
| | | 3. 45% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20301020 | 800,000.000 | 838,392.000 | |
| | | 2. 9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20340220 | 500,000.000 | 501,250.000 | |
| | | 3. 2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20390715 | 500,000.000 | 493,030.000 | |
| | | 2. 5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20291020 | 800,000.000 | 806,280.000 | |
| | | 2. 95% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20350220 | 300,000.000 | 299,238.000 | |
| | | 1% Belgium Government Bond 20310622 | 1,774,000.000 | 1,620,460.300 | |
| | | 1. 9% Belgium Government Bond 20380622 | 758,000.000 | 632,149.260 | |
| | | 1. 6% Belgium Government Bond 20470622 | 1,244,000.000 | 812,195.160 | |
| | | 2. 15% Belgium Government Bond 20660622 | 740,000.000 | 441,447.000 | |
| | | 0. 8% Belgium Government Bond 20270622 | 1,100,000.000 | 1,077,879.000 | |
| | | 2. 25% Belgium Government Bond 20570622 | 580,000.000 | 379,865.200 | |
| | | 1. 45% Belgium Government Bond 20370622 | 600,000.000 | 485,352.000 | |
| | | 0. 8% Belgium Government Bond 20280622 | 1,490,000.000 | 1,437,954.300 | |
| | | 1. 25% Belgium Government Bond 20330422 | 1,350,000.000 | 1,200,703.500 | |
| | | 0. 9% Belgium Government Bond 20290622 | 1,500,000.000 | 1,423,875.000 | |
| | | 1. 7% Belgium Government Bond 20500622 | 700,000.000 | 439,985.000 | |
| | | 0. 1% Belgium Government Bond 20300622 | 420,000.000 | 375,232.200 | |
| | | 0. 4% Belgium Government Bond 20400622 | 860,000.000 | 539,030.800 | |
| | | Belgium Government Bond 20271022 | 1,200,000.000 | 1,150,932.000 | |
| | | Belgium Government Bond 20311022 | 1,600,000.000 | 1,358,560.000 | |
| | | 0. 65% Belgium Government Bond 20710622 | 530,000.000 | 159,784.400 | |
| | | 0. 35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622 | 1,400,000.000 | 1,189,020.000 | |
| | | 1. 4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622 | 800,000.000 | 438,384.000 | |
| | | 2. 75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422 | 800,000.000 | 728,944.000 | |
| | | 3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622 | 1,500,000.000 | 1,505,970.000 | |
| | | 3. 3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622 | 600,000.000 | 510,684.000 | |
| | | 3. 45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20430622 | 700,000.000 | 662,011.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---|------------------|------------------|----|
| | | 2. 85% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20341022 | 1, 100, 000. 000 | 1, 075, 437. 000 | |
| | | 3. 5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20550622 | 1, 000, 000. 000 | 876, 890. 000 | |
| | | 2. 7% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20291022 | 100, 000. 000 | 101, 247. 000 | |
| | | 3. 1% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20350622 | 200, 000. 000 | 197, 944. 000 | |
| | | 3. 45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20420622 | 700, 000. 000 | 666, 267. 000 | |
| | | 2. 6% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20301022 | 550, 000. 000 | 551, 122. 000 | |
| | | 6. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704 | 1, 167, 000. 000 | 1, 261, 877. 100 | |
| | | 5. 625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104 | 2, 162, 000. 000 | 2, 342, 224. 320 | |
| | | 4. 75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704 | 950, 000. 000 | 1, 022, 504. 000 | |
| | | 6. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104 | 1, 951, 000. 000 | 2, 280, 562. 920 | |
| | | 5. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104 | 3, 048, 000. 000 | 3, 541, 288. 320 | |
| | | 4. 75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704 | 1, 705, 000. 000 | 2, 001, 294. 900 | |
| | | 4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104 | 1, 371, 000. 000 | 1, 533, 998. 190 | |
| | | 4. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704 | 2, 725, 000. 000 | 3, 129, 417. 250 | |
| | | 4. 75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704 | 1, 739, 000. 000 | 2, 103, 529. 180 | |
| | | 3. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704 | 1, 174, 000. 000 | 1, 200, 332. 820 | |
| | | 2. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704 | 2, 708, 000. 000 | 2, 466, 311. 000 | |
| | | 2. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815 | 2, 679, 000. 000 | 2, 403, 839. 910 | |
| | | 0. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215 | 2, 200, 000. 000 | 2, 149, 752. 000 | |
| | | 0. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815 | 3, 300, 000. 000 | 3, 213, 474. 000 | |
| | | 1. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815 | 3, 470, 000. 000 | 2, 370, 495. 800 | |
| | | 0. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215 | 1, 900, 000. 000 | 1, 837, 737. 000 | |
| | | 0. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815 | 4, 100, 000. 000 | 3, 903, 282. 000 | |
| | | 0. 25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215 | 4, 700, 000. 000 | 4, 429, 233. 000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815 | 3, 000, 000. 000 | 2, 769, 240. 000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815 | 3, 150, 000. 000 | 1, 416, 996. 000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215 | 1, 750, 000. 000 | 1, 594, 687. 500 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515 | 2, 800, 000. 000 | 2, 170, 868. 000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---|---------------|---------------|----|
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115 | 2,000,000.000 | 1,919,860.000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815 | 3,500,000.000 | 3,151,190.000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815 | 1,900,000.000 | 1,711,064.000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215 | 1,900,000.000 | 1,687,466.000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515 | 2,400,000.000 | 1,792,272.000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115 | 2,000,000.000 | 1,879,820.000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815 | 1,700,000.000 | 767,448.000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815 | 1,600,000.000 | 1,401,456.000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815 | 1,000,000.000 | 876,450.000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215 | 3,100,000.000 | 2,673,564.000 | |
| | | 1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515 | 1,600,000.000 | 1,278,544.000 | |
| | | 1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815 | 2,700,000.000 | 2,585,655.000 | |
| | | 1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815 | 2,650,000.000 | 1,940,860.000 | |
| | | 2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115 | 3,200,000.000 | 3,197,120.000 | |
| | | 2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215 | 2,400,000.000 | 2,377,704.000 | |
| | | 2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215 | 1,000,000.000 | 991,290.000 | |
| | | 1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815 | 1,000,000.000 | 733,680.000 | |
| | | 2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330815 | 2,400,000.000 | 2,419,704.000 | |
| | | 2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301115 | 1,500,000.000 | 1,513,050.000 | |
| | | 2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340215 | 2,400,000.000 | 2,339,520.000 | |
| | | 2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20540815 | 2,100,000.000 | 1,795,584.000 | |
| | | 2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20410515 | 1,200,000.000 | 1,131,828.000 | |
| | | 2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340815 | 3,500,000.000 | 3,507,105.000 | |
| | | 2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20350215 | 1,900,000.000 | 1,881,361.000 | |
| | | 2.9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20560815 | 1,250,000.000 | 1,153,312.500 | |
| | | 2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20350215 | 800,000.000 | 792,432.000 | |
| | | 2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20350815 | 1,600,000.000 | 1,591,616.000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815 | 2,100,000.000 | 886,032.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|--|---------------|---------------|----|
| | | 2. 7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260917 | 1,000,000.000 | 1,007,830.000 | |
| | | 2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20261210 | 100,000.000 | 100,111.000 | |
| | | 2. 2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270311 | 2,000,000.000 | 2,008,400.000 | |
| | | 1. 7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270610 | 100,000.000 | 99,621.000 | |
| | | 1. 9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270916 | 100,000.000 | 99,949.000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009 | 2,800,000.000 | 2,743,888.000 | |
| | | GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416 | 2,600,000.000 | 2,523,118.000 | |
| | | 1. 3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015 | 3,000,000.000 | 2,964,450.000 | |
| | | 1. 3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015 | 430,000.000 | 424,934.600 | |
| | | 2. 2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413 | 1,000,000.000 | 1,006,930.000 | |
| | | 2. 4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20281019 | 100,000.000 | 101,205.000 | |
| | | 2. 1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412 | 100,000.000 | 100,146.000 | |
| | | 2. 1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412 | 1,100,000.000 | 1,101,793.000 | |
| | | 2. 5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291011 | 10,000.000 | 10,149.600 | |
| | | 2. 4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300418 | 500,000.000 | 505,070.000 | |
| | | 2. 2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301010 | 400,000.000 | 399,704.000 | |
| | | 5. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425 | 3,323,000.000 | 3,675,902.600 | |
| | | 5. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025 | 2,927,000.000 | 3,430,502.540 | |
| | | 4. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425 | 2,659,000.000 | 2,949,735.060 | |
| | | 4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425 | 2,964,000.000 | 2,791,495.200 | |
| | | 4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025 | 2,374,000.000 | 2,432,851.460 | |
| | | 4. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425 | 3,164,000.000 | 3,374,880.600 | |
| | | 4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425 | 1,717,000.000 | 1,590,148.040 | |
| | | 2. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025 | 5,099,000.000 | 5,166,816.700 | |
| | | 3. 25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525 | 2,788,000.000 | 2,475,548.840 | |
| | | 2. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525 | 5,087,000.000 | 5,063,447.190 | |
| | | 1. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525 | 5,120,000.000 | 4,773,120.000 | |
| | | 1. 25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525 | 5,369,000.000 | 4,270,663.670 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|--|------------------|------------------|----|
| | | 1. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525 | 1, 387, 000. 000 | 703, 708. 320 | |
| | | 0. 25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125 | 3, 050, 000. 000 | 2, 988, 085. 000 | |
| | | 1. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625 | 2, 770, 000. 000 | 2, 166, 721. 700 | |
| | | 1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525 | 3, 400, 000. 000 | 3, 342, 302. 000 | |
| | | 2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525 | 2, 550, 000. 000 | 1, 739, 712. 000 | |
| | | 0. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525 | 5, 400, 000. 000 | 5, 195, 610. 000 | |
| | | 1. 25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525 | 6, 350, 000. 000 | 5, 370, 576. 000 | |
| | | 0. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125 | 4, 950, 000. 000 | 4, 712, 004. 000 | |
| | | 1. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525 | 3, 250, 000. 000 | 1, 896, 115. 000 | |
| | | 0. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525 | 4, 550, 000. 000 | 4, 242, 056. 000 | |
| | | FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125 | 4, 200, 000. 000 | 3, 784, 200. 000 | |
| | | 0. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525 | 2, 770, 000. 000 | 1, 230, 932. 600 | |
| | | 0. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525 | 2, 500, 000. 000 | 1, 558, 150. 000 | |
| | | FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125 | 5, 000, 000. 000 | 4, 350, 650. 000 | |
| | | 0. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525 | 980, 000. 000 | 248, 586. 800 | |
| | | 0. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625 | 2, 400, 000. 000 | 1, 291, 872. 000 | |
| | | FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125 | 5, 200, 000. 000 | 4, 355, 260. 000 | |
| | | FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225 | 4, 000, 000. 000 | 3, 886, 040. 000 | |
| | | 0. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525 | 2, 600, 000. 000 | 1, 120, 626. 000 | |
| | | FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525 | 4, 200, 000. 000 | 3, 445, 638. 000 | |
| | | 1. 25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525 | 3, 000, 000. 000 | 2, 244, 690. 000 | |
| | | 0. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225 | 4, 300, 000. 000 | 4, 156, 251. 000 | |
| | | 2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125 | 4, 100, 000. 000 | 3, 818, 822. 000 | |
| | | 2. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525 | 1, 000, 000. 000 | 807, 880. 000 | |
| | | 3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525 | 2, 100, 000. 000 | 1, 639, 785. 000 | |
| | | 2. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260924 | 3, 200, 000. 000 | 3, 217, 728. 000 | |
| | | 3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20330525 | 4, 600, 000. 000 | 4, 551, 194. 000 | |
| | | 2. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290225 | 4, 300, 000. 000 | 4, 352, 116. 000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---|------------------|------------------|----|
| | | 3. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20331125 | 3, 200, 000. 000 | 3, 260, 640. 000 | |
| | | 3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20490625 | 700, 000. 000 | 574, 518. 000 | |
| | | 2. 5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270924 | 3, 100, 000. 000 | 3, 125, 420. 000 | |
| | | 3. 25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550525 | 1, 200, 000. 000 | 977, 676. 000 | |
| | | 2. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300225 | 4, 600, 000. 000 | 4, 633, 350. 000 | |
| | | 3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20341125 | 3, 700, 000. 000 | 3, 590, 702. 000 | |
| | | 3. 6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20420525 | 1, 200, 000. 000 | 1, 141, 548. 000 | |
| | | 3. 75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20560525 | 1, 100, 000. 000 | 979, 374. 000 | |
| | | 3. 2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350525 | 2, 700, 000. 000 | 2, 645, 487. 000 | |
| | | 2. 4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280924 | 1, 500, 000. 000 | 1, 504, 845. 000 | |
| | | 2. 7% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310225 | 1, 200, 000. 000 | 1, 195, 656. 000 | |
| | | 5. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115 | 1, 139, 000. 000 | 1, 229, 846. 640 | |
| | | 4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115 | 1, 755, 000. 000 | 1, 929, 096. 000 | |
| | | 3. 75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115 | 1, 729, 000. 000 | 1, 842, 837. 360 | |
| | | 2. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115 | 1, 468, 000. 000 | 1, 460, 293. 000 | |
| | | 2. 75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115 | 1, 879, 000. 000 | 1, 709, 852. 420 | |
| | | 0. 75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715 | 2, 200, 000. 000 | 2, 153, 096. 000 | |
| | | 0. 75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715 | 1, 350, 000. 000 | 1, 301, 967. 000 | |
| | | 0. 25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715 | 1, 200, 000. 000 | 1, 115, 352. 000 | |
| | | 0. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115 | 1, 200, 000. 000 | 836, 244. 000 | |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715 | 1, 400, 000. 000 | 1, 253, 700. 000 | |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115 | 1, 300, 000. 000 | 1, 266, 863. 000 | |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115 | 1, 450, 000. 000 | 599, 691. 000 | |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715 | 1, 300, 000. 000 | 1, 129, 843. 000 | |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115 | 900, 000. 000 | 617, 733. 000 | |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115 | 900, 000. 000 | 838, 800. 000 | |
| | | 0. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715 | 1, 000, 000. 000 | 873, 140. 000 | |
| | | 2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115 | 1, 500, 000. 000 | 1, 106, 190. 000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---|---------------|---------------|----|
| | | 2. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715 | 900,000.000 | 891,144.000 | |
| | | 2. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300115 | 1,300,000.000 | 1,313,091.000 | |
| | | 3. 25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20440115 | 600,000.000 | 597,666.000 | |
| | | 2. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20340715 | 1,000,000.000 | 981,210.000 | |
| | | 2. 5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20350715 | 800,000.000 | 777,312.000 | |
| | | 7. 25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101 | 1,110,000.000 | 1,176,122.700 | |
| | | 6. 5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101 | 2,392,000.000 | 2,611,083.280 | |
| | | 3. 25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901 | 1,509,000.000 | 1,311,954.780 | |
| | | 1. 65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301 | 2,065,000.000 | 1,910,765.150 | |
| | | 2. 7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301 | 1,610,000.000 | 1,271,948.300 | |
| | | 2. 25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901 | 2,324,000.000 | 2,051,441.280 | |
| | | 1. 25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201 | 1,068,000.000 | 1,059,018.120 | |
| | | 2. 8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301 | 968,000.000 | 674,105.520 | |
| | | 2. 45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901 | 1,500,000.000 | 1,425,675.000 | |
| | | 2. 2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601 | 1,510,000.000 | 1,514,741.400 | |
| | | 3. 45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301 | 1,650,000.000 | 1,464,540.000 | |
