【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長　殿
【提出日】	2023年2月21日提出
【計算期間】	第9計算期間 （自　2021年12月1日　至　2022年11月30日）
【ファンド名】	Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　小松　幹太
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇　保宏
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【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、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）	補足分類
単位型投信	国　内	株　式	インデックス型
追加型投信	海　外	債　券	特殊型
	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	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル（除く日本）	ファミリーファンド	あり（　　）	日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性（　　）	年2回	日本			
不動産投信	年4回	北米			TOPIX
その他資産（投資信託証券（債券　公債））	年6回（隔月）	欧州			
資産複合（　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年12回（毎月）	アジア			
	日々	オセアニア	ファンド・オブ・ファンズ	なし	その他（FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））
	その他（　）	中南米			
		アフリカ			
		中近東（中東）			
		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・マネージメント・ファンド）	「ＭＭＦ等の運営に関する規則」に定めるＭＭＦ
	ＭＲＦ（マネー・リザーブ・ファンド）	「ＭＭＦ等の運営に関する規則」に定めるＭＲＦ
	ＥＴＦ	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第１号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託
補足分類	インデックス型	目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	特殊型	目論見書等において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

（注2）属性区分の定義

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

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

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

＜信託金の限度額＞

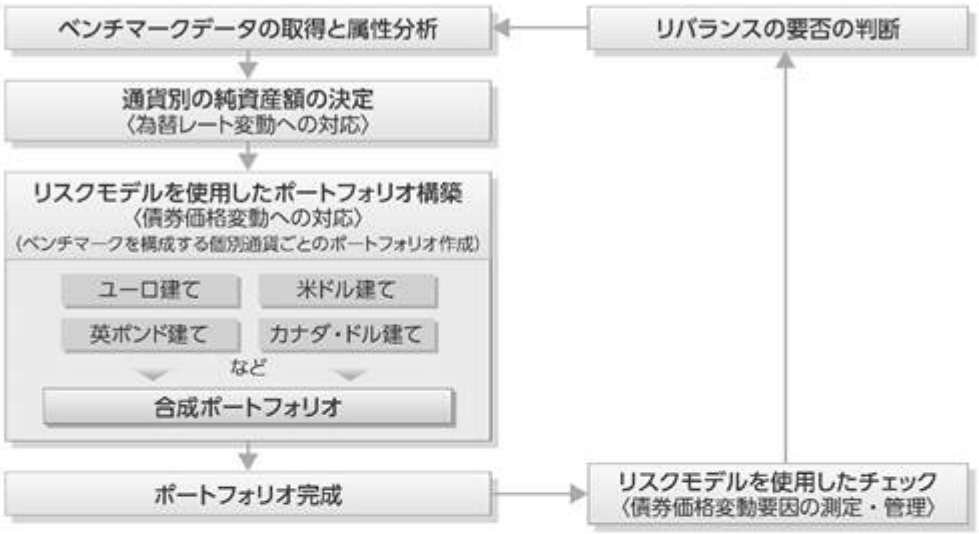
・委託会社は、受託会社と合意のうえ、1兆円を限度として信託金を追加することができます。

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

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います。

運用プロセス



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

①為替レート変動への対応
為替レート変動がベンチマークの騰落に与える影響度とファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるように、ファンドの通貨別構成比率をベンチマークの通貨別構成比率に近づけます。

②債券価格変動への対応
ベンチマークは構成する債券の銘柄数が多く、構成銘柄の比率がベンチマークと同一のポートフォリオを構築することは困難です。したがって、債券価格変動がベンチマークの騰落に与える影響度とファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるように、リスクモデル(注)を使用した効率的な複製を行なうことを基本とします。なお、リスクモデルを使用した効率的な複製はベンチマークを構成する通貨別に行ないます。

③債券価格変動要因の測定・管理
リスクモデルを使用し債券価格変動要因の測定・管理を行ない、債券価格変動がベンチマークの騰落に与える影響度とファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるようチェックを行なっています。

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

FTSE世界国債インデックスについて

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。

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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

- マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。
- 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。

- 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11月30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

●マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

●株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権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（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

●同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

●外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

●基準価額の動きに関する留意点

当ファンドは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をあげることをめざして運用を行ないます。ただし、主として次の理由から、基準価額の動きが指数と完全に一致するものではありません。

- 指数の構成銘柄のすべてを指数の算出方法どおりに組入れるわけではないこと
- 基準価額の算出に使用する為替レートと、指数の算出に使用する為替レートの評価時点が異なること
- 運用管理費用（信託報酬）等を負担することによる影響
- 追加設定および解約に対応した公社債の約定価格と指数の算出に使用する価格の差
- 債券先物取引等を利用した場合の指数との値動きの差、コストなど
- 公社債および債券先物取引等の最低取引単位の影響
- 公社債または債券先物取引等の流動性が低下した場合における売買対応の影響

(2)【ファンドの沿革】

2013年12月9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	外国の公社債　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収受します。また、販売会社には、委託会社から業務に対する代行手数料が支払われます。

＜委託会社の概況（2022年11月末日現在）＞

・資本金の額　151億7,427万2,500円

・沿革

1959年12月12日	大和証券投資信託委託株式会社として設立
1960年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1960年 4月 1日	営業開始
1985年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
1995年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。

1995年 9月14日　「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。

2007年 9月30日　「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。
（金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号）

2020年 4月 1日　大和アセットマネジメント株式会社に商号変更

・大株主の状況

名　称	住　所	所有株式数	比率
		株	%
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	100.00

2【投資方針】

(1)【投資方針】

①　主要投資対象

外国債券インデックスマザーファンド（以下「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。

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、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います。

ロ．マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。

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。

※指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、＜ファンドの特色＞をご参照下さい。

(2)【投資対象】

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

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)⑦、⑧および⑨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、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. 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. 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. 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. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）

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. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前19.の有価証券に表示されるべき権利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。

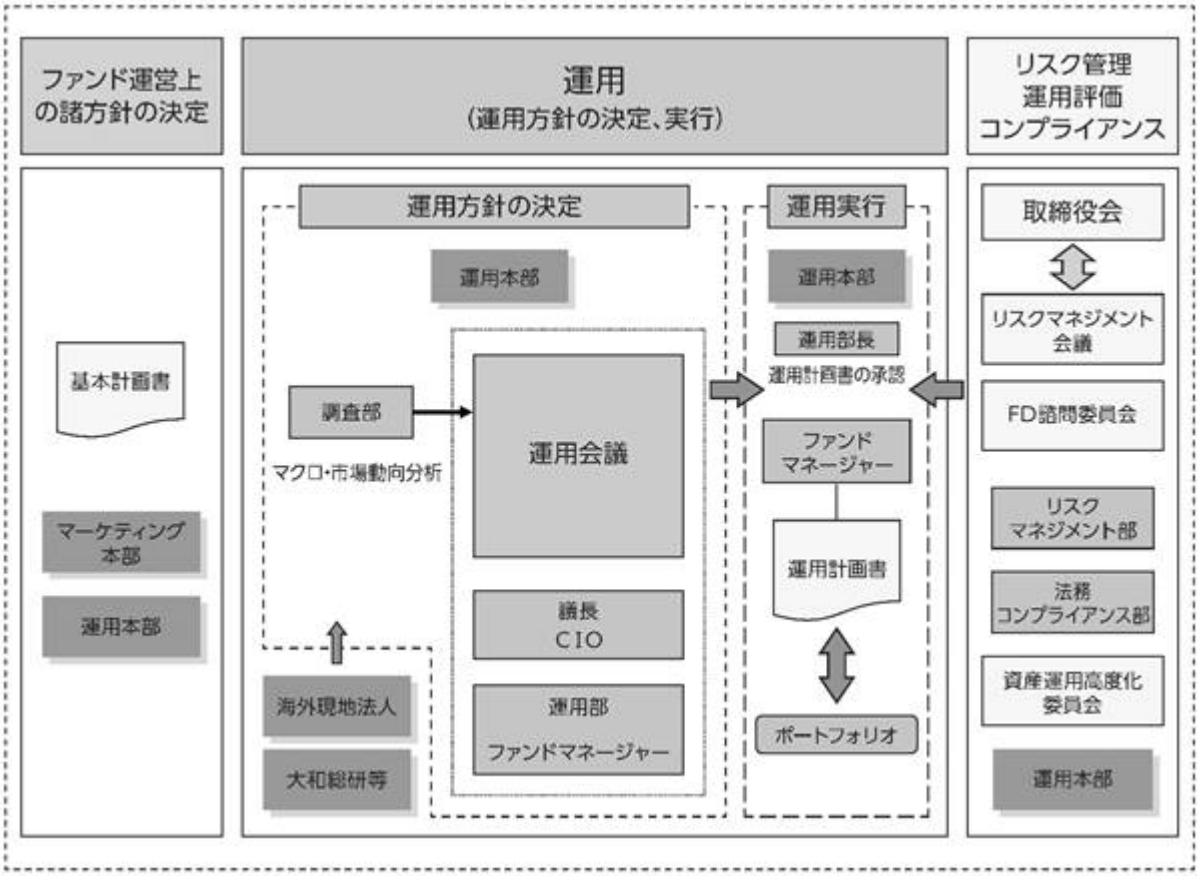
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

※指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、＜ファンドの特色＞をご参照下さい。

(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、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会

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

イ．リスクマネジメント会議

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

ロ．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。

ハ．資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

⑤　受託会社に対する管理体制

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

※　上記の運用体制は2022年11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　マザーファンドの受益証券（信託約款）

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

②　株式（信託約款）

イ．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。

ロ．委託会社は、信託財産に属する株式および株式を組入可能な投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式および株式を組入可能な投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の30を超えることとなる投資の指図をしません。

ハ．前ロ．において信託財産に属するとみなした額とは、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株式および株式を組入可能な投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

③　新株引受権証券等（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ．前イ．において信託財産に属するとみなした額とは、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新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

④　投資信託証券（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドの受益証券および金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券（以下「上場投資信託証券」といいます。）を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ．前イ．において信託財産に属するとみなした額とは、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投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑤　投資する株式等の範囲（信託約款）

イ．委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

ロ．前イ．の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

⑥　同一銘柄の株式等（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ．前イ．において信託財産に属するとみなした額とは、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当該株式の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ハ．委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

ニ．前ハ．において信託財産に属するとみなした額とは、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当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑦　先物取引等（信託約款）

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。

⑧　スワップ取引（信託約款）

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とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ．において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）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．前ハ．においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の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の割合を乗じて得た額をいいます。

ホ．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。

ヘ．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。

⑨　金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

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とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ．において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有金利商品（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.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ．において「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。）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の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が保有金利商品の時価総額の合計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．前ハ．においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の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の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有

金利商品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の割合を乗じて得た額をいいます。

ホ．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とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ホ．において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ホ．において「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）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の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計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。

