

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2023年5月31日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 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
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	i F r e e 8 資産バランス
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

i F r e e 8資産バランス

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(5)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(6)【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

(7)【申込期間】

2023年6月1日から2023年11月30日まで（継続申込期間）

(終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。)

(8)【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(9)【払込期日】

受益権の取得申込者は、販売会社が定める期日(くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。)までに、取得申込代金(取得申込金額、申込手数料および申込手数料に対する消費税等に相当する金額の合計額をいいます。以下同じ。)を販売会社において支払うものとしします。

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12)【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、値動きの異なる8つの資産クラスに分散投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

(注1) 商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行なわれないファンド
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
投資対象地域	国内	目論見書または投資信託約款(以下「目論見書等」といいます。)において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	海外	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	内外	目論見書等において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
投資対象資産	株式	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるもの
	債券	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるもの
	不動産投信(リート)	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるもの
	その他資産	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券、不動産投信(リート)以外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	資産複合	目論見書等において、株式、債券、不動産投信(リート)およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
独立区分	MMF(マネー・マネージメント・ファンド)	「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMF
	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、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの
対象インデックス	日経225	目論見書等において、日経225に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	TOPIX	目論見書等において、TOPIXに連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	その他の指数	目論見書等において、上記以外の指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
特殊型	ブル・ベア型	目論見書等において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行なうとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）をめざす旨の記載があるもの
	条件付運用型	目論見書等において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるもの
	ロング・ショート型 / 絶対収益追求型	目論見書等において、ロング・ショート戦略により収益の追求をめざす旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求をめざす旨の記載があるもの
	その他型	目論見書等において、特殊型のうち上記に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

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

< 信託金の限度額 >

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

< ファンドの特色 >

iFree 8資産バランス

SIMPLE
& EASY

インデックスってなに？

FREE
& LOW

費用はどれくらいかかるのかな？



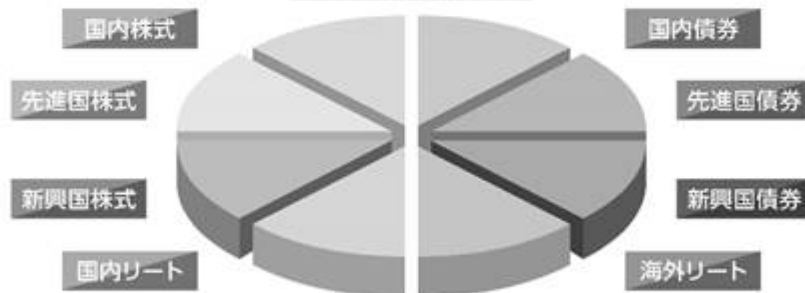
これらの質問については、以降でご説明します。

ファンドの目的・特色

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

■ 8つの資産クラスについて

資産配分のイメージ



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

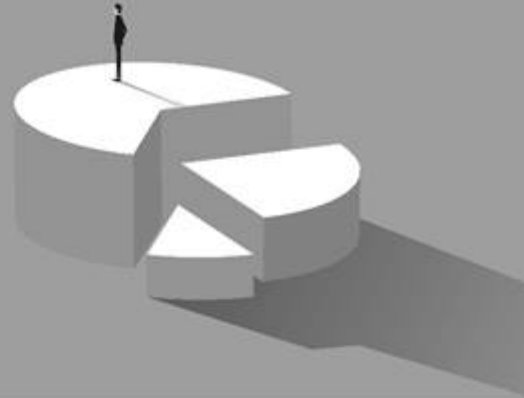
※先進国株式・債券の資産クラスには、日本の株式・債券を含みません。
 ※対象インデックスについては、後掲の「対象インデックスについて」をご参照下さい。



当ファンドは、「つみたてNISA」対象ファンドです。



インデックス ってなに？




「インデックス」とは

いふなれば「市場のモノサシ」です。

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

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

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



当ファンドの各資産クラスにおける対象インデックスは以下のとおりです。

■対象インデックスについて

資産クラス	対象インデックス
国内株式	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
先進国株式	MSCIコクサイ指数 (配当込み、円ベース)
新興国株式	FTSE RAFI エマージング インデックス(円換算)
国内債券	NOMURA-BPI総合指数

資産クラス	対象インデックス
先進国債券	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)
新興国債券	JPモルガン ガバメント・ボンド・イン デックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算)
国内リート	東証REIT指数(配当込み)
海外リート	S&P先進国REIT指数(除く日本) (円ベース)

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



費用はどれくらいかかるのかな？



ファンドへの投資にかかる主な費用は

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

当ファンドは、費用を低く抑えたファンドです。

※上記は主な費用であり、他にも費用・税金がかかります。

— Aさんの場合 —

運用管理費用っていくらくらい？

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

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

※上記の運用管理費用は簡便に計算した概算値です。

■ インデックスの概要について

● 東証株価指数(TOPIX)

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

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

● MSCIコクサイ指数

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

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

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

● FTSE RAFI エマージング インデックス

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

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

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

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

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

● NOMURA-BPI総合指数

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

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

● FTSE世界国債インデックス

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

● JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド(円換算)

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

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

● 東証REIT指数(配当込み)

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

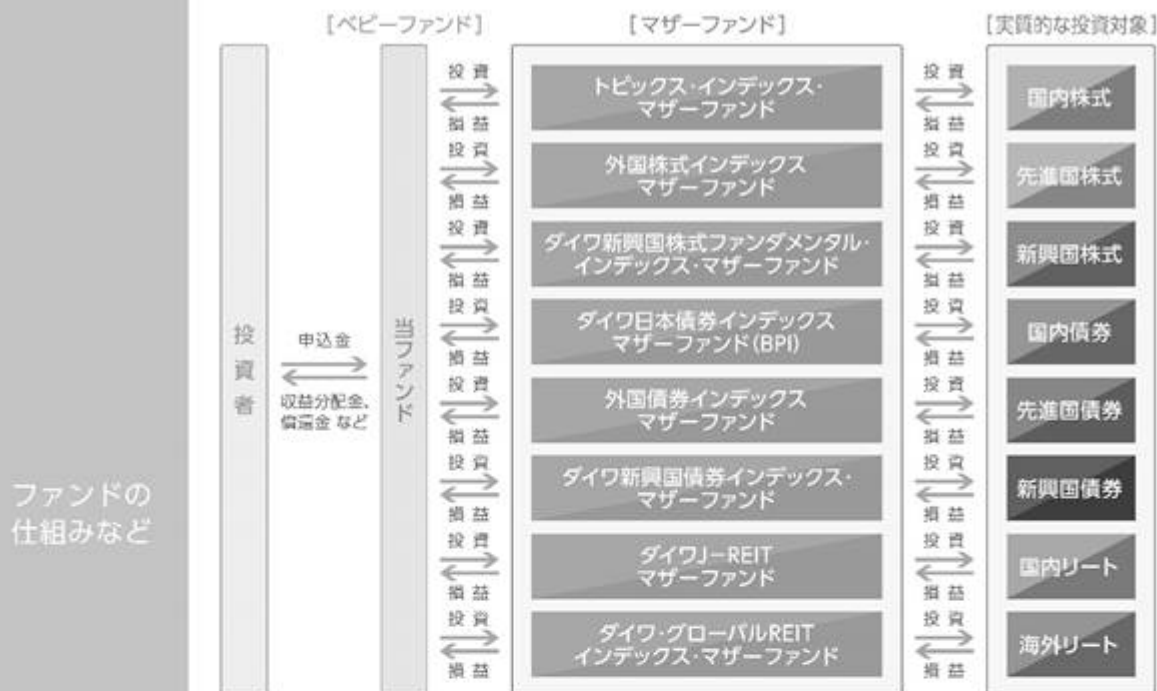
● S&P先進国REIT指数

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

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

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



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

分配方針

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

【分配方針】

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

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

(2) 【ファンドの沿革】

2016年9月8日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金（注）、償還金など お申込金（ 3）	
お取扱窓口	販売会社	<p>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せん。</p> <p>受益権の募集の取扱い</p> <p>一部解約請求に関する事務</p> <p>収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務</p> <p style="text-align: right;">など</p>
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	<p>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せん。</p> <p>受益権の募集・発行</p> <p>信託財産の運用指図</p> <p>信託財産の計算</p> <p>運用報告書の作成</p> <p style="text-align: right;">など</p>
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	<p>信託契約（ 2）の受託者であり、次の業務を行ないません。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分</p> <p>信託財産の計算</p> <p style="text-align: right;">など</p>
	損益 投資	
投資対象	内外の株式・債券およびリート（不動産投資信託） など （ファミリーファンド方式で運用を行ないません。）	

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は、自動的に再投資されます。

- 1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。
- 2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。

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

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

< 委託会社の概況（2023年3月末日現在） >

・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

・ 沿革

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

・ 大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

主要投資対象

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

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

1. トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券（東証株価指数（配当込み））
2. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券（MSCIコクサイ指数（配当込み、円ベース））
3. ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの受益証券（FTSE RAFI エマージング インデックス（円換算））

4. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)の受益証券(NOMURA-BPI総合指数)
5. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券(FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース))
6. ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券(JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド(円換算))
7. ダイワJ-REITマザーファンドの受益証券(東証REIT指数(配当込み))
8. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券(S&P先進国REIT指数(除く日本)(円ベース))

投資態度

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

1. 国内株式
2. 先進国株式
3. 新興国株式
4. 国内債券
5. 先進国債券
6. 新興国債券
7. 国内リート
8. 海外リート

ロ. 各資産クラスの配分比率については、均等とすることを目標とします。

ハ. 各資産クラスの配分比率の合計は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

ニ. 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

ホ. 安定した収益の確保および効率的な運用を行なうためのものとして定める次の目的により投資する場合を除き、法人税法第61条の5第1項に規定するデリバティブ取引にかかる権利に対する投資として運用を行ないません。

- (a) 投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的
- (b) 信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスク(為替相場の変動、市場金利の変動、経済事情の変化その他の要因による利益または損失の増加または減少の生じるおそれをいいます。)を減じる目的
- (c) 法人税法施行規則第27条の7第1項第6号に規定する先物外国為替取引により、信託財産の資産または負債について為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的

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

(2)【投資対象】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1．から8．までに掲げる親投資信託（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券、ならびに次の9．から12．までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

- 1．トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
- 2．外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
- 3．ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの受益証券
- 4．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）の受益証券
- 5．外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
- 6．ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券
- 7．ダイワJ-REITマザーファンドの受益証券
- 8．ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券
- 9．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- 10．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前9．の証券の性質を有するもの
- 11．外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 12．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

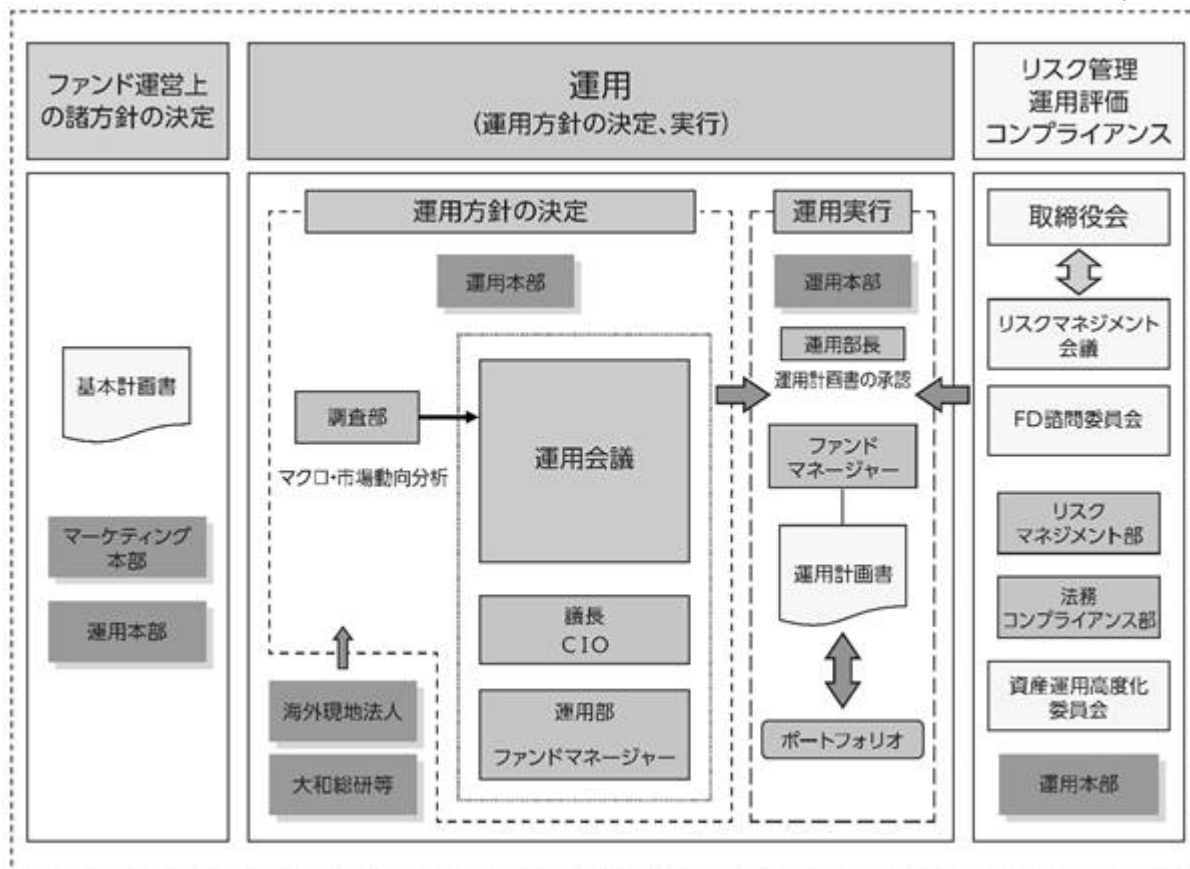
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

- 1．預金
- 2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3．コール・ローン
- 4．手形割引市場において売買される手形

(3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を商品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。

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。

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。

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2023年3月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

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。

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

外国為替予約取引（信託約款）

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

信用リスク集中回避（信託約款）

一般社団法人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。

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> マザーファンドの概要

1. トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

投資対象

東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

投資態度

投資成果を東証株価指数（配当込み）の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。

イ．上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行ないます。

ロ．ポートフォリオは、東証株価指数（配当込み）における業種別、銘柄別時価構成比率等を参考に、東証株価指数（配当込み）との連動性を維持するよう構築します。

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

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

1. 株券または新株引受権証書
2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
3. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
4. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

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

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

(3) 主な投資制限

株式

株式への投資には、制限を設けません。

先物取引等

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

2. 外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

外国の株式（預託証券を含みます。）を主要投資対象とします。

投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

11. 外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. 預託証書(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。

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

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

(3) 主な投資制限

株式

株式への投資割合には、制限を設けません。

投資信託証券

投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

3. ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

次の有価証券を主要投資対象とします。

イ．新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。）

ロ．新興国の企業のDR（預託証券）

ハ．FTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすETF（上場投資信託証券）

投資態度

イ．主として、新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）（ ）に投資し、投資成果をFTSE RAFI エマージング インデックス（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

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

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

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

ニ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

(2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．外国通貨表示の株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
20. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
21. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
22. 外国の者に対する権利で前21.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書ならびに前12.および前17.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券ならびに前14.の証券のうち投資法人債券ならびに前12.および前17.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前13.の証券および前14.の証券(投資法人債券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

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

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

株式

株式への投資割合には、制限を設けません。

投資信託証券

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等

イ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

ロ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

ハ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

スワップ取引

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

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

ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

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

4. ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

(1) 投資方針

主要投資対象

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

投資態度

- イ．主としてわが国の公社債等に投資しベンチマーク（NOMURA - BPI総合指数）の動きに連動する投資成果をめざします。
- ロ．運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ハ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

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

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

八．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．転換社債の転換、新株予約権（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券

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7．コマーシャル・ペーパー

8．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの

9．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

10．投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

11．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

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

13．外国法人が発行する譲渡性預金証書

14．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

15．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

16．外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

株式

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

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

スワップ取引

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

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

ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

金利先渡取引

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

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

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

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

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

5. 外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

イ．主として外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。

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

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

(2) 投資対象

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

1. 転換社債の転換、新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
19. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

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

(3) 主な投資制限

株式

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

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

投資信託証券

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式

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

外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

6. ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

新興国通貨建ての債券を主要投資対象とします。

投資態度

- イ．主として、新興国通貨建ての債券に投資し、投資成果をJPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
- ロ．運用の効率化をはかるため、債券先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、債券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産の組入総額ならびに外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
- ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1．次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
 - イ．有価証券
 - ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)、および に定めるものに限ります。）
 - ハ．約束手形
 - ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの
- 2．次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ．為替手形

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

- 1．転換社債の転換、新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証書
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人の発行する債券
- 5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）

6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. コマーシャル・ペーパー
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
9. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
10. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
11. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
12. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
13. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
14. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
15. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
16. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
17. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
18. 外国の者に対する権利で前17.の有価証券の性質を有するもの

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

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

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

(3) 主な投資制限

株式

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券

投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等

イ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。)

ロ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

ハ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

スワップ取引

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

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

ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

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

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

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

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

7. ダイワJ-REITマザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

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

投資態度

イ．「東証REIT指数」に連動する投資成果をめざして運用を行ないません。

ロ．投資成果を「東証REIT指数」の動きにできるだけ連動させるため、組入銘柄は「東証REIT指数」の構成銘柄（採用予定を含みます。）とし、組入比率を高位に保ちます。

ハ．運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

2．投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

3．投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

4．新投資口予約権証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、不動産投資信託証券にかかる投資法人より発行されたものに限り。）

5．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限り。）

なお、前2.の証券および前3.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

株式

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券

同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、当該同一銘柄の「東証REIT指数」における時価の構成割合が30%を超える場合には、当該指数における構成割合の範囲で組入れることができるものとします。

外貨建資産

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

先物取引

委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。）および外国の金融商品取引所におけるこの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

8. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

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

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

投資態度

- イ. 主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券に投資し、ベンチマーク(S & P先進国REIT指数(除く日本)(円ベース))をいいます。以下同じ。)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
- ロ. 組入銘柄はベンチマーク構成銘柄とし、不動産投資信託証券の組入比率を高位に保ちます。
- ハ. 運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ニ. 保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
- ホ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1. 次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。)
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)に定めるものに限りません。)
 - ハ. 約束手形
 - ニ. 金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの
- 2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

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

- 1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- 2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの
- 3. 外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 4. 外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 5. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 6. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)

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

- 1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、「投資態度」で定めた指数における時価の構成割合が30%を超える場合には、当該指数における構成割合の範囲で組入れることができるものとします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引

委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。)および外国の金融商品取引所におけるこの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

3【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動(価格変動リスク・信用リスク)