| | | 2. 05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801 | 2,700,000.000 | 2,700,054.000 | |
| | | 2. 95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901 | 1,300,000.000 | 1,194,141.000 | |
| | | 2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201 | 2,100,000.000 | 2,094,141.000 | |
| | | 2. 8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201 | 2,550,000.000 | 2,592,942.000 | |
| | | 3. 35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301 | 2,470,000.000 | 2,468,295.700 | |
| | | 3. 85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901 | 1,450,000.000 | 1,359,157.500 | |
| | | 3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801 | 2,900,000.000 | 2,963,075.000 | |
| | | 3. 1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301 | 1,250,000.000 | 1,143,250.000 | |
| | | 1. 35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401 | 1,900,000.000 | 1,802,625.000 | |
| | | 0. 85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115 | 2,350,000.000 | 2,315,784.000 | |
| | | 2. 45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901 | 1,550,000.000 | 1,112,683.000 | |
| | | 1. 45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301 | 1,500,000.000 | 1,228,875.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---|------------------|------------------|----|
| | | 0. 95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801 | 2, 000, 000. 000 | 1, 846, 260. 000 | |
| | | 1. 65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201 | 2, 100, 000. 000 | 1, 992, 123. 000 | |
| | | 0. 95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915 | 2, 200, 000. 000 | 2, 151, 842. 000 | |
| | | 1. 8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301 | 1, 500, 000. 000 | 1, 125, 330. 000 | |
| | | 0. 9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401 | 2, 600, 000. 000 | 2, 350, 426. 000 | |
| | | 1. 7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901 | 1, 200, 000. 000 | 721, 500. 000 | |
| | | 0. 95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301 | 1, 200, 000. 000 | 899, 976. 000 | |
| | | 0. 25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315 | 1, 900, 000. 000 | 1, 812, 125. 000 | |
| | | 0. 6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801 | 1, 800, 000. 000 | 1, 583, 154. 000 | |
| | | 1. 5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430 | 1, 100, 000. 000 | 716, 463. 000 | |
| | | 2. 15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301 | 560, 000. 000 | 322, 756. 000 | |
| | | 0. 5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715 | 2, 300, 000. 000 | 2, 191, 371. 000 | |
| | | 0. 95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201 | 1, 900, 000. 000 | 1, 691, 437. 000 | |
| | | 0. 95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601 | 2, 300, 000. 000 | 2, 018, 480. 000 | |
| | | 0. 45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215 | 2, 600, 000. 000 | 2, 438, 514. 000 | |
| | | 2. 15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901 | 800, 000. 000 | 524, 880. 000 | |
| | | 1. 1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401 | 300, 000. 000 | 295, 695. 000 | |
| | | 2. 8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615 | 1, 800, 000. 000 | 1, 823, 580. 000 | |
| | | 2. 5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201 | 1, 600, 000. 000 | 1, 542, 336. 000 | |
| | | 3. 25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301 | 2, 300, 000. 000 | 2, 189, 830. 000 | |
| | | 2. 65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201 | 1, 000, 000. 000 | 1, 010, 780. 000 | |
| | | 4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430 | 1, 500, 000. 000 | 1, 581, 960. 000 | |
| | | 4. 4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501 | 1, 800, 000. 000 | 1, 953, 522. 000 | |
| | | 3. 85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215 | 3, 100, 000. 000 | 3, 262, 843. 000 | |
| | | 3. 4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401 | 1, 500, 000. 000 | 1, 544, 475. 000 | |
| | | 4. 45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20430901 | 1, 600, 000. 000 | 1, 668, 560. 000 | |
| | | 4. 5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001 | 1, 200, 000. 000 | 1, 212, 252. 000 | |
| | | 4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311030 | 900, 000. 000 | 958, 122. 000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---|------------------|------------------|----|
| | | 3. 7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615 | 1, 200, 000. 000 | 1, 255, 872. 000 | |
| | | 4. 35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101 | 2, 100, 000. 000 | 2, 268, 315. 000 | |
| | | 3. 8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280801 | 700, 000. 000 | 729, 848. 000 | |
| | | 3. 85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260915 | 900, 000. 000 | 916, 038. 000 | |
| | | 4. 2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340301 | 2, 100, 000. 000 | 2, 243, 451. 000 | |
| | | 4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301115 | 1, 500, 000. 000 | 1, 590, 960. 000 | |
| | | 4. 1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290201 | 600, 000. 000 | 633, 348. 000 | |
| | | 2. 95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270215 | 200, 000. 000 | 202, 368. 000 | |
| | | 3. 5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310215 | 1, 000, 000. 000 | 1, 035, 320. 000 | |
| | | 4. 15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20391001 | 2, 000, 000. 000 | 2, 060, 800. 000 | |
| | | 3. 35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290701 | 400, 000. 000 | 412, 620. 000 | |
| | | 3. 85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340701 | 1, 600, 000. 000 | 1, 664, 160. 000 | |
| | | 4. 05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20371030 | 50, 000. 000 | 51, 809. 000 | |
| | | 3. 45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310715 | 1, 200, 000. 000 | 1, 237, 260. 000 | |
| | | 3. 45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270715 | 1, 500, 000. 000 | 1, 535, 475. 000 | |
| | | 3. 85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350201 | 500, 000. 000 | 517, 905. 000 | |
| | | 3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291001 | 200, 000. 000 | 203, 652. 000 | |
| | | 4. 3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20541001 | 1, 000, 000. 000 | 972, 800. 000 | |
| | | 3. 15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311115 | 1, 300, 000. 000 | 1, 315, 873. 000 | |
| | | 2. 7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271015 | 800, 000. 000 | 808, 760. 000 | |
| | | 3. 65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350801 | 1, 000, 000. 000 | 1, 015, 060. 000 | |
| | | 4. 1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460430 | 200, 000. 000 | 198, 310. 000 | |
| | | 3. 85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20401001 | 300, 000. 000 | 296, 322. 000 | |
| | | 2. 55% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270225 | 800, 000. 000 | 805, 032. 000 | |
| | | 2. 95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300701 | 500, 000. 000 | 506, 185. 000 | |
| | | 2. 65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280615 | 500, 000. 000 | 504, 975. 000 | |
| | | 3. 25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320715 | 1, 700, 000. 000 | 1, 720, 978. 000 | |
| | | 3. 6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20351001 | 600, 000. 000 | 605, 232. 000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---|------------------|------------------|----|
| | | 2. 7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301001 | 1, 500, 000. 000 | 1, 497, 675. 000 | |
| | | 2. 1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270826 | 200, 000. 000 | 199, 796. 000 | |
| | | 2. 35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290115 | 300, 000. 000 | 299, 586. 000 | |
| | | 5. 25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101 | 1, 254, 000. 000 | 1, 392, 604. 620 | |
| | | 6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501 | 2, 849, 000. 000 | 3, 331, 506. 640 | |
| | | 5. 75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201 | 1, 805, 000. 000 | 2, 117, 932. 850 | |
| | | 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801 | 2, 298, 000. 000 | 2, 597, 199. 600 | |
| | | 4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201 | 2, 740, 000. 000 | 2, 845, 709. 200 | |
| | | 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801 | 1, 544, 000. 000 | 1, 739, 686. 560 | |
| | | 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901 | 2, 243, 000. 000 | 2, 522, 096. 490 | |
| | | 4. 75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901 | 2, 410, 000. 000 | 2, 580, 772. 600 | |
| | | 4. 75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901 | 1, 313, 000. 000 | 1, 423, 909. 110 | |
| | | 3. 5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301 | 2, 318, 000. 000 | 2, 414, 938. 760 | |
| | | 5. 5% Belgium Government Bond 20280328 | 2, 006, 000. 000 | 2, 173, 681. 540 | |
| | | 5% Belgium Government Bond 20350328 | 1, 904, 000. 000 | 2, 192, 589. 280 | |
| | | 4. 25% Belgium Government Bond 20410328 | 1, 504, 000. 000 | 1, 593, 939. 200 | |
| | | 4% Belgium Government Bond 20320328 | 780, 000. 000 | 836, 768. 400 | |
| | | 3. 75% Belgium Government Bond 20450622 | 643, 000. 000 | 626, 957. 150 | |
| | | 3% Belgium Government Bond 20340622 | 747, 000. 000 | 743, 003. 550 | |
| | | 2. 4% IRISH TREASURY 20300515 | 961, 000. 000 | 964, 661. 410 | |
| | | 2% IRISH TREASURY 20450218 | 931, 000. 000 | 738, 971. 940 | |
| | | 1. 7% IRISH TREASURY 20370515 | 550, 000. 000 | 474, 842. 500 | |
| | | 0. 9% IRISH TREASURY 20280515 | 800, 000. 000 | 777, 112. 000 | |
| | | 1. 3% IRISH TREASURY 20330515 | 750, 000. 000 | 678, 765. 000 | |
| | | 1. 35% IRISH TREASURY 20310318 | 750, 000. 000 | 710, 467. 500 | |
| | | 1. 1% IRISH TREASURY 20290515 | 950, 000. 000 | 913, 957. 000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---|---------------|---------------|----|
| | | 1. 5% IRISH TREASURY 20500515 | 600,000.000 | 398,502.000 | |
| | | 0. 4% IRISH TREASURY 20350515 | 350,000.000 | 275,205.000 | |
| | | 0. 2% IRISH TREASURY 20270515 | 500,000.000 | 485,825.000 | |
| | | 0. 2% IRISH TREASURY 20301018 | 800,000.000 | 716,616.000 | |
| | | IRISH TREASURY 20311018 | 800,000.000 | 687,288.000 | |
| | | 0. 55% IRISH TREASURY 20410422 | 400,000.000 | 264,776.000 | |
| | | 0. 35% IRISH TREASURY 20321018 | 100,000.000 | 85,282.000 | |
| | | 3% IRISH TREASURY 20431018 | 200,000.000 | 188,430.000 | |
| | | 2. 6% IRISH TREASURY 20341018 | 300,000.000 | 293,064.000 | |
| | | 3. 15% IRISH TREASURY 20551018 | 320,000.000 | 287,955.200 | |
| | | 6. 25% Austria Government Bond 20270715 | 825,000.000 | 887,939.250 | |
| | | 4. 15% Austria Government Bond 20370315 | 1,373,000.000 | 1,504,135.230 | |
| | | 3. 8% Austria Government Bond 20620126 | 338,000.000 | 340,609.360 | |
| | | 3. 15% Austria Government Bond 20440620 | 723,000.000 | 687,920.040 | |
| | | 2. 4% Austria Government Bond 20340523 | 1,371,000.000 | 1,320,780.270 | |
| | | 2. 75% Finland Government Bond 20280704 | 389,000.000 | 396,507.700 | |
| | | 2. 625% Finland Government Bond 20420704 | 407,000.000 | 363,621.940 | |
| | | 6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131 | 2,652,000.000 | 2,975,623.560 | |
| | | 1. 95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730 | 2,052,000.000 | 2,001,705.480 | |
| | | 2. 9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031 | 1,752,000.000 | 1,499,221.440 | |
| | | 3. 45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730 | 1,250,000.000 | 1,053,100.000 | |
| | | 1. 3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031 | 2,630,000.000 | 2,610,669.500 | |
| | | 1. 5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430 | 1,900,000.000 | 1,886,605.000 | |
| | | 2. 35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730 | 1,750,000.000 | 1,676,762.500 | |
| | | 1. 45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031 | 2,050,000.000 | 2,026,486.500 | |
| | | 1. 4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430 | 2,400,000.000 | 2,357,688.000 | |
| | | 2. 7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031 | 2,200,000.000 | 1,782,088.000 | |
| | | 1. 4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730 | 2,900,000.000 | 2,838,810.000 | |
| | | 1. 45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430 | 1,600,000.000 | 1,553,392.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---|---------------|---------------|----|
| | | 1. 85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730 | 3,950,000.000 | 3,504,203.000 | |
| | | 0. 6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031 | 3,800,000.000 | 3,535,368.000 | |
| | | 0. 5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430 | 2,560,000.000 | 2,342,195.200 | |
| | | 1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031 | 1,700,000.000 | 900,728.000 | |
| | | 0. 8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730 | 2,600,000.000 | 2,543,762.000 | |
| | | 1. 25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031 | 2,400,000.000 | 2,251,008.000 | |
| | | 1. 2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031 | 1,600,000.000 | 1,139,376.000 | |
| | | 0. 1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430 | 2,200,000.000 | 1,912,614.000 | |
| | | 1. 45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031 | 650,000.000 | 287,033.500 | |
| | | SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131 | 2,500,000.000 | 2,381,050.000 | |
| | | 0. 85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730 | 700,000.000 | 523,635.000 | |
| | | 0. 5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031 | 1,900,000.000 | 1,666,072.000 | |
| | | 1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730 | 600,000.000 | 393,576.000 | |
| | | SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131 | 2,200,000.000 | 2,140,820.000 | |
| | | 0. 7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430 | 2,100,000.000 | 1,838,067.000 | |
| | | 1. 9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031 | 1,600,000.000 | 1,032,448.000 | |
| | | 0. 8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730 | 3,100,000.000 | 2,922,060.000 | |
| | | 2. 55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031 | 1,700,000.000 | 1,667,394.000 | |
| | | 3. 45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730 | 1,300,000.000 | 1,231,737.000 | |
| | | 3. 15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430 | 2,600,000.000 | 2,638,948.000 | |
| | | 3. 9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730 | 2,100,000.000 | 2,162,244.000 | |
| | | 3. 55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20331031 | 1,500,000.000 | 1,558,245.000 | |
| | | 3. 5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290531 | 1,400,000.000 | 1,457,834.000 | |
| | | 3. 25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20340430 | 2,600,000.000 | 2,633,852.000 | |
| | | 2. 5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270531 | 200,000.000 | 201,682.000 | |
| | | 4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20541031 | 1,000,000.000 | 972,030.000 | |
| | | 3. 45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20341031 | 1,600,000.000 | 1,639,808.000 | |
| | | 3. 1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310730 | 1,200,000.000 | 1,227,012.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|---|---------------|---------------|----|
| | | 2. 7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300131 | 200,000.000 | 202,092.000 | |
| | | 3. 15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350430 | 1,200,000.000 | 1,195,968.000 | |
| | | 2. 4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280531 | 500,000.000 | 503,160.000 | |
| | | 3. 5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410131 | 500,000.000 | 485,410.000 | |
| | | 3. 2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20351031 | 1,300,000.000 | 1,294,514.000 | |
| | | 5. 75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730 | 2,179,000.000 | 2,579,652.730 | |
| | | 4. 2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131 | 1,754,000.000 | 1,888,391.480 | |
| | | 4. 9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730 | 1,858,000.000 | 2,115,853.240 | |
| | | 4. 7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730 | 1,973,000.000 | 2,199,342.560 | |
| | | 5. 15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031 | 1,770,000.000 | 1,926,397.200 | |
| | | 5. 15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031 | 1,699,000.000 | 1,992,621.180 | |
| | | 4. 1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20370415 | 850,000.000 | 918,263.500 | |
| | | 4. 125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20270414 | 680,000.000 | 703,228.800 | |
| | | 3. 875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20300215 | 630,000.000 | 672,084.000 | |
| | | 2. 125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20281017 | 1,300,000.000 | 1,303,445.000 | |
| | | 4. 1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20450215 | 570,000.000 | 594,874.800 | |
| | | 2. 25% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20340418 | 720,000.000 | 682,596.000 | |
| | | 1. 95% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20290615 | 1,000,000.000 | 992,670.000 | |
| | | 0. 475% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20301018 | 900,000.000 | 818,523.000 | |
| | | 0. 7% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20271015 | 620,000.000 | 604,636.400 | |
| | | 0. 9% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20351012 | 750,000.000 | 607,357.500 | |
| | | 1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20520412 | 630,000.000 | 330,252.300 | |
| | | 0. 3% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20311017 | 750,000.000 | 655,207.500 | |
| | | 1. 15% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20420411 | 520,000.000 | 358,779.200 | |
| | | 1. 65% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20320716 | 570,000.000 | 533,121.000 | |
| | | 3. 5% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20380618 | 500,000.000 | 504,205.000 | |
| | | 2. 875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20341020 | 630,000.000 | 623,662.200 | |
| | | 3. 625% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20540612 | 240,000.000 | 224,872.800 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---------|--------|--|-------------|--------------------------------------|----|
| | | 3% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20350615 | 300,000.000 | 297,918.000 | |
| | | 3.375% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20400615 | 300,000.000 | 292,830.000 | |
| | ユーロ 小計 | | | 598,650,024.280 (104,081,293,221) | |
| 国債証券 合計 | | | | 346,096,709,260 [346,096,709,260] | |
| 合計 | | | | 346,096,709,260 [346,096,709,260] | |