ヘ．前ホ．においてマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の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の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産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の割合を乗じて得た額をいいます。

ト．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。

チ．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。

⑩　デリバティブ取引等（信託約款）

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

⑪　同一銘柄の転換社債等（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ．前イ．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド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当該転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑫　有価証券の貸付け（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および投資信託証券を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

1．株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

2．公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

3．投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。

ロ．前イ．に定める限度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契約の一部の解約を指図するものとします。

ハ．委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

⑬　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。

⑭　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。

⑮　外国為替予約取引（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、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。

ロ．前イ．の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる為替の売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

ハ．前ロ．においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の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の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の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の割合を乗じて得た額をいいます。

ニ．前ロ．の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

⑯　信用リスク集中回避（信託約款）

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

⑰　資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜参　考＞ マザーファンド（外国債券インデックスマザーファンド）の概要

(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

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。

②　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。

③　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　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

3【投資リスク】

(1)価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

① 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。

② 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。

なお、当ファンドにおいては、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。そのため基準価額は、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。

③ その他

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

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

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

① 金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、お買付け、ご換金の申込みの受付けを中止することがあります。

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。

※指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映することができないことについては、＜ファンドの特色＞の「●基準価額の動きに関する留意点」をご参照下さい。

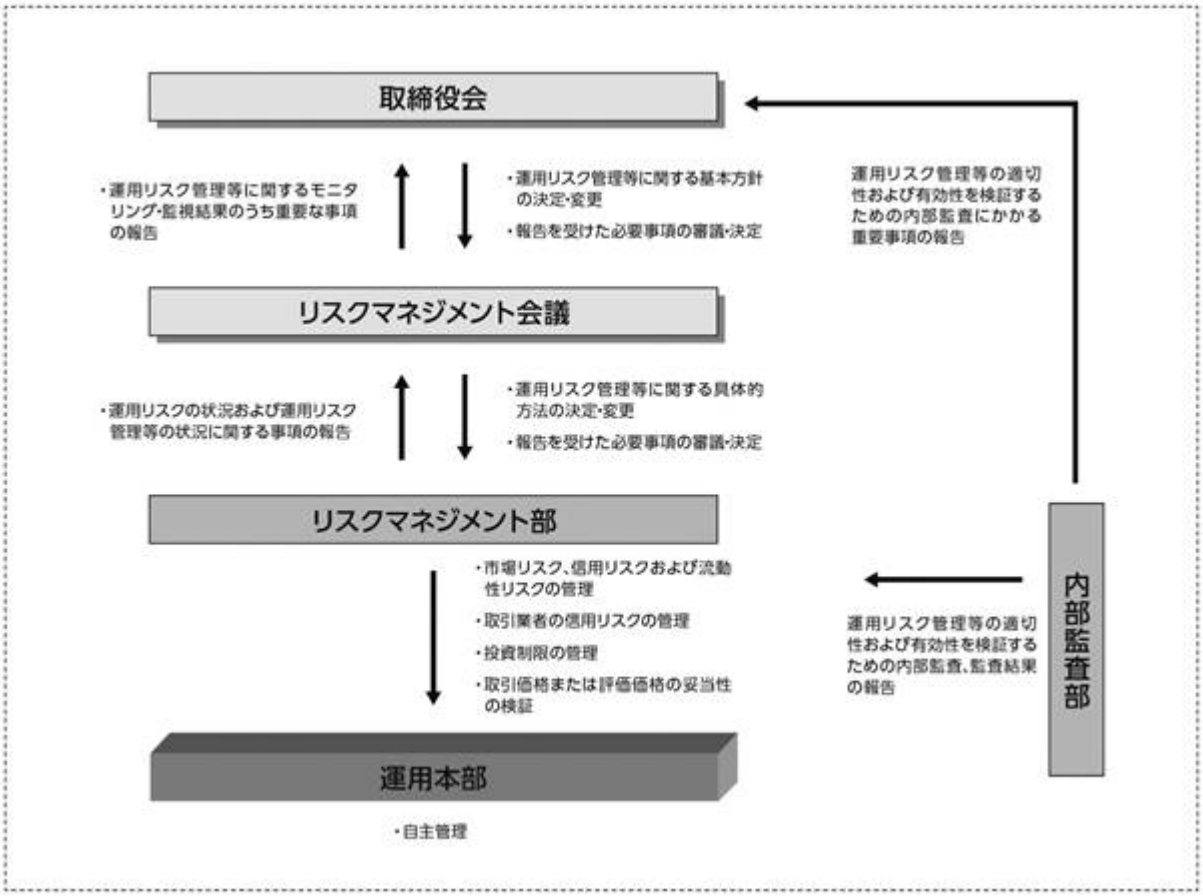
※　流動性リスクに関する事項

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

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

(4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※　流動性リスクに対する管理体制

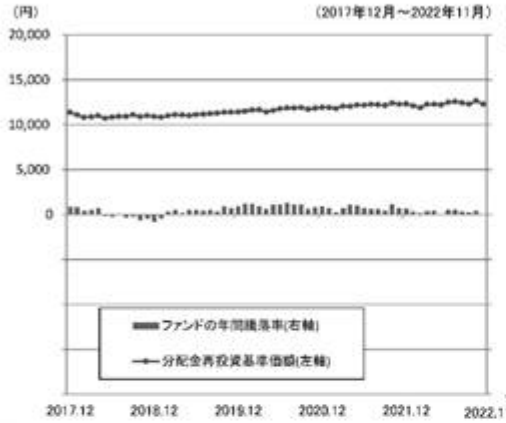
・　委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行ないます。

・　取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

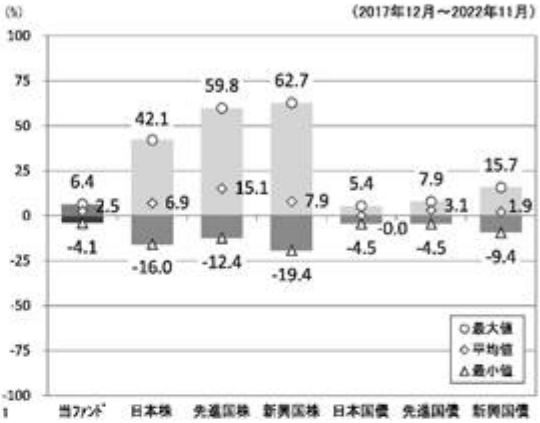
参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。
※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。
①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※資産クラスについて

日 本 株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
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・マーケッツ グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

※指数について

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、2.2%（税抜2.0%）となっています。
具体的な手数料の料率等については、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。

申込手数料は、お買付時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供、取引執行等の対価です。くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

(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0.605%（税抜0.55%）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、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.26%（税抜）	年率0.26%（税抜）	年率0.03%（税抜）

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

信託報酬を対価とする役務の内容は、配分先に応じて、それぞれ以下のとおりです。
委託会社：ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
販売会社：運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

① 信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

② 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

③ 信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。

④ 信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

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

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

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

信託財産に関する租税、有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を支弁します。

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

① 個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアＮＩＳＡ（ジュニアニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は、税法上、少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアＮＩＳＡ（ジュニアニーサ）」の適用対象です。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一定期間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方となります。当ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

②　法人の投資者に対する課税

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

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

＜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、2022年11月末日現在のものですので、税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】(2022年11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		3,136,362	99.61
	内 日本	3,136,362	99.61
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		12,288	0.39
純資産総額		3,148,650	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】(2022年11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	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	992,049	3.1358 3,110,881	3.1615 3,136,362	99.61

(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	99.61%
合計	99.61%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

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(2014年12月1日)	1,330,251	1,330,251	1.1947	1.1947
第2計算期間末(2015年11月30日)	1,308,221	1,308,221	1.1561	1.1561
第3計算期間末(2016年11月30日)	2,241,596	2,241,596	1.0574	1.0574
第4計算期間末(2017年11月30日)	2,472,906	2,472,906	1.1236	1.1236
第5計算期間末(2018年11月30日)	2,019,268	2,019,268	1.0983	1.0983
第6計算期間末(2019年12月2日)	7,069,937	7,069,937	1.1394	1.1394
第7計算期間末(2020年11月30日)	3,180,122	3,180,122	1.1835	1.1835
第8計算期間末(2021年11月30日)	2,343,055	2,343,055	1.2255	1.2255
2021年12月末日	2,435,746	－	1.2325	－
2022年1月末日	2,471,385	－	1.2107	－
2月末日	2,494,792	－	1.1884	－
3月末日	2,873,502	－	1.2270	－
4月末日	2,907,290	－	1.2290	－
5月末日	2,968,131	－	1.2212	－
6月末日	3,123,102	－	1.2496	－
7月末日	3,241,969	－	1.2575	－
8月末日	3,301,393	－	1.2419	－
9月末日	2,978,713	－	1.2306	－
10月末日	3,166,841	－	1.2662	－
第9計算期間末(2022年11月30日)	3,148,650	3,148,650	1.2275	1.2275

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
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	19.5
第2計算期間	△3.2
第3計算期間	△8.5
第4計算期間	6.3
第5計算期間	△2.3
第6計算期間	3.7
第7計算期間	3.9
第8計算期間	3.5
第9計算期間	0.2

(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	113,482	0
第2計算期間	188,712	170,624
第3計算期間	988,317	0
第4計算期間	3,167,992	3,086,917
第5計算期間	728,410	1,090,843
第6計算期間	5,053,404	687,067
第7計算期間	2,408,432	5,926,145
第8計算期間	873,373	1,648,581
第9計算期間	1,026,831	373,693

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

（参考）マザーファンド

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2022年11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		236,705,030,945	98.07
	内 ユーロ	81,126,760,924	33.61
	内 中国	7,534,316,737	3.12
	内 シンガポール	1,047,303,699	0.43
	内 マレーシア	1,197,267,343	0.50
	内 イスラエル	855,180,021	0.35
	内 ノルウェー	485,804,163	0.20
	内 スウェーデン	612,648,139	0.25
	内 デンマーク	871,107,851	0.36
	内 イギリス	11,154,519,094	4.62
	内 ポーランド	981,527,558	0.41
	内 カナダ	4,759,828,807	1.97
	内 アメリカ	120,068,309,446	49.75
	内 メキシコ	1,972,998,607	0.82
	内 オーストラリア	3,580,216,305	1.48
	内 ニュージーランド	457,242,251	0.19
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,647,287,639	1.93
純資産総額		241,352,318,584	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）		2,127,572,068	0.88
	内 日本	2,127,572,068	0.88