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

新興国の証券市場は、先進国の証券市場に比べ、一般に市場規模や取引量が小さく、流動性が低いことにより本来想定される投資価値とは乖離した価格水準で取引される場合もあるなど、価格の変動性が大きくなる傾向が考えられます。

公社債の価格変動(価格変動リスク・信用リスク)

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

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

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

イ．リートは、株式と同様に金融商品取引所等で売買され、その価格は、不動産市況に対する見通しや市場における需給等、さまざまな要因で変動します。

- ・リートには資産規模が小さく、流動性が低いものもあります。このようなリートへの投資は、流動性の高い株式等に比べ、より制約を受けることが考えられます。
- ・金利の上昇局面においては、他の、より利回りの高い債券等との比較でリートに対する投資価値が相対的に低下し、価格が下落することも想定されます。

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

- ・リートの収益は、所有する不動産から得られる賃料収入がその大半を占めます。したがって、賃料水準や入居率の低下等により賃料収入が減少した場合には、リートの収益が悪化し、価格や配当が下落することが考えられます。
- ・リートの資産価値は、所有する不動産の評価等により変動します。市況の悪化、不動産の老朽化等によってリートの資産価値が低下した場合には、価格が下落することがあります。なお、実物資産である不動産には、人的災害、自然災害等に伴って大きな損害が発生する可能性もあり、このような場合、リートの価格が大幅に下落することも想定されます。
- ・リートでは、投資資金を調達するために金融機関等から借入れを行なうことがあります。したがって、金利上昇局面において金利負担等が増加し、収益の悪化要因となることが考えられます。
- ・法人形態のリートでは、経営陣の運営如何によっては収益や財務内容が著しく悪化する可能性があります。リートが倒産等に陥り、投資資金が回収できなくなることもありえます。

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

- ・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リートの価格や配当に影響を受けることが考えられます。
- ・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。

ニ．組入リートの市場価格が下落した場合、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

外貨建資産の円換算価値は、資産自体の価格変動のほか、当該外貨の円に対する為替レートの変動の影響を受けます。為替レートは、各国の金利動向、政治・経済情勢、為替市場の需給その他の要因により大幅に変動することがあります。組入外貨建資産について、当該外貨の為替レートが円高方向に進んだ場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

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

当ファンドにおいては、保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。そのため、外貨建資産を実質的に組入れた部分は、為替レートの変動の影響を直接受けます。

ロ．カントリー・リスク

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

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

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

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

その他

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

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

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生した場合には、お買付け、ご換金の申込みの受け付けを中止すること、すでに受け付けたお買付けの申込みを取消すことがあります。

ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受け付けたものとして取扱います。

(3)その他の留意点

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

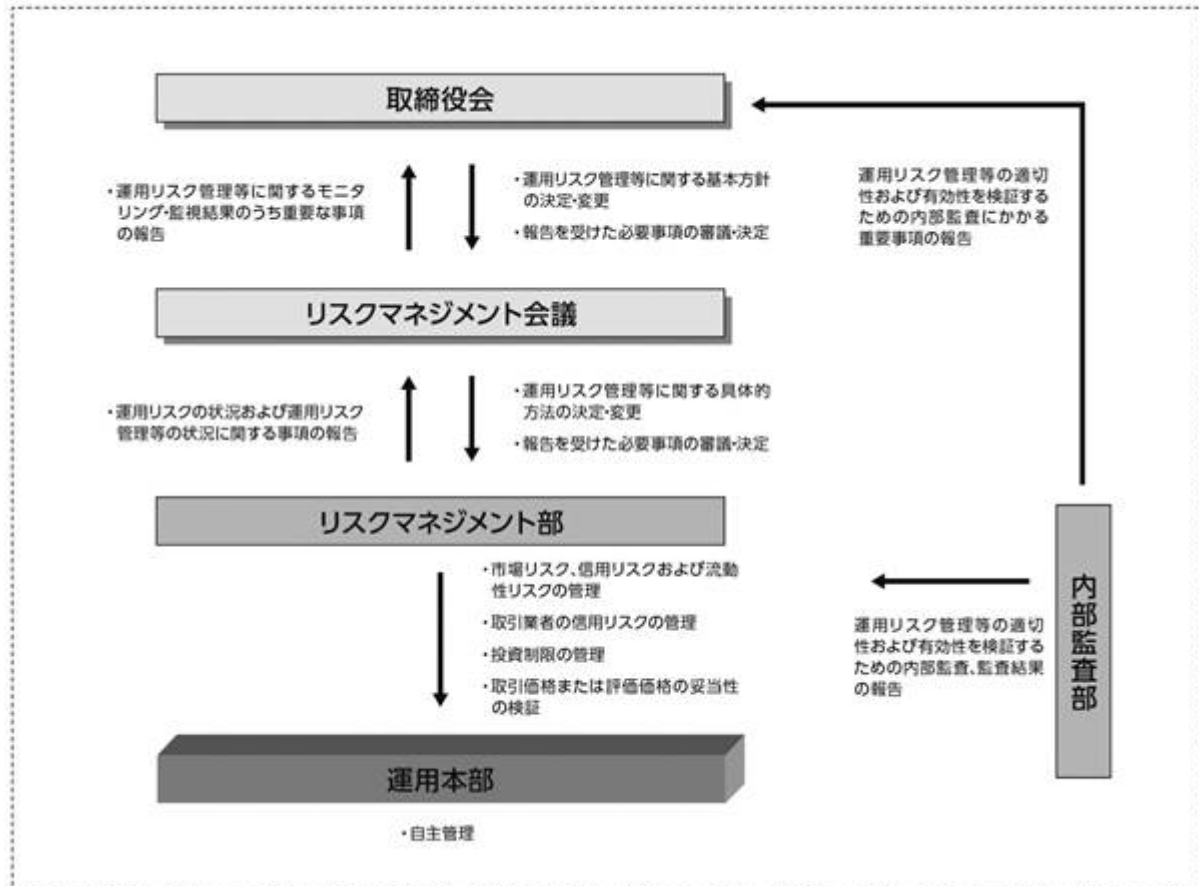
流動性リスクに関する事項

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

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付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年間に於ける年間騰落率（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年間に於ける年間騰落率の推移を表示しています。



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

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

※指数について

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.242%（税抜0.22%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分については、次のとおりです。

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

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。また、上場不動産投資信託は市場価格により取引されており、費用を表示することができません。

< マザーファンドより支弁する手数料等 >

各マザーファンドの投資対象等に応じて、信託財産に関する租税、有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を支弁します。

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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。

「つみたてNISA」をご利用の場合

販売会社によっては「つみたてNISA」の適用対象となります。くわしくは、販売会社にお問合せ下さい。

毎年、一定額の範囲で販売会社との契約に基づいて定期かつ継続的な方法で購入することにより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。

なお、「NISA」と「つみたてNISA」の投資枠は、年ごとに選択制であり、同一年においてその両方を併用した投資は行なえません。

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。

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

<注1> 個別元本について

投資者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。

投資者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

投資者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

個別元本について、詳しくは販売会社にお問合せ下さい。

<注2> 収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（投資者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

- () 外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- () 上記は、2023年3月末日現在のもので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- () 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】（2023年3月31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	50,325,046,155	99.03
内 日本	50,325,046,155	99.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	492,494,024	0.97
純資産総額	50,817,540,179	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】（2023年3月31日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	4,489,258,201	1.3284 5,963,717,903	1.4214 6,381,031,606	12.56
2	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,469,125,917	4.2930 6,307,070,919	4.3305 6,362,049,783	12.52
3	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	4,126,402,944	1.5024 6,199,874,601	1.5357 6,336,917,001	12.47
4	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	3,192,115,558	2.0184 6,442,968,248	1.9851 6,336,668,594	12.47
5	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,021,369,269	3.2249 6,518,882,661	3.1180 6,302,629,380	12.40
6	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	日本	親投資信託受益証券	5,039,149,782	1.2502 6,300,399,528	1.2497 6,297,425,482	12.39

7	ダイワ・REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,975,835,402	3.4110 6,739,639,139	3.1158 6,156,307,945	12.11
8	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,090,886,845	3.2958 6,891,266,042	2.9423 6,152,016,364	12.11

(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	99.03%
合計	99.03%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年9月7日)	4,423,564,263	4,423,564,263	1.1184	1.1184
第2計算期間末 (2018年9月7日)	9,247,296,645	9,247,296,645	1.1443	1.1443
第3計算期間末 (2019年9月9日)	15,633,295,158	15,633,295,158	1.2108	1.2108
第4計算期間末 (2020年9月7日)	22,486,955,149	22,486,955,149	1.1937	1.1937
第5計算期間末 (2021年9月7日)	34,554,535,822	34,554,535,822	1.4651	1.4651

2022年3月末日	40,824,873,058	-	1.4996	-
4月末日	41,126,575,921	-	1.4821	-
5月末日	41,745,467,002	-	1.4704	-
6月末日	42,431,809,024	-	1.4627	-
7月末日	43,941,590,179	-	1.4845	-
8月末日	45,216,458,643	-	1.4989	-
第6計算期間末 (2022年9月7日)	45,579,049,607	45,579,049,607	1.5066	1.5066
9月末日	44,134,911,285	-	1.4340	-
10月末日	46,742,529,587	-	1.4892	-
11月末日	47,479,829,978	-	1.4847	-
12月末日	46,566,493,806	-	1.4245	-
2023年1月末日	48,727,009,510	-	1.4619	-
2月末日	50,121,245,751	-	1.4779	-
3月末日	50,817,540,179	-	1.4697	-

【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
2022年9月8日～ 2023年3月7日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	11.8
第2計算期間	2.3
第3計算期間	5.8
第4計算期間	1.4
第5計算期間	22.7
第6計算期間	2.8
2022年9月8日～ 2023年3月7日	1.1

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	5,119,041,794	1,173,761,616
第2計算期間	5,936,562,291	1,810,640,911
第3計算期間	6,888,328,647	2,057,961,207
第4計算期間	9,224,765,978	3,298,328,374
第5計算期間	8,347,815,842	3,601,501,893
第6計算期間	9,073,700,420	2,405,303,826
2022年9月8日～ 2023年3月7日	4,831,348,796	1,062,809,403

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2023年3月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	210,740,552,220	97.25
内 日本	210,740,552,220	97.25
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,967,883,960	2.75
純資産総額	216,708,436,180	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	5,810,150,000	2.68
内 日本	5,810,150,000	2.68

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

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

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

(2) 投資資産 (2023年3月31日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
-----	----	----	----	----------------------	-------------------	-------------------	-----------------

1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	4,027,200	2,036.91 8,203,049,440	1,880.00 7,571,136,000	3.49
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	518,800	10,379.49 5,384,881,438	11,985.00 6,217,818,000	2.87
3	キーエンス	日本	株式	電気機器	73,400	51,552.03 3,783,919,711	64,450.00 4,730,630,000	2.18
4	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,522,300	738.83 3,341,214,526	847.90 3,834,458,170	1.77
5	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	942,500	3,918.14 3,692,848,023	3,962.00 3,734,185,000	1.72
6	第一三共	日本	株式	医薬品	640,800	4,236.18 2,714,550,039	4,822.00 3,089,937,600	1.43
7	武田薬品	日本	株式	医薬品	651,000	3,856.44 2,510,545,072	4,350.00 2,831,850,000	1.31
8	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	527,900	4,395.62 2,320,451,138	5,298.00 2,796,814,200	1.29
9	日立	日本	株式	電気機器	360,200	6,731.97 2,424,855,969	7,252.00 2,612,170,400	1.21
10	信越化学	日本	株式	化学	610,500	3,194.82 1,950,441,338	4,275.00 2,609,887,500	1.20
11	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	155,100	13,756.68 2,133,661,636	16,040.00 2,487,804,000	1.15
12	任天堂	日本	株式	その他製品	463,000	6,138.91 2,842,316,588	5,131.00 2,375,653,000	1.10
13	三井物産	日本	株式	卸売業	567,800	3,344.06 1,898,757,891	4,116.00 2,337,064,800	1.08
14	KDDI	日本	株式	情報・通信業	568,400	4,351.49 2,473,391,802	4,093.00 2,326,461,200	1.07
15	三菱商事	日本	株式	卸売業	485,200	4,377.45 2,123,940,632	4,751.00 2,305,185,200	1.06
16	HOYA	日本	株式	精密機器	156,600	14,439.88 2,261,285,426	14,560.00 2,280,096,000	1.05
17	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	425,300	5,512.67 2,344,542,758	5,182.00 2,203,904,600	1.02
18	本田技研	日本	株式	輸送用機器	596,200	3,532.86 2,106,293,372	3,510.00 2,092,662,000	0.97
19	ダイキン工業	日本	株式	機械	88,400	24,016.95 2,123,099,038	23,655.00 2,091,102,000	0.96
20	伊藤忠	日本	株式	卸売業	478,200	3,818.37 1,825,947,259	4,301.00 2,056,738,200	0.95

21	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	558,200	4,374.09 2,441,621,775	3,650.00 2,037,430,000	0.94
22	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,044,600	1,675.69 1,750,435,109	1,878.00 1,961,758,800	0.91
23	東京海上HD	日本	株式	保険業	727,400	2,637.84 1,918,770,419	2,547.00 1,852,687,800	0.85
24	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	1,181,700	1,503.06 1,776,169,313	1,529.00 1,806,819,300	0.83
25	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	399,000	4,066.38 1,622,485,871	4,528.00 1,806,672,000	0.83
26	村田製作所	日本	株式	電気機器	222,500	7,391.20 1,644,543,068	8,040.00 1,788,900,000	0.83
27	ファナック	日本	株式	電気機器	360,000	4,355.15 1,567,856,185	4,760.00 1,713,600,000	0.79
28	SMC	日本	株式	機械	24,000	63,215.24 1,517,165,886	69,830.00 1,675,920,000	0.77
29	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	267,400	5,975.50 1,597,848,968	5,975.00 1,597,715,000	0.74
30	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	475,500	2,432.16 1,156,495,235	2,798.00 1,330,449,000	0.61

(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
株式	97.25%
合計	97.25%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.08%
鉱業	0.29%
建設業	1.91%
食料品	3.44%
繊維製品	0.46%
パルプ・紙	0.17%
化学	6.14%
医薬品	5.41%
石油・石炭製品	0.45%

ゴム製品	0.76%
ガラス・土石製品	0.71%
鉄鋼	0.91%
非鉄金属	0.72%
金属製品	0.56%
機械	5.27%
電気機器	17.56%
輸送用機器	7.26%
精密機器	2.52%
その他製品	2.19%
電気・ガス業	1.18%
陸運業	2.88%
海運業	0.59%
空運業	0.48%
倉庫・運輸関連業	0.14%
情報・通信業	8.41%
卸売業	6.02%
小売業	4.42%
銀行業	5.76%
証券、商品先物取引業	0.72%
保険業	2.09%
その他金融業	1.06%
不動産業	1.78%
サービス業	4.93%
合計	97.25%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 050 6月	買建	290	5,758,765,700	5,810,150,000	2.68%

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

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

ダイワJ-REITマザーファンド

(1) 投資状況 (2023年3月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	447,227,228,820	97.82
内 日本	447,227,228,820	97.82
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	9,951,864,188	2.18
純資産総額	457,179,093,008	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	9,951,200,000	2.18
内 日本	9,951,200,000	2.18

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

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

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

(2) 投資資産 (2023年3月31日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	52,045	559,956.91 29,142,957,568	551,000.00 28,676,795,000	6.27
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	44,613	548,936.71 24,489,713,592	528,000.00 23,555,664,000	5.15
3	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	225,097	99,681.75 22,438,063,194	96,700.00 21,766,879,900	4.76

4	野村不動産マスターF	日本	投資証券	144,269	149,096.65 21,510,024,683	148,500.00 21,423,946,500	4.69
5	日本プロロジスリート	日本	投資証券	75,199	291,656.27 21,932,260,135	280,300.00 21,078,279,700	4.61
6	GLP投資法人	日本	投資証券	143,993	149,667.10 21,551,015,485	143,100.00 20,605,398,300	4.51
7	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	67,248	274,582.28 18,465,109,835	271,500.00 18,257,832,000	3.99
8	オリックス不動産投資	日本	投資証券	88,891	172,567.83 15,339,727,592	168,000.00 14,933,688,000	3.27
9	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	99,796	144,580.96 14,428,602,046	143,000.00 14,270,828,000	3.12
10	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	44,607	318,979.55 14,228,720,949	316,500.00 14,118,115,500	3.09
11	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	196,361	54,590.89 10,719,523,701	55,700.00 10,937,307,700	2.39
12	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	143,869	74,680.92 10,744,269,797	75,100.00 10,804,561,900	2.36
13	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	30,510	345,993.70 10,556,267,969	349,000.00 10,647,990,000	2.33
14	産業ファンド	日本	投資証券	68,070	141,299.81 9,618,278,707	144,200.00 9,815,694,000	2.15
15	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	134,059	70,598.83 9,464,409,511	71,900.00 9,638,842,100	2.11
16	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	15,405	592,995.65 9,135,098,127	597,000.00 9,196,785,000	2.01
17	API投資法人	日本	投資証券	23,553	371,016.93 8,738,561,906	378,000.00 8,903,034,000	1.95
18	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	30,081	292,607.10 8,801,914,240	294,500.00 8,858,854,500	1.94
19	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	54,615	155,788.08 8,508,366,387	153,700.00 8,394,325,500	1.84
20	三井不ロジパーク	日本	投資証券	17,624	458,030.58 8,072,330,960	465,000.00 8,195,160,000	1.79
21	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	25,959	315,933.93 8,201,329,050	306,500.00 7,956,433,500	1.74
22	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	16,553	476,445.88 7,886,608,811	475,000.00 7,862,675,000	1.72
23	森ヒルズリート	日本	投資証券	52,461	148,194.61 7,774,437,723	147,600.00 7,743,243,600	1.69

24	イオンリート投資	日本	投資証券	51,216	144,794.35 7,415,787,862	144,900.00 7,421,198,400	1.62
25	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	61,821	111,386.85 6,886,046,787	108,900.00 6,732,306,900	1.47
26	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	21,334	307,531.22 6,560,871,123	315,500.00 6,730,877,000	1.47
27	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	日本	投資証券	32,717	202,994.47 6,641,370,217	204,800.00 6,700,441,600	1.47
28	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	41,740	148,298.39 6,189,974,817	149,600.00 6,244,304,000	1.37
29	三菱地所物流REIT	日本	投資証券	15,327	397,464.87 6,091,944,096	390,500.00 5,985,193,500	1.31
30	NTT都市開発リート投資法人	日本	投資証券	42,885	132,295.42 5,673,489,307	134,900.00 5,785,186,500	1.27

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	97.82%
合計	97.82%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指数先物取引	日本	TREIT先物 050 6月	買建	5,600	10,035,200,000	9,951,200,000	2.18%