- (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 286 銘柄 | 100% | 46.1% |
| イギリス・ポンド | 国債証券 62 銘柄 | 100% | 5.7% |
| イスラエル・シユケル | 国債証券 13 銘柄 | 100% | 0.4% |
| オーストラリア・ドル | 国債証券 28 銘柄 | 100% | 1.2% |
| オフショア・人民元 | 国債証券 82 銘柄 | 100% | 11.3% |
| 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 23 銘柄 | 100% | 0.4% |
| スウェーデン・クローナ | 国債証券 8 銘柄 | 100% | 0.2% |
| デンマーク・クローネ | 国債証券 8 銘柄 | 100% | 0.2% |
| ニュージーランド・ドル | 国債証券 14 銘柄 | 100% | 0.3% |
| ノルウェー・クローネ | 国債証券 11 銘柄 | 100% | 0.2% |
| ポーランド・ズロチ | 国債証券 17 銘柄 | 100% | 0.6% |
| 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 17 銘柄 | 100% | 0.8% |
| ユーロ | 国債証券 408 銘柄 | 100% | 30.1% |

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の状況
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

| | | 2024年9月9日現在 金額(円) | 2025年9月8日現在 金額(円) |
|-----------------|----|----------------------|----------------------|
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| コール・ローン | | 4,514,428,375 | 7,047,336,480 |
| 投資証券 | ※2 | 295,771,244,050 | 244,834,357,400 |
| 未収入金 | | 717,868,796 | 996,240,000 |
| 未収配当金 | | 4,662,699,802 | 3,875,691,115 |
| 差入委託証拠金 | | 620,633,866 | 424,338,659 |
| 流動資産合計 | | 306,286,874,889 | 257,177,963,654 |
| 資産合計 | | 306,286,874,889 | 257,177,963,654 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 16,800,000 | 59,976,000 |
| 前受金 | | 240,800,000 | 907,872,000 |
| 未払解約金 | | 527,186,500 | 890,157,000 |
| 流動負債合計 | | 784,786,500 | 1,858,005,000 |
| 負債合計 | | 784,786,500 | 1,858,005,000 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | ※1 | 94,350,059,834 | 68,820,120,999 |
| 剰余金 | | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△) | | 211,152,028,555 | 186,499,837,655 |
| 元本等合計 | | 305,502,088,389 | 255,319,958,654 |
| 純資産合計 | | 305,502,088,389 | 255,319,958,654 |
| 負債純資産合計 | | 306,286,874,889 | 257,177,963,654 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | 自 2024 年 9 月 10 日 至 2025 年 9 月 8 日 |
|------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | 受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 2024 年 9 月 9 日現在 | 2025 年 9 月 8 日現在 |
|----------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 1. ※1 期首 | | |
| 期首元本額 | 2023 年 9 月 8 日 136,692,550,176 円 | 2024 年 9 月 10 日 94,350,059,834 円 |
| 期中追加設定元本額 | 7,339,411,864 円 | 4,761,095,051 円 |
| 期中一部解約元本額 | 49,681,902,206 円 | 30,291,033,886 円 |
| 期末元本額の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| ダイワ J－R E I T オープン | 3,578,820,300 円 | 2,828,391,027 円 |
| ダイワ J－R E I T オープン (毎月分配型) | 74,819,549,026 円 | 48,321,826,502 円 |
| ダイワ J－R E I T オープン (年 1 回決算型) | 672,034,345 円 | 779,747,561 円 |
| D C ダイワ・ターゲットイイヤー 2050 | 23,749,159 円 | 27,798,955 円 |
| i F r e e J－R E I T インデ ックス | 641,563,821 円 | 505,553,169 円 |
| i F r e e 8 資産バランス | 3,035,489,065 円 | 3,382,075,391 円 |
| ダイワ J－R E I T オープン (奇数月決算型) | 102,242,888 円 | 99,127,135 円 |
| D C ダイワ・ターゲットイイヤー 2060 | 352,019 円 | 452,067 円 |

| 区分 | 2024年9月9日現在 | 2025年9月8日現在 |
|------------------------------|---|---|
| DC・ダイワJ-REITオーブン | 5,186,316,965円 | 5,390,657,348円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2030 | 8,750,476円 | 8,533,477円 |
| DCダイワ・ターゲットイヤー2040 | 9,885,771円 | 9,682,553円 |
| ダイワ国内REITインデックス(投資一任専用) | 5,652,304円 | 7,967,562円 |
| ダイワ・ノーロード J-REITファンド | 86,270,280円 | 65,815,111円 |
| ダイワファンドラップ J-REITインデックス | 3,999,594,498円 | 5,051,263,663円 |
| ダイワJ-REITインデックス(ダイワSMA専用) | 843,765,822円 | 1,070,024,485円 |
| ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス | 609,719,689円 | 669,829,082円 |
| スタイル9(6資産分散・保守型) | 53,416円 | 55,864円 |
| スタイル9(6資産分散・バランス型) | 1,843,754円 | 3,288,033円 |
| スタイル9(6資産分散・積極型) | 1,002,513円 | 1,693,554円 |
| スタイル9(8資産分散・保守型) | 73,843円 | 62,687円 |
| スタイル9(8資産分散・バランス型) | 1,367,883円 | 2,481,763円 |
| スタイル9(8資産分散・積極型) | 726,159円 | 3,683,245円 |
| ダイワ・インデックスセレクト J-REIT | 721,235,838円 | 590,110,765円 |
| 計 | 94,350,059,834円 | 68,820,120,999円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 94,350,059,834口 | 68,820,120,999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 755,000,000円 | 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 799,500,000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2024年9月10日 至2025年9月8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 2024 年 9 月 10 日 至 2025 年 9 月 8 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 | 2025 年 9 月 8 日現在 |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 金融商品の時価の算定方法 | (1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 2024 年 9 月 9 日現在 | 2025 年 9 月 8 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 | 2, 623, 019, 802 | 27, 241, 171, 946 |
| 合計 | 2, 623, 019, 802 | 27, 241, 171, 946 |

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

| 種類 | 2024年9月9日現在 | | | 2025年9月8日現在 | | |
|-----------------|---------------|-----------|---------------|-------------|----------------|-------------|
| | 契約額等 (円) | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 (円) | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| うち 1年超 | | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引 | | | | | | |
| 不動産投信 指数先物取引 | | | | | | |
| 買建 | 9,695,784,000 | - | 9,679,600,000 | △16,184,000 | 10,618,160,000 | - |
| 合計 | 9,695,784,000 | - | 9,679,600,000 | △16,184,000 | 10,618,160,000 | - |
| | | | | | | |
| | | | | | | |

(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)

| | 2024年9月9日現在 | 2025年9月8日現在 |
|---------------------------|------------------------|------------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 3,2380 円 (32,380 円) | 3,7100 円 (37,100 円) |

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 (円) | 備考 |
|-----------------|---------------------------|----------------|----------------|----|
| 投資証券 | エスコンジャパンリート | 4,912 | 614,000,000 | |
| | サンケイリアルエステート | 7,109 | 676,776,800 | |
| | SOSILA 物流リート投 | 11,073 | 1,301,077,500 | |
| | 東海道リート投資法 | 4,569 | 508,986,600 | |
| | 三井不動産アコモデーションファンド 投資法人 | 38,316 | 4,774,173,600 | |
| | 森ヒルズリート | 25,687 | 3,629,573,100 | |
| | 産業ファンド | 40,634 | 5,160,518,000 | |
| | アドバンス・レジデンス | 45,699 | 7,416,947,700 | |
| | A P I 投資法人 | 34,265 | 4,560,671,500 | |
| | G L P 投資法人 | 73,024 | 9,661,075,200 | |
| | コンフォリア・レジデンシャル | 11,252 | 3,521,876,000 | |
| | 日本プロジスリート | 114,246 | 9,391,021,200 | |
| | 星野リゾート・リート | 8,917 | 2,416,507,000 | |
| | Oneリート投資法人 | 10,968 | 961,893,600 | |
| | イオンリート投資 | 26,949 | 3,535,708,800 | |
| | ヒューリックリート投資法 | 19,610 | 3,216,040,000 | |
| | 日本リート投資法人 | 28,332 | 2,765,203,200 | |
| | 積水ハウス・リート投資 | 66,292 | 5,243,697,200 | |
| | トーセイ・リート投資法人 | 4,825 | 698,177,500 | |
| | ヘルスケア&メディカル投資 | 5,760 | 679,104,000 | |
| | サムティ・レジデンシャル | 6,148 | 678,739,200 | |
| | 野村不動産マスターF | 70,720 | 11,308,128,000 | ※ |
| | いちごホテルリート投資 | 3,673 | 496,589,600 | |
| | ラサールロジポート投資 | 29,009 | 4,069,962,700 | |
| | スターアジア不動産投 | 40,898 | 2,457,969,800 | |
| | マリモ地方創生リート | 4,059 | 451,766,700 | |
| | 三井不ロジパーク | 49,006 | 5,292,648,000 | |
| | 日本ホテル&レジデンシャル投資法人 | 4,734 | 375,406,200 | |
| | 投資法人みらい | 30,560 | 1,442,432,000 | |
| | 三菱地所物流 REIT | 22,990 | 2,745,006,000 | |
| CRE ロジスティクスファンド | 9,415 | 1,428,255,500 | | |
| ザイマックス・リート | 3,600 | 429,120,000 | | |
| タカラレーベン不動産投 | 14,593 | 1,344,015,300 | | |
| 日本ビルファンド | 131,658 | 18,629,607,000 | | |
| ジャパンリアルエステイト | 113,983 | 14,681,010,400 | | |
| 日本都市ファンド投資法人 | 115,240 | 12,941,452,000 | | |
| オリックス不動産投資 | 88,439 | 8,543,207,400 | | |
| 日本プライムリアルティ | 60,018 | 6,115,834,200 | | |

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 (円) | 備考 |
|------|-------------------|---------|-----------------|----|
| | NTT 都市開発リート投資法人 | 22,347 | 3,005,671,500 | |
| | 東急リアル・エステート | 14,633 | 2,870,994,600 | |
| | グローバル・ワン不動産投資法人 | 15,999 | 2,332,654,200 | |
| | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 49,068 | 8,660,502,000 | |
| | 森トラストリート投資法人 | 42,778 | 3,195,516,600 | |
| | インヴィンシブル投資法人 | 122,509 | 8,061,092,200 | |
| | フロンティア不動産投資 | 39,005 | 3,412,937,500 | |
| | 平和不動産リート | 17,044 | 2,536,147,200 | |
| | 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 43,998 | 4,175,410,200 | |
| | 福岡リート投資法人 | 12,528 | 2,257,545,600 | |
| | KDX 不動産投資法人 | 64,715 | 10,859,177,000 | |
| | いちごオフィスリート投資法人 | 16,193 | 1,559,385,900 | |
| | 大和証券オフィス投資法人 | 9,067 | 3,309,455,000 | |
| | 阪急阪神リート投資法人 | 10,581 | 1,786,072,800 | |
| | スターツプロシード投資法人 | 3,710 | 730,128,000 | |
| | 大和ハウスリート投資法人 | 69,870 | 8,775,672,000 | |
| | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 81,662 | 6,949,436,200 | |
| | 大和証券リビング投資法人 | 32,778 | 3,507,246,000 | |
| | ジャパンエクセレント投資法人 | 18,608 | 2,685,134,400 | |
| 投資証券 | 合計 | | 244,834,357,400 | |
| 合計 | | | 244,834,357,400 | |

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

(注) ※先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の有価証券が差し入れられております。
野村不動産マスターF 5,000 口

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

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

貸借対照表

| | 2024年9月9日現在 金額(円) | 2025年9月8日現在 金額(円) |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 434,799,819 | 511,890,251 |
| コール・ローン | 337,551,711 | 376,644,293 |
| 投資信託受益証券 | 1,922,377,070 | 1,934,968,206 |
| 投資証券 | 40,541,502,106 | 49,506,376,297 |
| 派生商品評価勘定 | 146,176,066 | 23,181,396 |
| 未収入金 | 2,774,040 | 3,621,685 |
| 未収配当金 | 62,361,722 | 78,758,772 |
| 差入委託証拠金 | 349,690,914 | 450,724,089 |
| 流動資産合計 | 43,797,233,448 | 52,886,164,989 |
| 資産合計 | 43,797,233,448 | 52,886,164,989 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 7,297,983 | 17,682,217 |
| 未払金 | 35,251,811 | 77,577,357 |
| 未払解約金 | 3,653,600 | 15,500,000 |
| 流動負債合計 | 46,203,394 | 110,759,574 |
| 負債合計 | 46,203,394 | 110,759,574 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ※1 11,178,461,295 | 12,844,489,558 |
| 剩余金 | | |
| 期末剩余金又は期末欠損金(△) | 32,572,568,759 | 39,930,915,857 |
| 元本等合計 | 43,751,030,054 | 52,775,405,415 |
| 純資産合計 | 43,751,030,054 | 52,775,405,415 |
| 負債純資産合計 | 43,797,233,448 | 52,886,164,989 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | 自 2024 年 9 月 10 日 至 2025 年 9 月 8 日 |
|------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>(1) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、市場価格のない有価証券については投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。また、市場価格のある有価証券については、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の 1 口当たり純資産額に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | <p>(1) 先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p> |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | 受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 |

| 区分 | 自 2024 年 9 月 10 日 至 2025 年 9 月 8 日 |
|--------------------------------|---|
| 4. その他財務諸表作成のための 基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成 12 年総理府令第 133 号）第 60 条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第 61 条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 2024 年 9 月 9 日現在 | 2025 年 9 月 8 日現在 |
|--|----------------------------------|----------------------------------|
| 1. ※1 期首 | 2023 年 9 月 8 日 | 2024 年 9 月 10 日 |
| 期首元本額 | 10,116,723,115 円 | 11,178,461,295 円 |
| 期中追加設定元本額 | 2,114,341,286 円 | 2,570,076,503 円 |
| 期中一部解約元本額 | 1,052,603,106 円 | 904,048,240 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) | 82,616,918 円 | - 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) | 2,096,952,787 円 | 2,812,777,388 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) | 352,447,616 円 | 273,241,143 円 |
| D - I ' s グローバル R E I T インデックス | 1,480,147 円 | 1,381,357 円 |
| D C ダイワ・ターゲットイヤー 2050 | 19,599,696 円 | 22,460,237 円 |
| i F r e e 外国 R E I T インデ ックス | 640,252,524 円 | 593,646,532 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) | 2,473,064,144 円 380,225,890 円 | 3,063,070,087 円 444,953,671 円 |
| グローバル・リート・インデッ クスファンド (毎月決算型) | 234,595,966 円 | 219,435,626 円 |
| D C ダイワ・ターゲットイヤー 2060 | 3,804,284 円 | 6,569,090 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 | 4,219,241,496 円 | 4,619,615,827 円 |
| D C ダイワ・ターゲットイヤー 2030 | 7,239,335 円 | 7,868,075 円 |

| 区分 | 2024年9月9日現在 | 2025年9月8日現在 |
|--|------------------|------------------|
| DCダイワ・ターゲットイヤー 2040 | 8,245,286 円 | 8,987,650 円 |
| ダイワ海外R E I T インデックス (為替ヘッジなし) (投資一 任専用) | 4,525,126 円 | 6,537,165 円 |
| ダイワバランスファンド 2021-02 (適格機関投資家専用) | 130,015,618 円 | 127,623,683 円 |
| スタイル9 (6 資産分散・保守 型) | 27,608 円 | 24,685 円 |
| スタイル9 (6 資産分散・バラン ス型) | 1,251,871 円 | 2,397,622 円 |
| スタイル9 (6 資産分散・積極 型) | 1,058,285 円 | 3,296,331 円 |
| スタイル9 (8 資産分散・保守 型) | 35,065 円 | 38,792 円 |
| スタイル9 (8 資産分散・バラン ス型) | 834,483 円 | 1,678,464 円 |
| スタイル9 (8 資産分散・積極 型) | 847,750 円 | 3,720,526 円 |
| ダイワ・インデックスセレクト グローバルR E I T | 198,278,659 円 | 163,286,978 円 |
| ダイワ・ノーロード グローバル R E I T ファンド | 63,434,254 円 | 54,624,680 円 |
| ダイワ外国R E I T インデックス (為替ヘッジなし) (ダイワ SMA 専用) | 17,587,214 円 | 252,198,675 円 |
| ダイワバランスファンド 2023-08 (適格機関投資家専用) | 82,346,237 円 | -円 |
| ダイワバランスファンド 2024-01 (適格機関投資家専用) | 79,777,774 円 | 78,001,867 円 |
| ダイワバランスファンド 2024-05 (適格機関投資家専用) | 78,675,262 円 | 77,053,407 円 |
| 計 | 11,178,461,295 円 | 12,844,489,558 円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 11,178,461,295 口 | 12,844,489,558 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 2024年9月10日 至 2025年9月8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 2024 年 9 月 10 日 至 2025 年 9 月 8 日 |
|----------------------------|---|
| 2. 金融商品の内容及びリスク | <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品は、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。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。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。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>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。</p> <p>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。</p> |

II 金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | 2025 年 9 月 8 日現在 |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 金融商品の時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 2024 年 9 月 9 日現在 | 2025 年 9 月 8 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 | 158, 456, 830 | 55, 286, 546 |
| 投資証券 | 6, 174, 110, 709 | △2, 028, 340, 887 |
| 合計 | 6, 332, 567, 539 | △1, 973, 054, 341 |

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

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

1. 不動産投信関連

| 種類 | 2024年9月9日現在 | | | 2025年9月8日現在 | | |
|-----------------|---------------|-----------|---------------|-------------|---------------|-------------|
| | 契約額等 (円) | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 (円) | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| うち 1年超 | | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引 | | | | | | |
| 不動産投信 指数先物取引 | | | | | | |
| 買建 | 1,176,218,395 | - | 1,322,394,461 | 146,176,066 | 1,402,067,857 | - |
| 合計 | 1,176,218,395 | - | 1,322,394,461 | 146,176,066 | 1,402,067,857 | - |
| | | | | | | |
| | | | | | | |