(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（2022年11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	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,400,000	92.58 1,337,098,117	85.43 1,233,864,393	1.875000 2032/02/15	0.51
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	96.91 1,439,994,411	82.21 1,221,625,225	1.125000 2031/02/15	0.51
3	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,300,000	100.49 1,297,918,585	92.98 1,200,879,991	2.875000 2032/05/15	0.50
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	97.64 1,396,725,436	81.65 1,167,975,578	1.250000 2031/08/15	0.48
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	94.91 1,291,750,131	80.69 1,098,253,672	0.875000 2030/11/15	0.46
6	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,000,000	98.51 1,231,228,003	82.05 1,025,535,508	1.375000 2031/11/15	0.42
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,700,000	101.16 1,222,183,760	84.81 1,024,672,292	1.625000 2031/05/15	0.42
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	102.16 1,096,553,009	91.87 986,150,673	1.625000 2026/05/15	0.41
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,500,000	98.95 1,030,661,894	92.85 967,149,699	0.375000 2024/09/15	0.40
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,500,000	92.40 962,466,886	91.84 956,567,805	2.750000 2032/08/15	0.40
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	93.01 1,033,315,005	79.30 880,991,280	0.625000 2030/08/15	0.37
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	109.49 1,018,745,320	94.46 878,883,233	2.875000 2028/08/15	0.36
13	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	6,086,000	106.76 932,980,628	100.09 874,684,231	2.250000 2024/05/25	0.36
14	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,899,000	117.32 993,694,882	102.76 870,422,782	2.750000 2027/10/25	0.36
15	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	95.26 926,098,511	89.29 868,037,486	1.125000 2026/10/31	0.36
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	109.25 986,150,587	94.65 854,381,010	2.875000 2028/05/15	0.35
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	108.20 991,725,940	92.84 850,945,089	2.625000 2029/02/15	0.35
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,350,000	108.34 955,395,118	94.24 831,049,045	2.750000 2028/02/15	0.34

19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,400,000	105.91 941,329,739	93.27 828,980,576	2.375000 2027/05/15	0.34
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	96.50 938,066,850	85.09 827,199,985	0.750000 2028/01/31	0.34
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,162,000	104.36 893,051,870	96.29 823,986,955	2.375000 2024/08/15	0.34
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	97.44 879,556,058	90.33 815,413,394	0.250000 2025/06/30	0.34
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	100.21 904,617,864	90.21 814,357,287	1.500000 2027/01/31	0.34
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,921,000	104.19 856,775,516	95.78 787,624,353	2.250000 2024/11/15	0.33
25	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	94.75 789,549,756	93.37 777,985,846	2.750000 2029/05/31	0.32
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	104.66 848,850,207	94.50 766,395,756	2.250000 2025/11/15	0.32
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	104.00 835,987,006	94.82 762,175,929	2.125000 2025/05/15	0.32
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,900,000	105.28 862,667,522	92.58 758,579,458	2.250000 2027/08/15	0.31
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	103.53 825,755,011	94.92 757,087,642	2.000000 2025/02/15	0.31
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,800,000	93.24 880,499,124	79.72 752,827,601	0.625000 2030/05/15	0.31

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.07%
合計	98.07%

(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	豪ドル買/円売 2022年12月	買建	959,000	90,011,493	88,942,453	0.04%
		英ポンド買/円売 2022年12月	買建	1,078,000	179,447,652	179,112,796	0.07%
		メキシコ・ペソ買/円売 2022年12月	買建	4,386,000	32,514,295	31,607,270	0.01%
		ユーロ買/円売 2022年12月	買建	4,108,000	592,268,599	589,735,514	0.24%
		米ドル買/円売 2022年12月	買建	6,729,000	941,267,656	934,036,875	0.39%
		カナダ・ドル買/円売 2022年12月	買建	1,656,000	176,541,309	169,074,798	0.07%
		オフショア人民元買/円売 2022年12月	買建	4,379,000	88,623,078	84,987,194	0.04%
		シンガポール・ドル買/円売 2022年12月	買建	496,000	51,909,276	50,075,168	0.02%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●D-I's 外国債券インデックス

2022年11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	12,275円
純資産総額	3百万円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-3.1%
3カ月間	-1.2%
6カ月間	0.5%
1年間	0.2%
3年間	7.9%
5年間	9.2%
設定来	22.8%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

決算期	第1期 14年12月	第2期 15年11月	第3期 16年11月	第4期 17年11月	第5期 18年11月	第6期 19年12月	第7期 20年11月	第8期 21年11月	第9期 22年11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、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国債券	920	97.7%
コール・ローン、その他		2.3%
合計	920	100.0%

債券種別構成	比率
国債	97.7%

通貨別構成	比率
米ドル	50.2%
ユーロ	34.0%
英ポンド	4.8%
オフショア人民元	3.2%
カナダ・ドル	2.1%
豪ドル	1.5%
メキシコ・ペソ	0.9%
マレーシア・リンギット	0.5%
日本円	0.5%
その他	2.3%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	2.3
最終利回り(%)	3.5
修正デュレーション	6.8
残存年数	8.6

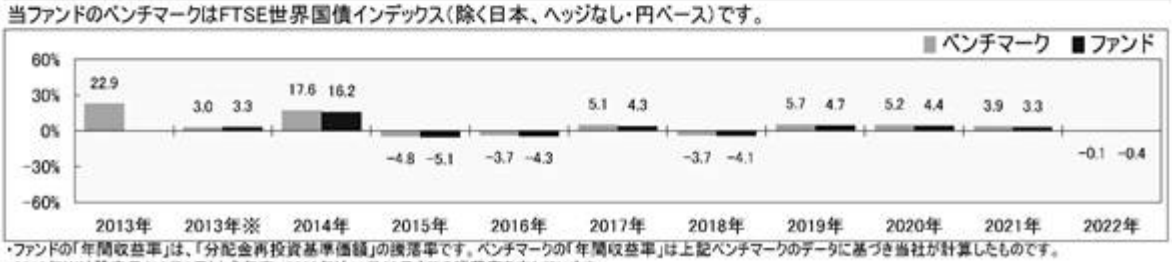
格付別構成	比率
AAA	79.9%
AA	11.0%
A	9.0%
BBB	-
BB	-
合計	100.0%

組入上位10銘柄	償還日	比率
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2032/02/15	0.5%
United States Treasury Note/Bond	2031/02/15	0.5%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2032/05/15	0.5%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2031/08/15	0.5%
United States Treasury Note/Bond	2030/11/15	0.5%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2031/11/15	0.4%
United States Treasury Note/Bond	2031/05/15	0.4%
United States Treasury Note/Bond	2026/05/15	0.4%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2024/09/15	0.4%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2032/08/15	0.4%
合計		4.5%

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）です。



・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。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2013年※は設定日（12月9日）から年末、2022年は1月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

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。

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。

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

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

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

２【換金（解約）手続等】

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

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

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

純資産総額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）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

・外国の公社債：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。

1. 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。）
2. 価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター）	0120-106212（営業日の9:00～17:00）
ホームページ	https://www.daiwa-am.co.jp/

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

2013年12月9日から2028年11月30日までとします。ただし、(5)①により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

(4)【計算期間】

毎年12月1日から翌年11月30日までとします。ただし、第1計算期間は、2013年12月9日から2014年11月30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。ただし、最終計算期間の終了日には適用しません。

(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、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）が改廃された場合、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、これを行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

4．前2．の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。

5．書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

6. 前2. から前5. までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

7. 前1. から前6. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。

8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前7. までの規定にしたがいます。

③ 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

④ 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を計算期間の末日および償還時に作成し、信託財産にかかる知れている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。

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

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

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

⑤ 公告

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

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

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

⑥ 関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

＜収益分配金および償還金にかかる請求権＞

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

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

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

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

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

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

＜換金請求権＞

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

第３　【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間（2021年12月1日から2022年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

D－I's 外国債券インデックス

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 2021年11月30日現在	第9期 2022年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	17,795	22,002
親投資信託受益証券	2,333,937	3,136,362
流動資産合計	2,351,732	3,158,364
資産合計	2,351,732	3,158,364
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	435	497
未払委託者報酬	8,059	9,034
その他未払費用	183	183
流動負債合計	8,677	9,714
負債合計	8,677	9,714
純資産の部		
元本等		
元本	※1 1,911,945	※1 2,565,083
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	431,110	583,567
（分配準備積立金）	112,230	106,262
元本等合計	2,343,055	3,148,650
純資産合計	2,343,055	3,148,650
負債純資産合計	2,351,732	3,158,364

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期 自　2020年12月1日 至　2021年11月30日	第9期 自　2021年12月1日 至　2022年11月30日
営業収益		
有価証券売買等損益	109,080	27,966
営業収益合計	109,080	27,966
営業費用		
受託者報酬	813	873
委託者報酬	16,017	16,516
その他費用	365	365
営業費用合計	17,195	17,754
営業利益	91,885	10,212
経常利益	91,885	10,212
当期純利益	91,885	10,212
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	28,450	837
期首剰余金又は期首欠損金（△）	492,969	431,110
剰余金増加額又は欠損金減少額	182,824	226,365
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	182,824	226,365
剰余金減少額又は欠損金増加額	308,118	83,283
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	308,118	83,283
分配金	※1 ―	※1 ―
期末剰余金又は期末欠損金（△）	431,110	583,567

(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　2021年12月1日 至　2022年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	第8期 2021年11月30日現在	第9期 2022年11月30日現在
1.　※1　期首元本額	2,687,153円	1,911,945円
期中追加設定元本額	873,373円	1,026,831円
期中一部解約元本額	1,648,581円	373,693円
2.　計算期間末日における受益権の総数	1,911,945口	2,565,083口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第8期 自　2020年12月1日 至　2021年11月30日	第9期 自　2021年12月1日 至　2022年11月30日

※1　分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（63,435円）、投資信託約款に規定される収益調整金（387,039円）及び分配準備積立金（48,795円）より分配対象額は499,269円（1万口当たり2,611.31円）であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（9,375円）、投資信託約款に規定される収益調整金（572,929円）及び分配準備積立金（96,887円）より分配対象額は679,191円（1万口当たり2,647.83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　2021年12月1日 至　2022年11月30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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
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 2022年11月30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 2021年11月30日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	第9期 2022年11月30日現在 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	75,330	25,481
合計	75,330	25,481

（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 2021年11月30日現在	第9期 2022年11月30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　2021年12月1日 至　2022年11月30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 2021年11月30日現在	第9期 2022年11月30日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2255円 (12,255円)	1.2275円 (12,275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	外国債券インデックスマザーファンド	992,049	3,136,362	
親投資信託受益証券　合計			3,136,362	
合計			3,136,362	

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、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	700,635,449	744,126,868
コール・ローン	1,607,697,128	2,484,935,442