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

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

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

(1) 投資状況（2023年3月31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	40,657,159,020	91.41
内 日本	40,657,159,020	91.41
地方債証券	1,684,845,676	3.79
内 日本	1,684,845,676	3.79
特殊債券	722,138,800	1.62
内 日本	722,138,800	1.62
社債券	1,170,891,800	2.63
内 日本	1,170,891,800	2.63
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	244,845,987	0.55
純資産総額	44,479,881,283	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（2023年3月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	347 10年国債	日本	国債証券	800,000,000	99.91 799,324,000	100.25 802,016,000	0.100000 2027/06/20	1.80
2	145 5年国債	日本	国債証券	710,000,000	100.30 712,186,800	100.43 713,067,200	0.100000 2025/09/20	1.60
3	144 5年国債	日本	国債証券	650,000,000	100.29 651,932,100	100.39 652,593,500	0.100000 2025/06/20	1.47
4	143 5年国債	日本	国債証券	630,000,000	100.26 631,671,200	100.37 632,349,900	0.100000 2025/03/20	1.42
5	141 5年国債	日本	国債証券	620,000,000	100.24 621,506,600	100.29 621,816,600	0.100000 2024/09/20	1.40
6	147 5年国債	日本	国債証券	580,000,000	100.00 580,000,000	100.17 581,026,600	0.005000 2026/03/20	1.31

7	337 10年国債	日本	国債証券	550,000,000	100.65 553,578,500	100.67 553,729,000	0.300000 2024/12/20	1.24
8	148 5年国債	日本	国債証券	530,000,000	99.96 529,792,100	100.16 530,848,000	0.005000 2026/06/20	1.19
9	353 10年国債	日本	国債証券	520,000,000	99.56 517,736,800	99.82 519,110,800	0.100000 2028/12/20	1.17
10	349 10年国債	日本	国債証券	500,000,000	99.80 499,026,400	100.09 500,465,000	0.100000 2027/12/20	1.13
11	352 10年国債	日本	国債証券	500,000,000	99.74 498,705,000	99.89 499,455,000	0.100000 2028/09/20	1.12
12	350 10年国債	日本	国債証券	480,000,000	99.84 479,241,600	100.02 480,115,200	0.100000 2028/03/20	1.08
13	358 10年国債	日本	国債証券	480,000,000	99.06 475,516,800	99.24 476,376,000	0.100000 2030/03/20	1.07
14	361 10年国債	日本	国債証券	480,000,000	98.54 473,026,200	98.64 473,472,000	0.100000 2030/12/20	1.06
15	140 5年国債	日本	国債証券	470,000,000	100.22 471,057,500	100.26 471,226,700	0.100000 2024/06/20	1.06
16	351 10年国債	日本	国債証券	470,000,000	99.74 468,778,900	99.97 469,877,800	0.100000 2028/06/20	1.06
17	149 5年国債	日本	国債証券	460,000,000	99.90 459,556,100	100.10 460,478,400	0.005000 2026/09/20	1.04
18	360 10年国債	日本	国債証券	460,000,000	98.73 454,194,800	98.90 454,940,000	0.100000 2030/09/20	1.02
19	151 5年国債	日本	国債証券	450,000,000	99.72 448,744,500	99.94 449,730,000	0.005000 2027/03/20	1.01
20	362 10年国債	日本	国債証券	450,000,000	98.50 443,250,000	98.40 442,827,000	0.100000 2031/03/20	1.00
21	154 5年国債	日本	国債証券	440,000,000	99.95 439,788,800	100.17 440,783,200	0.100000 2027/09/20	0.99
22	359 10年国債	日本	国債証券	440,000,000	98.73 434,445,200	99.07 435,938,800	0.100000 2030/06/20	0.98
23	364 10年国債	日本	国債証券	440,000,000	98.13 431,811,600	98.10 431,662,000	0.100000 2031/09/20	0.97
24	348 10年国債	日本	国債証券	430,000,000	99.95 429,793,600	100.17 430,765,400	0.100000 2027/09/20	0.97
25	356 10年国債	日本	国債証券	420,000,000	99.27 416,963,400	99.48 417,849,600	0.100000 2029/09/20	0.94
26	357 10年国債	日本	国債証券	420,000,000	99.30 417,063,000	99.37 417,354,000	0.100000 2029/12/20	0.94

27	345 10年国債	日本	国債証券	410,000,000	100.20 410,828,200	100.37 411,521,100	0.100000 2026/12/20	0.93
28	368 10年国債	日本	国債証券	400,000,000	99.52 398,084,000	100.37 401,488,000	0.200000 2032/09/20	0.90
29	439 2年国債	日本	国債証券	390,000,000	100.07 390,292,500	100.15 390,620,100	0.005000 2024/08/01	0.88
30	366 10年国債	日本	国債証券	390,000,000	100.13 390,534,300	99.04 386,256,000	0.200000 2032/03/20	0.87

(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	91.41%
地方債証券	3.79%
特殊債券	1.62%
社債券	2.63%
合計	99.45%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（2023年3月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	22,235,842,387	86.96
内 中国	8,994,171,920	35.17
内 台湾	3,535,042,816	13.82

	内 タイ	880,376,971	3.44
	内 マレーシア	168,487,801	0.66
	内 インドネシア	443,632,953	1.73
	内 インド	2,325,211,121	9.09
	内 サウジアラビア	549,237,257	2.15
	内 トルコ	339,838,660	1.33
	内 カナダ	22,599,685	0.09
	内 メキシコ	779,991,149	3.05
	内 チリ	103,295,857	0.40
	内 ブラジル	3,071,118,631	12.01
	内 南アフリカ	1,022,837,566	4.00
投資証券		1,899,905,433	7.43
	内 アメリカ	1,899,905,433	7.43
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,434,816,375	5.61
純資産総額		25,570,564,195	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1,432,433,060	5.60
内 アメリカ	1,432,433,060	5.60

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

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

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

(2) 投資資産 (2023年3月31日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	アメリカ	投資証券	-	771,600	2,415.55 1,863,844,321	2,462.29 1,899,905,433	7.43
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技術	464,000	2,027.59 940,803,820	2,342.76 1,087,042,960	4.25
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	中国	株式	一般消費 財・サービ ス	456,200	1,808.65 825,112,857	1,648.26 751,940,318	2.94

4	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	87,700	5,550.63 486,791,057	6,548.85 574,334,145	2.25
5	VALE SA	ブラジル	株式	素材	248,290	1,983.27 492,428,524	2,142.71 532,013,551	2.08
6	IND & COMM BK OF CHINA-H	中国	株式	金融	6,956,000	72.22 502,457,562	72.63 505,233,061	1.98
7	CHINA CONSTRUCTION BANK- H	中国	株式	金融	5,500,000	87.32 480,381,881	86.24 474,323,850	1.85
8	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	株式	金融	541,500	880.33 476,705,410	864.10 467,914,482	1.83
9	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	ブラジル	株式	エネル ギー	665,400	715.93 476,394,540	627.72 417,690,715	1.63
10	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	ブラジル	株式	エネル ギー	472,500	777.99 367,613,927	709.17 335,084,596	1.31
11	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	株式	エネル ギー	87,477	3,967.72 347,084,992	3,664.90 320,595,157	1.25
12	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国	株式	エネル ギー	3,521,800	61.66 217,179,575	80.28 282,755,461	1.11
13	BANK OF CHINA LTD-H	中国	株式	金融	5,310,000	52.16 277,042,578	51.37 272,775,762	1.07
14	JD.COM INC - CL A	中国	株式	一般消費 財・サービ ス	91,245	3,294.13 300,574,906	2,776.03 253,299,040	0.99
15	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	541,902	445.56 241,455,529	457.60 247,977,336	0.97
16	ITAU UNIBANCO HOLDING S- PREF	ブラジル	株式	金融	368,336	610.57 224,900,610	644.75 237,485,012	0.93
17	PETROCHINA CO LTD-H	中国	株式	エネル ギー	2,874,000	64.21 184,550,760	79.60 228,789,943	0.89
18	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	中国	株式	金融	4,224,000	49.02 207,103,601	49.49 209,084,198	0.82
19	BANCO BRADESCO SA-PREF	ブラジル	株式	金融	569,959	431.84 246,144,425	350.39 199,711,797	0.78
20	AMERICA MOVIL L	メキシコ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	1,382,100	145.18 200,657,158	142.64 197,155,487	0.77

21	BAIDU INC-CLASS A	中国	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	76,150	2,480.27 188,874,224	2,542.99 193,649,069	0.76
22	PTT PCL-NVDR	タイ	株式	エネル ギー	1,511,500	130.63 197,448,817	122.50 185,158,750	0.72
23	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	インド	株式	金融	39,674	3,757.95 149,092,940	4,269.00 169,368,385	0.66
24	INFOSYS LTD	インド	株式	情報技術	67,287	2,431.72 163,623,774	2,269.02 152,675,683	0.60
25	CHINA MERCHANTS BANK-H	中国	株式	金融	221,000	797.59 176,271,206	679.54 150,180,440	0.59
26	MEDIATEK INC	台湾	株式	情報技術	41,003	2,981.86 122,265,647	3,406.86 139,691,563	0.55
27	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	中国	株式	不動産	3,584,000	42.96 153,996,753	38.78 138,997,555	0.54
28	XIAOMI CORP-CLASS B	中国	株式	情報技術	590,400	217.71 128,539,759	206.50 121,918,427	0.48
29	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	メキシコ	株式	金融	109,300	900.95 98,475,027	1,101.39 120,382,659	0.47
30	CHINA RESOURCES LAND LTD	中国	株式	不動産	190,000	615.74 116,992,436	623.41 118,449,135	0.46

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	86.96%
投資証券	7.43%
合計	94.39%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	10.02%
素材	9.85%
資本財・サービス	3.48%
一般消費財・サービス	8.33%
生活必需品	4.08%
ヘルスケア	0.81%

金融	26.12%
情報技術	11.62%
コミュニケーション・サービス	6.93%
公益事業	2.59%
不動産	3.13%
合計	86.96%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	MSCI EMER MKT INDEX (ICE) JUN 23	買建	215	1,364,091,405	1,432,433,060	5.60%

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

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

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2023年3月31日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		291,744,515,914	92.43
	内 香港	2,535,826,725	0.80
	内 シンガポール	1,313,560,037	0.42
	内 イスラエル	643,831,930	0.20
	内 ノルウェー	639,709,291	0.20
	内 スウェーデン	3,250,727,271	1.03
	内 デンマーク	2,970,460,164	0.94
	内 イギリス	13,286,634,485	4.21
	内 アイルランド	695,421,422	0.22

	内 オランダ	4,103,860,925	1.30
	内 ベルギー	881,586,650	0.28
	内 フランス	11,125,273,901	3.52
	内 ドイツ	7,752,107,187	2.46
	内 スイス	8,793,466,672	2.79
	内 ポルトガル	195,331,181	0.06
	内 スペイン	2,360,436,151	0.75
	内 イタリア	2,232,836,987	0.71
	内 フィンランド	880,360,434	0.28
	内 オーストリア	162,128,046	0.05
	内 カナダ	10,239,432,226	3.24
	内 アメリカ	211,560,605,324	67.02
	内 オーストラリア	5,908,769,315	1.87
	内 ニュージーランド	212,149,590	0.07
投資証券		6,691,428,643	2.12
	内 香港	133,267,226	0.04
	内 シンガポール	138,529,933	0.04
	内 イギリス	122,568,829	0.04
	内 ベルギー	26,821,322	0.01
	内 フランス	109,325,562	0.03
	内 カナダ	27,448,945	0.01
	内 アメリカ	5,572,949,290	1.77
	内 オーストラリア	560,517,536	0.18
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		17,211,296,261	5.45
純資産総額		315,647,240,818	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	17,640,329,110	5.59
内 イギリス	1,035,028,141	0.33
内 ドイツ	3,524,147,854	1.12
内 カナダ	1,019,269,850	0.32
内 アメリカ	11,277,409,680	3.57
内 オーストラリア	784,473,585	0.25
為替予約取引(買建)	10,496,333,530	3.33
内 日本	10,496,333,530	3.33

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

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

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

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

(2) 投資資産（2023年3月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	722,400	18,933.48 13,677,556,416	21,679.93 15,661,582,010	4.96
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	321,700	32,298.23 10,390,354,668	37,929.19 12,201,822,514	3.87
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	417,100	12,400.39 5,172,255,440	13,620.06 5,680,927,026	1.80
4	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	111,680	21,300.97 2,378,903,475	36,564.51 4,083,525,582	1.29
5	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	271,300	12,745.70 3,457,921,856	13,471.84 3,654,910,653	1.16
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	248,740	12,778.01 3,178,429,759	13,529.25 3,365,268,033	1.07
7	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	122,050	24,409.95 2,979,239,573	26,075.73 3,182,543,872	1.01
8	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	102,100	15,026.39 1,534,200,012	27,752.87 2,833,568,558	0.90
9	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネル ギー	187,005	14,778.16 2,763,610,816	14,620.19 2,734,050,445	0.87
10	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	42,366	70,284.85 2,977,690,959	62,767.11 2,659,191,459	0.84

11	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	118,700	23,426.77 2,780,761,449	20,487.50 2,431,867,188	0.77
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	59,150	42,048.86 2,487,194,075	40,737.33 2,409,613,211	0.76
13	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	133,170	18,286.53 2,435,228,699	17,191.98 2,289,456,975	0.73
14	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	74,050	28,063.73 2,078,128,191	29,691.73 2,198,672,666	0.70
15	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	107,567	19,397.90 2,086,575,854	19,688.99 2,117,886,502	0.67
16	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	119,516	16,241.59 1,941,145,131	16,185.75 1,934,457,101	0.61
17	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	39,000	46,018.84 1,794,737,606	47,971.98 1,870,907,524	0.59
18	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	83,418	24,115.78 2,011,694,818	21,683.93 1,808,830,632	0.57
19	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービス	46,350	42,208.96 1,956,385,819	38,104.12 1,766,125,999	0.56
20	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	80,272	21,067.56 1,691,144,017	21,087.05 1,692,700,288	0.54
21	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	36,685	48,398.88 1,775,514,460	45,492.33 1,668,886,335	0.53
22	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	株式	ヘルスケア	78,258	17,314.04 1,354,962,540	21,116.97 1,652,572,308	0.52
23	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	115,221	14,523.52 1,673,421,947	14,143.49 1,629,627,937	0.52
24	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	17,728	81,927.57 1,452,414,293	90,885.56 1,611,219,279	0.51
25	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	19,012	70,617.47 1,342,581,348	84,624.63 1,608,883,608	0.51
26	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	186,650	8,328.53 1,554,539,035	8,258.83 1,541,510,713	0.49
27	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	62,600	24,322.48 1,522,594,920	24,146.22 1,511,553,992	0.48
28	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	フランス	株式	一般消費 財・サービス	12,180	103,231.69 1,257,362,005	120,510.44 1,467,817,159	0.47
29	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	255,013	6,564.20 1,673,980,067	5,391.94 1,375,015,152	0.44

30	THERMO FISHER	アメリカ	株式	ヘルスケア	17,800	72,362.57	75,173.38	0.42
	SCIENTIFIC INC					1,288,055,217	1,338,086,237	

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	92.43%
投資証券	2.12%
合計	94.55%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	5.01%
素材	4.09%
資本財・サービス	9.61%
一般消費財・サービス	9.43%
生活必需品	7.53%
ヘルスケア	12.91%
金融	14.40%
情報技術	19.73%
コミュニケーション・サービス	6.48%
公益事業	2.93%
不動産	0.30%
合計	92.43%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 EMINI JUN 23	買建	414	10,867,780,861	11,277,409,680	3.57%
	イギリス	FTSE 100 INDEX JUN 23	買建	82	1,018,213,950	1,035,028,141	0.33%

	オーストラリア	SPI 200 JUN 23	買建	49	771,806,711	784,473,585	0.25%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX JUN 23	買建	43	1,000,976,758	1,019,269,850	0.32%
	ドイツ	SWISS MKT IX JUN 23	買建	55	842,088,965	878,560,452	0.28%
		EURO STOXX 50 JUN 23	買建	429	2,533,693,604	2,645,587,402	0.84%
為替予約取引	日本	スイス・フラン買/円売 2023年4月	買建	4,100,000	591,774,790	598,982,120	0.19%
		豪ドル買/円売 2023年4月	買建	4,900,000	441,874,500	438,980,710	0.14%
		英ポンド買/円売 2023年4月	買建	3,600,000	584,976,080	595,181,520	0.19%
		米ドル買/円売 2023年4月	買建	49,800,000	6,606,699,850	6,639,231,420	2.10%
		ユーロ買/円売 2023年4月	買建	10,400,000	1,486,433,160	1,513,975,840	0.48%
		カナダ・ドル買/円売 2023年4月	買建	7,200,000	707,652,190	709,981,920	0.22%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（2023年3月31日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券		1,079,085,307	3.79
	内 アメリカ	1,079,085,307	3.79
投資証券		26,591,785,146	93.48
	内 ガーンジー	58,146,089	0.20
	内 韓国	63,435,881	0.22
	内 香港	415,831,053	1.46
	内 シンガポール	1,097,762,724	3.86

内 イスラエル	35,550,100	0.12
内 イギリス	1,294,103,458	4.55
内 アイルランド	8,897,876	0.03
内 オランダ	49,685,682	0.17
内 ベルギー	287,030,282	1.01
内 フランス	451,285,687	1.59
内 ドイツ	12,810,030	0.05
内 スペイン	103,126,459	0.36
内 イタリア	2,883,092	0.01
内 カナダ	483,290,378	1.70
内 アメリカ	20,266,862,516	71.24
内 オーストラリア	1,844,912,074	6.49
内 ニューージーランド	116,171,765	0.41
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	777,040,680	2.73
純資産総額	28,447,911,133	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	794,098,064	2.79
内 ドイツ	192,175,536	0.68
内 アメリカ	601,922,528	2.12
為替予約取引(買建)	361,962,735	1.27
内 日本	361,962,735	1.27

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

(注2) 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 (2023年3月31日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	147,471	15,252.46 2,249,311,850	16,279.97 2,400,824,577	8.44
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	14,784	89,896.93 1,329,037,374	93,739.39 1,385,843,220	4.87
3	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	99,400	11,153.89 1,108,701,286	10,855.98 1,079,085,307	3.79