(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。
- 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。
 - 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
 - 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2. 通貨関連

| 種類 | 2024年9月9日現在 | | | 2025年9月8日現在 | | |
|-----------|-------------|-----------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| | 契約額等 (円) | 時価 (円) | 評価損益 (円) | 契約額等 (円) | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| うち 1年超 | | | | うち 1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | | |
| 買建 | 366,909,447 | - | 359,611,464 | △7,297,983 | 428,495,311 | - |
| アメリカ・ドル | 267,038,607 | - | 261,775,030 | △5,263,577 | 251,382,382 | - |
| ユーロ | 99,870,840 | - | 97,836,434 | △2,034,406 | 177,112,929 | - |
| 合計 | 366,909,447 | - | 359,611,464 | △7,297,983 | 428,495,311 | - |
| | | | | | | |
| | | | | | | |

(注) 1. 時価の算定方法

- 期末日に對顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
 - 期末日において為替予約の受渡日の對顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

(1 口当たり情報)

| | 2024 年 9 月 9 日現在 | 2025 年 9 月 8 日現在 |
|-----------------------------|------------------------|------------------------|
| 1 口当たり純資産額 (1 万口当たり純資産額) | 3.9139 円 (39,139 円) | 4.1088 円 (41,088 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 | 140,940 | 13,032,721.800 | |
| | アメリカ・ドル | 小計 | | 13,032,721.800 (1,934,968,206) | |
| 投資信託受益証券 合計 | | | | 1,934,968,206 [1,934,968,206] | |
| 投資証券 | アメリカ・ドル | PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 25,585 | 301,647.150 | |
| | | URBAN EDGE PROPERTIES | 27,617 | 585,480.400 | |
| | | XENIA HOTELS & RESORTS INC | 21,380 | 308,085.800 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 31,229 | 6,102,458.890 | |
| | | SIMON PROPERTY GROUP INC | 67,388 | 12,281,463.000 | |
| | | BXP INC | 31,990 | 2,457,791.700 | |
| | | APARTMENT INVT & MGMT CO -A | 28,097 | 219,999.510 | |
| | | VORNADO REALTY TRUST | 36,676 | 1,514,352.040 | |
| | | EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI | 9,091 | 210,911.200 | |
| | | NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 15,451 | 514,518.300 | |
| | | NEXPOINT RESIDENTIAL | 4,831 | 167,490.770 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL | 75,101 | 5,017,497.810 | |
| | | APPLE HOSPITALITY REIT INC | 48,594 | 633,665.760 | |
| | | EPR PROPERTIES | 16,706 | 889,761.560 | |
| | | CITY OFFICE REIT INC | 8,863 | 61,509.220 | |
| | | GLOBAL NET LEASE INC | 41,594 | 333,999.820 | |
| | | EQUINIX INC | 21,483 | 16,620,967.440 | |
| | | FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 22,066 | 576,143.260 | |
| | | CHATHAM LODGING TRUST | 9,853 | 73,010.730 | |
| | | RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 13,177 | 1,327,978.060 | |
| | | COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | 5,248 | 82,183.680 | |
| | | BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 10,300 | 30,694.000 | |
| | | HOST HOTELS & RESORTS INC | 152,358 | 2,655,599.940 | |
| | | AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 69,796 | 2,432,390.600 | |
| | | HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 72,728 | 223,274.960 | |
| | | RLJ LODGING TRUST | 32,902 | 259,267.760 | |
| | | FARMLAND PARTNERS INC | 8,636 | 92,577.920 | |
| | | ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN | 17,053 | 124,486.900 | |
| | | KIMCO REALTY CORP | 148,577 | 3,381,612.520 | |
| | | GLOBAL MEDICAL REIT INC | 13,195 | 100,282.000 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|-----------------------------------|----------|------------------|----|
| | | HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS | 77, 182 | 1, 393, 906. 920 | |
| | | WHITESTONE REIT | 9, 836 | 129, 638. 480 | |
| | | GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 60, 360 | 2, 923, 234. 800 | |
| | | PIEDMONT REALTY TRUST INC CLASS A | 26, 473 | 232, 432. 940 | |
| | | PARK HOTELS & RESORTS INC | 43, 901 | 526, 812. 000 | |
| | | INVITATION HOMES INC | 125, 197 | 3, 787, 209. 250 | |
| | | OUTFRONT MEDIA INC | 30, 456 | 554, 908. 320 | |
| | | LAMAR ADVERTISING CO-A | 19, 320 | 2, 472, 960. 000 | |
| | | JBG SMITH PROPERTIES | 15, 745 | 357, 883. 850 | |
| | | ALEXANDER & BALDWIN INC | 15, 969 | 310, 437. 360 | |
| | | GLADSTONE LAND CORP | 6, 732 | 60, 453. 360 | |
| | | AMERICOLD REALTY TRUST | 57, 531 | 803, 708. 070 | |
| | | INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT | 12, 928 | 79, 377. 920 | |
| | | VICI PROPERTIES INC | 232, 082 | 7, 797, 955. 200 | |
| | | BRT APARTMENTS CORP | 2, 485 | 38, 964. 800 | |
| | | INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER | 6, 039 | 346, 034. 700 | |
| | | ESSENTIAL PROPERTIES REALTY | 43, 379 | 1, 336, 073. 200 | |
| | | PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 8, 417 | 188, 540. 800 | |
| | | BROADSTONE NET LEASE INC | 41, 525 | 775, 687. 000 | |
| | | SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 23, 552 | 132, 833. 280 | |
| | | AMERICAN ASSETS TRUST INC | 10, 370 | 216, 940. 400 | |
| | | INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 51, 258 | 924, 694. 320 | |
| | | PARAMOUNT GROUP INC | 40, 444 | 305, 352. 200 | |
| | | EMPIRE STATE REALTY TRUST-A | 29, 603 | 235, 935. 910 | |
| | | NETSTREIT CORP | 17, 944 | 322, 453. 680 | |
| | | CTO REALTY GROWTH INC | 6, 246 | 108, 805. 320 | |
| | | REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN | 51, 859 | 2, 224, 232. 510 | |
| | | STAG INDUSTRIAL INC | 40, 986 | 1, 514, 842. 560 | |
| | | ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC | 2, 366 | 36, 602. 020 | |
| | | POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A | 4, 914 | 78, 427. 440 | |
| | | PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC | 27, 541 | 995, 607. 150 | |
| | | ORION OFFICE REIT INC | 9, 048 | 27, 234. 480 | |
| | | DIGITAL CORE REIT UNITS | 196, 700 | 99, 333. 500 | |
| | | VENTAS INC | 99, 117 | 6, 731, 035. 470 | |
| | | CARETRUST REIT INC | 46, 327 | 1, 572, 338. 380 | |
| | | INVENTRUST PROPERTIES CORP | 17, 036 | 510, 398. 560 | |
| | | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 67, 219 | 1, 895, 575. 800 | |
| | | SABRA HEALTH CARE REIT INC | 52, 257 | 994, 450. 710 | |
| | | UMH PROPERTIES INC | 16, 851 | 256, 809. 240 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|------------------------------------|----------|-------------------|----|
| | | CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC | 3, 125 | 100, 000. 000 | |
| | | NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C | 7, 709 | 29, 294. 200 | |
| | | PEAKSTONE REALTY TRUST CLASS E | 7, 600 | 103, 284. 000 | |
| | | NET LEASE OFFICE PROPERTIES | 3, 253 | 95, 605. 670 | |
| | | AMERICAN HEALTHCARE REIT INC | 35, 029 | 1, 496, 789. 170 | |
| | | LINEAGE INC | 13, 053 | 529, 821. 270 | |
| | | MODIV INDUSTRIAL INC CLASS C | 1, 600 | 24, 416. 000 | |
| | | SILA RLTY TR INC TRUST | 12, 111 | 308, 346. 060 | |
| | | CURBLINE PROPERTIES | 20, 797 | 477, 291. 150 | |
| | | FRONTVIEW REIT INC | 3, 619 | 48, 530. 790 | |
| | | MILLROSE PROPERTIES INC CLASS A | 26, 413 | 903, 588. 730 | |
| | | IRON MOUNTAIN INC | 64, 799 | 5, 973, 171. 820 | |
| | | TERRENO REALTY CORP | 22, 692 | 1, 340, 643. 360 | |
| | | SUN COMMUNITIES INC | 26, 351 | 3, 420, 886. 820 | |
| | | ACADIA REALTY TRUST | 28, 762 | 578, 403. 820 | |
| | | ALEXANDER'S INC | 462 | 108, 320. 520 | |
| | | PROLOGIS INC | 203, 798 | 23, 161, 642. 700 | |
| | | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 33, 813 | 2, 863, 961. 100 | |
| | | BRANDYWINE REALTY TRUST | 36, 941 | 161, 432. 170 | |
| | | SAUL CENTERS INC | 2, 561 | 85, 306. 910 | |
| | | VERIS RESIDENTIAL INC | 17, 484 | 283, 765. 320 | |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 23, 464 | 2, 612, 951. 040 | |
| | | COUSINS PROPERTIES INC | 36, 878 | 1, 086, 794. 660 | |
| | | SITE CENTERS CORP | 10, 022 | 93, 605. 480 | |
| | | EASTGROUP PROPERTIES INC | 11, 517 | 1, 936, 813. 890 | |
| | | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 14, 140 | 3, 791, 216. 800 | |
| | | FIRST INDUSTRIAL REALTY TR | 29, 078 | 1, 519, 325. 500 | |
| | | FEDERAL REALTY INVS TRUST | 17, 050 | 1, 750, 523. 500 | |
| | | GETTY REALTY CORP | 11, 202 | 323, 401. 740 | |
| | | WELLTOWER INC | 136, 444 | 22, 898, 032. 080 | |
| | | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 152, 582 | 2, 805, 982. 980 | |
| | | HIGHWOODS PROPERTIES INC | 23, 678 | 754, 144. 300 | |
| | | SERVICE PROPERTIES TRUST | 36, 597 | 105, 399. 360 | |
| | | KILROY REALTY CORP | 23, 380 | 998, 326. 000 | |
| | | LTC PROPERTIES INC | 9, 899 | 362, 501. 380 | |
| | | LXP INDUSTRIAL TRUST | 64, 956 | 594, 347. 400 | |
| | | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 25, 709 | 3, 738, 088. 600 | |
| | | MACERICH CO/THE | 55, 488 | 1, 040, 400. 000 | |
| | | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 41, 990 | 2, 591, 622. 800 | |
| | | NATL HEALTH INVESTORS INC | 10, 255 | 803, 992. 000 | |
| | | NATIONAL RETAIL PROPERTIES | 41, 279 | 1, 789, 444. 650 | |
| | | REALTY INCOME CORP | 198, 341 | 11, 759, 637. 890 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|--------------|------------------------------------|---------|-------------------------------------|----|
| | | COPT DEFENSE PROPERTIES TRUST | 24,740 | 758,528.400 | |
| | | PUBLIC STORAGE | 34,676 | 10,326,512.800 | |
| | | REGENCY CENTERS CORP | 35,881 | 2,643,712.080 | |
| | | SAFEHOLD INC | 9,705 | 158,191.500 | |
| | | TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 24,856 | 864,491.680 | |
| | | SL GREEN REALTY CORP | 15,597 | 966,858.030 | |
| | | DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 46,467 | 191,444.040 | |
| | | UDR INC | 66,213 | 2,588,266.170 | |
| | | UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 2,798 | 115,725.280 | |
| | | WP CAREY INC | 48,093 | 3,276,095.160 | |
| | | ELME | 19,362 | 333,413.640 | |
| | | AGREE REALTY CORP | 24,116 | 1,761,673.800 | |
| | | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 63,559 | 2,741,935.260 | |
| | | CUBESMART | 50,065 | 2,089,713.100 | |
| | | SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 42,952 | 410,621.120 | |
| | | DIGITAL REALTY TRUST INC | 69,530 | 11,350,077.200 | |
| | | EXTRA SPACE STORAGE INC | 46,607 | 6,864,278.960 | |
| | | CENTERSPACE | 3,606 | 218,163.000 | |
| | | KITE REALTY GROUP TRUST | 48,276 | 1,122,899.760 | |
| | | ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 3,397 | 80,305.080 | |
| | | GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 9,974 | 131,856.280 | |
| | | DIAMONDRock HOSPITALITY CO | 45,311 | 388,768.380 | |
| | | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 131,952 | 608,298.720 | |
| | | FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 16,005 | 26,888.400 | |
| | | DOUGLAS EMMETT INC | 36,775 | 621,865.250 | |
| | | MANULIFE US REAL ESTATE INV | 341,662 | 25,966.310 | |
| | | KEPPEL PACIFIC OAK US REIT | 171,300 | 40,255.500 | |
| | | EAGLE HOSPITALITY TRUST | 90,000 | 0.000 | |
| | | PRIME US REIT | 155,920 | 29,780.720 | |
| | アメリカ・ドル | 小計 | | 259,068,863.850 (38,463,954,216) | |
| | イギリス・ポン ド | WAREHOUSE REIT PLC | 86,763 | 98,562.760 | |
| | | HELICAL PLC | 23,433 | 50,615.280 | |
| | | LIFE SCIENCE REIT PLC | 74,423 | 29,099.390 | |
| | | HAMMERSHOLM REIT PLC | 97,368 | 266,983.050 | |
| | | EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 144,983 | 130,774.660 | |
| | | ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITE | 76,976 | 4,164.400 | |
| | | CLS HOLDINGS PLC | 29,656 | 16,785.290 | |
| | | PICTON PROPERTY INCOME LTD | 118,918 | 87,642.560 | |
| | | REGIONAL REIT LTD | 36,280 | 44,624.400 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---------------|----|------------------------------------|---------|-----------------------------------|----|
| | | NEWRIVER REIT PLC | 101,749 | 72,241.790 | |
| | | SHAFESBURY CAPITAL PLC | 437,179 | 618,608.280 | |
| | | CUSTODIAN REIT PLC | 96,834 | 74,659.010 | |
| | | PRS REIT PLC/THE | 113,932 | 111,653.360 | |
| | | SOCIAL HOUSING REIT PLC | 72,416 | 50,039.450 | |
| | | TARGET HEALTHCARE REIT PLC | 138,827 | 132,579.780 | |
| | | AEW UK REIT PLC | 32,682 | 33,858.550 | |
| | | SUPERMARKET INCOME REIT PLC | 278,945 | 221,761.270 | |
| | | HOME REIT PLC | 117,587 | 0.000 | |
| | | LAND SECURITIES GROUP PLC | 166,740 | 899,562.300 | |
| | | SEGRO PLC | 302,927 | 1,901,775.700 | |
| | | UNITE GROUP PLC/THE | 92,998 | 657,960.850 | |
| | | BRITISH LAND CO PLC | 223,641 | 752,775.600 | |
| | | GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 90,917 | 272,751.000 | |
| | | DERWENT LONDON PLC | 25,134 | 421,245.840 | |
| | | PRIMARY HEALTH PROPERTIES | 548,938 | 494,044.200 | |
| | | WORKSPACE GROUP PLC | 30,965 | 123,705.170 | |
| | | SAFESTORE HOLDINGS PLC | 48,904 | 309,562.320 | |
| | | BIG YELLOW GROUP PLC | 44,030 | 407,277.500 | |
| | | LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 518,447 | 936,315.280 | |
| | | SCHRODER REAL ESTATE INVESTM | 104,674 | 51,028.570 | |
| | | TRITAX BIG BOX REIT PLC | 555,249 | 759,580.630 | |
| イギリス・ポンド 小計 | | | | 10,032,238.240 (2,009,657,964) | |
| イスラエル・シユケル | | MENIVIM- THE NEW REIT LTD | 169,724 | 379,842.310 | |
| | | SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT | 50,267 | 534,840.880 | |
| | | REIT 1 LTD | 44,595 | 1,070,280.000 | |
| イスラエル・シユケル 小計 | | | | 1,984,963.190 (88,237,768) | |
| オーストラリア・ドル | | DEXUS/AU | 249,153 | 1,831,274.550 | |
| | | HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI | 88,653 | 65,603.220 | |
| | | ABACUS STORAGE KING STAPLED UNITS | 122,443 | 172,032.410 | |
| | | DIGICO INFRASTRUCTURE REIT STAPLED | 88,604 | 266,698.040 | |
| | | CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR | 75,197 | 252,661.920 | |
| | | CROMWELL PROPERTY GROUP | 308,949 | 139,027.050 | |
| | | CENTURIA INDUSTRIAL REIT | 123,548 | 412,650.320 | |
| | | RURAL FUNDS GROUP | 86,746 | 165,684.860 | |
| | | WAYPOINT REIT | 155,667 | 421,857.570 | |
| | | CHARTER HALL LONG WALE REIT | 151,349 | 687,124.460 | |
| | | CENTURIA OFFICE REIT | 86,351 | 107,075.240 | |
| | | CENTURIA CAPITAL GROUP | 192,289 | 453,802.040 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|------------|---------------------------------------|-------------|---|----|
| | | HOMECO DAILY NEEDS REIT | 407, 518 | 554, 224. 480 | |
| | | REGION GROUP | 269, 372 | 651, 880. 240 | |
| | | GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | 60, 426 | 148, 647. 960 | |
| | | NATIONAL STORAGE REIT | 322, 324 | 786, 470. 560 | |
| | | DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT | 48, 020 | 133, 015. 400 | |
| | | SCENTRE GROUP | 1, 206, 580 | 4, 898, 714. 800 | |
| | | ARENA REIT | 92, 663 | 378, 065. 040 | |
| | | BWP TRUST | 128, 921 | 465, 404. 810 | |
| | | GPT GROUP | 443, 740 | 2, 405, 070. 800 | |
| | | CHARTER HALL RETAIL REIT | 119, 830 | 503, 286. 000 | |
| | | MIRVAC GROUP | 914, 053 | 2, 138, 884. 020 | |
| | | STOCKLAND | 555, 914 | 3, 457, 785. 080 | |
| | | ABACUS GROUP UNIT | 100, 940 | 122, 642. 100 | |
| | | GOODMAN GROUP | 470, 513 | 15, 752, 775. 240 | |
| | | VICINITY CENTRES | 898, 437 | 2, 299, 998. 720 | |
| | | CHARTER HALL GROUP | 109, 569 | 2, 552, 957. 700 | |
| | | INGENIA COMMUNITIES GROUP | 86, 862 | 489, 033. 060 | |
| | オーストラリア・ドル | 小計 | | 42, 714, 347. 690 (4, 156, 533, 173) | |
| | カナダ・ドル | NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS | 7, 000 | 54, 180. 000 | |
| | | PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN | 11, 496 | 173, 934. 480 | |
| | | ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 11, 230 | 82, 989. 700 | |
| | | SLATE GROCERY REIT | 6, 100 | 87, 413. 000 | |
| | | KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 13, 621 | 249, 400. 510 | |
| | | MINTO APARTMENT REAL ESTATE | 3, 900 | 53, 781. 000 | |
| | | NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | 27, 639 | 139, 853. 340 | |
| | | GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 6, 952 | 547, 261. 440 | |
| | | DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE | 31, 743 | 391, 073. 760 | |
| | | INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 15, 565 | 208, 415. 350 | |
| | | FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN | 23, 654 | 459, 833. 760 | |
| | | CHOICE PROPERTIES REIT | 37, 233 | 567, 803. 250 | |
| | | MORGARD NORTH AMERICAN RESI | 3, 800 | 71, 136. 000 | |
| | | CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 12, 000 | 198, 000. 000 | |
| | | SMARTCENTRES REAL ESTATE INV | 16, 112 | 435, 507. 360 | |
| | | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 18, 189 | 782, 672. 670 | |
| | | H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 29, 803 | 360, 616. 300 | |
| | | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 33, 681 | 628, 487. 460 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|-------------|------------------------------------|-----------|-----------------------------------|----|
| | | DREAM OFFICE REAL ESTATE INV | 1,650 | 29,865.000 | |
| | | BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 5,445 | 392,530.050 | |
| | | CROMBIE REAL ESTATE INVESTME | 12,391 | 187,723.650 | |
| | | ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 14,524 | 281,475.120 | |
| | | カナダ・ドル 小計 | | 6,383,953.200 (684,934,339) | |
| | シンガポール・ドル | KEPPEL DC REIT | 423,283 | 986,249.390 | |
| | | AIMS APAC REIT | 149,400 | 204,678.000 | |
| | | FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL | 681,090 | 633,413.700 | |
| | | SASSEUR REAL ESTATE INVESTME | 114,700 | 82,010.500 | |
| | | LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL | 408,040 | 248,904.400 | |
| | | EC WORLD REIT | 36,500 | 0.000 | |
| | | CAPITALAND ASCENDAS REIT | 815,477 | 2,258,871.290 | |
| | | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL | 1,304,522 | 2,948,219.720 | |
| | | SUNTEC REIT | 510,400 | 668,624.000 | |
| | | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 786,300 | 967,149.000 | |
| | | KEPPEL REIT | 557,300 | 543,367.500 | |
| | | CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU | 592,256 | 530,069.120 | |
| | | ESR-REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 146,850 | 414,117.000 | |
| | | CDL HOSPITALITY TRUSTS | 155,400 | 125,874.000 | |
| | | FRASERS CENTREPOINT TRUST | 313,801 | 734,294.340 | |
| | | STARHILL GLOBAL REIT | 316,000 | 178,540.000 | |
| | | CAPITALAND CHINA TRUST | 274,042 | 211,012.340 | |
| | | PARKWAYLIFE REAL ESTATE | 96,700 | 404,206.000 | |
| | | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 482,169 | 1,007,733.210 | |
| | | MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS | 537,184 | 746,685.760 | |
| | | FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 237,600 | 141,372.000 | |
| | | OUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 513,500 | 172,022.500 | |
| | | シンガポール・ドル 小計 | | 14,207,413.770 (1,641,098,365) | |
| | ニュージーランド・ドル | GOODMAN PROPERTY TRUST | 242,388 | 523,558.080 | |
| | | ニュージーランド・ドル 小計 | | 523,558.080 (45,800,860) | |
| | ユーロ | EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 8,650 | 231,820.000 | |
| | | SHURGARD SELF STORAGE LTD | 6,048 | 198,072.000 | |
| | | STONEWEG EUROPE STAPLED TRUST | 64,220 | 99,541.000 | |
| | | HAMBORNER REIT AG | 13,318 | 75,646.240 | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 | |
|-----------|----|------------------------------|----------|--|----|--|
| | | WERELDHAVE NV | 7, 150 | 133, 419. 000 | | |
| | | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 20, 345 | 1, 781, 815. 100 | | |
| | | NSI NV | 3, 397 | 72, 525. 950 | | |
| | | ICADE | 6, 192 | 126, 192. 960 | | |
| | | CARMILA | 12, 358 | 209, 097. 360 | | |
| | | ALTAREA | 1, 004 | 98, 291. 600 | | |
| | | GECINA SA | 10, 338 | 865, 807. 500 | | |
| | | KLEPIERRE | 43, 761 | 1, 467, 743. 940 | | |
| | | COVIVIO | 10, 615 | 597, 093. 750 | | |
| | | MERCIALYS | 17, 002 | 184, 641. 720 | | |
| | | AEDIFICA | 9, 420 | 592, 989. 000 | | |
| | | COFINIMMO | 7, 547 | 557, 723. 300 | | |
| | | RETAIL ESTATES | 2, 505 | 170, 089. 500 | | |
| | | WAREHOUSES DE PAUW SCA | 35, 348 | 766, 344. 640 | | |
| | | CARE PROPERTY INVEST | 6, 928 | 84, 798. 720 | | |
| | | XIOR STUDENT HOUSING NV | 7, 352 | 218, 722. 000 | | |
| | | MONTEA NV | 4, 102 | 272, 783. 000 | | |
| | | IMMOBILIARE GRANDE | 9, 559 | 31, 927. 060 | | |
| | | DISTRIBUZ | | | | |
| | | INMOBILIARIA COLONIAL | 67, 116 | 377, 863. 080 | | |
| | | SOCIMI | | | | |
| | | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 78, 179 | 978, 019. 290 | | |
| | | IRISH RESIDENTIAL | 98, 529 | 97, 248. 120 | | |
| | | PROPERTIES | | | | |
| ユーロ 小計 | | | | 10, 290, 215. 830 (1, 789, 056, 924) | | |
| 韓国・ウォン | | SK REITS LTD | 32, 181 | 163, 801, 290. 000 | | |
| | | IGIS VALUE PLUS REIT LTD | 3, 663 | 366, 300. 000 | | |
| | | SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 23, 689 | 132, 421, 510. 000 | | |
| | | LOTTE REIT CO LTD | 32, 639 | 128, 924, 050. 000 | | |
| | | IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD | 10, 468 | 42, 918, 800. 000 | | |
| | | JR REIT XXVII | 41, 466 | 119, 214, 750. 000 | | |
| | | KORAMCO ENERGY PLUS REIT | 10, 067 | 44, 043, 125. 000 | | |
| | | ESR KENDALL SQUARE REIT CO L | 41, 944 | 190, 425, 760. 000 | | |
| 韓国・ウォン 小計 | | | | 822, 115, 585. 000 (87, 884, 157) | | |
| 香港・ドル | | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN | 571, 000 | 542, 450. 000 | | |
| | | SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST | 181, 000 | 394, 580. 000 | | |
| | | FORTUNE REIT | 350, 000 | 1, 704, 500. 000 | | |
| | | LINK REIT | 597, 874 | 24, 811, 771. 000 | | |
| | | CHAMPION REIT | 425, 000 | 867, 000. 000 | | |
| 香港・ドル 小計 | | | | 28, 320, 301. 000 (539, 218, 531) | | |
| 投資証券 合計 | | | | 49, 506, 376, 297 [49, 506, 376, 297] | | |
| 合計 | | | | 51, 441, 344, 503 | | |