国債証券	230,341,773,353	236,705,030,930
派生商品評価勘定	431,286	191,337
未収入金	2,787,836	30,062
未収利息	1,240,818,660	1,496,086,797
前払費用	21,860,457	72,896,925
流動資産合計	233,916,004,169	241,503,298,361
資産合計	233,916,004,169	241,503,298,361
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,725,909	25,202,627
未払金	252,029,658	3,816,639
未払解約金	25,134,000	121,960,511
流動負債合計	283,889,567	150,979,777
負債合計	283,889,567	150,979,777
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	74,475,307,643	76,340,507,617
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	159,156,806,959	165,011,810,967
元本等合計	233,632,114,602	241,352,318,584
純資産合計	233,632,114,602	241,352,318,584
負債純資産合計	233,916,004,169	241,503,298,361

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2021年12月1日 至　2022年11月30日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

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

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1．※1　期首	2020年12月1日	2021年12月1日
期首元本額	72,688,498,430円	74,475,307,643円
期中追加設定元本額	10,294,827,028円	9,175,662,845円
期中一部解約元本額	8,508,017,815円	7,310,462,871円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックスＶＡ	498,388,691円	447,343,827円

ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	10,756,510円	9,071,985円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	79,498,163円	51,739,813円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	22,023,940円	19,793,735円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	312,397,465円	243,846,488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）	211,430,078円	347,889,324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）	505,972,682円	589,471,225円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	2,311,980,333円	2,679,395,542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）	842,742,592円	612,758,959円
Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス	744,003円	992,049円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	7,190,607円	12,619,026円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	1,686,822,876円	2,022,055,185円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,443,360,479円	1,843,024,587円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	229,923,693円	342,801,665円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	49,590,694,433円	50,603,926,450円
ダイワ・ライフ・バランス３０	964,870,268円	1,059,415,494円
ダイワ・ライフ・バランス５０	601,682,079円	676,505,626円
ダイワ・ライフ・バランス７０	393,993,399円	451,133,774円

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	578,219,728円	638,338,066円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	439,097,748円	501,969,526円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	160,496,213円	192,677,874円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	28,543,954円	31,943,484円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	10,558,255円	13,831,284円
ダイワつみたてインデックス外国債券	599,439,774円	1,384,617,622円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	3,367,466円	3,873,500円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	1,453,811円	1,528,422円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	1,909,053円	2,590,775円
ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ラップ専用）	317,987円	159,668,286円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	163,610,849円	115,798,326円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	135,308,646円	36,264,152円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	3,912,241,392円	3,287,759,159円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	231,133,046円	199,611,808円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	143,219,876円	150,551,922円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	43,309,779円	49,437,293円
ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	2,367,106,464円	1,733,569,277円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,825,688,039円	5,720,730,269円
ダイワライフスタイル２５	33,014,942円	28,448,488円
ダイワライフスタイル５０	65,372,616円	58,536,147円

ダイワライフスタイル７５	17,425,714円	14,977,183円
計	74,475,307,643円	76,340,507,617円
2. 期末日における受益権の総数	74,475,307,643口	76,340,507,617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 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△9,023,697,557	△40,716,680,142
合計	△9,023,697,557	△40,716,680,142

（注）　「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2020年12月1日から2021年11月30日まで、及び2021年12月1日から2022年11月30日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種　類	2021年11月30日 現在				2022年11月30日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買　建	1,712,299,150	－	1,706,004,527	△6,294,623	2,152,583,358	－	2,127,572,068	△25,011,290
アメリカ・ドル	755,807,619	－	756,096,737	289,118	941,267,656	－	934,036,875	△7,230,781
イギリス・ポンド	66,758,721	－	66,834,123	75,402	179,447,652	－	179,112,796	△334,856
オーストラリア・ドル	－	－	－	－	90,011,493	－	88,942,453	△1,069,040
オフショア・人民元	－	－	－	－	88,623,078	－	84,987,194	△3,635,884
カナダ・ドル	61,806,931	－	59,980,905	△1,826,026	176,541,309	－	169,074,798	△7,466,511
シンガポール・ドル	31,361,148	－	31,422,799	61,651	51,909,276	－	50,075,168	△1,834,108

デンマーク・クローネ	53,986,987	－	52,312,950	△1,674,037	－	－	－	－
メキシコ・ペソ	－	－	－	－	32,514,295	－	31,607,270	△907,025
ユーロ	742,577,744	－	739,357,013	△3,220,731	592,268,599	－	589,735,514	△2,533,085
合計	1,712,299,150	－	1,706,004,527	△6,294,623	2,152,583,358	－	2,127,572,068	△25,011,290

（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）

	2021年11月30日現在	2022年11月30日現在
1口当たり純資産額	3.1370円	3.1615円
（1万口当たり純資産額）	(31,370円)	(31,615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		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	

		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	4,926,655.410	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,106,013.920	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	4,758,843.840	
		6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	900,246.600	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	775,107.160	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	786,051.180	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	822,435.180	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,650,208.310	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,274,090.160	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	960,777.510	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	583,811.800	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	560,436.960	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	1,002,550.280	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,173,014.400	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,142,499.800	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,282,382.200	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,103,364.400	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	1,775,105.860	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,080,471.850	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,526,232.240	

		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,386,986.700	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,439,501.700	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,466,028.800	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,273,839.500	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,424,864.160	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,159,656.300	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	4,281,416.570	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,330,422.300	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,278,448.900	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,909,660.980	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	3,012,353.640	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	1,984,941.040	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	3,090,722.200	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	2,981,424.510	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	5,933,513.040	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,656,297.270	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	5,671,666.690	
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,304,910.020	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,451,772.470	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	1,963,898.750	

		2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,488,413.120	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	1,835,000.000	1,536,739.100	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,408,470.250	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,532,844.470	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,518,800.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	551,418.250	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,490,004.180	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	2,396,887.200	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,101,250.620	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	2,146,891.500	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	4,914,810.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	2,007,438.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	4,894,391.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,430,950.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	817,960.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,427,276.900	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,434,075.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,385,891.600	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,409,940.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	1,960,443.450	

		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,226,860.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	4,550,000.000	4,396,255.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	5,969,472.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,672,960.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	2,887,590.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240531	5,300,000.000	5,093,671.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,303,472.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,462,515.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	2,878,800.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	1,450,000.000	1,157,665.500	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	1,907,640.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,394,375.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,072,870.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	1,995,975.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,355,345.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,056,096.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,677,276.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	5,984,367.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,495,688.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,605,068.000	

		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,513,760.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	2,791,569.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	3,266,062.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,152,380.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	1,834,754.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,426,566.500	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	2,888,430.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,328,820.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,707,923.400	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,411,900.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,457,800.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,417,075.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,415,325.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	3,934,840.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,537,977.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,727,422.400	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	2,887,020.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,000,000.000	1,964,060.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,500,000.000	1,432,020.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,444,025.000	

		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,127,638.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	3,898,280.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,383,300.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	3,969,103.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,371,275.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,205,884.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,352,825.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	3,836,250.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,560,856.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,381,035.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,641,184.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,802,060.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,346,035.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,591,848.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	5,500,000.000	5,245,185.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,309,550.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,092,102.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	3,326,536.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,534,308.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	3,775,120.000	

		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,283,200.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	2,839,680.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	945,000.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,733,150.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	2,850,000.000	2,504,437.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	3,347,730.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,819,800.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	2,829,480.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,284,700.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,367,275.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,700,000.000	1,593,750.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,285,500.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	5,864,170.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	3,668,814.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	266,226.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	4,837,820.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	1,500,000.000	1,373,700.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,384,624.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,421,096.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,457,081.000	

		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,061,648.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	3,104,696.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	3,176,650.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	2,997,190.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,711,580.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	6,500,000.000	5,871,775.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	2,990,295.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,059,048.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,344,000.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,238,750.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,700,000.000	3,838,363.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	5,000,000.000	3,151,250.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	2,975,385.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	4,000,000.000	3,583,200.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,371,840.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,136,980.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20231115	2,000,000.000	1,915,780.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	7,908,502.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,568,800.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,383,960.000	

		1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	4,172,140.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,358,095.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,551,036.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,247,250.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20231215	3,000,000.000	2,859,630.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,237,200.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,000,000.000	890,950.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20240115	4,000,000.000	3,797,960.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	5,956,650.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	3,865,149.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	8,796,898.000	
		0.125% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,000,000.000	4,729,650.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,436,600.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,334,250.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,370,652.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,665,230.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20240315	2,000,000.000	1,888,420.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,483,800.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,577,720.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20240415	3,000,000.000	2,827,260.000	

		1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	7,378,644.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20240515	5,100,000.000	4,781,403.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,013,235.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,215,380.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	4,730,496.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	2,899,476.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	4,000,000.000	3,470,520.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	3,913,580.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20240615	2,000,000.000	1,868,820.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,328,700.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,458,200.000	
		0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240715	5,500,000.000	5,136,560.000	
		0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240815	3,000,000.000	2,792,730.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,410,568.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	6,900,000.000	4,659,639.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	3,700,000.000	2,562,176.000	
		0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,287,680.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,257,800.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,281,600.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,417,350.000	

		0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240915	7,500,000.000	6,964,425.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,305,050.000	
		0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,100,615.000	
		0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241015	2,000,000.000	1,861,160.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241115	4,500,000.000	4,184,820.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	9,000,000.000	7,384,860.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,600,000.000	4,312,638.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	2,892,320.000	
		0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20231031	4,000,000.000	3,843,920.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,193,960.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	7,000,000.000	6,250,720.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,583,560.000	
		0.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20231130	5,000,000.000	4,793,200.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	4,877,208.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241215	2,200,000.000	2,052,094.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20231231	2,500,000.000	2,394,800.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	4,000,000.000	3,458,880.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,577,320.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250115	1,000,000.000	932,810.000	
		0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240131	3,000,000.000	2,868,270.000	

		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	10,400,000.000	8,885,032.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250215	3,700,000.000	3,471,784.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,791,052.000	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	3,900,000.000	2,799,459.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	1,931,250.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,441,950.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240229	4,000,000.000	3,843,720.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	1,000,000.000	915,580.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250315	5,000,000.000	4,714,450.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,741,130.000	
		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,695,100.000	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240331	2,000,000.000	1,935,920.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250415	2,000,000.000	1,920,620.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	9,300,000.000	8,647,512.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250515	3,000,000.000	2,888,190.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	4,133,550.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,337,340.000	
		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240430	4,500,000.000	4,362,345.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,823,030.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,845,650.000	

		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240531	4,500,000.000	4,356,720.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	6,000,000.000	5,602,260.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,887,140.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250615	2,000,000.000	1,931,320.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,847,880.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,905,470.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250715	3,000,000.000	2,902,830.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	3,855,429.600	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240630	1,000,000.000	974,450.000	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250815	2,500,000.000	2,426,050.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	7,500,000.000	6,888,225.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	3,700,000.000	3,150,772.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	1,000,000.000	908,590.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240731	3,970,000.000	3,867,931.300	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,111,796.800	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240831	3,890,000.000	3,802,825.100	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,409,500.000	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,342,605.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250915	2,300,000.000	2,254,000.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240930	3,500,000.000	3,481,800.000	