4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	25,254	38,861.23 981,402,692	39,343.27 993,575,173	3.49
5	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	100,194	8,323.32 833,952,535	8,360.31 837,653,231	2.94
6	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	52,233	15,564.79 813,000,393	14,362.48 750,195,773	2.64
7	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	75,490	9,242.01 697,681,912	9,473.95 715,188,750	2.51
8	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	160,350	4,460.16 715,206,464	4,247.58 681,100,944	2.39
9	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	45,935	14,445.67 663,564,420	12,481.04 573,316,990	2.02
10	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	292,254	1,678.09 490,456,583	1,673.61 489,120,795	1.72
11	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	22,350	22,721.86 507,834,182	21,800.10 487,232,409	1.71
12	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	21,395	20,561.34 439,911,276	21,208.56 453,757,353	1.60
13	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	54,412	8,430.28 458,715,485	7,815.51 425,257,579	1.49
14	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	25,164	19,867.26 499,941,082	16,555.04 416,591,263	1.46
15	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	92,795	4,249.05 394,303,587	4,099.37 380,401,132	1.34
16	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	63,903	6,056.38 387,023,523	5,936.74 379,375,739	1.33
17	LINK REIT	香港	投資証券	431,900	880.94 380,487,790	857.30 370,269,598	1.30
18	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	19,793	19,240.60 380,829,355	18,610.07 368,349,236	1.29
19	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	18,449	21,462.54 395,963,808	19,826.53 365,779,733	1.29
20	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	33,649	10,446.71 351,524,017	10,295.16 346,421,940	1.22
21	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	46,445	7,158.40 332,475,946	6,915.51 321,191,266	1.13
22	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	10,321	28,571.01 294,881,869	27,264.15 281,393,348	0.99
23	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	アメリカ	投資証券	41,141	6,871.58 282,705,323	6,798.01 279,677,024	0.98

24	UDR INC	アメリカ	投資証券	49,406	5,422.51 267,907,024	5,325.17 263,095,665	0.92
25	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	87,354	3,364.02 293,867,324	2,896.26 253,000,394	0.89
26	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	200,537	1,334.08 267,536,309	1,259.91 252,658,893	0.89
27	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	98,809	2,984.79 294,927,687	2,511.69 248,178,496	0.87
28	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	27,950	8,735.26 244,154,120	8,775.59 245,277,785	0.86
29	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	17,595	15,505.90 272,828,107	13,781.63 242,487,803	0.85
30	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	114,233	2,459.48 280,959,970	2,108.43 240,853,278	0.85

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	3.79%
投資証券	93.48%
合計	97.27%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	アメリカ	DOW JONES US REAL ESTATE JUN 23	買建	139	600,494,285	601,922,528	2.12%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE JUN 23	買建	240	199,864,627	192,175,536	0.68%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2023年4 月	買建	1,980,000	266,385,816	263,991,030	0.93%

	ユーロ買/円売 2023年4月	買建	673,000	96,686,208	97,971,705	0.34%
--	-----------------	----	---------	------------	------------	-------

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2023年3月31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	29,837,520,486	96.53
内 中国	2,950,826,359	9.55
内 タイ	3,090,754,536	10.00
内 マレーシア	2,969,138,297	9.61
内 フィリピン	23,868,418	0.08
内 インドネシア	2,960,819,424	9.58
内 ポーランド	2,154,330,271	6.97
内 ハンガリー	937,758,355	3.03
内 ルーマニア	1,058,445,164	3.42
内 トルコ	345,308,462	1.12
内 チェコ	1,698,664,484	5.50
内 メキシコ	2,979,349,845	9.64
内 ドミニカ共和国	26,216,960	0.08
内 コロンビア	1,107,989,762	3.58
内 ペルー	675,437,340	2.19
内 チリ	654,266,236	2.12
内 ブラジル	3,052,976,775	9.88
内 ウルグアイ	30,412,060	0.10
内 エジプト	235,736,855	0.76
内 南アフリカ	2,885,220,883	9.33
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,073,950,584	3.47
純資産総額	30,911,471,070	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)		41,487,161	0.13
	内 日本	41,487,161	0.13

(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（2023年3月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	35,700,000	84.24 787,631,827	91.22 852,829,618	- 2024/01/01	2.76
2	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	65,650,000	106.10 521,749,262	106.36 523,016,382	10.500000 2026/12/21	1.69
3	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	23,700,000	68.90 427,663,926	73.19 454,265,774	- 2026/01/01	1.47
4	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	59,700,000	87.75 392,389,508	90.79 405,979,151	8.000000 2030/01/31	1.31
5	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	55,350,000	92.47 377,918,792	93.12 380,559,766	7.750000 2031/05/29	1.23
6	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	14,850,000	90.68 352,673,239	93.99 365,548,021	10.000000 2027/01/01	1.18
7	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	63,020,000	77.67 366,627,053	76.55 361,331,156	8.750000 2048/02/28	1.17
8	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	14,190,000	94.39 350,784,279	97.05 360,665,249	10.000000 2025/01/01	1.17
9	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	52,400,000	88.94 344,108,637	89.90 347,853,785	5.750000 2026/03/05	1.13
10	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	15,500,000	70.80 287,423,130	77.71 315,465,387	- 2025/07/01	1.02
11	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	47,200,000	84.54 298,890,814	86.81 306,915,333	8.250000 2032/03/31	0.99
12	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	44,200,000	84.00 278,110,857	85.36 282,607,661	8.875000 2035/02/28	0.91
13	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	12,400,000	79.42 257,933,112	86.49 280,883,818	- 2024/07/01	0.91

14	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	40,030,000	93.49 276,327,875	94.21 278,454,405	7.500000 2027/06/03	0.90
15	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	39,000,000	97.28 280,145,556	96.30 277,319,386	8.000000 2024/09/05	0.90
16	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	43,800,000	79.34 260,289,071	80.03 262,564,421	8.500000 2037/01/31	0.85
17	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	35,230,000	97.20 252,853,461	97.83 254,494,294	8.500000 2029/05/31	0.82
18	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	10,600,000	87.58 243,140,564	90.29 250,647,824	10.000000 2029/01/01	0.81
19	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	8,190,000	83.99 214,414,382	89.83 229,318,964	2.500000 2026/07/25	0.74
20	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	30,550,000	101.11 228,082,272	99.09 223,513,275	10.000000 2024/12/05	0.72
21	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	37,200,000	78.11 217,640,008	77.10 214,836,119	8.750000 2044/01/31	0.70
22	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	8,250,000	78.61 202,144,337	82.87 213,111,715	2.750000 2029/10/25	0.69
23	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	33,900,000	81.53 207,020,392	80.90 205,426,694	9.000000 2040/01/31	0.66
24	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	31,120,000	87.53 201,124,214	86.79 199,425,901	7.750000 2042/11/13	0.65
25	Thailand Government Bond	タイ	国債証券	51,000,000	94.08 188,102,117	97.87 195,679,696	2.000000 2031/12/17	0.63
26	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	29,300,000	89.44 193,504,390	88.48 191,431,886	8.000000 2047/11/07	0.62
27	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	6,950,000	81.27 176,055,933	86.29 186,939,154	2.750000 2028/04/25	0.60
28	Indonesia Treasury Bond	インドネシア	国債証券	20,800,000,000	95.83 177,417,904	99.48 184,162,929	6.500000 2031/02/15	0.60
29	THAILAND GOVERNMENT BOND	タイ	国債証券	48,000,000	93.84 176,587,966	96.26 181,124,697	1.000000 2027/06/17	0.59
30	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	6,150,000	89.74 172,034,366	94.28 180,741,036	3.250000 2025/07/25	0.58

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	96.53%
合計	96.53%

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	ルーマニア・レイ買/円 売 2023年4月	買建	652,000	18,990,282	19,153,804	0.06%
		チェコ・コルナ買/円売 2023年4月	買建	3,612,000	22,030,888	22,333,357	0.07%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2023年3月31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	239,552,296,651	97.66
内 ユーロ	81,068,524,956	33.05
内 中国	10,529,708,383	4.29
内 シンガポール	1,005,456,983	0.41
内 マレーシア	1,271,183,463	0.52
内 イスラエル	727,426,277	0.30
内 ノルウェー	473,302,678	0.19
内 スウェーデン	496,502,958	0.20
内 デンマーク	747,488,732	0.30
内 イギリス	11,612,725,010	4.73
内 ポーランド	1,074,568,758	0.44

	内 カナダ	4,519,715,411	1.84
	内 アメリカ	119,889,120,105	48.88
	内 メキシコ	1,935,929,454	0.79
	内 オーストラリア	3,738,743,609	1.52
	内 ニュージーランド	461,899,874	0.19
	コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,740,184,305	2.34
	純資産総額	245,292,480,956	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	1,246,171,519	0.51
内 日本	1,246,171,519	0.51

(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 (2023年3月31日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,400,000	85.43 1,186,418,322	87.31 1,212,512,221	1.875000 2032/02/15	0.49
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	82.21 1,174,649,789	83.78 1,197,124,357	1.125000 2031/02/15	0.49
3	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,300,000	92.98 1,154,702,277	94.65 1,175,415,985	2.875000 2032/05/15	0.48
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	81.65 1,123,063,145	83.42 1,147,448,260	1.250000 2031/08/15	0.47
5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	81.92 1,093,995,474	83.95 1,120,997,703	1.375000 2031/11/15	0.46
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	80.69 1,056,022,272	82.33 1,077,430,869	0.875000 2030/11/15	0.44
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,700,000	84.81 985,270,333	86.48 1,004,670,907	1.625000 2031/05/15	0.41
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	91.87 948,229,995	93.41 964,041,052	1.625000 2026/05/15	0.39

9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,500,000	92.85 929,959,670	94.37 945,172,075	0.375000 2024/09/15	0.39
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,500,000	91.84 919,784,684	93.58 937,230,378	2.750000 2032/08/15	0.38
11	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,700,000	102.85 920,221,257	104.51 935,044,492	4.125000 2032/11/15	0.38
12	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	6,086,000	100.09 887,721,034	99.16 879,420,100	2.250000 2024/05/25	0.36
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	79.30 847,114,320	81.10 866,374,687	0.625000 2030/08/15	0.35
14	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,899,000	102.76 883,396,071	100.19 861,287,100	2.750000 2027/10/25	0.35
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	94.46 845,087,334	95.89 857,934,522	2.875000 2028/08/15	0.35
16	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	89.29 834,658,641	90.93 849,959,844	1.125000 2026/10/31	0.35
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	94.65 821,527,301	96.08 833,982,312	2.875000 2028/05/15	0.34
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	92.84 818,223,502	94.40 832,015,815	2.625000 2029/02/15	0.34
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	85.09 795,391,474	86.98 813,029,452	0.750000 2028/01/31	0.33
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,350,000	94.24 799,092,525	95.67 811,260,112	2.750000 2028/02/15	0.33
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,400,000	93.27 797,103,596	94.66 809,033,700	2.375000 2027/05/15	0.33
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,162,000	96.29 792,301,996	97.27 800,406,693	2.375000 2024/08/15	0.33
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	90.33 784,058,115	92.01 798,674,309	0.250000 2025/06/30	0.33
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	90.21 783,042,620	91.77 796,573,882	1.500000 2027/01/31	0.32
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,921,000	95.78 757,337,653	96.77 765,101,650	2.250000 2024/11/15	0.31
26	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	93.37 748,069,777	94.91 760,456,020	2.750000 2029/05/31	0.31
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	94.50 736,925,364	95.72 746,454,705	2.250000 2025/11/15	0.30
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	94.82 732,867,803	96.00 741,979,960	2.125000 2025/05/15	0.30

29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,900,000	92.58 729,409,627	93.97 740,321,031	2.250000 2027/08/15	0.30
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,800,000	79.72 723,878,948	81.48 739,914,299	0.625000 2030/05/15	0.30

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.66%
合計	97.66%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	カナダ・ドル買/円売 2023年4月	買建	1,304,000	129,690,794	128,673,041	0.05%
		マレーシア・リングgit 買/円売 2023年4月	買建	1,500,000	45,315,000	45,330,150	0.02%
		米ドル買/円売 2023年4 月	買建	1,220,000	162,473,039	162,782,207	0.07%
		オフショア人民元買/円 売 2023年4月	買建	34,050,000	665,496,822	660,787,920	0.27%
		メキシコ・ペソ買/円売 2023年4月	買建	9,109,000	66,834,554	66,943,862	0.03%
		豪ドル買/円売 2023年4 月	買建	461,000	41,925,172	41,323,997	0.02%
		ユーロ買/円売 2023年4 月	買建	776,000	110,996,151	113,025,836	0.05%
		英ポンド買/円売 2023年 4月	買建	165,000	26,908,562	27,304,506	0.01%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

●iFree 8資産バランス

2023年3月31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	14,697円
純資産総額	508億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-0.6%
3カ月間	3.2%
6カ月間	2.5%
1年間	-2.0%
3年間	38.0%
5年間	29.3%
設定来	47.0%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期				
	17年9月	18年9月	19年9月	20年9月	21年9月	22年9月				
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円				

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

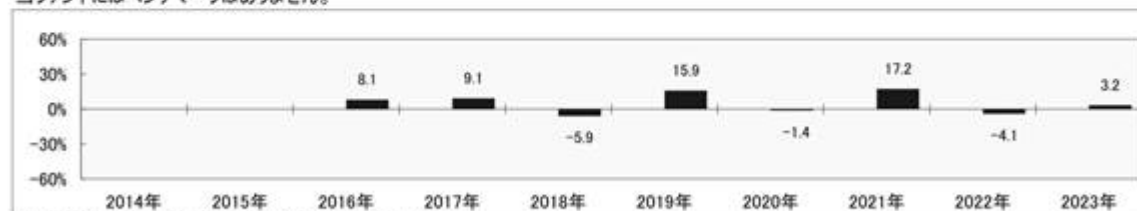
マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
トピックス・インデックス・MF	12.6%	外国債券	1,167	24.1%	日本円	38.2%	PROLOGIS INC	アメリカ	1.0%
外国株式INDEXMF	12.5%	外国株式・先物	1,641	23.8%	米ドル	25.9%	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	アメリカ	0.9%
ダイワ新興国債券インデックス・MF	12.5%	国内株式・先物	2,141	12.5%	ユーロ	6.0%	日本ビルファンド	日本	0.8%
ダイワ新興国株式 F-INDEX・MF	12.5%	国内債券	287	12.3%	香港ドル	4.0%	MSCI EMER MKT INDEX (GCE) JUN 23	アメリカ	0.7%
外国債券INDEXMF	12.4%	国内リート・先物	61	12.1%	ブラジル・レアル	2.9%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.6%
日本債券インデックスMF(BPD)	12.4%	外国リート・先物	327	11.9%	オフショア人民元	2.3%	APPLE INC	アメリカ	0.6%
ダイワJ-REIT MF	12.1%	外国投資信託等	9	1.4%	英ポンド	1.8%	EQUINIX INC	アメリカ	0.6%
ダイワ・グローバルREIT INDEX MF	12.1%				台湾ドル	1.8%	日本都市ファンド投資法人	日本	0.6%
					メキシコ・ペソ	1.7%	野村不動産マスターF	日本	0.6%
		コール・ローン、その他		4.1%	その他	15.4%	日本プロロジスリート	日本	0.6%
合計	99.0%	合計	5,654	-	合計	100.0%	合計		7.0%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2016年は設定日(9月8日)から年末、2023年は3月31日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

(参考情報) ファンドの総経費率

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

※対象期間は2021年9月8日～2022年9月7日です。

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。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。

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

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

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

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

毎年9月8日から翌年9月7日までとします。

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

(5)【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2.の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 前2.から前4.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2.から前4.までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
6. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
8. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更等

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

3. 前2. の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2. の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前2. から前5. までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1. から前6. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1. から前7. までの規定にしたがいます。

反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書(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。

公告

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

関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

< 収益分配金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6期計算期間（2021年9月8日から2022年9月7日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

iFree 8資産バランス

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 2021年9月7日現在	第6期 2022年9月7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	411,799,652	518,647,063
親投資信託受益証券	34,212,125,313	45,128,094,473
流動資産合計	34,623,924,965	45,646,741,536
資産合計	34,623,924,965	45,646,741,536
負債の部		
流動負債		
未払解約金	30,424,438	15,502,315
未払受託者報酬	3,434,031	4,643,907
未払委託者報酬	34,340,657	46,439,355
その他未払費用	1,190,017	1,106,352
流動負債合計	69,389,143	67,691,929
負債合計	69,389,143	67,691,929
純資産の部		
元本等		
元本	1 23,584,320,551	1 30,252,717,145
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	10,970,215,271	15,326,332,462
（分配準備積立金）	5,671,819,546	6,473,943,266
元本等合計	34,554,535,822	45,579,049,607
純資産合計	34,554,535,822	45,579,049,607
負債純資産合計	34,623,924,965	45,646,741,536

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自	2020年9月8日	自	2021年9月8日
	至	2021年9月7日	至	2022年9月7日
営業収益				
受取利息		138		117
有価証券売買等損益		5,749,147,475		1,386,390,160
その他収益		-		378
営業収益合計		5,749,147,613		1,386,390,655
営業費用				
支払利息		90,137		88,837
受託者報酬		6,144,948		8,638,589
委託者報酬		61,450,224		86,386,630
その他費用		2,201,591		2,199,095
営業費用合計		69,886,900		97,313,151
営業利益		5,679,260,713		1,289,077,504
経常利益		5,679,260,713		1,289,077,504
当期純利益		5,679,260,713		1,289,077,504
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		381,979,171		5,509,644
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,648,948,547		10,970,215,271
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,764,859,107		4,177,530,659
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,764,859,107		4,177,530,659
剰余金減少額又は欠損金増加額		740,873,925		1,116,000,616
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		740,873,925		1,116,000,616
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		10,970,215,271		15,326,332,462

(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6期	
	自 2021年9月8日	至 2022年9月7日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
1. 1 期首元本額	18,838,006,602円	23,584,320,551円
期中追加設定元本額	8,347,815,842円	9,073,700,420円
期中一部解約元本額	3,601,501,893円	2,405,303,826円
2. 計算期間末日における受益権の総数	23,584,320,551口	30,252,717,145口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第5期	第6期
	自 2020年9月8日 至 2021年9月7日	自 2021年9月8日 至 2022年9月7日

1 分配金の計算過程	<p>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(5,167,194,273円)、投資信託約款に規定される収益調整金(5,298,479,837円)及び分配準備積立金(504,625,273円)より分配対象額は10,970,299,383円(1万口当たり4,651.52円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(1,294,595,123円)、投資信託約款に規定される収益調整金(8,852,473,979円)及び分配準備積立金(5,179,348,143円)より分配対象額は15,326,417,245円(1万口当たり5,066.13円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	--	--

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第6期 自 2021年9月8日 至 2022年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第6期
	2022年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第5期	第6期
	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	5,635,039,183	1,374,333,643
合計	5,635,039,183	1,374,333,643

（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5期	第6期
2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第6期
自 2021年9月8日
至 2022年9月7日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第5期	第6期
	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4651円 (14,651円)	1.5066円 (15,066円)
---------------------------	----------------------	----------------------