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|----|------|---------------------|----|
| | | | | [51, 441, 344, 503] | |

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

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

| 通貨 | 銘柄数 | 組入 投資信託 受益証券 時価比率 | 組入 投資証券 時価比率 | 合計金額に 対する比率 |
|-------------|------------------------------|----------------------------|--------------------|----------------|
| アメリカ・ドル | 投資信託受益証券 1 銘柄 投資証券 140 銘柄 | 4.8% | 95.2% | 78.5% |
| イギリス・ポンド | 投資証券 31 銘柄 | -% | 100% | 3.9% |
| イスラエル・シュケル | 投資証券 3 銘柄 | -% | 100% | 0.2% |
| オーストラリア・ドル | 投資証券 29 銘柄 | -% | 100% | 8.1% |
| カナダ・ドル | 投資証券 22 銘柄 | -% | 100% | 1.3% |
| シンガポール・ドル | 投資証券 22 銘柄 | -% | 100% | 3.2% |
| ニュージーランド・ドル | 投資証券 1 銘柄 | -% | 100% | 0.1% |
| ユーロ | 投資証券 25 銘柄 | -% | 100% | 3.5% |
| 韓国・ウォン | 投資証券 8 銘柄 | -% | 100% | 0.2% |
| 香港・ドル | 投資証券 5 銘柄 | -% | 100% | 1.0% |

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

| | 2024年9月9日現在 金額(円) | 2025年9月8日現在 金額(円) |
|-----------------|-----------------------|------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 195,343,382 | 799,236,514 |
| 国債証券 | 81,477,050,720 | 93,656,545,570 |
| 地方債証券 | 5,374,875,336 | 5,085,705,197 |
| 特殊債券 | 4,402,418,286 | 4,267,855,688 |
| 社債券 | 7,028,210,200 | 7,192,700,000 |
| 未収入金 | － | 185,536,000 |
| 未収利息 | 202,543,354 | 276,219,368 |
| 前払費用 | 17,018,172 | 35,002,376 |
| 流動資産合計 | 98,697,459,450 | 111,498,800,713 |
| 資産合計 | 98,697,459,450 | 111,498,800,713 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | － | 800,000,000 |
| 未払解約金 | 3,234,488 | 1,219,686 |
| 流動負債合計 | 3,234,488 | 801,219,686 |
| 負債合計 | 3,234,488 | 801,219,686 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | ※1 81,894,612,584 | 96,635,396,862 |
| 剩余金 | | |
| 期末剩余金又は期末欠損金（△） | 16,799,612,378 | 14,062,184,165 |
| 元本等合計 | 98,694,224,962 | 110,697,581,027 |
| 純資産合計 | 98,694,224,962 | 110,697,581,027 |
| 負債純資産合計 | 98,697,459,450 | 111,498,800,713 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | 自 2024 年 9 月 10 日 至 2025 年 9 月 8 日 |
|-----------------|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 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。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 2024 年 9 月 9 日現在 | 2025 年 9 月 8 日現在 |
|--|---------------------|---------------------|
| 1. ※1 期首 | | |
| 期首元本額 | 2023 年 9 月 8 日 | 2024 年 9 月 10 日 |
| 期中追加設定元本額 | 41, 118, 291, 684 円 | 81, 894, 612, 584 円 |
| 期中一部解約元本額 | 42, 482, 462, 228 円 | 16, 759, 962, 937 円 |
| | 1, 706, 141, 328 円 | 2, 019, 178, 659 円 |
| 期末元本額の内訳 | | |
| ファンド名 | | |
| 日本債券インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用) | 3, 822, 409, 530 円 | 5, 361, 367, 589 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) | 30, 964, 825, 168 円 | 35, 486, 306, 096 円 |
| i F r e e 日本債券インデックス | 2, 772, 696, 062 円 | 2, 392, 950, 447 円 |
| i F r e e 8 資産バランス | 8, 115, 070, 138 円 | 10, 620, 795, 370 円 |
| ダイワ・ライフ・バランス 30 | 13, 104, 740, 465 円 | 15, 137, 492, 051 円 |
| ダイワ・ライフ・バランス 50 | 10, 972, 473, 547 円 | 12, 847, 076, 877 円 |
| ダイワ・ライフ・バランス 70 | 4, 447, 693, 771 円 | 5, 284, 717, 815 円 |
| DC ダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース) | 2, 203, 900, 623 円 | 2, 577, 699, 451 円 |
| DC ダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6 分散コース) | 1, 802, 706, 364 円 | 2, 108, 246, 375 円 |
| DC ダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース) | 741, 243, 964 円 | 1, 012, 512, 251 円 |
| ダイワつみたてインデックス日本債券 | 2, 596, 469, 317 円 | 3, 198, 791, 778 円 |
| ダイワつみたてインデックスバランス 30 | 55, 133, 049 円 | 62, 666, 425 円 |
| ダイワつみたてインデックスバランス 50 | 29, 481, 573 円 | 38, 609, 806 円 |

| 区分 | 2024年9月9日現在 | 2025年9月8日現在 |
|---------------------|-----------------|-----------------|
| ダイワつみたてインデックスバランス70 | 24,911,566円 | 259,182,912円 |
| ダイワ世界バランスファンド40VA | 192,331,972円 | 194,578,361円 |
| ダイワ世界バランスファンド60VA | 48,525,475円 | 52,403,258円 |
| 計 | 81,894,612,584円 | 96,635,396,862円 |
| 2. 期末日における受益権の総数 | 81,894,612,584口 | 96,635,396,862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2024年9月10日 至2025年9月8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 | 2025年9月8日現在 |
|--------------------------|---|
| 1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額 | 金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| 種類 | 2024年9月9日現在 | 2025年9月8日現在 |
|-------|------------------------|------------------------|
| | 当期間の損益に 含まれた評価差額（円） | 当期間の損益に 含まれた評価差額（円） |
| 国債証券 | △1,446,951,460 | △4,300,103,960 |
| 地方債証券 | △27,770,757 | △96,543,265 |
| 特殊債券 | △31,999,165 | △103,230,777 |
| 社債券 | △31,903,900 | △79,422,700 |
| 合計 | △1,538,625,282 | △4,579,300,702 |

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

| 2024年9月9日現在 | 2025年9月8日現在 |
|-------------|-------------|
| 該当事項はありません。 | 該当事項はありません。 |