	3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,499,200.000	
	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	1,500,000.000	1,509,660.000	
	4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251015	3,400,000.000	3,398,640.000	
	4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241031	1,000,000.000	997,420.000	
アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 864,609,414.840 (120,068,309,439)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	2% United Kingdom Gilt 20250907	921,000.000	893,416.050	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,282,000.000	1,116,122.020	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,382,388.650	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	1,200,267.200	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,170,367.500	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	1,272,882.500	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,410,000.000	1,292,081.700	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,378,710.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,040,000.000	694,865.600	
	1% United Kingdom Gilt 20240422	1,800,000.000	1,745,820.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	869,808.500	
	1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	574,991.000	
	0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,500,000.000	1,291,995.000	
	0.625% United Kingdom Gilt 20250607	1,900,000.000	1,785,183.000	

		1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	835,106.300	
		0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,300,000.000	1,051,661.000	
		0.5% United Kingdom Gilt 20611022	1,700,000.000	737,970.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,367,745.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,368,000.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	564,454.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,700,000.000	1,226,482.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20240131	1,300,000.000	1,253,408.000	
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	1,955,900.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20460131	500,000.000	297,105.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20261022	500,000.000	448,745.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20510731	800,000.000	492,728.000	
		0.25% UNITED KINGDOM GILT 20250131	100,000.000	93,460.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	900,000.000	643,077.000	
		0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	700,000.000	594,146.000	
		0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	300,000.000	236,241.000	
		1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	300,000.000	195,687.000	
		1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	2,100,000.000	1,738,002.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	820,000.000	441,676.600	
		4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	2,000,000.000	2,052,200.000	

		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,088,512.490	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	2,240,000.000	2,454,345.600	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,528,436.480	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,362,000.000	1,491,621.540	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	1,574,567.810	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	2,035,423.600	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,541,954.460	
		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,287,132.000	
		4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	2,437,103.000	
		4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,600,000.000	1,789,888.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,536,499.440	
		4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	1,586,999.460	
		4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,751,037.600	
		4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	1,384,568.640	
		4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,740,266.810	
		3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,666,289.280	
		3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,866,000.000	1,799,402.460	
		3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	1,534,509.900	
		2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,081,287.480	
		3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,524,000.000	1,530,385.560	
	イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド	

			67,102,924.230 (11,154,519,095)	
イスラエル・シュケル		イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	1,989,162.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,600,000.000	2,051,456.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20240331	2,000,000.000	2,009,520.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,204,182.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,704,636.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,479,608.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,132,044.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20231130	1,500,000.000	1,475,895.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,045,232.000	
	0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	1,600,000.000	1,494,176.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,330,913.000	
	0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	182,434.000	
	0.4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20241031	900,000.000	850,743.000	
	1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	300,000.000	252,459.000	
イスラエル・シュケル　小計			イスラエル・シュケル 21,202,460.000 (855,180,022)	
オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,104,660.350	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	573,000.000	569,837.040	

		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,339,119.540	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,798,000.000	1,801,056.600	
		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,354,815.680	
		4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,748,000.000	1,803,096.960	
		3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,099,810.950	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,176,300.000	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	725,590.800	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,626,772.400	
		2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,111,643.260	
		3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,054,409.360	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,446,240.000	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,814,614.000	
		2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,680,924.400	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,163,721.900	
		1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,410,421.600	
		1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	1,700,000.000	1,383,511.000	
		0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,266,632.000	
		1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,645,320.000	
		1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	870,996.000	
		0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,600,000.000	1,465,584.000	

	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,008,925.000	
	0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,081,200.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,600,000.000	1,353,440.000	
	3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,300,000.000	1,225,432.000	
オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 38,584,074.840 (3,580,216,304)	
オフショア・人民元		オフショア・人民元	オフショア・人民元	
	3.22% China Government Bond 20251206	5,200,000.000	5,313,516.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,155,800.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,171,650.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,132,900.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,285,840.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	8,000,000.000	8,191,920.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,116,610.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	6,500,000.000	6,405,230.000	
	2.88% China Government Bond 20231105	37,000,000.000	37,276,760.000	
	3.02% China Government Bond 20251022	18,000,000.000	18,336,240.000	
	3.28% China Government Bond 20271203	9,000,000.000	9,257,760.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	12,986,250.000	
	3.03% China Government Bond 20260311	7,000,000.000	7,125,090.000	
	3.81% China Government Bond 20500914	7,300,000.000	7,983,426.000	

		3.01% China Government Bond 20280513	7,000,000.000	7,089,530.000	
		3.72% China Government Bond 20510412	8,000,000.000	8,618,000.000	
		3.02% China Government Bond 20310527	5,800,000.000	5,868,440.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,513,005.000	
		2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,037,450.000	
		3.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20240622	11,000,000.000	11,249,040.000	
		3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,751,240.000	
		3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20240921	15,000,000.000	15,413,100.000	
		3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,297,450.000	
		3.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20250607	17,000,000.000	17,537,200.000	
		3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,722,615.000	
		4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	4,500,000.000	5,070,510.000	
		3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	6,300,000.000	6,931,449.000	
		3.77% CHINA GOVERNMENT BOND 20250308	11,000,000.000	11,372,790.000	
		3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	12,000,000.000	12,187,320.000	
		2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,543,890.000	
		3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	3,500,000.000	3,632,440.000	
		2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	6,000,000.000	6,011,220.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	17,000,000.000	16,825,070.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	7,200,000.000	7,116,336.000	

	2.26% CHINA GOVERNMENT BOND 20250224	10,000,000.000	9,963,900.000	
	2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	14,962,950.000	
	3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	5,547,355.000	
	2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	4,931,200.000	
	2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	4,000,000.000	3,977,840.000	
	2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	4,000,000.000	3,924,600.000	
	2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	12,000,000.000	11,715,360.000	
	1.99% CHINA GOVERNMENT BOND 20240915	2,000,000.000	1,988,260.000	
	2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	9,349,805.000	
	2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	2,200,000.000	2,174,436.000	
オフショア・人民元　小計			オフショア・人民元 388,062,793.000 (7,534,316,739)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	2.75% Canada Government International Bond 20641201	605,000.000	563,787.400	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,140,555.240	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,386,465.080	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,235,014.440	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	1,026,166.350	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	1,026,165.410	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,374,371.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,265,523.980	

		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,116,002.400	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	907,904.550	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,128,015.600	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	616,167.500	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,968,037.100	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,167,613.200	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,173,072.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,342,768.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,050,386.500	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	700,000.000	661,199.000	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,649,031.800	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,648,660.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	1,887,816.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240401	1,200,000.000	1,141,404.000	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	274,407.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	3,020,866.000	
		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241001	1,000,000.000	944,230.000	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	1,450,000.000	1,079,423.500	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,000,000.000	966,220.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	200,000.000	183,678.000	

		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240201	3,000,000.000	2,884,650.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,100,000.000	1,852,914.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250401	200,000.000	189,636.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240501	400,000.000	385,896.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,376,610.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	95,513.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	400,000.000	391,596.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240801	200,000.000	195,934.000	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20251001	1,000,000.000	980,930.000	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	770,000.000	736,558.900	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241101	360,000.000	353,718.000	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	200,000.000	202,996.000	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 46,591,902.950 (4,759,828,805)	
	シンガポール・ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
		3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	788,212.000	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	923,000.000	921,837.020	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	797,269.500	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	393,056.000	
		3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	585,892.000	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	617,937.500	

		2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	516,873.600	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	679,056.000	
		2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	437,760.000	
		2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	687,082.500	
		2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	540,705.000	
		2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	490,000.000	482,650.000	
		2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	320,600.000	
		1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	443,070.000	
		0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	750,000.000	699,225.000	
		1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	535,650.000	
		1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	200,000.000	165,454.000	
		1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	187,460.000	
		2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	231,993.600	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	220,000.000	233,637.800	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	100,000.000	99,817.000	
	シンガポール・ドル　小計			シンガポール・ドル 10,365,238.520 (1,047,303,700)	
	スウェーデン・クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
		3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,655,000.000	5,812,000.250	
		1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	8,025,000.000	7,951,170.000	
		2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	7,612,316.600	

	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	6,867,741.800	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,728,365.500	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,421,044.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	5,906,880.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,325,150.000	
スウェーデン・クローナ　小計			スウェーデン・クローナ 46,624,668.150 (612,648,139)	
デンマーク・クローネ		デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	18,287,679.960	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	4,821,236.940	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	5,954,673.900	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,729,944.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	8,590,000.000	7,706,948.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	2,239,580.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	414,205.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20241115	1,000,000.000	957,480.000	
デンマーク・クローネ　小計			デンマーク・クローネ 45,111,747.800 (871,107,850)	
ニュージーランド・ドル		ニュージーランド・ドル	ニュージーランド・ドル	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	600,000.000	603,438.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	400,000.000	380,456.000	

	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	412,756.400	
	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	600,000.000	560,268.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	530,000.000	430,943.000	
	1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	235,994.500	
	0.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20240515	700,000.000	658,973.000	
	0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	400,000.000	322,600.000	
	0.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20260515	500,000.000	436,920.000	
	2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	440,000.000	368,222.800	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	284,996.200	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20250415	640,000.000	613,177.600	
ニュージーランド・ドル　小計			ニュージーランド・ドル 5,308,745.500 (457,242,250)	
ノルウェー・クローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,072,559.400	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,200,294.450	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,099,824.400	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,188,384.500	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,299,030.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,530,142.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	6,800,000.000	5,992,908.000	

	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	3,003,630.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	1,700,000.000	1,563,167.000	
ノルウェー・クローネ　小計			ノルウェー・クローネ 34,949,939.750 (485,804,163)	
ポーランド・ズロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	3,742,991.550	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	2,624,443.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,870,000.000	2,712,063.900	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	3,811,500.000	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	3,400,000.000	3,122,866.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	2,000,000.000	1,742,300.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,019,480.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	1,703,988.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20240725	1,000,000.000	891,930.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,800,000.000	1,192,140.000	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	500,000.000	436,860.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	785,939.450	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	2,996,029.500	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	4,176,662.250	
ポーランド・ズロチ　小計			ポーランド・ズロチ 31,959,193.650 (981,527,559)	

	マレーシア・リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
		3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,325,397.620	
		4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,197,083.600	
		4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,535,862.160	
		4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,298,154.000	
		3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	728,404.950	
		3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,371,261.380	
		3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,853,259.040	
		4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,368,237.000	
		4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,067,379.740	
		3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,740,317.670	
		4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,206,043.200	
		4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	949,464.900	
		3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,546,016.500	
		4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	1,550,000.000	1,563,516.000	
		3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,184,621.200	
		4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,036,034.000	
		3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,201,416.000	
		4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,231,488.000	
		4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	632,100.000	