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益 証券	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド	2,879,253,653	5,836,535,079	
	ダイワ新興国債券インデックス・マ ザーファンド	3,823,114,293	5,748,052,339	
	トピックス・インデックス・マザー ファンド	4,107,777,908	5,447,324,283	
	外国株式インデックスマザーファンド	1,304,789,990	5,622,079,108	
	外国債券インデックスマザーファンド	1,749,743,615	5,673,893,620	
	ダイワJ-REITマザーファンド	1,629,952,741	5,624,477,923	
	ダイワ・グローバルREITインデッ クス・マザーファンド	1,670,709,367	5,630,123,495	
	ダイワ日本債券インデックスマザー ファンド(BPI)	4,429,046,104	5,545,608,626	
親投資信託受益証券 合計			45,128,094,473	
合計			45,128,094,473	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)」受益証券、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」受益証券、「ダイワ」-REITマザーファンド」受益証券及び「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	12,994,807,885	12,330,157,483
株式	2 3 189,788,890,350	187,268,579,370
派生商品評価勘定	146,211,950	146,700
未収入金	12,646,800	-
未収配当金	102,946,124	119,145,822
未収利息	1,025,745	694,750
前払金	-	12,615,000
その他未収収益	4 4,435,797	7,667,503
差入委託証拠金	-	35,820,000
流動資産合計	203,050,964,651	199,774,826,628
資産合計	203,050,964,651	199,774,826,628
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	31,688,250
前受金	134,453,500	-
未払解約金	452,261,100	33,328,030
受入担保金	9,924,137,895	6,307,055,790
流動負債合計	10,510,852,495	6,372,072,070
負債合計	10,510,852,495	6,372,072,070
純資産の部		

元本等			
元本	1	138,110,552,502	145,845,153,885
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		54,429,559,654	47,557,600,673
元本等合計		192,540,112,156	193,402,754,558
純資産合計		192,540,112,156	193,402,754,558
負債純資産合計		203,050,964,651	199,774,826,628

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9月8日 至 2022年9月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
1. 1 期首	2020年9月8日	2021年9月8日
期首元本額	145,237,517,692円	138,110,552,502円
期中追加設定元本額	20,022,399,043円	21,860,168,849円
期中一部解約元本額	27,149,364,233円	14,125,567,466円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	112,903,062円	205,919,431円
iFree TOPIXイン デックス	4,179,535,750円	6,016,503,572円
iFree 8資産バランス	3,197,005,271円	4,107,777,908円
iFree 年金バランス	442,601,861円	739,333,771円
DCダイワ日本株式インデッ クス	65,744,715,587円	68,872,398,480円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,911,072,949円	3,258,351,019円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,953,569,925円	4,647,636,589円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	3,760,977,295円	4,614,321,177円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	5,859,678,861円	6,616,170,343円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	52,356,678円	59,300,522円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	53,333,164円	68,797,227円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	1,308,591,695円	2,343,262,160円
ダイワつみたてインデックス バランス30	9,810,933円	12,113,839円
ダイワつみたてインデックス バランス50	8,690,476円	10,132,276円
ダイワつみたてインデックス バランス70	17,428,664円	25,524,777円
ダイワ国内株式インデックス (ラップ専用)	- 円	861,004,190円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	113,101,715円	80,584,476円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	130,262,046円	44,620,861円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	6,250,599,539円	5,379,500,249円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	570,082,799円	495,554,875円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	82,764,931円	70,111,584円

	ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専用)	147,596,159円	110,064,644円
	ダイワ・ノーロードTOP IXファンド	179,598,319円	217,095,115円
	ダイワファンドラップTOP PIXインデックス	10,238,504,982円	11,504,859,511円
	ダイワTOPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	2,518,929,016円	1,659,739,755円
	ダイワファンドラップオンラ インTOPIXインデック ス	2,631,610,906円	3,221,121,856円
	ダイワ・インデックスセレク トTOPIX	1,222,729,074円	1,205,170,804円
	ダイワライフスタイル25	158,275,910円	135,770,055円
	ダイワライフスタイル50	620,574,149円	558,491,615円
	ダイワライフスタイル75	496,136,802円	423,357,277円
	DC・ダイワ・トピックス・ インデックス(確定拠出年金 専用ファンド)	10,668,527,372円	8,843,092,864円
	計	138,110,552,502円	145,845,153,885円
2.	期末日における受益権の総数	138,110,552,502口	145,845,153,885口
3.	2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以 下のとおり有価証券の貸付を 行っております。 株式 9,613,970,350円	株券貸借取引契約により、以 下のとおり有価証券の貸付を 行っております。 株式 5,953,773,350円
4.	3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 株式 984,520,000円	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 株式 844,940,000円
5.	4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相 当額の未入金分3,169,649円が 含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相 当額の未入金分6,664,970円が 含まれております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年9月8日 至 2022年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	36,346,847,074	12,946,123,641
合計	36,346,847,074	12,946,123,641

（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9月24日から2021年9月7日まで、及び2021年9月22日から2022年9月7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

株式関連

種 類	2021年9月7日 現在				2022年9月7日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	2,350,556,500	-	2,496,835,000	146,278,500	6,123,945,000	-	6,092,580,000	31,365,000
合計	2,350,556,500	-	2,496,835,000	146,278,500	6,123,945,000	-	6,092,580,000	31,365,000

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

（1口当たり情報）

	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
1口当たり純資産額	1.3941円	1.3261円
（1万口当たり純資産額）	（13,941円）	（13,261円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	3,300	3,535.00	11,665,500	
日本水産	96,700	537.00	51,927,900	
マルハニチロ	13,800	2,401.00	33,133,800	
雪国まいたけ	7,500	966.00	7,245,000	
カネコ種苗	3,000	1,545.00	4,635,000	
サカタのタネ	11,300	5,050.00	57,065,000	貸付株式数 4,400株
ホクト	7,900	1,891.00	14,938,900	貸付株式数 1,300株
ホクリヨウ	1,300	614.00	798,200	貸付株式数 100株
ショーボンドHD	12,100	5,980.00	72,358,000	
ミライト・ワン	33,500	1,520.00	50,920,000	
タマホーム	6,300	2,298.00	14,477,400	貸付株式数 2,500株
サンヨーホームズ	1,800	692.00	1,245,600	貸付株式数 400株
日本アクア	4,200	676.00	2,839,200	
ファーストコーポレーション	2,600	737.00	1,916,200	貸付株式数 100株
ベステラ	2,100	1,101.00	2,312,100	貸付株式数 800株
キャンディル	1,500	588.00	882,000	貸付株式数 700株
住石ホールディングス	18,600	275.00	5,115,000	貸付株式数 7,100株
日鉄鉱業	2,000	5,760.00	11,520,000	
三井松島HLDGS	4,400	3,605.00	15,862,000	貸付株式数 1,700株
INPEX	329,600	1,500.00	494,400,000	貸付株式数 146,700株
石油資源開発	12,300	3,815.00	46,924,500	
K&Oエナジーグループ	4,000	1,658.00	6,632,000	
ダイセキ環境ソリューション	2,000	908.00	1,816,000	貸付株式数 700株
第一カッター興業	2,200	1,246.00	2,741,200	
明豊ファシリティワークス	3,400	656.00	2,230,400	貸付株式数 1,100株
安藤・間	47,200	869.00	41,016,800	
東急建設	28,000	663.00	18,564,000	
コムシスホールディングス	33,400	2,535.00	84,669,000	

ビーアールホールディングス	12,800	338.00	4,326,400	貸付株式数	4,900株
高松コンストラクシヨンG P	6,900	1,900.00	13,110,000		
東建コーポレーション	2,900	8,320.00	24,128,000	貸付株式数	1,100株
ソネック	1,100	1,050.00	1,155,000	貸付株式数	300株
ヤマウラ	4,800	955.00	4,584,000	貸付株式数	1,800株
オリエンタル白石	35,000	248.00	8,680,000		
大成建設	66,600	4,180.00	278,388,000		
大林組	222,600	953.00	212,137,800		
清水建設	205,900	753.00	155,042,700		
飛島建設	6,200	1,063.00	6,590,600		
長谷工コーポレーション	64,300	1,597.00	102,687,100		
松井建設	8,000	573.00	4,584,000	貸付株式数	400株
銭高組	900	3,195.00	2,875,500	貸付株式数	300株
鹿島建設	163,100	1,449.00	236,331,900		
不動テトラ	5,000	1,521.00	7,605,000		
大末建設	2,600	1,525.00	3,965,000		
鉄建建設	4,700	1,777.00	8,351,900		
西松建設	14,500	4,020.00	58,290,000	貸付株式数	5,700株
三井住友建設	53,500	448.00	23,968,000	貸付株式数	400株
大豊建設	3,500	4,030.00	14,105,000	貸付株式数	1,000株
佐田建設	4,900	430.00	2,107,000	貸付株式数	1,800株
ナカノフドー建設	5,400	301.00	1,625,400	貸付株式数	1,500株
奥村組	11,800	2,907.00	34,302,600	貸付株式数	4,200株
東鉄工業	9,500	2,307.00	21,916,500		
イチケン	1,700	1,812.00	3,080,400	貸付株式数	200株
富士ピー・エス	3,500	468.00	1,638,000	貸付株式数	1,100株
浅沼組	5,200	2,817.00	14,648,400	貸付株式数	200株
戸田建設	91,800	681.00	62,515,800		
熊谷組	11,800	2,621.00	30,927,800		
北野建設	1,400	2,399.00	3,358,600	貸付株式数	400株
植木組	2,100	1,254.00	2,633,400	貸付株式数	800株
矢作建設	10,100	758.00	7,655,800	貸付株式数	300株
ピーエス三菱	7,800	644.00	5,023,200		
日本ハウスHLDGS	12,600	439.00	5,531,400	貸付株式数	5,700株
大東建託	24,600	14,080.00	346,368,000		
新日本建設	10,500	715.00	7,507,500		
東亜道路	1,300	5,810.00	7,553,000		
日本道路	2,100	5,930.00	12,453,000		

東亜建設	5,300	2,366.00	12,539,800	
日本国土開発	18,800	597.00	11,223,600	
若築建設	3,800	2,267.00	8,614,600	
東洋建設	27,100	864.00	23,414,400	
五洋建設	88,200	713.00	62,886,600	貸付株式数 700株
世紀東急	10,800	758.00	8,186,400	
福田組	2,400	4,580.00	10,992,000	貸付株式数 800株
日本ドライケミカル	1,700	1,565.00	2,660,500	貸付株式数 200株
住友林業	47,800	2,269.00	108,458,200	
日本基礎技術	5,900	501.00	2,955,900	貸付株式数 2,300株
巴コーポレーション	9,600	424.00	4,070,400	貸付株式数 200株
大和ハウス	189,700	3,055.00	579,533,500	
ライト工業	13,200	1,876.00	24,763,200	
積水ハウス	227,600	2,468.00	561,716,800	
日特建設	5,100	921.00	4,697,100	
北陸電気工事	4,100	740.00	3,034,000	
ユアテック	13,900	731.00	10,160,900	
日本リーテック	4,600	810.00	3,726,000	貸付株式数 1,800株
四電工	2,300	1,848.00	4,250,400	
中電工	9,200	2,129.00	19,586,800	
関電工	39,100	827.00	32,335,700	
きんでん	48,800	1,505.00	73,444,000	
東京エネシス	7,000	1,013.00	7,091,000	
トーエネック	2,400	3,405.00	8,172,000	
住友電設	5,900	2,603.00	15,357,700	
日本電設工業	10,200	1,752.00	17,870,400	
エクシオグループ	33,000	2,110.00	69,630,000	
新日本空調	5,200	1,834.00	9,536,800	貸付株式数 1,200株
日本工営	4,600	3,680.00	16,928,000	
九電工	15,200	2,806.00	42,651,200	
三機工業	15,600	1,653.00	25,786,800	貸付株式数 100株
日揮ホールディングス	67,900	1,918.00	130,232,200	
中外炉工業	2,200	1,570.00	3,454,000	
ヤマト	5,900	767.00	4,525,300	
太平電業	4,300	3,475.00	14,942,500	
高砂熱学	18,200	1,610.00	29,302,000	
三晃金属	1,000	2,662.00	2,662,000	貸付株式数 200株
NEC ネットズエスアイ	24,800	1,693.00	41,986,400	
朝日工業社	2,900	1,862.00	5,399,800	
明星工業	12,000	731.00	8,772,000	貸付株式数 200株

大 気 社	10,000	3,195.00	31,950,000	
ダイダン	4,400	2,237.00	9,842,800	
日比谷総合設備	6,400	1,855.00	11,872,000	
ニッポン	18,600	1,542.00	28,681,200	
日清製粉G本社	72,300	1,517.00	109,679,100	
日東富士製粉	1,100	4,535.00	4,988,500	
昭和産業	6,000	2,496.00	14,976,000	
鳥越製粉	5,400	645.00	3,483,000	
中部飼料	7,800	1,054.00	8,221,200	貸付株式数 3,100株
フィード・ワン	8,900	694.00	6,176,600	
東洋精糖	1,000	884.00	884,000	貸付株式数 300株
日本甜菜糖	3,900	1,609.00	6,275,100	
DM三井製糖ホールディ	6,100	1,851.00	11,291,100	
塩水港精糖	7,900	204.00	1,611,600	貸付株式数 3,200株
日新製糖	3,500	1,756.00	6,146,000	
L I F U L L	22,500	166.00	3,735,000	貸付株式数 7,500株
ミクシィ	16,700	2,303.00	38,460,100	
ジェイエシーリクルート メント	6,000	1,937.00	11,622,000	
日本M&Aセンターホール デ	119,800	1,642.00	196,711,600	
メンバーズ	1,900	2,558.00	4,860,200	貸付株式数 700株
中広	1,100	402.00	442,200	貸付株式数 400株
UTグループ	10,500	2,690.00	28,245,000	
アイティメディア	3,400	1,684.00	5,725,600	貸付株式数 1,200株
E・Jホールディングス	4,200	1,290.00	5,418,000	貸付株式数 1,500株
夢真ビーネックスグルー フ	23,900	1,604.00	38,335,600	
コシダカホールディング ス	19,500	824.00	16,068,000	貸付株式数 6,100株
アルトナー	1,900	951.00	1,806,900	
パソナグループ	7,900	1,991.00	15,728,900	
C D S	1,900	1,740.00	3,306,000	
リンクアンドモチベーシ ョン	18,900	649.00	12,266,100	貸付株式数 6,400株
エス・エム・エス	24,900	2,933.00	73,031,700	
サニーサイドアップG	2,500	605.00	1,512,500	貸付株式数 100株
パーソルホールディング ス	73,100	2,765.00	202,121,500	
リニカル	4,200	736.00	3,091,200	貸付株式数 500株
クックパッド	17,700	206.00	3,646,200	貸付株式数 5,200株
エスクリ	3,500	371.00	1,298,500	貸付株式数 1,300株

アイ・ケイ・ケイホールディング	3,700	592.00	2,190,400	貸付株式数	1,300株
森永製菓	15,500	3,830.00	59,365,000		
中村屋	1,600	3,075.00	4,920,000	貸付株式数	600株
江崎グリコ	17,900	3,485.00	62,381,500	貸付株式数	1,700株 (1,700株)
名糖産業	2,800	1,620.00	4,536,000	貸付株式数	1,200株
井村屋グループ	3,800	2,203.00	8,371,400	貸付株式数	1,500株
不二家	4,400	2,346.00	10,322,400		
山崎製パン	42,000	1,634.00	68,628,000		
第一屋製パン	600	461.00	276,600	貸付株式数	300株
モロゾフ	2,300	3,515.00	8,084,500		
亀田製菓	4,000	4,450.00	17,800,000	貸付株式数	1,500株
寿スピリッツ	6,700	7,840.00	52,528,000	貸付株式数	2,600株
カルビー	35,000	2,702.00	94,570,000		
森永乳業	13,000	3,980.00	51,740,000		
六甲バター	4,500	1,409.00	6,340,500	貸付株式数	1,000株
ヤクルト	48,800	7,930.00	386,984,000		
明治ホールディングス	42,300	6,370.00	269,451,000		
雪印メグミルク	16,900	1,650.00	27,885,000		
プリマハム	9,600	2,065.00	19,824,000		
日本ハム	26,900	3,870.00	104,103,000		
林兼産業	1,700	466.00	792,200	貸付株式数	400株
丸大食品	6,800	1,505.00	10,234,000	貸付株式数	2,600株
S Foods	6,900	2,915.00	20,113,500	貸付株式数	2,400株
柿安本店	2,700	2,235.00	6,034,500	貸付株式数	300株
伊藤ハム米久HLDGS	48,500	655.00	31,767,500		
学情	3,000	1,140.00	3,420,000	貸付株式数	1,100株
スタジオアリス	3,300	2,113.00	6,972,900	貸付株式数	1,300株 (100株)
クロスキャット	4,100	1,393.00	5,711,300	貸付株式数	1,600株
シミックホールディングス	3,700	1,619.00	5,990,300	貸付株式数	1,400株
エプロ	1,600	626.00	1,001,600	貸付株式数	600株
システナ	107,000	423.00	45,261,000		
NJS	1,300	1,921.00	2,497,300		
デジタルアーツ	4,000	6,150.00	24,600,000		
日鉄ソリューションズ	13,000	3,700.00	48,100,000		
総合警備保障	26,700	3,530.00	94,251,000		
キューブシステム	3,900	1,013.00	3,950,700	貸付株式数	1,500株 (200株)

いちご	84,400	295.00	24,898,000		
WOW WORLD	1,000	845.00	845,000		
日本駐車場開発	75,800	158.00	11,976,400	貸付株式数	29,400株
コア	3,100	1,421.00	4,405,100	貸付株式数	600株
カカクコム	53,600	2,471.00	132,445,600		
アイロムグループ	2,700	2,376.00	6,415,200		
セントケア・ホールディング	4,800	832.00	3,993,600		
サイネックス	1,200	599.00	718,800	貸付株式数	200株
ルネサンス	5,100	936.00	4,773,600	貸付株式数	1,900株
ディップ	12,900	3,350.00	43,215,000	貸付株式数	4,000株
SBSホールディングス	5,600	2,873.00	16,088,800		
デジタルホールディングス	5,100	1,291.00	6,584,100		
新日本科学	9,000	2,466.00	22,194,000	貸付株式数	3,100株
キャリアデザインセンター	1,600	1,521.00	2,433,600		
ベネフィット・ワン	26,400	1,979.00	52,245,600		
エムスリー	128,900	4,204.00	541,895,600		
ツカダ・グローバルHOLD	4,600	343.00	1,577,800	貸付株式数	1,800株
プラス	1,000	939.00	939,000		
アウトソーシング	38,900	1,159.00	45,085,100		
ウェルネット	6,700	588.00	3,939,600	貸付株式数	2,500株
ワールドホールディングス	2,900	2,636.00	7,644,400	貸付株式数	1,000株
ディー・エヌ・エー	27,900	1,854.00	51,726,600		
博報堂DYHLDGS	92,400	1,210.00	111,804,000		
ぐるなび	10,600	433.00	4,589,800	貸付株式数	100株
タカミヤ	8,800	399.00	3,511,200		
ジャパンベストレスキュー	4,100	723.00	2,964,300	貸付株式数	900株
ファンコミュニケーションズ	12,800	403.00	5,158,400	貸付株式数	2,400株
ライク	2,400	2,150.00	5,160,000	貸付株式数	900株
ビジネス・ブレークスルー	2,500	405.00	1,012,500	貸付株式数	1,000株
エスプール	18,800	1,026.00	19,288,800		
WDBホールディングス	3,400	2,556.00	8,690,400	貸付株式数	800株
手間いらず	1,100	4,600.00	5,060,000	貸付株式数	400株
ティア	4,100	439.00	1,799,900	貸付株式数	500株
CDG	600	1,272.00	763,200	貸付株式数	200株
アドウェイズ	9,000	750.00	6,750,000	貸付株式数	4,300株
バリューコマース	4,900	2,398.00	11,750,200	貸付株式数	2,200株