(1 口当たり情報)

| | 2024年9月9日現在 | 2025年9月8日現在 |
|----------------------------|------------------------|------------------------|
| 1 口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.2051 円 (12,051 円) | 1.1455 円 (11,455 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 | 465 2年国債 | 100,000,000 | 99,705,000 | |
| | 466 2年国債 | 800,000,000 | 798,176,000 | |
| | 467 2年国債 | 450,000,000 | 449,370,000 | |
| | 469 2年国債 | 710,000,000 | 709,552,700 | |
| | 470 2年国債 | 575,000,000 | 575,373,750 | |
| | 473 2年国債 | 450,000,000 | 450,112,500 | |
| | 474 2年国債 | 400,000,000 | 399,284,000 | |
| | 475 2年国債 | 350,000,000 | 350,584,500 | |
| | 150 5年国債 | 1,450,000,000 | 1,436,848,500 | |
| | 151 5年国債 | 600,000,000 | 593,250,000 | |
| | 152 5年国債 | 290,000,000 | 287,155,100 | |
| | 153 5年国債 | 1,520,000,000 | 1,498,932,800 | |
| | 154 5年国債 | 1,900,000,000 | 1,872,868,000 | |
| | 155 5年国債 | 90,000,000 | 88,932,600 | |
| | 156 5年国債 | 1,870,000,000 | 1,843,633,000 | |
| | 157 5年国債 | 60,000,000 | 59,013,600 | |
| | 158 5年国債 | 2,050,000,000 | 2,011,214,000 | |
| | 159 5年国債 | 200,000,000 | 195,690,000 | |
| | 161 5年国債 | 810,000,000 | 796,934,700 | |
| | 162 5年国債 | 280,000,000 | 274,839,600 | |
| | 163 5年国債 | 1,810,000,000 | 1,781,981,200 | |
| | 164 5年国債 | 1,200,000,000 | 1,171,188,000 | |
| | 166 5年国債 | 620,000,000 | 609,057,000 | |
| | 168 5年国債 | 700,000,000 | 690,816,000 | |
| | 169 5年国債 | 1,800,000,000 | 1,770,246,000 | |
| | 170 5年国債 | 300,000,000 | 295,521,000 | |
| | 171 5年国債 | 650,000,000 | 635,453,000 | |
| | 173 5年国債 | 150,000,000 | 147,475,500 | |
| | 174 5年国債 | 920,000,000 | 908,067,600 | |
| | 175 5年国債 | 50,000,000 | 49,692,500 | |
| | 176 5年国債 | 745,000,000 | 743,621,750 | |
| | 177 5年国債 | 400,000,000 | 400,900,000 | |
| | 178 5年国債 | 1,075,000,000 | 1,071,742,750 | |
| | 179 5年国債 | 500,000,000 | 497,840,000 | |
| | 1 40年国債 | 30,000,000 | 27,842,400 | |
| | 2 40年国債 | 48,000,000 | 42,324,000 | |
| | 3 40年国債 | 19,000,000 | 16,434,240 | |
| | 4 40年国債 | 54,000,000 | 45,769,860 | |
| | 5 40年国債 | 61,000,000 | 48,748,760 | |

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 (円) | 備考 |
|----|-----------|---------------|---------------|----|
| | 6 40年国債 | 268,000,000 | 206,435,040 | |
| | 7 40年国債 | 190,000,000 | 137,740,500 | |
| | 8 40年国債 | 100,000,000 | 66,099,000 | |
| | 9 40年国債 | 40,000,000 | 18,574,400 | |
| | 10 40年国債 | 290,000,000 | 160,074,200 | |
| | 11 40年国債 | 85,000,000 | 44,477,100 | |
| | 12 40年国債 | 99,000,000 | 44,848,980 | |
| | 13 40年国債 | 252,000,000 | 111,787,200 | |
| | 14 40年国債 | 273,000,000 | 127,941,450 | |
| | 15 40年国債 | 650,000,000 | 335,211,500 | |
| | 16 40年国債 | 710,000,000 | 399,864,900 | |
| | 17 40年国債 | 1,050,000,000 | 779,394,000 | |
| | 18 40年国債 | 550,000,000 | 510,548,500 | |
| | 3 CT5年国債 | 150,000,000 | 149,352,000 | |
| | 1 CT10年国債 | 130,000,000 | 122,791,500 | |
| | 345 10年国債 | 410,000,000 | 406,773,300 | |
| | 346 10年国債 | 20,000,000 | 19,803,800 | |
| | 347 10年国債 | 500,000,000 | 493,905,000 | |
| | 348 10年国債 | 430,000,000 | 423,859,600 | |
| | 349 10年国債 | 430,000,000 | 422,973,800 | |
| | 350 10年国債 | 400,000,000 | 392,432,000 | |
| | 351 10年国債 | 500,000,000 | 489,225,000 | |
| | 352 10年国債 | 150,000,000 | 146,329,500 | |
| | 353 10年国債 | 520,000,000 | 505,861,200 | |
| | 355 10年国債 | 200,000,000 | 193,306,000 | |
| | 356 10年国債 | 600,000,000 | 578,070,000 | |
| | 357 10年国債 | 600,000,000 | 576,300,000 | |
| | 358 10年国債 | 1,280,000,000 | 1,225,331,200 | |
| | 359 10年国債 | 1,060,000,000 | 1,011,187,000 | |
| | 360 10年国債 | 1,380,000,000 | 1,312,021,200 | |
| | 361 10年国債 | 1,250,000,000 | 1,184,375,000 | |
| | 362 10年国債 | 1,530,000,000 | 1,444,641,300 | |
| | 363 10年国債 | 830,000,000 | 780,664,800 | |
| | 364 10年国債 | 1,000,000,000 | 936,820,000 | |
| | 365 10年国債 | 1,180,000,000 | 1,100,987,200 | |
| | 366 10年国債 | 1,500,000,000 | 1,403,685,000 | |
| | 367 10年国債 | 1,250,000,000 | 1,165,062,500 | |
| | 368 10年国債 | 1,300,000,000 | 1,206,712,000 | |
| | 369 10年国債 | 1,370,000,000 | 1,294,526,700 | |
| | 370 10年国債 | 1,250,000,000 | 1,176,600,000 | |
| | 371 10年国債 | 1,200,000,000 | 1,116,216,000 | |
| | 372 10年国債 | 1,180,000,000 | 1,128,481,200 | |
| | 373 10年国債 | 1,260,000,000 | 1,181,262,600 | |
| | 374 10年国債 | 1,170,000,000 | 1,111,020,300 | |
| | 375 10年国債 | 600,000,000 | 582,282,000 | |

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 (円) | 備考 |
|----|-----------|-------------|-------------|----|
| | 376 10年国債 | 858,000,000 | 815,434,620 | |
| | 377 10年国債 | 950,000,000 | 924,141,000 | |
| | 378 10年国債 | 950,000,000 | 938,163,000 | |
| | 379 10年国債 | 700,000,000 | 696,136,000 | |
| | 2 30年国債 | 9,000,000 | 9,520,470 | |
| | 3 30年国債 | 4,000,000 | 4,221,720 | |
| | 4 30年国債 | 8,000,000 | 8,716,480 | |
| | 5 30年国債 | 8,000,000 | 8,457,840 | |
| | 6 30年国債 | 9,000,000 | 9,642,420 | |
| | 7 30年国債 | 12,000,000 | 12,813,840 | |
| | 10 30年国債 | 25,000,000 | 24,606,500 | |
| | 11 30年国債 | 9,000,000 | 9,234,720 | |
| | 12 30年国債 | 11,000,000 | 11,601,810 | |
| | 13 30年国債 | 11,000,000 | 11,510,950 | |
| | 14 30年国債 | 22,000,000 | 23,711,820 | |
| | 15 30年国債 | 21,000,000 | 22,796,760 | |
| | 16 30年国債 | 26,000,000 | 28,213,380 | |
| | 17 30年国債 | 17,000,000 | 18,298,290 | |
| | 18 30年国債 | 20,000,000 | 21,342,400 | |
| | 19 30年国債 | 15,000,000 | 16,002,750 | |
| | 20 30年国債 | 16,000,000 | 17,349,440 | |
| | 21 30年国債 | 16,000,000 | 17,033,760 | |
| | 22 30年国債 | 17,000,000 | 18,394,850 | |
| | 23 30年国債 | 16,000,000 | 17,284,000 | |
| | 24 30年国債 | 15,000,000 | 16,182,150 | |
| | 25 30年国債 | 17,000,000 | 17,956,760 | |
| | 26 30年国債 | 32,000,000 | 34,060,160 | |
| | 27 30年国債 | 120,000,000 | 128,432,400 | |
| | 28 30年国債 | 34,000,000 | 36,228,700 | |
| | 29 30年国債 | 43,000,000 | 45,080,340 | |
| | 30 30年国債 | 56,000,000 | 57,696,240 | |
| | 31 30年国債 | 76,000,000 | 76,906,680 | |
| | 32 30年国債 | 115,000,000 | 117,038,950 | |
| | 33 30年国債 | 95,000,000 | 92,383,700 | |
| | 34 30年国債 | 110,000,000 | 109,052,900 | |
| | 35 30年国債 | 120,000,000 | 114,975,600 | |
| | 36 30年国債 | 138,000,000 | 131,545,740 | |
| | 37 30年国債 | 165,000,000 | 153,540,750 | |
| | 38 30年国債 | 250,000,000 | 227,012,500 | |
| | 39 30年国債 | 105,000,000 | 96,356,400 | |
| | 40 30年国債 | 80,000,000 | 71,922,400 | |
| | 41 30年国債 | 80,000,000 | 70,467,200 | |
| | 42 30年国債 | 200,000,000 | 175,192,000 | |
| | 43 30年国債 | 335,000,000 | 292,163,550 | |
| | 44 30年国債 | 155,000,000 | 134,499,700 | |

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 (円) | 備考 |
|----|----------|-------------|-------------|----|
| | 45 30年国債 | 200,000,000 | 166,612,000 | |
| | 46 30年国債 | 250,000,000 | 207,140,000 | |
| | 47 30年国債 | 355,000,000 | 298,302,950 | |
| | 48 30年国債 | 300,000,000 | 241,452,000 | |
| | 49 30年国債 | 340,000,000 | 272,095,200 | |
| | 50 30年国債 | 320,000,000 | 224,576,000 | |
| | 51 30年国債 | 350,000,000 | 216,307,000 | |
| | 52 30年国債 | 350,000,000 | 225,536,500 | |
| | 53 30年国債 | 280,000,000 | 183,428,000 | |
| | 54 30年国債 | 290,000,000 | 197,881,500 | |
| | 55 30年国債 | 350,000,000 | 237,170,500 | |
| | 56 30年国債 | 250,000,000 | 168,127,500 | |
| | 57 30年国債 | 315,000,000 | 210,375,900 | |
| | 58 30年国債 | 480,000,000 | 318,163,200 | |
| | 59 30年国債 | 290,000,000 | 186,026,300 | |
| | 60 30年国債 | 250,000,000 | 167,540,000 | |
| | 61 30年国債 | 260,000,000 | 164,294,000 | |
| | 62 30年国債 | 390,000,000 | 231,429,900 | |
| | 63 30年国債 | 270,000,000 | 154,172,700 | |
| | 64 30年国債 | 300,000,000 | 169,539,000 | |
| | 65 30年国債 | 275,000,000 | 153,815,750 | |
| | 66 30年国債 | 440,000,000 | 243,438,800 | |
| | 67 30年国債 | 340,000,000 | 197,740,600 | |
| | 68 30年国債 | 300,000,000 | 172,746,000 | |
| | 69 30年国債 | 300,000,000 | 176,337,000 | |
| | 70 30年国債 | 460,000,000 | 268,442,200 | |
| | 71 30年国債 | 310,000,000 | 179,366,000 | |
| | 72 30年国債 | 300,000,000 | 172,212,000 | |
| | 73 30年国債 | 340,000,000 | 193,643,600 | |
| | 74 30年国債 | 450,000,000 | 278,761,500 | |
| | 75 30年国債 | 360,000,000 | 241,185,600 | |
| | 76 30年国債 | 290,000,000 | 198,650,000 | |
| | 77 30年国債 | 275,000,000 | 197,535,250 | |
| | 78 30年国債 | 260,000,000 | 176,521,800 | |
| | 79 30年国債 | 300,000,000 | 191,871,000 | |
| | 80 30年国債 | 280,000,000 | 209,098,400 | |
| | 81 30年国債 | 350,000,000 | 247,740,500 | |
| | 82 30年国債 | 350,000,000 | 259,871,500 | |
| | 83 30年国債 | 300,000,000 | 244,611,000 | |
| | 84 30年国債 | 280,000,000 | 222,751,200 | |
| | 85 30年国債 | 290,000,000 | 241,422,100 | |
| | 86 30年国債 | 410,000,000 | 349,074,000 | |
| | 87 30年国債 | 80,000,000 | 74,215,200 | |
| | 92 20年国債 | 60,000,000 | 61,053,000 | |
| | 93 20年国債 | 18,000,000 | 18,342,180 | |

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 (円) | 備考 |
|----|-----------|-------------|-------------|----|
| | 94 20年国債 | 45,000,000 | 45,923,400 | |
| | 95 20年国債 | 30,000,000 | 30,796,800 | |
| | 96 20年国債 | 63,000,000 | 64,452,150 | |
| | 97 20年国債 | 25,000,000 | 25,699,000 | |
| | 98 20年国債 | 64,000,000 | 65,661,440 | |
| | 99 20年国債 | 53,000,000 | 54,523,750 | |
| | 100 20年国債 | 35,000,000 | 36,172,850 | |
| | 101 20年国債 | 18,000,000 | 18,692,100 | |
| | 102 20年国債 | 10,000,000 | 10,413,600 | |
| | 103 20年国債 | 21,000,000 | 21,811,440 | |
| | 104 20年国債 | 64,000,000 | 66,126,080 | |
| | 105 20年国債 | 38,000,000 | 39,339,120 | |
| | 106 20年国債 | 16,000,000 | 16,611,040 | |
| | 107 20年国債 | 40,000,000 | 41,489,200 | |
| | 108 20年国債 | 68,000,000 | 70,087,600 | |
| | 109 20年国債 | 60,000,000 | 61,912,800 | |
| | 110 20年国債 | 27,000,000 | 28,049,760 | |
| | 111 20年国債 | 35,000,000 | 36,548,750 | |
| | 113 20年国債 | 170,000,000 | 177,175,700 | |
| | 114 20年国債 | 45,000,000 | 46,983,150 | |
| | 115 20年国債 | 42,000,000 | 44,023,140 | |
| | 116 20年国債 | 27,000,000 | 28,347,570 | |
| | 117 20年国債 | 77,000,000 | 80,492,720 | |
| | 118 20年国債 | 13,000,000 | 13,549,510 | |
| | 119 20年国債 | 23,000,000 | 23,757,620 | |
| | 120 20年国債 | 98,000,000 | 100,314,760 | |
| | 123 20年国債 | 42,000,000 | 44,095,380 | |
| | 124 20年国債 | 100,000,000 | 104,464,000 | |
| | 125 20年国債 | 25,000,000 | 26,405,000 | |
| | 126 20年国債 | 21,000,000 | 21,955,920 | |
| | 127 20年国債 | 110,000,000 | 114,435,200 | |
| | 128 20年国債 | 32,000,000 | 33,309,120 | |
| | 129 20年国債 | 95,000,000 | 98,344,950 | |
| | 130 20年国債 | 110,000,000 | 113,902,800 | |
| | 131 20年国債 | 150,000,000 | 154,434,000 | |
| | 132 20年国債 | 25,000,000 | 25,737,250 | |
| | 133 20年国債 | 150,000,000 | 155,346,000 | |
| | 134 20年国債 | 15,000,000 | 15,539,850 | |
| | 135 20年国債 | 20,000,000 | 20,592,600 | |
| | 136 20年国債 | 180,000,000 | 184,188,600 | |
| | 137 20年国債 | 18,000,000 | 18,529,200 | |
| | 139 20年国債 | 250,000,000 | 255,705,000 | |
| | 140 20年国債 | 100,000,000 | 102,874,000 | |
| | 141 20年国債 | 140,000,000 | 143,914,400 | |
| | 142 20年国債 | 210,000,000 | 217,343,700 | |

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 (円) | 備考 |
|----|-----------|-------------|-------------|----|
| | 143 20年国債 | 100,000,000 | 101,986,000 | |
| | 144 20年国債 | 130,000,000 | 131,645,800 | |
| | 145 20年国債 | 40,000,000 | 41,043,200 | |
| | 146 20年国債 | 160,000,000 | 163,937,600 | |
| | 147 20年国債 | 350,000,000 | 355,323,500 | |
| | 148 20年国債 | 290,000,000 | 291,653,000 | |
| | 149 20年国債 | 110,000,000 | 110,385,000 | |
| | 150 20年国債 | 480,000,000 | 476,371,200 | |
| | 151 20年国債 | 290,000,000 | 282,106,200 | |
| | 152 20年国債 | 640,000,000 | 620,633,600 | |
| | 153 20年国債 | 600,000,000 | 585,768,000 | |
| | 154 20年国債 | 80,000,000 | 77,133,600 | |
| | 155 20年国債 | 600,000,000 | 564,978,000 | |
| | 156 20年国債 | 580,000,000 | 510,173,800 | |
| | 157 20年国債 | 670,000,000 | 572,454,700 | |
| | 158 20年国債 | 680,000,000 | 597,271,200 | |
| | 159 20年国債 | 660,000,000 | 582,733,800 | |
| | 160 20年国債 | 710,000,000 | 630,330,900 | |
| | 161 20年国債 | 470,000,000 | 409,614,400 | |
| | 162 20年国債 | 540,000,000 | 467,596,800 | |
| | 163 20年国債 | 450,000,000 | 387,126,000 | |
| | 164 20年国債 | 760,000,000 | 640,991,600 | |
| | 165 20年国債 | 550,000,000 | 460,410,500 | |
| | 166 20年国債 | 720,000,000 | 614,671,200 | |
| | 167 20年国債 | 480,000,000 | 395,932,800 | |
| | 168 20年国債 | 700,000,000 | 564,823,000 | |
| | 169 20年国債 | 500,000,000 | 394,340,000 | |
| | 170 20年国債 | 720,000,000 | 563,068,800 | |
| | 171 20年国債 | 400,000,000 | 310,172,000 | |
| | 172 20年国債 | 700,000,000 | 547,141,000 | |
| | 173 20年国債 | 520,000,000 | 403,244,400 | |
| | 174 20年国債 | 850,000,000 | 653,556,500 | |
| | 175 20年国債 | 450,000,000 | 348,948,000 | |
| | 176 20年国債 | 700,000,000 | 538,888,000 | |
| | 177 20年国債 | 480,000,000 | 360,235,200 | |
| | 178 20年国債 | 770,000,000 | 583,737,000 | |
| | 179 20年国債 | 510,000,000 | 383,764,800 | |
| | 180 20年国債 | 720,000,000 | 567,561,600 | |
| | 181 20年国債 | 450,000,000 | 358,537,500 | |
| | 182 20年国債 | 690,000,000 | 565,158,300 | |
| | 183 20年国債 | 450,000,000 | 385,155,000 | |
| | 184 20年国債 | 420,000,000 | 339,649,800 | |
| | 185 20年国債 | 610,000,000 | 490,110,600 | |
| | 186 20年国債 | 600,000,000 | 513,618,000 | |
| | 187 20年国債 | 490,000,000 | 403,078,900 | |