	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	649,161.500	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,266,410.300	
	4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,254,516.000	
	3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	400,008.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,237,002.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,604,330.000	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,439,510.500	
	2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,596,672.000	
	3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	500,000.000	478,590.000	
	4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	400,000.000	412,068.000	
	4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	510,995.000	
マレーシア・リンギット　小計			マレーシア・リンギット 38,885,320.260 (1,197,267,345)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	37,290,000.000	33,350,684.400	
	8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	18,817,911.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	23,800,000.000	22,992,704.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	6,065,780.000	
	5% MEXICAN BONOS 20250306	1,000,000.000	898,140.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	3,000,000.000	2,636,250.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	28,033,000.000	27,286,481.210	
	10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	23,833,609.170	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	26,130,502.400	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,413,184.240	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	28,513,209.840	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	17,700,088.140	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	32,515,000.000	29,769,108.250	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	21,654,000.000	18,672,893.820	

	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	7,104,716.400	
メキシコ・ペソ　小計			メキシコ・ペソ 273,185,262.870 (1,972,998,605)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	318,267.040	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	269,991.090	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	768,308.960	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	297,205.200	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	736,328.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	405,365.600	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	451,545.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	442,510.000	
	Finland Government Bond 20240915	200,000.000	192,866.000	
	0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	225,686.200	
	0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	269,988.000	
	Finland Government Bond 20300915	500,000.000	416,505.000	
	0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	219,864.000	
	0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	493,314.000	
	FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	183,922.000	
	0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	308,920.500	
	1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	300,000.000	275,046.000	
	1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	259,831.800	

		1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,340,061.730	
		0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,070,837.260	
		1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	645,083.040	
		1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	170,752.800	
		0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,191,808.000	
		2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	465,334.200	
		0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,115,676.000	
		0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,148,659.200	
		Austria Government Bond 20240715	800,000.000	773,232.000	
		Austria Government Bond 20300220	980,000.000	826,649.600	
		0.75% Austria Government Bond 20510320	700,000.000	464,009.000	
		Austria Government Bond 20401020	400,000.000	255,452.000	
		0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	177,863.000	
		Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	984,372.000	
		Austria Government Bond 20250420	480,000.000	456,144.000	
		0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	438,690.000	
		0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	157,134.000	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	300,000.000	262,503.000	
		0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	500,000.000	434,875.000	
		1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	300,000.000	264,345.000	

		2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	300,000.000	298,617.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,646,891.670	
		1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,594,116.400	
		1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	950,750.540	
		1% Belgium Government Bond 20260622	1,463,000.000	1,408,078.980	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	999,019.080	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	665,001.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,035,078.000	
		0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,019,445.000	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	533,281.000	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	510,720.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,384,686.800	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	580,008.000	
		0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,377,300.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	565,579.000	
		0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,037,866.200	
		0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	583,931.400	
		Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,079,076.000	
		Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,298,624.000	
		0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	265,196.100	

		0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	400,000.000	328,128.000	
		1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	588,888.000	
		2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	400,000.000	400,868.000	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,020,089.680	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,397,109.060	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,544,674.000	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,090,201.000	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,512,497.800	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,856,177.200	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	2,978,244.400	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,271,000.000	4,089,600.460	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	1,744,137.250	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,448,477.220	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,974,000.000	2,395,449.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	3,123,843.840	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,556,785.300	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	3,024,483.840	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,582,395.680	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	4,042,000.000	3,977,085.480	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,125,349.740	

		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,080,884.740	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,368,000.000	2,264,186.880	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,257,569.600	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	4,200,000.000	3,926,328.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,099,987.000	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	2,770,000.000	2,474,468.700	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,772,206.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,744,325.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,200,000.000	1,994,608.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,651,640.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,850,000.000	1,770,876.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,531,792.500	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,100,000.000	1,646,484.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,825,080.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,562,634.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,041,732.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	900,000.000	773,271.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	1,400,000.000	1,077,216.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,791,900.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	684,871.000	

		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	3,600,000.000	3,065,904.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	596,309.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	1,800,000.000	1,515,600.000	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	400,000.000	348,012.000	
		1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,650,212.000	
		1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,200,000.000	1,197,684.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	200,000.000	202,778.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	1,200,000.000	721,620.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20231215	4,200,000.000	4,116,504.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20240315	100,000.000	97,489.000	
		0.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240614	100,000.000	97,266.000	
		0.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240913	530,000.000	515,027.500	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	1,920,000.000	1,869,638.400	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,637,321.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,291,472.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,177,433.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	94,965.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,065,096.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	1,300,000.000	1,207,050.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	100,000.000	92,064.000	

		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,915,670.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	418,291.100	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,350,248.000	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,967,927.840	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	3,227,000.000	4,190,001.340	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,264,028.860	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	2,273,249.160	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,785,627.860	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,996,100.360	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,217,000.000	1,599,186.680	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	3,803,725.960	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,899,000.000	6,062,284.320	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	3,088,000.000	3,404,025.920	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	6,086,000.000	6,091,964.280	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	5,200,847.060	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	4,899,000.000	4,856,623.650	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,352,529.520	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	4,934,095.280	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,839,219.200	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	4,387,000.000	4,145,144.690	

		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	3,533,644.400	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	1,113,677.780	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	3,761,518.500	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	2,294,855.800	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,233,740.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	2,254,047.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	5,000,670.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	3,449,693.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,550,832.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	3,400,000.000	3,305,990.000	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,850,000.000	2,244,489.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	4,350,000.000	3,904,734.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	4,330,000.000	4,116,444.400	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,604,944.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,752,025.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	2,798,460.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,550,934.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	4,000,000.000	3,350,080.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	1,480,000.000	689,842.800	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20240225	100,000.000	97,407.000	

		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	1,500,000.000	991,140.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,756,176.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	3,100,000.000	2,831,819.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	1,500,000.000	930,315.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	2,100,000.000	1,687,161.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250225	2,100,000.000	1,999,410.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	200,000.000	164,956.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	300,000.000	278,616.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	1,300,000.000	1,256,125.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	973,260.000	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,327,401.990	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	2,127,411.000	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	2,158,639.210	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,508,546.160	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	2,193,369.450	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,512,970.480	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,711,175.130	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,938,000.000	1,836,855.780	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,078,692.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,367,912.000	

		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,258,524.000	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,064,856.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	687,555.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,198,050.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	736,584.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,250,000.000	720,562.500	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,087,606.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	646,416.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	792,603.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	100,000.000	93,827.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	600,000.000	513,198.000	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	300,000.000	298,677.000	
		9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	906,000.000	958,955.700	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,287,355.800	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,759,148.080	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,809,465.000	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,377,354.840	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,407,590.090	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,745,544.500	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	2,891,000.000	2,814,215.040	

		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,338,570.100	
		1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,275,313.460	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	1,941,980.880	
		1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	997,917.840	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	756,162.880	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,312,320.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,454,930.300	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,285,674.000	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,250,000.000	1,175,262.500	
		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,574,477.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,566,608.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,152,840.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	1,978,746.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,260,298.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,481,889.500	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,533,198.000	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,198,054.500	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,650,000.000	1,650,759.000	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	1,855,863.000	
		1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	2,200,000.000	2,170,696.000	

		2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,034,354.000	
		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,119,050.000	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,638,902.000	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,236,612.000	
		0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,152,247.500	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,196,135.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,135,035.000	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	1,500,000.000	1,460,430.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,652,900.000	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,823,451.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	1,987,480.000	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,571,990.000	
		1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,096,470.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,900,000.000	1,536,910.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240115	1,100,000.000	1,069,321.000	
		1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	784,560.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	484,554.000	
		0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,620,453.000	
		0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,399,914.000	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	700,000.000	459,830.000	

		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	993,938.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240415	1,500,000.000	1,448,520.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	302,183.200	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	684,856.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,509,151.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,000,000.000	956,800.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240130	1,200,000.000	1,165,620.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	3,100,000.000	2,776,887.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,700,000.000	1,331,967.000	
		0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	900,000.000	753,039.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241215	300,000.000	285,222.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	569,632.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231129	200,000.000	195,222.000	
		1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	275,676.000	
		1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250815	500,000.000	477,475.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	769,440.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	3,300,000.000	2,950,794.000	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	300,000.000	275,400.000	
		1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240530	100,000.000	98,605.000	
		2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	200,000.000	194,210.000	

		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	500,000.000	504,835.000	
		3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260115	300,000.000	303,447.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	3,254,000.000	3,638,720.420	
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,361,677.550	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,096,778.250	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,529,592.440	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,785,621.000	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	2,304,303.400	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,223,328.140	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,543,988.170	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,167,579.800	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,591,521.200	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	2,027,586.680	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,245,339.600	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,242,819.000	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,329,520.460	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	1,994,262.820	
		5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,372,936.160	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	1,946,069.040	
		4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,078,677.600	

		4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	879,980.400	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	750,888.970	
		2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,515,775.800	
		3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	776,043.360	
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,105,799.050	
		3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	617,610.360	
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	973,493.000	
		2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	832,360.550	
		1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,035,659.600	
		1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	491,727.500	
		0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	746,640.000	
		1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	671,190.000	
		1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	700,440.000	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	884,697.000	
		1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	475,554.000	
		0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	270,788.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	458,680.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	681,512.000	
		IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	653,232.000	
		0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	277,932.000	
		0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	82,526.000	
		6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	974,275.500	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,623,242.980	
		4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	951,755.000	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	441,755.860	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	800,216.400	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	762,079.530	
		1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	923,658.600	

		4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	700,123.220	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	398,822.250	
		2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	413,654.450	
		2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	528,608.540	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,177,997.680	
		1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	2,015,490.650	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	1,951,698.240	
		2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,187,681.760	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	2,700,586.620	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,872,612.160	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	1,603,630.000	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,530,401.900	
		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,828,940.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,663,270.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	1,954,654.500	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,264,904.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,200,000.000	1,098,684.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,728,697.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,496,272.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	2,250,000.000	1,974,352.500	

		0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	2,300,000.000	2,226,929.000	
		0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,452,576.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,360,000.000	1,166,893.600	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	2,500,000.000	2,383,275.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	844,830.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,226,408.000	
		1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,157,960.000	
		1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	944,528.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	464,440.000	
		0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,770,362.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20240531	300,000.000	289,917.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	365,306.500	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	500,000.000	439,525.000	
		0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	1,900,000.000	1,384,454.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,562,313.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	412,152.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	900,000.000	813,447.000	
		0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,736,049.000	
		1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	600,000.000	444,180.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20250531	100,000.000	94,363.000	