インフォマート	67,800	387.00	26,238,600		
サッポロホールディングス	20,700	2,996.00	62,017,200		
アサヒグループホールディングン	144,400	4,539.00	655,431,600	貸付株式数	63,600株
キリンHD	282,100	2,193.50	618,786,350		
宝ホールディングス	42,700	1,066.00	45,518,200		
オエノンホールディングス	17,500	277.00	4,847,500	貸付株式数	1,300株
養命酒	2,000	1,789.00	3,578,000	貸付株式数	700株
コカ・コーラボトラーズJHD	48,900	1,365.00	66,748,500		
サントリー食品インター	44,000	4,980.00	219,120,000	貸付株式数	18,000株
ダイドーグループHD	3,900	4,605.00	17,959,500	貸付株式数	1,500株
伊藤園	23,300	5,750.00	133,975,000	貸付株式数	9,300株
キーコーヒー	7,000	2,082.00	14,574,000		
ユニカフェ	2,000	921.00	1,842,000	貸付株式数	800株
ジャパンフーズ	1,100	1,104.00	1,214,400	貸付株式数	300株
日清オイリオグループ	8,700	3,180.00	27,666,000		
不二製油グループ	16,600	2,334.00	38,744,400	貸付株式数	100株
かどや製油	700	3,550.00	2,485,000	貸付株式数	100株
J-オイルミルズ	6,800	1,551.00	10,546,800	貸付株式数	200株
ローソン	16,700	4,670.00	77,989,000		
サンエー	5,100	4,120.00	21,012,000		
カワチ薬品	5,800	2,062.00	11,959,600	貸付株式数	300株
エービーシー・マート	11,800	6,050.00	71,390,000		
ハードオフコーポレーション	3,200	1,237.00	3,958,400		
高千穂交易	2,700	2,237.00	6,039,900	貸付株式数	1,000株
アスクル	16,200	1,805.00	29,241,000	貸付株式数	4,200株
ゲオホールディングス	9,100	1,678.00	15,269,800		
アダストリア	8,200	2,075.00	17,015,000	貸付株式数	3,600株
ジーフット	4,900	303.00	1,484,700	貸付株式数	1,800株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	800	388.00	310,400	貸付株式数	300株
オルバヘルスケアHLDGS	1,200	1,481.00	1,777,200		
伊藤忠食品	1,500	4,915.00	7,372,500		
くら寿司	7,900	2,824.00	22,309,600	貸付株式数	3,100株
キャンドウ	2,400	2,104.00	5,049,600	貸付株式数	1,200株
エレマテック	5,900	1,329.00	7,841,100		
アイケイ	2,300	427.00	982,100	貸付株式数	900株

パルグループHLDGS	6,700	2,360.00	15,812,000		
エディオン	34,400	1,163.00	40,007,200	貸付株式数	7,100株
あらた	5,500	4,100.00	22,550,000	貸付株式数	1,900株
サーラコーポレーション	14,400	810.00	11,664,000		
ワッツ	3,600	673.00	2,422,800	貸付株式数	1,400株
トーメンデバイス	1,100	5,580.00	6,138,000	貸付株式数	400株
ハローズ	3,400	2,999.00	10,196,600	貸付株式数	700株
J Pホールディングス	17,900	267.00	4,779,300	貸付株式数	1,200株
フジオフードG本社	5,700	1,272.00	7,250,400	貸付株式数	2,200株
あみやき亭	1,800	2,884.00	5,191,200	貸付株式数	600株
東京エレクトロニクス	2,200	5,710.00	12,562,000	貸付株式数	200株
ひらまつ	15,500	180.00	2,790,000	貸付株式数	6,200株
フィールズ	6,600	1,392.00	9,187,200	貸付株式数	2,500株
双日	77,200	2,299.00	177,482,800		
アルフレッサホールディングス	78,100	1,650.00	128,865,000		
大黒天物産	2,400	5,680.00	13,632,000	貸付株式数	900株
ハニーズホールディングス	6,100	1,209.00	7,374,900	貸付株式数	2,100株
ファーマライズHD	1,300	651.00	846,300	貸付株式数	500株
キッコーマン	46,000	8,410.00	386,860,000		
味の素	152,900	3,800.00	581,020,000		
ブルドックソ - ス	2,800	1,815.00	5,082,000	貸付株式数	1,100株
キューピー	33,600	2,207.00	74,155,200		
ハウス食品G本社	24,000	2,883.00	69,192,000		
カゴメ	29,200	2,945.00	85,994,000		
焼津水産化工	3,100	874.00	2,709,400	貸付株式数	1,200株
アリアケジャパン	7,000	4,465.00	31,255,000		
ピエトロ	900	1,772.00	1,594,800	貸付株式数	300株
エバラ食品工業	1,700	3,065.00	5,210,500	貸付株式数	500株
やまみ	700	1,435.00	1,004,500		
ニチレイ	28,600	2,425.00	69,355,000		
横浜冷凍	18,700	912.00	17,054,400	貸付株式数	6,900株
東洋水産	34,300	5,700.00	195,510,000	貸付株式数	1,100株
イトアンドHLDGS	3,000	2,051.00	6,153,000	貸付株式数	1,100株
大冷	600	1,912.00	1,147,200	貸付株式数	300株
ヨシムラ・フード・HLDGS	3,800	479.00	1,820,200	貸付株式数	1,500株
日清食品HD	24,800	9,720.00	241,056,000		
永谷園ホールディングス	3,300	1,971.00	6,504,300		
一正蒲鉾	3,000	768.00	2,304,000	貸付株式数	700株

フジッコ	7,100	1,875.00	13,312,500		
ロックフィールド	7,700	1,440.00	11,088,000	貸付株式数	2,900株
日本たばこ産業	411,200	2,371.50	975,160,800	貸付株式数	144,800株
ケンコーマヨネーズ	3,900	1,506.00	5,873,400	貸付株式数	100株
わらべや日洋HD	4,700	2,185.00	10,269,500		
なとり	4,300	2,010.00	8,643,000	貸付株式数	1,500株
イフジ産業	1,200	909.00	1,090,800	貸付株式数	400株
ファーマフーズ	9,700	1,291.00	12,522,700	貸付株式数	3,800株
北の達人コーポ	27,100	229.00	6,205,900	貸付株式数	10,700株 (2,600株)
ユーグレナ	40,200	916.00	36,823,200	貸付株式数	15,300株
紀文食品	5,900	968.00	5,711,200	貸付株式数	2,300株
ピクルスホールディングス	3,700	1,095.00	4,051,500		
スター・マイカ・HLDGS	3,400	1,479.00	5,028,600		
SREホールディングス	1,900	2,967.00	5,637,300	貸付株式数	700株
ADワークスグループ	21,200	158.00	3,349,600	貸付株式数	5,300株
片倉工業	6,000	1,993.00	11,958,000	貸付株式数	500株
グンゼ	4,400	3,840.00	16,896,000	貸付株式数	600株
ヒューリック	147,000	1,065.00	156,555,000	貸付株式数	63,100株
神栄	1,100	797.00	876,700	貸付株式数	200株
ラサ商事	3,000	971.00	2,913,000		
アルペン	5,500	2,008.00	11,044,000	貸付株式数	2,200株
ハブ	2,400	558.00	1,339,200	貸付株式数	900株
ラクーンホールディングス	6,400	1,221.00	7,814,400	貸付株式数	2,500株
クオールホールディングス	9,300	1,207.00	11,225,100	貸付株式数	1,200株
アルコニックス	9,700	1,360.00	13,192,000		
神戸物産	51,900	3,415.00	177,238,500	貸付株式数	20,700株
ソリトンシステムズ	3,300	1,137.00	3,752,100	貸付株式数	1,400株
ジンスホールディングス	4,000	4,330.00	17,320,000	貸付株式数	1,500株
ビックカメラ	44,500	1,080.00	48,060,000	貸付株式数	17,800株
DCMホールディングス	44,500	1,020.00	45,390,000		
ペッパーフードサービス	14,100	241.00	3,398,100	貸付株式数	3,300株
ハイパー	1,500	437.00	655,500	貸付株式数	600株
Monotaro	95,100	2,383.00	226,623,300		
東京一番フーズ	1,100	595.00	654,500	貸付株式数	600株
DDホールディングス	4,100	580.00	2,378,000	貸付株式数	1,100株
あいホールディングス	10,700	2,144.00	22,940,800	貸付株式数	4,200株
ディービーエックス	2,400	901.00	2,162,400	貸付株式数	1,000株

きちりホールディングス	1,800	351.00	631,800	貸付株式数	700株
アークランドサービスHD	5,500	2,047.00	11,258,500	貸付株式数	2,200株 (100株)
J. フロント リテイリング	83,600	1,141.00	95,387,600		
ドトール・日レスHD	11,900	1,623.00	19,313,700		
マツキヨココカラ&カンパニー	44,100	5,360.00	236,376,000		
ブロンコビリー	3,500	2,347.00	8,214,500	貸付株式数	1,500株
ZOZO	51,800	2,918.00	151,152,400		
トレジャー・ファクトリー	2,200	1,743.00	3,834,600	貸付株式数	700株
物語コーポレーション	3,700	6,940.00	25,678,000	貸付株式数	1,300株
三越伊勢丹HD	113,200	1,132.00	128,142,400		
東洋紡	29,400	1,087.00	31,957,800		
ユニチカ	20,900	269.00	5,622,100	貸付株式数	8,100株
富士紡ホールディングス	3,000	3,485.00	10,455,000		
日清紡ホールディングス	52,200	1,081.00	56,428,200		
倉敷紡績	5,300	2,111.00	11,188,300		
ダイワボウHD	32,000	1,932.00	61,824,000		
シキボウ	4,200	886.00	3,721,200		
日東紡績	9,500	2,483.00	23,588,500		
トヨタ紡織	26,800	1,998.00	53,546,400		
マクニカホールディングス	17,800	2,886.00	51,370,800		
Hamee	2,700	1,079.00	2,913,300	貸付株式数	1,000株
マーケットエンタープライズ	800	859.00	687,200	貸付株式数	200株
ラクト・ジャパン	2,600	2,281.00	5,930,600	貸付株式数	1,000株 (400株)
ウエルシアHD	39,800	2,862.00	113,907,600		
クリエイトSDH	11,000	3,015.00	33,165,000	貸付株式数	3,700株
グリムス	3,300	1,665.00	5,494,500	貸付株式数	1,300株 (100株)
バイタルKSKHD	11,800	658.00	7,764,400	貸付株式数	300株
八洲電機	5,500	998.00	5,489,000	貸付株式数	2,100株
メディアスホールディングス	4,100	715.00	2,931,500	貸付株式数	1,600株
レスターホールディングス	7,100	1,991.00	14,136,100	貸付株式数	1,600株
ジューテックHD	1,600	1,085.00	1,736,000	貸付株式数	500株
丸善CHI HD	8,200	353.00	2,894,600	貸付株式数	3,200株
大光	3,300	702.00	2,316,600	貸付株式数	1,100株

OCHIホールディングス	1,500	1,225.00	1,837,500	貸付株式数	700株
TOKAIホールディングス	36,300	877.00	31,835,100		
黒谷	2,100	551.00	1,157,100	貸付株式数	700株
ミサワ	1,400	601.00	841,400	貸付株式数	500株
ティーライフ	1,000	1,245.00	1,245,000	貸付株式数	400株
Cominix	800	715.00	572,000	貸付株式数	400株
エー・ピーホールディングス	1,300	443.00	575,900	貸付株式数	500株
三洋貿易	7,000	1,004.00	7,028,000		
チムニー	2,400	1,238.00	2,971,200	貸付株式数	900株
シュッピン	6,200	1,147.00	7,111,400	貸付株式数	2,400株
ビューティガレージ	1,200	2,751.00	3,301,200	貸付株式数	400株
オイシックス・ラ・大地	10,800	1,818.00	19,634,400	貸付株式数	4,300株
ウイン・パートナーズ	5,300	965.00	5,114,500	貸付株式数	2,000株
ネクステージ	15,300	3,145.00	48,118,500	貸付株式数	500株
ジョイフル本田	21,500	1,705.00	36,657,500	貸付株式数	7,300株
鳥貴族ホールディングス	2,500	2,086.00	5,215,000	貸付株式数	900株
ホットランド	5,000	1,289.00	6,445,000	貸付株式数	2,000株 (2,000株)
すかいらーくHD	91,900	1,497.00	137,574,300	貸付株式数	36,600株
SFPホールディングス	3,800	1,611.00	6,121,800	貸付株式数	1,500株 (100株)
綿半ホールディングス	5,200	1,369.00	7,118,800	貸付株式数	1,400株
日本毛織	18,600	1,022.00	19,009,200	貸付株式数	8,000株
ダイトウボウ	16,500	83.00	1,369,500	貸付株式数	4,700株
トーア紡コーポレーション	2,300	349.00	802,700	貸付株式数	800株
ダイドーリミテッド	12,600	146.00	1,839,600	貸付株式数	4,000株
ヨシックスホールディングス	1,500	2,108.00	3,162,000	貸付株式数	600株
ユナイテッド・スーパーマケ	22,000	1,043.00	22,946,000	貸付株式数	8,600株
三栄建築設計	3,300	1,589.00	5,243,700		
野村不動産HLDS	39,300	3,465.00	136,174,500		
三重交通グループHD	15,800	479.00	7,568,200	貸付株式数	6,200株 (900株)
サムティ	10,400	2,176.00	22,630,400	貸付株式数	4,100株
地主	5,100	1,965.00	10,021,500	貸付株式数	1,900株
プレサンスコーポレーション	8,400	1,528.00	12,835,200	貸付株式数	3,200株

フィル・カンパニー	1,100	1,193.00	1,312,300	貸付株式数	400株
ハウスコム	2,000	949.00	1,898,000	貸付株式数	400株
J P M C	3,800	1,004.00	3,815,200		
サンセイランディック	3,200	828.00	2,649,600		
エストラスト	2,800	541.00	1,514,800	貸付株式数	100株
フージャースHD	10,000	799.00	7,990,000	貸付株式数	100株
オープンハウスグループ	24,000	5,290.00	126,960,000		
東急不動産HD	205,300	750.00	153,975,000		
飯田GH D	61,800	2,127.00	131,448,600		
イーグランド	1,300	1,606.00	2,087,800		
帝国繊維	7,200	1,567.00	11,282,400	貸付株式数	2,900株
日本コークス工業	64,700	97.00	6,275,900	貸付株式数	20,600株
ゴルフダイジェスト・オン	3,000	1,973.00	5,919,000	貸付株式数	1,500株
ミタチ産業	2,100	766.00	1,608,600	貸付株式数	700株
B E E N O S	3,800	2,219.00	8,432,200	貸付株式数	1,500株
あさひ	6,200	1,302.00	8,072,400	貸付株式数	2,200株
日本調剤	4,700	1,208.00	5,677,600	貸付株式数	1,800株
コスモス薬品	7,600	14,480.00	110,048,000	貸付株式数	3,000株
シップヘルスケアHD	21,600	2,654.00	57,326,400		
トーエル	3,400	790.00	2,686,000	貸付株式数	1,300株
ソフトクリエイイトHD	3,300	3,460.00	11,418,000		
セブン&アイ・H L D G S	252,400	5,661.00	1,428,836,400		
クリエイイト・レストラン ツ・ホール	50,600	876.00	44,325,600	貸付株式数	20,100株
明治電機工業	2,200	1,032.00	2,270,400	貸付株式数	600株
ツルハホールディングス	16,400	7,690.00	126,116,000		
デリカフーズH L D G S	2,800	512.00	1,433,600	貸付株式数	1,100株
スターティアホールディング ス	1,700	970.00	1,649,000	貸付株式数	600株
サンマルクホールディング ス	6,000	1,580.00	9,480,000		
フェリシモ	1,600	1,020.00	1,632,000	貸付株式数	600株
トリドールホールディング ス	18,700	2,981.00	55,744,700	貸付株式数	7,400株
帝 人	66,100	1,452.00	95,977,200		
東 レ	464,900	781.00	363,086,900		
ク ラ レ	101,200	1,056.00	106,867,200		
旭 化 成	463,000	1,017.50	471,102,500		
T O K Y O B A S E	7,000	336.00	2,352,000	貸付株式数	2,800株
稲葉製作所	3,900	1,327.00	5,175,300	貸付株式数	200株