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 (円) | 備考 |
|-------|--------------|-------------|----------------|----|
| | 188 20年国債 | 400,000,000 | 344,600,000 | |
| | 189 20年国債 | 350,000,000 | 315,500,500 | |
| | 190 20年国債 | 400,000,000 | 352,968,000 | |
| | 191 20年国債 | 430,000,000 | 390,594,800 | |
| | 192 20年国債 | 360,000,000 | 347,522,400 | |
| | 193 20年国債 | 300,000,000 | 293,397,000 | |
| | 1 フィリピン共和国 | 100,000,000 | 98,842,700 | |
| 国債証券 | 合計 | | 93,656,545,570 | |
| 地方債証券 | 797 東京都公債 | 100,000,000 | 95,637,100 | |
| | 866 東京都公債 | 200,000,000 | 200,251,600 | |
| | 5 東京都 30年 | 100,000,000 | 56,223,900 | |
| | 28 東京都 20年 | 100,000,000 | 100,970,200 | |
| | 3-5 北海道公債 | 100,000,000 | 93,527,800 | |
| | 262 神奈川県公債 | 300,000,000 | 288,367,500 | |
| | 457 大阪府公債 | 100,000,000 | 94,772,400 | |
| | 26-5 京都府 20年 | 100,000,000 | 98,740,100 | |
| | 6-1 京都府 5年 | 200,000,000 | 195,601,400 | |
| | 11 兵庫県公債 20年 | 100,000,000 | 102,925,300 | |
| | 8 静岡県 20年 | 100,000,000 | 104,233,400 | |
| | 5-3 愛知県公債 | 100,000,000 | 94,173,000 | |
| | 6-1 愛知県 5年 | 300,000,000 | 293,369,700 | |
| | 24-1 広島県 20年 | 100,000,000 | 101,888,000 | |
| | 25-1 広島県 20年 | 100,000,000 | 101,773,800 | |
| | 1 埼玉県 15年 | 100,000,000 | 99,144,200 | |
| | 9 埼玉県 20年 | 100,000,000 | 104,292,800 | |
| | 29-6 千葉県公債 | 100,000,000 | 98,328,800 | |
| | 30-3 新潟県公債 | 134,160,000 | 129,842,597 | |
| | 3-1 茨城県公債 | 100,000,000 | 93,548,000 | |
| | 168 共同発行地方 | 100,000,000 | 99,001,400 | |
| | 170 共同発行地方 | 200,000,000 | 197,545,400 | |
| | 206 共同発行地方 | 200,000,000 | 190,144,200 | |
| | 244 共同発行地方 | 100,000,000 | 93,274,100 | |
| | 255 共同発行地方 | 300,000,000 | 287,395,800 | |
| | 270 共同発行地方 | 300,000,000 | 301,899,300 | |
| | 3-3 堺市公債 | 100,000,000 | 92,653,200 | |
| | 4-3 長崎県公債 | 100,000,000 | 93,415,400 | |
| | 2-1 静岡市公債 | 100,000,000 | 94,438,200 | |
| | 6-1 大阪市 5年 | 200,000,000 | 196,098,800 | |
| | 6-2 大阪市公債 | 200,000,000 | 190,423,400 | |
| | 11 名古屋市 20年 | 100,000,000 | 103,968,000 | |
| | 10 京都市 20年 | 100,000,000 | 102,769,100 | |
| | 24-3 神戸市 20年 | 100,000,000 | 101,536,200 | |
| | 2-2 横浜市公債 | 100,000,000 | 94,745,300 | |
| | 6 札幌市 20年 | 100,000,000 | 104,111,500 | |

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 (円) | 備考 |
|----------|-----------------|-------------|---------------|----|
| | 17 北九州市 20 年 | 100,000,000 | 99,491,600 | |
| | 2-1 千葉市公債 | 100,000,000 | 95,182,700 | |
| 地方債証券 合計 | | | 5,085,705,197 | |
| 特殊債券 | 86 政保政策投資 C | 300,000,000 | 298,141,800 | |
| | 47 日本政策投資 CO | 100,000,000 | 99,300,100 | |
| | 174 日本政策投資 | 100,000,000 | 93,435,300 | |
| | 184 日本政策投資 | 200,000,000 | 195,299,000 | |
| | 79 政保道路機構 | 100,000,000 | 103,580,100 | |
| | 81 政保道路機構 | 100,000,000 | 103,631,200 | |
| | 97 政保道路機構 | 100,000,000 | 103,968,500 | |
| | 143 政保道路機構 | 200,000,000 | 205,693,800 | |
| | 235 政保道路機構 | 100,000,000 | 96,455,000 | |
| | 321 政保道路機構 | 100,000,000 | 98,546,300 | |
| | 397 政保道路機構 | 100,000,000 | 95,468,900 | |
| | 478 政保道路機構 | 300,000,000 | 287,985,600 | |
| | 23 地方公共団 20 | 100,000,000 | 101,527,500 | |
| | F163 地方公共団体 | 100,000,000 | 100,014,600 | |
| | F168 地方公共団体 | 200,000,000 | 201,831,400 | |
| | 3 地方公共団 15 年 | 100,000,000 | 100,133,500 | |
| | F231 地方公共団体 | 100,000,000 | 99,644,700 | |
| | 129 地方公共団体 | 100,000,000 | 95,009,600 | |
| | F568 地方公共団体 | 300,000,000 | 260,859,000 | |
| | 95 日本政策金融 | 300,000,000 | 297,360,000 | |
| | 4 国際協力銀行 CO | 100,000,000 | 98,258,400 | |
| | 47 住宅機構 RMBS | 158,868,000 | 161,584,642 | |
| | 92 住宅機構 RMBS | 74,256,000 | 69,622,425 | |
| | 100 住宅機構 RMBS | 45,663,000 | 42,553,349 | |
| | 120 住宅機構 RMBS | 859,544,000 | 763,275,072 | |
| | 33 沖縄振興開発 | 100,000,000 | 94,675,900 | |
| 特殊債券 合計 | | | 4,267,855,688 | |
| 社債券 | 39 BPCE S. A. | 100,000,000 | 98,912,200 | |
| | 4 香港上海銀行 | 100,000,000 | 99,421,400 | |
| | 33 首都高速道路 | 300,000,000 | 294,078,600 | |
| | 30 阪神高速道路 | 200,000,000 | 197,864,200 | |
| | 8 ビーエヌビーパリバ | 100,000,000 | 98,629,800 | |
| | 111 東日本高速道 | 300,000,000 | 293,877,300 | |
| | 101 中日本高速道 | 200,000,000 | 196,147,600 | |
| | 88 西日本高速道 | 300,000,000 | 291,332,400 | |
| | 22 積水ハウス | 100,000,000 | 97,831,000 | |
| | 11 サントリーホールディング | 100,000,000 | 97,963,700 | |
| | 3 伊藤園 | 100,000,000 | 97,620,300 | |
| | 29 東急不動産 HD | 100,000,000 | 97,783,200 | |
| | 18 セブンアンドアイ | 100,000,000 | 96,784,100 | |
| | 35 東レ | 100,000,000 | 97,164,500 | |
| | 57 三井化学 | 200,000,000 | 198,119,600 | |

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 (円) | 備考 |
|--------|----------------|-------------|-----------------|----|
| | 16 武田薬品 | 100,000,000 | 91,822,000 | |
| | 32 住友電工 | 100,000,000 | 96,794,200 | |
| | 16 クボタ | 100,000,000 | 98,174,300 | |
| | 34 ダイキン工業 | 200,000,000 | 200,075,200 | |
| | 40 ソニーG | 100,000,000 | 97,980,400 | |
| | 31 トヨタ自動車 | 100,000,000 | 93,490,800 | |
| | 6 楽天カード | 100,000,000 | 98,185,000 | |
| | 4 オリツクス銀行 | 100,000,000 | 98,038,400 | |
| | 26 りそなホールディングス | 100,000,000 | 97,870,500 | |
| | 39 芙蓉総合リース | 200,000,000 | 197,920,800 | |
| | 5 NTT ファイナンス | 100,000,000 | 91,614,700 | |
| | 33 NTT ファイナンス | 200,000,000 | 194,598,600 | |
| | 38 NTT ファイナンス | 100,000,000 | 94,756,300 | |
| | 58 日産ファイナンシャル | 200,000,000 | 193,683,200 | |
| | 81 ホンダファイナンス | 100,000,000 | 97,468,700 | |
| | 102 トヨタファイナンス | 100,000,000 | 99,100,400 | |
| | 103 トヨタファイナンス | 200,000,000 | 195,577,400 | |
| | 42 リコーリース | 100,000,000 | 98,673,200 | |
| | 214 オリツクス | 100,000,000 | 92,559,500 | |
| | 1 SOMPOHD | 100,000,000 | 97,931,800 | |
| | 7 三井住友海上 | 100,000,000 | 99,088,300 | |
| | 82 三井不動産 | 100,000,000 | 97,742,400 | |
| | 80 三菱地所 | 100,000,000 | 101,955,400 | |
| | 143 三菱地所 | 100,000,000 | 94,223,000 | |
| | 55 西日本鉄道 | 200,000,000 | 195,457,600 | |
| | 52 阪急阪神 HLDG | 100,000,000 | 95,489,700 | |
| | 20 三菱倉庫 | 100,000,000 | 95,997,500 | |
| | 34 KDDI | 100,000,000 | 97,636,100 | |
| | 9 ソフトバンク | 100,000,000 | 97,888,900 | |
| | 46 光通信 | 100,000,000 | 97,909,600 | |
| | 566 中部電力 | 200,000,000 | 186,713,800 | |
| | 448 中国電力 | 100,000,000 | 93,203,100 | |
| | 563 東北電力 | 200,000,000 | 186,760,200 | |
| | 489 九州電力 | 100,000,000 | 95,440,400 | |
| | 87 電源開発 | 100,000,000 | 93,475,600 | |
| | 83 東京電力 PG | 200,000,000 | 200,730,800 | |
| | 16 JERA | 100,000,000 | 98,300,700 | |
| | 65 東京瓦斯 | 100,000,000 | 94,446,200 | |
| | 44 大阪瓦斯 | 100,000,000 | 92,586,700 | |
| | 50 大阪瓦斯 | 100,000,000 | 97,981,800 | |
| | 60 ソフトバンクグループ | 100,000,000 | 99,826,900 | |
| 社債券 合計 | | | 7,192,700,000 | |
| 合計 | | | 110,202,806,455 | |

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】

2025年9月30日

| | |
|-----------------------|-------------------|
| I 資産総額 | 103,718,022,957 円 |
| II 負債総額 | 80,405,921 円 |
| III 純資産総額 (I - II) | 103,637,617,036 円 |
| IV 発行済数量 | 51,130,387,116 口 |
| V 1単位当たり純資産額 (III/IV) | 2.0269 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

2025年9月30日

| | |
|-----------------------|-------------------|
| I 資産総額 | 525,941,303,318 円 |
| II 負債総額 | 11,623,894,467 円 |
| III 純資産総額 (I - II) | 514,317,408,851 円 |
| IV 発行済数量 | 217,825,124,811 口 |
| V 1単位当たり純資産額 (III/IV) | 2.3611 円 |

(参考) ダイワJ-REITマザーファンド

純資産額計算書

2025年9月30日

| | |
|-----------------------|-------------------|
| I 資産総額 | 256,161,563,748 円 |
| II 負債総額 | 1,084,405,375 円 |
| III 純資産総額 (I - II) | 255,077,158,373 円 |
| IV 発行済数量 | 67,741,748,680 口 |
| V 1単位当たり純資産額 (III/IV) | 3.7654 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

2025年9月30日

| | | |
|-----|--------------------------|-------------------|
| I | 資産総額 | 111,864,111,969 円 |
| II | 負債総額 | 265,610,447 円 |
| III | 純資産総額 (I - II) | 111,598,501,522 円 |
| IV | 発行済数量 | 97,446,600,370 口 |
| V | 1 単位当たり純資産額 (III / IV) | 1.1452 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

2025 年 9 月 30 日

| | | |
|-----|--------------------------|------------------|
| I | 資産総額 | 55,931,832,706 円 |
| II | 負債総額 | 390,186,698 円 |
| III | 純資産総額 (I - II) | 55,541,646,008 円 |
| IV | 発行済数量 | 16,428,939,319 口 |
| V | 1 単位当たり純資産額 (III / IV) | 3.3807 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

2025 年 9 月 30 日

| | | |
|-----|--------------------------|-------------------|
| I | 資産総額 | 821,675,276,806 円 |
| II | 負債総額 | 200,061,012 円 |
| III | 純資産総額 (I - II) | 821,475,215,794 円 |
| IV | 発行済数量 | 104,501,811,872 口 |
| V | 1 単位当たり純資産額 (III / IV) | 7.8609 円 |

(参考) 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

純資産額計算書

2025 年 9 月 30 日

| | | |
|-----|--------------------------|------------------|
| I | 資産総額 | 53,700,325,115 円 |
| II | 負債総額 | 97,891,549 円 |
| III | 純資産総額 (I - II) | 53,602,433,566 円 |
| IV | 発行済数量 | 13,024,444,798 口 |
| V | 1 単位当たり純資産額 (III / IV) | 4.1155 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

2025年9月30日

| | |
|-----------------------|------------------|
| I 資産総額 | 62,283,870,113 円 |
| II 負債総額 | 334,292,951 円 |
| III 純資産総額 (I - II) | 61,949,577,162 円 |
| IV 発行済数量 | 29,750,428,055 口 |
| V 1単位当たり純資産額 (III/IV) | 2.0823 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

2025年9月30日

| | |
|-----------------------|-------------------|
| I 資産総額 | 355,087,975,361 円 |
| II 負債総額 | 82,556,338 円 |
| III 純資産総額 (I - II) | 355,005,419,023 円 |
| IV 発行済数量 | 92,789,499,877 口 |
| V 1単位当たり純資産額 (III/IV) | 3.8259 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ます。）に支払います。

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受け付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約

款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2025年9月末日現在

資本金の額 414億2,454万1,896円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 326万657株

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

b. 委託会社の機構

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。

2025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 | 86 | 406,448 |
| 追加型株式投資信託 | 784 | 34,024,819 |
| 株式投資信託 合計 | 870 | 34,431,267 |
| 単位型公社債投資信託 | 71 | 132,664 |
| 追加型公社債投資信託 | 14 | 1,488,448 |
| 公社債投資信託 合計 | 85 | 1,621,112 |
| 総合計 | 955 | 36,052,379 |

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(2024年4月1日から2025年3月31日まで)の財務諸表についての監査を、有限責任あづ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

2025年5月26日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あづさ監査法人

東京事務所

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

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2024年4月1日から2025年3月31日までの第66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2025年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