		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	100,000.000	88,820.000	
		2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,000,000.000	970,070.000	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,000,000.000	1,022,650.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,733,424.760	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,980,985.140	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,158,000.000	1,434,565.140	
		4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	1,732,830.040	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,406,172.150	
		4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,789,000.000	2,961,834.330	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,214,142.350	
		4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	1,937,023.950	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,018,207.100	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	1,705,353.180	
		3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,012,571.700	
		2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,116,669.860	
	ユーロ　小計			ユーロ 565,028,283.290 (81,126,760,915)	
国債証券　合計				236,705,030,930 [236,705,030,930]	
合計				236,705,030,930 [236,705,030,930]	

（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	264銘柄	100%	50.7%
イギリス・ポンド	国債証券	54銘柄	100%	4.7%
イスラエル・シュケル	国債証券	14銘柄	100%	0.4%
オーストラリア・ドル	国債証券	26銘柄	100%	1.5%
オフショア・人民元	国債証券	44銘柄	100%	3.2%
カナダ・ドル	国債証券	40銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券	21銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	100%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券	8銘柄	100%	0.4%
ニュージーランド・ドル	国債証券	12銘柄	100%	0.2%
ノルウェー・クローネ	国債証券	9銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券	14銘柄	100%	0.4%
マレーシア・リンギット	国債証券	30銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券	361銘柄	100%	34.3%

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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2022年11月30日

Ⅰ	資産総額	3,158,364円
Ⅱ	負債総額	9,714円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	3,148,650円
Ⅳ	発行済数量	2,565,083口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2275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

2022年11月30日

Ⅰ	資産総額	241,503,298,361円
Ⅱ	負債総額	150,979,777円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	241,352,318,584円
Ⅳ	発行済数量	76,340,507,617口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.1615円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

受益権の再分割を行なうにあたり、各受益者が保有する受益権口数に1口未満の端数が生じることとなる場合には、当該端数を切り捨てるものとし、当該端数処理は口座管理機関ごとに行ないます。また、各受益者が保有することとなる受益権口数の合計数と、受益権の再分割の比率に基づき委託会社が計算する受益権口数の合計数との間に差が生じることとなる場合には、委託会社が計算する受益権口数を当該差分減らし、当該口数にかかる金額については益金として計上することとします。

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【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

2022年11月末日現在

資本金の額　　151億7,427万2,500円

発行可能株式総数　799万9,980株

発行済株式総数　　260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

ｂ．委託会社の機構

①　会社の意思決定機構

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

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

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

②　投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ．商品会議

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

ロ．商品担当役員

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

ハ．運用会議

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

ニ．運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ．リスクマネジメント会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年11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	81	277,536
追加型株式投資信託	770	21,155,993
株式投資信託　　合計	851	21,433,528
単位型公社債投資信託	79	159,741
追加型公社債投資信託	14	1,428,018
公社債投資信託　合計	93	1,587,759
総合計	944	23,021,287

３【委託会社等の経理状況】

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

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

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第63期事業年度（2021年４月１日から2022年３月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第64期事業年度に係る中間会計期間（2022年４月１日から2022年９月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

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

(1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

		前事業年度 （2021年３月31日）		当事業年度 （2022年３月31日）
資産の部				
流動資産				
現金・預金		4,860		3,168
有価証券		333		486
前払費用		237		332
未収委託者報酬		13,150		13,811
未収収益		49		52
関係会社短期貸付金		18,700		24,900
その他		207		45
流動資産計		37,539		42,799
固定資産				
有形固定資産	※1	224	※1	203
建物		6		4

器具備品	218	198
無形固定資産	1,937	1,770
ソフトウェア	1,882	1,738
ソフトウェア仮勘定	54	31
投資その他の資産	16,121	16,617
投資有価証券	10,159	10,755
関係会社株式	3,705	3,705
出資金	183	177
長期差入保証金	1,068	1,067
繰延税金資産	973	885
その他	30	26
固定資産計	18,283	18,591
資産合計	55,822	61,390

（単位:百万円）

	前事業年度 （2021年３月31日）		当事業年度 （2022年３月31日）	
負債の部				
流動負債				
預り金		68		65
未払金		8,405		9,856
未払収益分配金		13		26
未払償還金		39		12
未払手数料		4,734		4,917
その他未払金	※2	3,617	※2	4,900
未払費用		3,777		4,246
未払法人税等		804		980
未払消費税等		631		1,016
賞与引当金		950		866
その他		88		2
流動負債計		14,725		17,033
固定負債				
退職給付引当金		2,452		2,399
役員退職慰労引当金		74		13
その他		3		1
固定負債計		2,530		2,415
負債合計		17,256		19,449
純資産の部				

株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	10,574	13,925
利益剰余金合計	10,948	14,299
株主資本合計	37,618	40,969
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	947	971
評価・換算差額等合計	947	971
純資産合計	38,566	41,941
負債・純資産合計	55,822	61,390

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	65,487	74,402
その他営業収益	419	545
営業収益計	65,906	74,948
営業費用		
支払手数料	27,965	31,234
広告宣伝費	624	650
調査費	8,245	9,104
調査費	1,134	1,252
委託調査費	7,110	7,851
委託計算費	1,501	1,729
営業雑経費	1,870	2,051
通信費	240	189
印刷費	478	468
協会費	51	46
諸会費	14	15
その他営業雑経費	1,084	1,331
営業費用計	40,207	44,768

一般管理費		
給料	5,991	5,948
役員報酬	351	306
給料・手当	4,293	4,281
賞与	395	493
賞与引当金繰入額	950	866
福利厚生費	893	867
交際費	32	46
旅費交通費	37	48
租税公課	472	527
不動産賃借料	1,302	1,300
退職給付費用	449	408
役員退職慰労引当金繰入額	28	10
固定資産減価償却費	661	606
諸経費	1,763	1,864
一般管理費計	11,631	11,628
営業利益	14,067	18,551

（単位:百万円）

	前事業年度 （自 2020年４月１日 至 2021年３月31日）	当事業年度 （自 2021年４月１日 至 2022年３月31日）
営業外収益		
投資有価証券売却益	578	327
有価証券償還益	42	40
その他	68	264
営業外収益計	689	631
営業外費用		
投資有価証券売却損	69	59
有価証券償還損	47	0
その他	24	34
営業外費用計	141	93
経常利益	14,616	19,089
特別損失		
システム刷新関連費用	547	-
関係会社整理損失	267	-
投資有価証券評価損	45	331
特別損失計	860	331
税引前当期純利益	13,756	18,757
法人税、住民税及び事業税	4,476	5,950
法人税等調整額	△109	69

法人税等合計	4,366	6,019
当期純利益	9,389	12,738

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793
当期変動額						
剰余金の配当	－	－	－	△ 10,564	△ 10,564	△ 10,564
当期純利益	－	－	－	9,389	9,389	9,389
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	－	－	－	－	－	－
当期変動額合計	－	－	－	△ 1,175	△ 1,175	△ 1,175
当期末残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618

	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	△ 363	△ 363	38,430
当期変動額			
剰余金の配当	－	－	△ 10,564
当期純利益	－	－	9,389
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	1,311	1,311	1,311
当期変動額合計	1,311	1,311	136
当期末残高	947	947	38,566

当事業年度（自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618
当期変動額						
剰余金の配当	－	－	－	△ 9,388	△ 9,388	△ 9,388
当期純利益	－	－	－	12,738	12,738	12,738
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	－	－	－	－	－	－
当期変動額合計	－	－	－	3,350	3,350	3,350
当期末残高	15,174	11,495	374	13,925	14,299	40,969

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

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物　　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別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員･参与及び上席参事についても、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

（３）役員退職慰労引当金

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

４．収益及び費用の計上基準

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

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

５．その他財務諸表作成のための基礎となる事項

(1) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(2) 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、翌事業年度から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行することとなります。ただし、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和２年法律第８号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号　2020年３月31日）第３項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号　2018年２月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

なお、翌事業年度の期首から、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを定めた「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号　2021年８月12日）を適用する予定であります。

（重要な会計上の見積り）

該当事項はありません。

（会計方針の変更に関する注記）

（収益認識に関する会計基準等の適用）

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年３月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。これによる当事業年度の損益及び期首利益剰余金に与える影響はありません。

なお、収益認識会計基準第89-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「収益認識関係」注記については記載しておりません。

（未適用の会計基準等）

・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年６月17日）

(1) 概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

(2) 適用予定日

2023年３月期の期首より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

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響については、現時点で評価中であります。

（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 （2021年３月31日）	当事業年度 （2022年３月31日）
建物	35百万円	37百万円
器具備品	259百万円	283百万円

※２ 関係会社項目

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

	前事業年度 （2021年３月31日）	当事業年度 （2022年３月31日）
未払金	3,473百万円	4,694百万円

３ 保証債務

前事業年度（2021年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,727百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（2022年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,900百万円に対して保証を行っております。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自　2020年４月１日　至　2021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
2020年６月23日定時株主総会	普通株式	10,564	4,050	2020年３月31日	2020年６月24日

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

2021年６月22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　9,388百万円
② 配当の原資　利益剰余金
③ １株当たり配当額　3,599円
④ 基準日　2021年３月31日
⑤ 効力発生日　2021年６月23日

当事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	―	―	2,608
合　　計	2,608	―	―	2,608

２．配当に関する事項

（１） 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額（百万円）	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2021年６月22日 定時株主総会	普通株式	9,388	3,599	2021年 ３月31日	2021年 ６月23日

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

2022年６月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

①	剰余金の配当の総額	12,737百万円
②	配当の原資	利益剰余金
③	１株当たり配当額	4,883円
④	基準日	2022年３月31日
⑤	効力発生日	2022年６月24日

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

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

（２）金融商品の内容及びそのリスク

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

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に関係する業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

（３） 金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

（ｉ）為替変動リスクの管理

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

（ii）価格変動リスクの管理

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

②信用リスクの管理

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

２．金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、2019年７月４日公表の企業会計基準適用指針第31号「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（以下、「2019年適用指針」という。）第26項に従い経過措置を適用した有価証券、市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。

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（2021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
投資有価証券（※１）	85	－	－	85
資産合計	85	－	－	85

（※1）2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券333百万円、投資有価証券9,406百万円は上記の表に含めておりません。

（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、コマーシャル・ペーパー、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。

当事業年度（2022年３月31日）

（１）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
投資有価証券（※１）	66	－	－	66
資産合計	66	－	－	66

（※１）2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券486百万円、投資有価証券10,022百万円は上記の表に含めておりません。

（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

投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル１に分類しております。なお、2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用している有価証券は、公表されている基準価額によっていることからレベルを付しておりません。保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