宮地エンジニアリングG	2,200	3,120.00	6,864,000	
トーカロ	19,300	1,261.00	24,337,300	
アルファCO	2,700	931.00	2,513,700	貸付株式数 900株
SUMCO	124,700	1,909.00	238,052,300	貸付株式数 33,200株
川田テクノロジーズ	1,500	3,635.00	5,452,500	貸付株式数 100株
RS TECHNOLOGIES	2,100	6,520.00	13,692,000	
ジェイテックコーポレーション	1,000	1,640.00	1,640,000	貸付株式数 300株
信和	4,700	806.00	3,788,200	
ビーロット	6,000	551.00	3,306,000	貸付株式数 2,000株
ファーストブラザーズ	1,500	828.00	1,242,000	貸付株式数 600株
AND DOホールディングス	4,200	851.00	3,574,200	貸付株式数 1,400株
シーアールイー	3,000	1,719.00	5,157,000	貸付株式数 1,100株
プロパティエージェント	900	1,513.00	1,361,700	貸付株式数 400株
ケイアイスター不動産	3,400	4,750.00	16,150,000	
アグレ都市デザイン	1,300	1,474.00	1,916,200	貸付株式数 400株
ジェイ・エス・ビー	1,700	3,460.00	5,882,000	貸付株式数 600株
ロードスターキャピタル	2,800	1,751.00	4,902,800	貸付株式数 1,000株
テンポイノベーション	2,600	901.00	2,342,600	貸付株式数 400株
グローバルリンクマネジメント	1,600	920.00	1,472,000	貸付株式数 500株
フェイスネットワーク	1,200	1,387.00	1,664,400	
住江織物	1,300	1,701.00	2,211,300	
日本フェルト	4,100	413.00	1,693,300	貸付株式数 1,700株
イチカワ	900	1,387.00	1,248,300	貸付株式数 100株
エコナックホールディングス	13,900	88.00	1,223,200	
日東製網	700	1,353.00	947,100	貸付株式数 100株
芦森工業	1,600	1,016.00	1,625,600	貸付株式数 500株
アツギ	5,300	402.00	2,130,600	貸付株式数 2,100株
ウイルプラスHLDGS	1,500	1,106.00	1,659,000	貸付株式数 400株
JMホールディングス	5,600	1,554.00	8,702,400	
コメダホールディングス	16,300	2,226.00	36,283,800	貸付株式数 6,500株
サツドラホールディングス	3,100	645.00	1,999,500	貸付株式数 1,300株
アレンザホールディングス	4,800	971.00	4,660,800	貸付株式数 2,000株
串カツ田中HLDGS	1,800	1,770.00	3,186,000	貸付株式数 700株
バロックジャパン	5,200	770.00	4,004,000	貸付株式数 2,000株
クスリのアオキHLDGS	6,700	6,120.00	41,004,000	

ダイニック	2,100	614.00	1,289,400	貸付株式数	900株
共和レザー	4,100	549.00	2,250,900	貸付株式数	900株
ピーバンドットコム	1,100	510.00	561,000	貸付株式数	300株
力の源HD	4,400	754.00	3,317,600	貸付株式数	1,600株
FOOD & LIFE CO MPAN	38,500	2,202.00	84,777,000		
アセンテック	2,500	625.00	1,562,500	貸付株式数	600株
セーレン	13,800	2,077.00	28,662,600	貸付株式数	5,400株
ソトー	2,800	752.00	2,105,600	貸付株式数	800株
東海染工	800	1,127.00	901,600	貸付株式数	300株
小松マテーレ	11,300	828.00	9,356,400		
ワコールホールディングス	15,300	2,196.00	33,598,800		
ホギメディカル	9,300	3,450.00	32,085,000		
クラウディアHLDGS	2,000	268.00	536,000	貸付株式数	500株
T S Iホールディングス	22,800	387.00	8,823,600		
マツオカコーポレーション	2,100	937.00	1,967,700	貸付株式数	800株
ワールド	9,900	1,380.00	13,662,000		
T I S	65,600	4,155.00	272,568,000		
J N Sホールディングス	3,600	400.00	1,440,000	貸付株式数	1,400株
グリー	34,300	855.00	29,326,500	貸付株式数	13,500株
GMOベパボ	900	1,873.00	1,685,700	貸付株式数	300株
コーエーテクモHD	23,900	4,540.00	108,506,000		
三菱総合研究所	3,100	4,265.00	13,221,500		
ボルテージ	2,100	305.00	640,500	貸付株式数	700株
電算	700	1,975.00	1,382,500	貸付株式数	200株
A G S	3,000	693.00	2,079,000	貸付株式数	1,200株
ファインデックス	5,100	622.00	3,172,200	貸付株式数	2,200株
ブレインパッド	6,400	998.00	6,387,200		
K L a b	12,000	379.00	4,548,000		
ポルトゥウィンホール ディン	10,900	1,003.00	10,932,700		
ネクソン	171,300	2,804.00	480,325,200		
アイスタイル	19,400	486.00	9,428,400	貸付株式数	7,700株
エムアップホールディング ス	8,700	1,500.00	13,050,000		
エイチーム	4,700	730.00	3,431,000		
エニグモ	8,100	519.00	4,203,900	貸付株式数	1,700株
テクノスジャパン	5,800	445.00	2,581,000	貸付株式数	100株
e n i s h	5,600	430.00	2,408,000	貸付株式数	2,100株
コロプラ	24,800	677.00	16,789,600		

オルトプラス	5,600	297.00	1,663,200	貸付株式数	2,000株
ブロードリーフ	37,200	512.00	19,046,400	貸付株式数	12,800株
クロス・マーケティングG	2,900	831.00	2,409,900	貸付株式数	1,100株
デジタルハーツHLDGS	3,400	1,739.00	5,912,600	貸付株式数	100株
システム情報	5,600	975.00	5,460,000	貸付株式数	2,000株
メディアドゥ	2,500	2,038.00	5,095,000	貸付株式数	1,000株
じげん	21,400	325.00	6,955,000		
ブイキューブ	7,600	1,204.00	9,150,400	貸付株式数	3,000株 (100株)
エンカレッジ・テクノロジー	1,700	517.00	878,900	貸付株式数	600株
サイバーリンクス	2,300	1,069.00	2,458,700	貸付株式数	1,000株
ディー・エル・イー	4,300	381.00	1,638,300		
フィックスターズ	7,300	1,140.00	8,322,000		
CARTAHOLDINGS	3,100	1,729.00	5,359,900	貸付株式数	1,200株
オプティム	5,200	844.00	4,388,800	貸付株式数	2,000株 (1,800株)
セレス	2,500	985.00	2,462,500	貸付株式数	1,100株
SHIFT	4,700	19,790.00	93,013,000		
特種東海製紙	3,900	3,105.00	12,109,500		
ティーガイア	6,600	1,648.00	10,876,800	貸付株式数	2,200株
セック	1,100	2,241.00	2,465,100	貸付株式数	100株
テクマトリックス	12,700	1,606.00	20,396,200	貸付株式数	3,900株
プロシップ	2,500	1,424.00	3,560,000	貸付株式数	900株
ガンホー・オンライン・エンター	19,500	2,224.00	43,368,000	貸付株式数	7,400株
GMOペイメントゲートウェイ	14,500	10,640.00	154,280,000		
ザッパラス	2,400	316.00	758,400	貸付株式数	800株
システムリサーチ	2,100	1,894.00	3,977,400	貸付株式数	800株
インターネットイニシアティブ	20,000	4,675.00	93,500,000		
さくらインターネット	7,800	548.00	4,274,400	貸付株式数	3,100株
ヴィンクス	2,200	1,552.00	3,414,400		
GMOグローバルサインHD	2,000	4,910.00	9,820,000	貸付株式数	600株
SRAホールディングス	3,600	2,953.00	10,630,800		
システムインテグレータ	2,400	445.00	1,068,000	貸付株式数	900株
朝日ネット	6,600	605.00	3,993,000		
eBASE	8,900	520.00	4,628,000	貸付株式数	300株

アバント	8,000	1,403.00	11,224,000		
アドソル日進	2,600	1,496.00	3,889,600	貸付株式数	1,000株
ODKソリューションズ	1,500	605.00	907,500		
フリービット	3,800	898.00	3,412,400	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
コムチュア	8,400	2,232.00	18,748,800	貸付株式数	800株
サイバーコム	1,200	1,378.00	1,653,600		
アステリア	5,500	804.00	4,422,000	貸付株式数	2,100株
アイル	3,600	1,624.00	5,846,400	貸付株式数	1,400株
王子ホールディングス	289,100	548.00	158,426,800		
日本製紙	30,000	869.00	26,070,000	貸付株式数	12,000株
三菱製紙	9,600	293.00	2,812,800	貸付株式数	3,800株
北越コーポレーション	44,600	737.00	32,870,200	貸付株式数	800株
中越パルプ	2,300	968.00	2,226,400	貸付株式数	900株
巴川製紙	2,300	806.00	1,853,800	貸付株式数	800株
大王製紙	31,900	1,191.00	37,992,900		
阿波製紙	1,400	306.00	428,400	貸付株式数	500株
マークラインズ	3,400	2,338.00	7,949,200		
メディカル・データ・ビジ	9,500	1,024.00	9,728,000		
gumi	10,500	770.00	8,085,000	貸付株式数	4,100株
ショーケース	1,600	406.00	649,600	貸付株式数	600株
モバイルファクトリー	1,600	933.00	1,492,800	貸付株式数	100株
テラスカイ	2,700	1,946.00	5,254,200	貸付株式数	900株
デジタル・インフォメーション	3,300	1,515.00	4,999,500		
PCIホールディングス	2,800	949.00	2,657,200	貸付株式数	200株
アイビーシー	1,200	508.00	609,600	貸付株式数	400株
ネオジャパン	2,100	1,072.00	2,251,200	貸付株式数	800株
PR TIMES	1,600	2,389.00	3,822,400	貸付株式数	600株
ラクス	34,400	1,572.00	54,076,800	貸付株式数	13,700株
ランドコンピュータ	1,700	860.00	1,462,000		
ダブルスタンダード	2,300	2,461.00	5,660,300	貸付株式数	700株
オープンドア	4,500	1,911.00	8,599,500	貸付株式数	1,700株
マイネット	2,300	502.00	1,154,600	貸付株式数	900株
アカツキ	3,400	2,246.00	7,636,400		
ベネフィットジャパン	600	1,530.00	918,000	貸付株式数	200株
UBICOMホールディングス	2,000	2,538.00	5,076,000	貸付株式数	600株
カナミックネットワーク	9,300	539.00	5,012,700	貸付株式数	2,800株

ノムラシステムコーポレーション	7,000	131.00	917,000	貸付株式数	2,900株
レンゴー	58,300	813.00	47,397,900		
トーモク	3,600	1,502.00	5,407,200		
ザ・パック	4,800	2,221.00	10,660,800		
チェンジ	15,600	1,804.00	28,142,400		
シンクロ・フード	4,100	428.00	1,754,800	貸付株式数	1,400株
オークネット	3,300	2,179.00	7,190,700	貸付株式数	1,500株
キャピタル・アセット・プラン	1,400	715.00	1,001,000	貸付株式数	500株
セグエグループ	1,600	710.00	1,136,000	貸付株式数	700株
エイトレッド	1,000	1,816.00	1,816,000	貸付株式数	500株
マクロミル	14,400	1,209.00	17,409,600		
ビーグリー	1,200	1,403.00	1,683,600	貸付株式数	600株
オロ	1,900	1,591.00	3,022,900	貸付株式数	800株
ユーザーローカル	2,200	1,517.00	3,337,400	貸付株式数	900株
テモナ	1,300	314.00	408,200	貸付株式数	500株
ニーズウェル	2,300	628.00	1,444,400	貸付株式数	600株
マネーフォワード	15,300	3,260.00	49,878,000	貸付株式数	6,000株
サインポスト	2,500	849.00	2,122,500	貸付株式数	600株
昭和電工	61,400	2,090.00	128,326,000		
住友化学	510,700	543.00	277,310,100		
住友精化	3,000	3,130.00	9,390,000	貸付株式数	400株
日産化学	33,700	6,890.00	232,193,000		
ラサ工業	2,600	2,392.00	6,219,200		
クレハ	5,400	9,170.00	49,518,000	貸付株式数	700株
多木化学	2,500	4,980.00	12,450,000	貸付株式数	1,000株
テイカ	4,300	1,262.00	5,426,600		
石原産業	13,400	1,037.00	13,895,800	貸付株式数	100株
片倉コープアグリ	1,700	1,209.00	2,055,300		
日本曹達	8,200	4,500.00	36,900,000	貸付株式数	900株
東ソー	92,700	1,816.00	168,343,200		
トクヤマ	22,300	1,838.00	40,987,400		
セントラル硝子	11,300	3,365.00	38,024,500	貸付株式数	100株
東亜合成	32,600	1,089.00	35,501,400		
大阪ソーダ	5,800	3,795.00	22,011,000	貸付株式数	2,500株
関東電化	13,700	974.00	13,343,800	貸付株式数	100株
デンカ	25,200	3,315.00	83,538,000		
イビデン	36,800	4,325.00	159,160,000		
信越化学	118,700	15,985.00	1,897,419,500		

日本カ - バイド	2,900	1,222.00	3,543,800	貸付株式数	900株
電算システムHD	3,100	2,265.00	7,021,500		
堺 化学	4,800	1,929.00	9,259,200	貸付株式数	1,700株
第一稀元素化学工	6,300	1,332.00	8,391,600	貸付株式数	2,400株
エア・ウォーター	59,900	1,727.00	103,447,300		
日本酸素HL DGS	61,600	2,483.00	152,952,800		
日本化学工業	2,100	2,040.00	4,284,000		
東邦アセチレン	1,500	1,165.00	1,747,500	貸付株式数	500株
日本パ - カライジング	31,500	955.00	30,082,500		
高压ガス	10,600	656.00	6,953,600		
チタン工業	900	1,604.00	1,443,600	貸付株式数	100株
四国化成	8,500	1,231.00	10,463,500		
戸田工業	1,600	2,615.00	4,184,000	貸付株式数	600株
ステラ ケミファ	3,800	2,697.00	10,248,600		
保土谷化学	2,000	3,140.00	6,280,000		
日本触媒	10,700	5,600.00	59,920,000		
大日精化	5,400	1,745.00	9,423,000		
カネカ	16,100	3,680.00	59,248,000		
協和キリン	76,900	3,105.00	238,774,500		
三菱瓦斯化学	58,900	2,058.00	121,216,200		
三井化学	58,200	3,060.00	178,092,000		
J S R	69,700	3,115.00	217,115,500		
東京応化工業	11,100	6,700.00	74,370,000		
大阪有機化学	4,800	2,359.00	11,323,200	貸付株式数	2,000株
三菱ケミカルグループ	464,600	720.40	334,697,840		
K Hネオケム	10,600	2,502.00	26,521,200	貸付株式数	4,300株
ダイセル	100,300	879.00	88,163,700		
住友ベ - クライト	10,600	4,380.00	46,428,000		
積水化学	143,000	1,875.00	268,125,000		
日本ゼオン	56,300	1,391.00	78,313,300		
アイカ工業	17,600	3,145.00	55,352,000		
U B E	35,100	2,049.00	71,919,900		
積水樹脂	10,400	1,698.00	17,659,200		
タキロンシーアイ	16,400	531.00	8,708,400	貸付株式数	1,800株
旭有機材	4,300	2,345.00	10,083,500		
ニチバン	4,000	1,632.00	6,528,000	貸付株式数	1,600株
リケンテクノス	15,200	521.00	7,919,200		
大倉工業	3,000	1,763.00	5,289,000	貸付株式数	1,300株
積水化成成品	7,700	400.00	3,080,000		
群栄化学	1,500	2,450.00	3,675,000		

タイガース ポリマー	4,100	423.00	1,734,300		
ミライアル	2,400	1,894.00	4,545,600		
ダイキアクシス	2,300	665.00	1,529,500	貸付株式数	900株
ダイキョーニシカワ	15,700	577.00	9,058,900		
竹本容器	2,500	748.00	1,870,000	貸付株式数	900株
森六ホールディングス	3,700	1,732.00	6,408,400		
恵和	2,100	4,315.00	9,061,500		
日本化薬	52,500	1,195.00	62,737,500		
カーリットホールディングス	6,400	666.00	4,262,400	貸付株式数	2,500株
ソルクシーズ	6,000	368.00	2,208,000	貸付株式数	2,400株
CLホールディングス	1,800	852.00	1,533,600	貸付株式数	600株
プレステージ・インター	27,500	661.00	18,177,500		
フェイス	1,900	567.00	1,077,300	貸付株式数	700株
プロトコーポレーション	8,100	1,046.00	8,472,600	貸付株式数	1,400株
ハイマックス	2,000	1,344.00	2,688,000	貸付株式数	600株
アミューズ	4,000	1,915.00	7,660,000		
野村総合研究所	130,400	3,700.00	482,480,000		
ドリームインキュベータ	2,300	1,865.00	4,289,500	貸付株式数	800株
サイバネットシステム	5,300	981.00	5,199,300	貸付株式数	1,000株
クイック	4,600	1,765.00	8,119,000		
TAC	3,900	206.00	803,400	貸付株式数	900株
CEホールディングス	3,700	501.00	1,853,700	貸付株式数	1,400株
日本システム技術	1,400	2,708.00	3,791,200	貸付株式数	100株
電通グループ	68,400	4,235.00	289,674,000		
インテージホールディングス	8,600	1,674.00	14,396,400		
テイクアンドギヴニーズ	3,500	1,562.00	5,467,000	貸付株式数	1,300株
東邦システムサイエンス	1,900	998.00	1,896,200	貸付株式数	700株
びあ	2,200	3,200.00	7,040,000	貸付株式数	900株
イオンファンタジー	2,900	3,315.00	9,613,500	貸付株式数	1,100株
ソースネクスト	32,700	232.00	7,586,400	貸付株式数	6,500株
シーティーエス	8,300	723.00	6,000,900	貸付株式数	500株
ネクシーズグループ	2,200	570.00	1,254,000	貸付株式数	800株
インフォコム	8,100	1,925.00	15,592,500		
メディカルシステムネット ワーク	6,500	412.00	2,678,000	貸付株式数	700株
日本精化	4,800	1,931.00	9,268,800	貸付株式数	2,100株
扶桑化学工業	5,900	3,420.00	20,178,000		
トリケミカル	7,700	2,336.00	17,987,200		

シンプレクスHD	11,900	1,994.00	23,728,600		
HEROZ	2,200	836.00	1,839,200	貸付株式数	800株 (700株)
ラクスル	8,900	2,100.00	18,690,000	貸付株式数	3,500株
メルカリ	28,500	2,118.00	60,363,000		
I P S	2,100	3,105.00	6,520,500		
F I G	8,300	400.00	3,320,000	貸付株式数	3,200株 (1,300株)
システムサポート	2,600	1,407.00	3,658,200	貸付株式数	1,000株
A D E K A	29,500	2,330.00	68,735,000		
日油	21,600	5,290.00	114,264,000		
ミヨシ油脂	2,300	993.00	2,283,900	貸付株式数	1,000株
新日本理化	10,700	240.00	2,568,000	貸付株式数	2,000株
ハリマ化成グループ	5,000	910.00	4,550,000		
イーソル	4,100	592.00	2,427,200	貸付株式数	1,800株
アルテリア・ネットワークス	7,000	1,277.00	8,939,000	貸付株式数	700株
東海ソフト	1,200	931.00	1,117,200	貸付株式数	400株
ウイングアーク1ST	5,700	1,792.00	10,214,400		
ヒト・コミュニケーションズHD	1,700	1,656.00	2,815,200	貸付株式数	600株
サーバーワークス	1,300	2,361.00	3,069,300	貸付株式数	500株
東名	600	1,070.00	642,000	貸付株式数	200株
ヴィッツ	700	1,047.00	732,900	貸付株式数	200株
トピラスシステムズ	1,900	1,002.00	1,903,800	貸付株式数	600株
S a n s a n	23,700	1,266.00	30,004,200	貸付株式数	9,400株
L i n k - U	1,300	744.00	967,200	貸付株式数	500株
ギフトィ	6,800	2,045.00	13,906,000	貸付株式数	2,700株
花 王	157,900	5,807.00	916,925,300	貸付株式数	62,800株
第一工業製薬	2,500	2,126.00	5,315,000		
石原ケミカル	3,500	1,267.00	4,434,500		
日華化学	2,900	876.00	2,540,400	貸付株式数	800株
ニイタカ	1,400	2,278.00	3,189,200	貸付株式数	500株
三洋化成	4,500	4,515.00	20,317,500		
ベース	1,100	6,480.00	7,128,000	貸付株式数	400株
J M D C	9,400	5,900.00	55,460,000	貸付株式数	3,500株
武田薬品	600,800	3,784.00	2,273,427,200		
アステラス製薬	653,600	1,959.50	1,280,729,200		
住友ファーマ	47,300	1,004.00	47,489,200		
塩野義製薬	88,800	6,681.00	593,272,800		