任がある。

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRL データは監査の対象には含まれていません。

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

| | 前事業年度 (2024年3月31日) | 当事業年度 (2025年3月31日) |
|--------------|-----------------------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 現金・預金 | 4,813 | 13,153 |
| 有価証券 | 503 | 1,194 |
| 前払費用 | 481 | 513 |
| 未収委託者報酬 | 16,513 | 19,097 |
| 未収収益 | 78 | 110 |
| 関係会社短期貸付金 | 23,400 | 70,000 |
| その他 | 88 | 94 |
| 流動資産計 | 45,878 | 104,164 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | ※1 | 176 |
| 建物 | | 2 |
| 器具備品 | | 174 |
| 建設仮勘定 | | 0 |
| 無形固定資産 | | 1,342 |
| ソフトウェア | | 1,063 |
| ソフトウェア仮勘定 | | 279 |
| その他 | | – |
| 投資その他の資産 | | 13,660 |
| 投資有価証券 | | 8,448 |
| 関係会社株式 | | 3,475 |
| 出資金 | | 177 |
| 長期差入保証金 | | 1,021 |
| 繰延税金資産 | | 524 |
| その他 | | 12 |
| 固定資産計 | 15,180 | 16,077 |
| 資産合計 | 61,058 | 120,241 |

(単位:百万円)

| | 前事業年度 (2024年3月31日) | 当事業年度 (2025年3月31日) |
|-------------------|-----------------------|-----------------------|
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 158 | 134 |
| 未払金 | 6,187 | 6,757 |
| 未払収益分配金 | 39 | 62 |
| 未払償還金 | 12 | 12 |
| 未払手数料 | 5,849 | 6,660 |
| その他未払金 | ※2 285 | 22 |
| 未払費用 | 5,035 | 5,997 |
| 未払法人税等 | 3,842 | 4,121 |
| 未払消費税等 | 872 | 763 |
| 賞与引当金 | 1,048 | 1,456 |
| その他 | 1 | 0 |
| 流動負債計 | 17,146 | 19,233 |
| 固定負債 | | |
| 退職給付引当金 | 2,227 | 2,300 |
| 役員退職慰労引当金 | 62 | 58 |
| 固定負債計 | 2,289 | 2,358 |
| 負債合計 | 19,435 | 21,592 |
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 15,174 | 41,424 |
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | 11,495 | 37,745 |
| 資本剰余金合計 | 11,495 | 37,745 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 374 | 374 |
| その他利益剰余金 | | |
| 繰越利益剰余金 | 13,048 | 17,743 |
| 利益剰余金合計 | 13,422 | 18,117 |
| 株主資本合計 | 40,092 | 97,287 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 1,530 | 1,361 |
| 評価・換算差額等合計 | 1,530 | 1,361 |
| 純資産合計 | 41,623 | 98,649 |
| 負債・純資産合計 | 61,058 | 120,241 |

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

| | 前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日) | 当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日) |
|--------------|--|--|
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | 76,221 | 91,634 |
| その他営業収益 | 717 | 1,233 |
| 営業収益計 | 76,939 | 92,868 |
| 営業費用 | | |
| 支払手数料 | 31,497 | 37,180 |
| 広告宣伝費 | 947 | 1,124 |
| 調査費 | 10,709 | 13,135 |
| 調査費 | 1,700 | 1,954 |
| 委託調査費 | 9,009 | 11,180 |
| 委託計算費 | 1,783 | 1,957 |
| 営業雑経費 | 2,285 | 3,114 |
| 通信費 | 163 | 167 |
| 印刷費 | 514 | 483 |
| 協会費 | 51 | 57 |
| 諸会費 | 18 | 18 |
| その他営業雑経費 | 1,538 | 2,388 |
| 営業費用計 | 47,224 | 56,512 |
| 一般管理費 | | |
| 給料 | 6,601 | 7,599 |
| 役員報酬 | 483 | 453 |
| 給料・手当 | 4,543 | 5,116 |
| 賞与 | 527 | 572 |
| 賞与引当金繰入額 | 1,048 | 1,456 |
| 福利厚生費 | 969 | 1,070 |
| 交際費 | 96 | 108 |
| 旅費交通費 | 192 | 247 |
| 租税公課 | 508 | 1,004 |
| 不動産賃借料 | 1,269 | 1,298 |
| 退職給付費用 | 334 | 349 |
| 役員退職慰労引当金繰入額 | 6 | 6 |
| 固定資産減価償却費 | 478 | 444 |
| 諸経費 | 1,888 | 2,164 |
| 一般管理費計 | 12,346 | 14,293 |
| 営業利益 | 17,368 | 22,061 |

(単位:百万円)

| | 前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日) | 当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日) |
|--------------|--|--|
| 営業外収益 | | |
| 受取配当金 | 32 | 959 |
| 投資有価証券売却益 | 220 | 387 |
| 有価証券償還益 | 40 | 183 |
| 受取利息 | 4 | 95 |
| その他 | 89 | 76 |
| 営業外収益計 | 388 | 1,703 |
| 営業外費用 | | |
| 投資有価証券売却損 | 1 | 176 |
| 有価証券償還損 | 196 | 4 |
| その他 | 18 | 54 |
| 営業外費用計 | 215 | 235 |
| 経常利益 | 17,540 | 23,528 |
| 特別利益 | | |
| 投資有価証券売却益 | — | ※1 380 |
| 固定資産売却益 | — | ※2 110 |
| 特別利益計 | — | 491 |
| 特別損失 | | |
| 固定資産売却損 | — | ※3 101 |
| システム刷新関連費用 | 153 | — |
| 投資有価証券評価損 | 132 | — |
| 特別損失計 | 286 | 101 |
| 税引前当期純利益 | 17,253 | 23,918 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 5,533 | 7,763 |
| 法人税等調整額 | △139 | △397 |
| 法人税等合計 | 5,394 | 7,366 |
| 当期純利益 | 11,859 | 16,552 |

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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 | 利益準備金 | 利益剰余金 | | 利益剰余金 合計 | | |
| | | 資本準備金 | | 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 | | | | | | | | |
| 剩余金の配当 | - | - | | - | △ 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 | | | |
| 剩余金の配当 | - | - | △ 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 |

当事業年度(自 2024 年 4 月 1 日 至 2025 年 3 月 31 日)

(単位:百万円)

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

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

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。

5. その他財務諸表の作成のための基本となる重要な事項

当社は株式会社大和証券グループ本社を通算親法人とするグループ通算制度を適用しておりましたが、2024年10月1日の第三者割当増資により、株式会社大和証券グループ本社の100%子会社ではなくなったため、株式会社大和証券グループ本社を通算親法人とするグループ通算制度から離脱しています。

(重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

(未適用の会計基準等)

リースに関する会計基準等

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

(1)概要

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

(2)適用予定日

2028年3月期の期首から適用予定であります。

(3)当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

(表示方法の変更)

(損益計算書関係)

前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「受取利息」は、金額的重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、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93百万円は、「受取利息」4百万円、「その他」89百万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 (2024年3月31日) | 当事業年度 (2025年3月31日) |
|------|-----------------------|-----------------------|
| 建物 | 39百万円 | 40百万円 |
| 器具備品 | 308百万円 | 269百万円 |

※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ほか次のものがあります。

| | 前事業年度 (2024年3月31日) | 当事業年度 (2025年3月31日) |
|-----|-----------------------|-----------------------|
| 未払金 | 236百万円 | —百万円 |

3 保証債務

前事業年度(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。

当事業年度(2025年3月31日)

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

(損益計算書関係)

※1 投資有価証券売却益の項目

| | 前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日) | 当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日) |
|-----------|--|--|
| 投資有価証券売却益 | | |
| 非上場株式 | — 百万円 | 380 百万円 |

※2 固定資産売却益の項目

| | 前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日) | 当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日) |
|---------|--|--|
| 固定資産売却益 | | |
| 美術品 | — 百万円 | 83 百万円 |
| ゴルフ会員権 | — 百万円 | 26 百万円 |

※3 固定資産売却損の項目

| | 前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日) | 当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日) |
|---------|--|--|
| 固定資産売却損 | | |
| 美術品 | — 百万円 | 85 百万円 |
| ゴルフ会員権 | — 百万円 | 15 百万円 |

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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 |
| ③1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 |

当事業年度(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

| | |
|------------|------------|
| ①剰余金の配当の総額 | 16,551百万円 |
| ②配当の原資 | 利益剰余金 |
| ③1株当たり配当額 | 5,076円 |
| ④基準日 | 2025年3月31日 |
| ⑤効力発生日 | 2025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ます、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。未払費用は主
にファンド運用に関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(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 |

当事業年度(2025年3月31日)

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

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

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

(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 | 342 |
| 子会社株式 | 1,448 | 1,386 |
| 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(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。

当事業年度(2025年3月31日)

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

2. その他有価証券

前事業年度(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。

当事業年度(2025年3月31日)

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

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(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 |

当事業年度(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

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

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 2023年4月1日 至 2024年3月31日) | 当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日) |
|-------------|--|--|
| 退職給付債務の期首残高 | 2,276百万円 | 2,227百万円 |
| 勤務費用 | 138 | 149 |
| 退職給付の支払額 | △ 266 | △ 166 |
| その他 | 78 | 89 |
| 退職給付債務の期末残高 | 2,227 | 2,300 |

(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 2023年4月1日 至 2024年3月31日) | 当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日) |
|---------------------|--|--|
| 非積立型制度の退職給付債務 | 2,227百万円 | 2,300百万円 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 2,227 | 2,300 |
| 退職給付引当金 | 2,227 | 2,300 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 2,227 | 2,300 |

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

| | 前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日) | 当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日) |
|-----------------|--|--|
| 勤務費用 | 138百万円 | 149百万円 |
| その他 | 9 | 8 |
| 確定給付制度に係る退職給付費用 | 147 | 158 |

(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187百万円、当事業年度191百万円であります。

(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 (2024年3月31日) | 当事業年度 (2025年3月31日) |
|--------------|-----------------------|-----------------------|
| 繰延税金資産 | | |
| 退職給付引当金 | 681 | 724 |
| 賞与引当金 | 262 | 340 |
| 未払事業税 | 197 | 260 |
| 投資有価証券評価損 | 204 | 171 |
| 株式報酬費用 | 115 | 150 |
| 関係会社株式評価損 | 155 | 87 |
| 出資金評価損 | 94 | 14 |
| システム関連費用 | 25 | - |
| その他 | 173 | 157 |
| 繰延税金資産小計 | 1,910 | 1,907 |
| 評価性引当額 | △ 486 | △ 277 |
| 繰延税金資産合計 | 1,424 | 1,629 |
| 繰延税金負債 | | |
| その他有価証券評価差額金 | △ 740 | △ 633 |
| 連結法人間取引(譲渡益) | △ 159 | - |
| 繰延税金負債合計 | △ 899 | △ 633 |
| 繰延税金資産の純額 | 524 | 995 |

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(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。

当事業年度(2025年3月31日)

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

この税率変更により、繰延税金資産が22百万円増加、法人税等調整額が22百万円減少しております。

(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 91,634 百万円、その他 1,233 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 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア)財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

前事業年度(自 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。

当事業年度(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

| 属性 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金又は出資金(百万円) | 事業の内容 | 議決権等の所有(被所有)割合(%) | 関係内容 | | 取引の内容 | 取引金額(百万円) | 科目 | 期末残高(百万円) |
|----------|-------------|---------|---------------|---------|-------------------|--------|-----------|--------------------|--------------|----------------|-------------|
| | | | | | | 役員の兼任等 | 事業上の関係 | | | | |
| 親会社 | ㈱大和証券グループ本社 | 東京都千代田区 | 247,397 | 証券持株会社業 | 被所有 80.0 | あり | 経営管理 | 資金の貸付 利息の受取(注1) | 63,600 89 | 関係会社短期貸付金 — | 70,000 — |
| その他の関係会社 | ㈱かんぽ生命保険 | 東京都千代田区 | 500,000 | 生命保険業 | 被所有 20.0 | あり | 投資顧問契約の締結 | 投資顧問報酬(注2) | 215 | — | — |

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(イ)財務諸表提出会社の子会社

前事業年度(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(%) | 関係内容 | | 取引の内容 | 取引金額(百万円) | 科目 | 期末残高(百万円) |
|-----|---|-----------|---------------|---------|-------------------|--------|--------|---------|-----------|----|-----------|
| | | | | | | 役員の兼任等 | 事業上の関係 | | | | |
| 子会社 | Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd. | Singapore | 133 | 金融商品取引業 | 所有 直接 100.0 | なし | 経営管理 | 債務保証(注) | 2,354 | — | — |

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。

当事業年度(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

| 属性 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金又は出資金(百万円) | 事業の内容 | 議決権等の所有(被所有)割合(%) | 関係内容 | | 取引の内容 | 取引金額(百万円) | 科目 | 期末残高(百万円) |
|-----|---|-----------|---------------|---------|-------------------|--------|--------|---------|-----------|----|-----------|
| | | | | | | 役員の兼任等 | 事業上の関係 | | | | |
| 子会社 | Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd. | Singapore | 133 | 金融商品取引業 | 所有 直接 100.0 | なし | 経営管理 | 債務保証(注) | 2,341 | — | — |

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(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 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(%) | 関係内容 | | 取引の内容 | 取引金額(百万円)(注1) | 科目 | 期末残高(百万円) |
|-------------|---------|---------|---------------|---------|-------------------|--------|-----------------|------------------|---------------|---------|-----------|
| | | | | | | 役員の兼任等 | 事業上の関係 | | | | |
| 同一の親会社をもつ会社 | 大和証券㈱ | 東京都千代田区 | 100,000 | 金融商品取引業 | — | なし | 証券投資信託受益証券の募集販売 | 証券投資信託の代行手数料(注2) | 13,749 | 未払手数料 | 3,491 |
| 同一の親会社をもつ会社 | (㈱)大和総研 | 東京都江東区 | 3,898 | 情報サービス業 | — | なし | 本社ビルの管理 | 不動産の賃借料(注3) | 1,030 | 長期差入保証金 | 1,010 |

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 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

| 属性 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金又は出資金(百万円) | 事業の内容 | 議決権等の所有(被所有)割合(%) | 関係内容 | | 取引の内容 | 取引金額(百万円)(注1) | 科目 | 期末残高(百万円) |
|-------------|--------|---------|---------------|---------|-------------------|--------|----------------------------|---------------------------------|-----------------|------------------|----------------|
| | | | | | | 役員の兼任等 | 事業上の関係 | | | | |
| 同一の親会社をもつ会社 | 大和証券㈱ | 東京都千代田区 | 100,000 | 金融商品取引業 | — | なし | 証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理 | 証券投資信託の代行手数料(注2) 不動産の賃借料(注3) | 15,779 1,038 | 未払手数料 長期差入保証金 | 3,657 1,037 |
| 同一の親会社をもつ会社 | ㈱大和総研 | 東京都江東区 | 3,898 | 情報サービス業 | — | なし | ソフトウェアの開発・保守 | ソフトウェアの購入・保守(注4) | 857 | 未払費用 | 77 |

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
- (注2) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。
- (注3) 差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し交渉の上、決定しております。
- (注4) ソフトウェアの購入・保守については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

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 2023年4月1日 至 2024年3月31日) | 当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日) |
|--|--|
| 1 株当たり純資産額 15,956.63円 | 1 株当たり純資産額 30,254.44円 |
| 1 株当たり当期純利益 4,546.57円 | 1 株当たり当期純利益 5,642.31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 2023年4月1日 至 2024年3月31日) | 当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日) |
|-----------------|--|--|
| 当期純利益(百万円) | 11,859 | 16,552 |
| 普通株式の期中平均株式数(株) | 2,608,525 | 2,933,697 |

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

- ① 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。
- ② 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。
- ③ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下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的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。

2025年3月31日、株式会社大和証券グループ本社、株式会社かんぽ生命保険、三井物産株式会社、三井物産かんぽアセットマネジメント株式会社及び三井物産オルタナティブインベストメント株式会社と、オルタナティブ資産運用分野における資本業務提携を締結いたしました。

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

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、それぞれかつて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 Free 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」ということがあります。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っ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ます。受託者は、委託者の指図により、当該投資等ならびに当該取引、当該行為を行なうことができます。

④ 前3項の場合、委託者および受託者は、受益者に対して信託法第31条第3項および同法第32条第3項の通知は行ないません。

(運用の基本方針)

第18条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針に従って、その指図を行ないます。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第19条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

(外国為替予約取引の指図)

第20条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

(信用リスク集中回避のための投資制限)

第21条 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

(信託業務の委託等)

第22条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第22条第1項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務にかかる実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行なう体制が整備されていること
4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

- ② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。
- ③ 前2項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務を、受託者および委託者が適當と認める者（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できます。

- 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ものとします。
- ③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することができます。
- 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できます。

（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、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。
- ③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

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

- 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。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由等の事項を定め、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発します。

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 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 THERE 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できます。

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できます。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できます。

(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することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、第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ます。

- 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発します。
- 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

(運用状況にかかる情報の提供)

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項に定める事項にかかる情報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、受益者から前項に定める情報の提供について、書面の交付の方法による提供の請求があった場合には、当該方法により行なうものとします。

(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ます。この場合、「積立投資約款」は当該別の名称に読み替えるものとします。

第2条 第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