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

（単位：百万円）

区分	前事業年度	当事業年度
非上場株式等	666	666
子会社株式	1,677	1,677
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（2021年３月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額　1,677百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額　2,027百万円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度（2022年３月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額　1,677百万円）及び関連会社株式（貸借対照表計上額　2,027百万円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

２．その他有価証券

前事業年度（2021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	85	55	30
（２）その他	7,179	5,697	1,481
小計	7,265	5,752	1,512
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,561	2,721	△160
小計	2,561	2,721	△160
合計	9,826	8,474	1,352

（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（2022年３月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）	取得原価（百万円）	差額（百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	66	55	11
（２）その他	6,755	4,917	1,838
小計	6,822	4,972	1,850
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,753	4,208	△454
小計	3,753	4,208	△454
合計	10,575	9,180	1,395

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

３．売却したその他有価証券

前事業年度（自　2020年４月１日　至　2021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	5,353	578	69
合計	5,353	578	69

当事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

種類	売却額（百万円）	売却益の合計額（百万円）	売却損の合計額（百万円）
（１）株式	-	-	-
（２）その他			
証券投資信託	1,719	327	59
合計	1,719	327	59

４．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、関係会社株式について267百万円、証券投資信託について45百万円の減損処理を行っております。

当事業年度において、証券投資信託について331百万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　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
退職給付債務の期首残高	2,574　百万円	2,452　百万円
勤務費用	155	152
退職給付の支払額	△ 378	△ 303
その他	101	98
退職給付債務の期末残高	2,452	2,399

(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　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
非積立型制度の退職給付債務	2,452百万円	2,399百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,452	2,399
退職給付引当金	2,452	2,399
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,452	2,399

(３)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
勤務費用	155　百万円	152　百万円
その他	108	67
確定給付制度に係る退職給付費用	263	219

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186百万円、当事業年度189百万円であります。

（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 （2021年３月31日）	当事業年度 （2022年３月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金	750	734
賞与引当金	243	227

未払事業税	170	213
投資有価証券評価損	128	144
システム関連費用	155	111
出資金評価損	94	94
その他	298	437
繰延税金資産小計	1,841	1,963
評価性引当額	△254	△ 356
繰延税金資産合計	1,586	1,607
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	△159	△ 159
その他有価証券評価差額金	△453	△ 562
繰延税金負債合計	△612	△ 722
繰延税金資産の純額	973	885

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（2021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（2022年３月31日）

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

（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74,402百万円、その他545百万円であります。

（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　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関係内容		取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取（注）	19,300 0	関係会社短期貸付金	18,700 ―

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　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関係内容		取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取（注）	19,000 0	関係会社短期貸付金 受取利息関係会社	24,900 0

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（イ）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有 直接100.0	経営管理	債務保証（注）	1,727	―	―

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　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有 直接100.0	経営管理	債務保証（注）	1,900	―	―

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（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　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料（注2） 不動産の賃借料（注4）	14,917 527	未払手数料 長期差入保証金	3,321 1,054
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入（注3）	883	未払費用	179
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料（注4）	527	―	―

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

(注４)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。

当事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)

同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料（注2） 不動産の賃借料（注3）	15,348 1,062	未払手数料 長期差入保証金	3,028 1,054
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	-	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守（注4）	1,065	未払費用	91

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

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　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
１株当たり純資産額　14,784.79円	１株当たり純資産額　16,078.50円
１株当たり当期純利益　3,599.54円	１株当たり当期純利益　4,883.43円

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

(注２)１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
当期純利益（百万円）	9,389	12,738
普通株式の期中平均株式数（株）	2,608,525	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

中間財務諸表

(１)中間貸借対照表

（単位:百万円）

		当中間会計期間 （2022年９月30日）
資産の部		
流動資産		
現金・預金		3,876
有価証券		498
未収委託者報酬		12,633
関係会社短期貸付金		16,600
その他		557
流動資産合計		34,165
固定資産		
有形固定資産	※１	196
無形固定資産		
ソフトウエア		1,443
その他		141
無形固定資産合計		1,584
投資その他の資産		
投資有価証券		7,533
関係会社株式		3,482
繰延税金資産		887
その他		1,267
投資その他の資産合計		13,170
固定資産合計		14,950
資産合計		49,116

（単位:百万円）

	当中間会計期間 （2022年９月30日）
負債の部	
流動負債	
未払金	5,646

未払費用		4,193
未払法人税等		1,623
賞与引当金		486
その他	※２	655
流動負債合計		12,605
固定負債		
退職給付引当金		2,344
役員退職慰労引当金		33
その他		1
固定負債合計		2,379
負債合計		14,984
純資産の部		
株主資本		
資本金		15,174
資本剰余金		
資本準備金		11,495
資本剰余金合計		11,495
利益剰余金		
利益準備金		374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		6,692
利益剰余金合計		7,067
株主資本合計		33,737
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		394
評価・換算差額等合計		394
純資産合計		34,131
負債・純資産合計		49,116

(２)中間損益計算書

（単位:百万円）

	当中間会計期間 （自　2022年４月１日 至　2022年９月30日）
営業収益	
委託者報酬	35,926
その他営業収益	281

営業収益合計		36,208
営業費用		
支払手数料		15,088
その他営業費用		6,970
営業費用合計		22,059
一般管理費	※１	5,766
営業利益		8,382
営業外収益	※２	579
営業外費用	※３	274
経常利益		8,686
特別利益		―
特別損失	※４	460
税引前中間純利益		8,226
法人税、住民税及び事業税		2,472
法人税等調整額		248
中間純利益		5,505

(３)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自　2022年４月１日 至　2022年９月30日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,925	14,299	40,969
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△12,737	△12,737	△12,737
中間純利益	-	-	-	5,505	5,505	5,505
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	△7,232	△7,232	△7,232
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,692	7,067	33,737

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	971	971	41,941
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△12,737
中間純利益	-	-	5,505
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△576	△576	△576
当中間期変動額合計	△576	△576	△7,809
当中間期末残高	394	394	34,131

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物　　10～18年

器具備品　　４～20年

（２）無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

４．収益及び費用の計上基準

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

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

（会計方針の変更）

（時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用）

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

（追加情報）

（連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用）

当社は、当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示については「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年８月12日。以下「実務対応報告第42号」という。）に従っております。また、実務対応報告第42号第32項(１)に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

（中間貸借対照表関係）

※１　減価償却累計額

	当中間会計期間 （2022年９月30日現在）
有形固定資産	326百万円

※２　消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

３　保証債務

当中間会計期間（2022年９月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,122百万円に対して保証を行っております。

（中間損益計算書関係）

※１　減価償却実施額

	当中間会計期間 （自　2022年４月　１日 至　2022年９月30日）
有形固定資産	11百万円
無形固定資産	302百万円

※２　営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 （自　2022年４月　１日 至　2022年９月30日）
投資有価証券売却益	268百万円
有価証券償還益	149百万円
為替差益	114百万円

※３　営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 （自　2022年４月　１日 至　2022年９月30日）
投資有価証券売却損	244百万円

※４　特別損失の項目

	当中間会計期間 （自　2022年４月　１日 至　2022年９月30日）
投資有価証券評価損	237百万円
関係会社整理損失	222百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自　2022年４月１日　至　2022年９月30日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項　　**（単位：千株）**

	当事業年度期首株式数	当中間会計期間増加株式数	当中間会計期間減少株式数	当中間会計期間末株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	－	－	2,608
合計	2,608	－	－	2,608

２．配当に関する事項

配当金支払額

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

（金融商品関係）

当中間会計期間（2022年９月30日）

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

（１）時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
有価証券及び投資有価証券	57	7,306	－	7,364
資産合計	57	7,306	－	7,364

（２）時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル１に分類しております。当社が保有している証券投資信託は基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル２に分類しております。保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

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

（単位：百万円）

区分	当中間会計期間
非上場株式等	666
子会社株式	1,454
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2022年９月30日）

１．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額　1,454百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額　2,027百万円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

２．その他有価証券

	中間貸借対照表計上額（百万円）	取得原価（百万円）	差額（百万円）
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	57	55	2
（２）その他	4,614	3,570	1,043
小計	4,671	3,625	1,046
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,692	3,171	△478
小計	2,692	3,171	△478
合計	7,364	6,797	567

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

（収益認識関係）

（１） 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が35,926百万円、その他281百万円であります。

（２） 収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の４．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

当中間会計期間（自　2022年４月１日　至　2022年９月30日）

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

［関連情報］

当中間会計期間（自　2022年４月１日　至　2022年９月30日）

１.サービスごとの情報

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

２.地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３.主要な顧客ごとの情報

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

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

当中間会計期間（自　2022年４月１日　至　2022年９月30日）

該当事項はありません。

［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］

当中間会計期間（自　2022年４月１日　至　2022年９月30日）

該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］

当中間会計期間（自　2022年４月１日　至　2022年９月30日）

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

当中間会計期間 （自　2022年４月１日 至　2022年９月30日）	
１株当たり純資産額	13,084.78円
１株当たり中間純利益	2,110.46円

（注１）　潜在株式調整後１株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

（注２）　１株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 （自　2022年４月１日 至　2022年９月30日）	
中間純利益(百万円)	5,505
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,505
普通株主に帰属しない金額(百万円)	―
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

① 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

② 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

③ 通常の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な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

⑤ 上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5 【その他】

ａ．定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2022年4月1日付で、定款について次の変更を致しました。

・監査役の人数の変更（4名以内から5名以内に変更）

ｂ．訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

	①　名　称	②　資本金の額 (2022年03月末日現在)	③　事業の内容	④　備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	（注6）	
再信託受託会社	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円	（注6）	
販売会社	株式会社愛媛銀行	21,367百万円	（注3）	
	株式会社北九州銀行	10,000百万円	（注3）	
	株式会社もみじ銀行	10,000百万円	（注3）	
	株式会社山口銀行	10,005百万円	（注3）	

（注1）金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
（注2）主として中小企業向け融資業を営んでいます。
（注3）銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
（注4）全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
（注5）協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。
（注6）銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
（注7）信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。
（注8）保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。
（注9）保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
（注10）全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。
（注11）労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。
（注12）農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでいます。

２【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに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。

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

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

３【資本関係】

該当事項はありません。

第３【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が関東財務局長に提出されております。

（提出年月日）	（書類名）
2022年2月21日	有価証券報告書、有価証券届出書
2022年8月24日	半期報告書、有価証券届出書

独立監査人の監査報告書

2022年５月23日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2021年４月１日から2022年３月31日までの第63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2022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．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年1月27日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人
　東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＤ－Ｉ’ｓ 外国債券インデックスの2021年12月1日から2022年11月30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、Ｄ－Ｉ’ｓ 外国債券インデックスの2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年11月28日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2022年４月１日から2023年３月31日までの第64期事業年度の中間会計期間（2022年４月１日から2022年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2022年９月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2022年４月１日から2022年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。