わかもと製薬	7,600	235.00	1,786,000	貸付株式数	2,900株
日本新薬	16,700	7,430.00	124,081,000		
中外製薬	199,200	3,508.00	698,793,600		
科研製薬	11,000	3,770.00	41,470,000	貸付株式数	500株
エーザイ	84,500	5,633.00	475,988,500		
理研ビタミン	5,300	1,743.00	9,237,900		
ロート製薬	36,500	4,190.00	152,935,000		
小野薬品	147,400	3,352.00	494,084,800		
久光製薬	16,200	3,390.00	54,918,000		
有機合成薬品	5,000	326.00	1,630,000	貸付株式数	400株
持田製薬	8,600	3,280.00	28,208,000	貸付株式数	100株
参天製薬	133,200	983.00	130,935,600		
扶桑薬品	2,500	2,032.00	5,080,000	貸付株式数	100株
日本ケミファ	800	1,885.00	1,508,000	貸付株式数	300株
ツムラ	21,800	3,120.00	68,016,000		
日医工	22,000	346.00	7,612,000	貸付株式数	8,800株
テルモ	216,300	4,416.00	955,180,800		
HUグループHD	19,100	2,716.00	51,875,600		
キッセイ薬品工業	11,100	2,465.00	27,361,500		
生化学工業	13,700	867.00	11,877,900		
栄研化学	11,400	1,843.00	21,010,200		
鳥居薬品	3,400	2,803.00	9,530,200		
JCRファーマ	21,500	2,087.00	44,870,500		
東和薬品	11,000	2,158.00	23,738,000		
富士製薬工業	4,000	994.00	3,976,000		
ゼリア新薬工業	11,300	2,033.00	22,972,900	貸付株式数	4,900株
第一三共	554,600	4,108.00	2,278,296,800		
キョーリン製薬HD	13,800	1,756.00	24,232,800	貸付株式数	100株
大幸薬品	11,600	615.00	7,134,000	貸付株式数	4,500株
ダイト	4,800	2,566.00	12,316,800		
大塚ホールディングス	145,600	4,492.00	654,035,200		
大正製薬HD	14,200	5,160.00	73,272,000		
ペプチドリーム	30,900	1,578.00	48,760,200		
大日本塗料	8,400	717.00	6,022,800	貸付株式数	3,300株
日本ペイントHOLD	281,300	1,030.00	289,739,000		
関西ペイント	64,700	2,092.00	135,352,400		
神東塗料	4,700	144.00	676,800	貸付株式数	2,100株
中国塗料	15,900	859.00	13,658,100	貸付株式数	6,000株
日本特殊塗料	4,600	946.00	4,351,600		
藤倉化成	9,300	451.00	4,194,300	貸付株式数	2,200株

太陽ホールディングス	10,900	2,680.00	29,212,000	
D I C	24,800	2,473.00	61,330,400	貸付株式数 11,000株
サカタインクス	14,000	930.00	13,020,000	
東洋インキS Cホールディ ン	12,300	1,889.00	23,234,700	貸付株式数 5,600株
T & K T O K A	6,100	1,004.00	6,124,400	
アルプス技研	5,700	1,807.00	10,299,900	
サニックス	12,800	235.00	3,008,000	貸付株式数 5,000株 (5,000株)
ダイオーズ	1,600	1,499.00	2,398,400	貸付株式数 500株
日本空調サービス	7,200	751.00	5,407,200	貸付株式数 500株
オリエンタルランド	77,700	18,940.00	1,471,638,000	
フォーカスシステムズ	4,500	988.00	4,446,000	貸付株式数 1,300株
ダスキン	15,700	2,784.00	43,708,800	
パーク24	48,700	1,965.00	95,695,500	貸付株式数 5,500株
明光ネットワークジャパン	8,500	590.00	5,015,000	貸付株式数 3,300株
ファルコホールディングス	3,300	1,790.00	5,907,000	貸付株式数 1,200株
クレスコ	5,500	1,735.00	9,542,500	
フジ・メディア・HD	66,200	1,086.00	71,893,200	
秀英予備校	1,600	442.00	707,200	貸付株式数 800株
田谷	1,300	555.00	721,500	貸付株式数 600株
ラウンドワン	20,500	2,003.00	41,061,500	
リゾートトラスト	31,000	2,143.00	66,433,000	
オービック	23,600	20,490.00	483,564,000	
ジャストシステム	10,700	3,360.00	35,952,000	
T D C ソフト	5,900	1,174.00	6,926,600	
Zホールディングス	1,081,400	403.10	435,912,340	
ビー・エム・エル	9,300	3,395.00	31,573,500	
トレンドマイクロ	36,800	8,250.00	303,600,000	
りらいあコミュニケーション	10,700	977.00	10,453,900	
I Dホールディングス	4,500	871.00	3,919,500	
リソー教育	33,800	312.00	10,545,600	貸付株式数 200株
日本オラクル	12,200	8,290.00	101,138,000	
早稲田アカデミー	4,100	1,097.00	4,497,700	貸付株式数 1,500株
アルファシステムズ	2,000	4,120.00	8,240,000	貸付株式数 700株
フューチャー	15,900	1,624.00	25,821,600	
C A C H O L D I N G S	4,100	1,413.00	5,793,300	
S Bテクノロジー	3,200	2,412.00	7,718,400	
トーセ	2,000	783.00	1,566,000	貸付株式数 600株
ユー・エス・エス	81,800	2,377.00	194,438,600	

オービックビジネスC	7,200	4,830.00	34,776,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	34,100	3,465.00	118,156,500	
アイティフォー	9,200	772.00	7,102,400	
東京個別指導学院	6,600	554.00	3,656,400	貸付株式数 2,500株
東計電算	900	5,970.00	5,373,000	貸付株式数 300株
サイバーエージェント	155,900	1,315.00	205,008,500	
楽天グループ	301,200	627.00	188,852,400	貸付株式数 134,800株
エクスネット	1,100	1,000.00	1,100,000	貸付株式数 400株
クリーク・アンド・リバー社	3,900	2,348.00	9,157,200	
モーニングスター	12,500	485.00	6,062,500	貸付株式数 4,800株
テー・オー・ダブリュー	13,100	306.00	4,008,600	貸付株式数 4,200株
大塚商会	36,100	4,525.00	163,352,500	貸付株式数 13,500株
サイボウズ	8,700	1,341.00	11,666,700	貸付株式数 200株
山田コンサルティングG P	3,900	1,212.00	4,726,800	貸付株式数 600株
セントラルスポーツ	2,700	2,461.00	6,644,700	貸付株式数 1,000株
パラカ	2,000	1,890.00	3,780,000	貸付株式数 600株
電通国際情報S	7,700	4,390.00	33,803,000	貸付株式数 3,800株
A C C E S S	8,600	693.00	5,959,800	貸付株式数 3,300株
デジタルガレージ	12,400	3,675.00	45,570,000	
イーエムシステムズ	10,700	856.00	9,159,200	貸付株式数 700株
ウェザーニューズ	2,300	7,740.00	17,802,000	
C I J	5,600	752.00	4,211,200	貸付株式数 400株
ビジネスエンジニアリング	1,700	2,360.00	4,012,000	貸付株式数 600株
日本エンタープライズ	7,300	159.00	1,160,700	貸付株式数 2,800株
WOWOW	2,800	1,314.00	3,679,200	貸付株式数 1,100株
スカラ	6,200	702.00	4,352,400	
インテリジェントウェイブ	4,000	835.00	3,340,000	貸付株式数 1,500株
フルキャストホールディングス	6,300	2,417.00	15,227,100	
エン・ジャパン	13,000	2,329.00	30,277,000	
あすか製薬HD	7,200	1,131.00	8,143,200	
サワイグループHD	14,600	3,915.00	57,159,000	
富士フイルムHLDGS	134,300	6,925.00	930,027,500	
コニカミノルタ	155,200	472.00	73,254,400	
資生堂	132,900	4,912.00	652,804,800	
ライオン	76,500	1,598.00	122,247,000	貸付株式数 32,500株
高砂香料	4,300	2,758.00	11,859,400	
マンダム	14,900	1,478.00	22,022,200	

ミルボン	9,400	6,110.00	57,434,000	貸付株式数	2,800株
ファンケル	30,900	2,761.00	85,314,900		
コーセー	12,900	13,060.00	168,474,000	貸付株式数	2,800株
コタ	5,300	1,553.00	8,230,900		
シーボン	1,000	1,665.00	1,665,000	貸付株式数	400株
ポーラ・オルビスHD	32,700	1,486.00	48,592,200	貸付株式数	11,500株
ノエビアホールディングス	5,600	5,640.00	31,584,000		
アジュバンホールディング	1,700	956.00	1,625,200	貸付株式数	600株
新日本製薬	3,700	1,564.00	5,786,800	貸付株式数	1,200株 (500株)
エステー	4,800	1,510.00	7,248,000	貸付株式数	200株
アグロカネショウ	2,600	1,261.00	3,278,600		
コニシ	11,600	1,575.00	18,270,000	貸付株式数	400株
長谷川香料	13,200	2,905.00	38,346,000	貸付株式数	500株
星光PMC	3,500	582.00	2,037,000	貸付株式数	1,400株
小林製薬	19,500	8,080.00	157,560,000	貸付株式数	7,800株
荒川化学工業	5,400	1,012.00	5,464,800		
メック	5,200	2,333.00	12,131,600		
日本高純度化学	1,700	2,357.00	4,006,900		
タカラバイオ	20,000	1,852.00	37,040,000		
JCU	7,800	3,070.00	23,946,000		
新田ゼラチン	4,400	844.00	3,713,600		
OATアグリオ	2,900	1,793.00	5,199,700		
デクセリアルズ	19,900	3,875.00	77,112,500	貸付株式数	1,700株
アース製薬	5,800	5,350.00	31,030,000		
北興化学	6,500	968.00	6,292,000		
大成ラミック	2,000	2,792.00	5,584,000		
クミアイ化学	25,400	1,053.00	26,746,200		
日本農薬	13,500	818.00	11,043,000		
富士興産	1,900	1,182.00	2,245,800		
ニチレキ	8,500	1,323.00	11,245,500		
ユシロ化学	3,200	857.00	2,742,400		
ビーピー・カストロール	2,600	1,091.00	2,836,600		
富士石油	16,700	342.00	5,711,400		
MORESCO	2,700	1,134.00	3,061,800	貸付株式数	900株
出光興産	77,800	3,435.00	267,243,000		
ENEOSホールディングス	1,149,600	509.40	585,606,240		
コスモエネルギーHLDGS	30,200	3,930.00	118,686,000	貸付株式数	12,000株

テスホールディングス	6,700	1,115.00	7,470,500	貸付株式数	2,600株
インフロニアHD	83,600	1,011.00	84,519,600		
横浜ゴム	36,300	2,324.00	84,361,200		
TOYO TIRE	36,700	1,668.00	61,215,600		
ブリヂストン	203,300	5,160.00	1,049,028,000		
住友ゴム	62,500	1,216.00	76,000,000	貸付株式数	24,800株
藤倉コンポジット	6,300	974.00	6,136,200	貸付株式数	2,500株
オカモト	3,500	3,795.00	13,282,500		
アキレス	4,800	1,301.00	6,244,800	貸付株式数	700株
フコク	3,500	992.00	3,472,000		
ニッタ	7,200	2,878.00	20,721,600		
クリエートメディック	2,500	914.00	2,285,000	貸付株式数	1,000株
住友理工	14,900	579.00	8,627,100		
三ツ星ベルト	9,400	3,205.00	30,127,000		
バンドー化学	12,500	1,032.00	12,900,000	貸付株式数	100株
AGC	64,800	4,765.00	308,772,000		
日本板硝子	34,700	553.00	19,189,100		
石塚硝子	1,200	1,601.00	1,921,200	貸付株式数	400株
有沢製作所	10,300	1,299.00	13,379,700	貸付株式数	1,100株
日本山村硝子	2,200	620.00	1,364,000	貸付株式数	400株
日本電気硝子	26,000	2,618.00	68,068,000	貸付株式数	5,100株
オハラ	3,000	1,299.00	3,897,000	貸付株式数	1,200株
住友大阪セメント	11,500	3,405.00	39,157,500		
太平洋セメント	43,500	2,060.00	89,610,000		
リソルホールディングス	800	4,405.00	3,524,000	貸付株式数	300株
日本ヒューム	7,100	660.00	4,686,000		
日本コンクリート	13,600	267.00	3,631,200	貸付株式数	100株
三谷セキサン	3,100	3,660.00	11,346,000		
アジアパイルHD	11,300	503.00	5,683,900		
東海カーボン	53,300	992.00	52,873,600		
日本カーボン	3,700	4,005.00	14,818,500		
東洋炭素	4,100	3,220.00	13,202,000		
ノリタケ	3,900	4,105.00	16,009,500		
TOTO	46,200	4,690.00	216,678,000		
日本碍子	75,300	1,974.00	148,642,200		
日本特殊陶業	53,400	2,897.00	154,699,800		
ダントーホールディングス	5,100	320.00	1,632,000	貸付株式数	2,000株
MARUWA	2,600	16,920.00	43,992,000		
品川リフラクトリーズ	1,800	3,855.00	6,939,000		
黒崎播磨	1,300	4,885.00	6,350,500		

ヨータイ	4,900	1,395.00	6,835,500	貸付株式数	100株
東京窯業	8,000	272.00	2,176,000	貸付株式数	2,800株
ニッカトー	3,500	452.00	1,582,000	貸付株式数	1,300株
フジインコーポレーテッド	6,100	6,530.00	39,833,000		
クニミネ工業	2,400	829.00	1,989,600	貸付株式数	900株
エーアンドエーマテリアル	1,200	861.00	1,033,200	貸付株式数	400株
ニチアス	16,100	2,347.00	37,786,700	貸付株式数	800株
日本製鉄	315,700	2,232.50	704,800,250		
神戸製鋼所	131,900	628.00	82,833,200		
中山製鋼所	10,900	572.00	6,234,800		
合同製鐵	3,600	1,809.00	6,512,400		
J F E ホールディングス	175,000	1,453.00	254,275,000		
東京製鐵	22,200	1,302.00	28,904,400		
共英製鋼	7,400	1,453.00	10,752,200		
大和工業	12,400	4,785.00	59,334,000	貸付株式数	100株
東京鐵鋼	2,900	1,334.00	3,868,600	貸付株式数	1,100株
大阪製鐵	4,100	1,223.00	5,014,300		
淀川製鋼所	8,200	2,456.00	20,139,200	貸付株式数	400株
丸一鋼管	21,900	2,939.00	64,364,100		
モリ工業	1,900	2,672.00	5,076,800		
大同特殊鋼	10,300	3,795.00	39,088,500		
日本高周波	2,900	331.00	959,900	貸付株式数	1,100株
日本冶金工	5,200	2,775.00	14,430,000		
山陽特殊製鋼	6,500	2,027.00	13,175,500		
愛知製鋼	4,200	2,056.00	8,635,200		
日立金属	71,500	2,109.00	150,793,500		
日本金属	2,000	1,012.00	2,024,000	貸付株式数	600株
大平洋金属	4,700	2,314.00	10,875,800		
新日本電工	42,000	356.00	14,952,000		
栗本鉄工所	3,000	1,625.00	4,875,000		
虹 技	1,000	940.00	940,000	貸付株式数	100株
日本鑄鉄管	800	973.00	778,400	貸付株式数	300株
日本製鋼所	19,400	3,035.00	58,879,000		
三菱製鋼	4,800	999.00	4,795,200		
日亜鋼業	8,700	245.00	2,131,500		
日本精線	1,200	4,515.00	5,418,000	貸付株式数	300株
エンビプロHD	5,000	863.00	4,315,000	貸付株式数	1,900株
大紀アルミニウム	9,300	1,301.00	12,099,300		
日本軽金属HD	19,200	1,592.00	30,566,400		

三井金属	20,400	3,160.00	64,464,000	
東邦亜鉛	3,900	2,449.00	9,551,100	
三菱マテリアル	43,600	2,024.00	88,246,400	
住友鉱山	82,900	4,217.00	349,589,300	
DOWAホールディングス	17,600	5,340.00	93,984,000	
古河機金	11,100	1,247.00	13,841,700	
エス・サイエンス	37,200	25.00	930,000	貸付株式数 12,600株
大阪チタニウム	8,800	3,060.00	26,928,000	貸付株式数 3,400株
東邦チタニウム	13,600	2,172.00	29,539,200	貸付株式数 5,400株
UACJ	10,300	2,394.00	24,658,200	
CKサンエツ	1,400	4,020.00	5,628,000	貸付株式数 500株
古河電工	21,800	2,454.00	53,497,200	
住友電工	263,800	1,603.00	422,871,400	
フジクラ	84,500	986.00	83,317,000	
昭和電線HLDGS	6,600	1,796.00	11,853,600	貸付株式数 100株
東京特殊電線	1,000	2,228.00	2,228,000	貸付株式数 400株
タツタ電線	13,600	456.00	6,201,600	
カナレ電気	1,100	1,488.00	1,636,800	貸付株式数 400株
平河ヒューテック	4,300	1,095.00	4,708,500	貸付株式数 1,600株
リョービ	7,100	1,277.00	9,066,700	
アールステイ	8,000	390.00	3,120,000	
アサヒHD	30,200	2,083.00	62,906,600	
東洋製罐グループHD	38,500	1,698.00	65,373,000	
ホッカンホールディングス	3,300	1,308.00	4,316,400	貸付株式数 1,400株
コロナ	3,400	824.00	2,801,600	貸付株式数 200株
横河ブリッジHLDGS	10,800	1,934.00	20,887,200	
駒井ハルテック	1,200	1,647.00	1,976,400	
高田機工	600	2,411.00	1,446,600	貸付株式数 200株
三和ホールディングス	71,200	1,348.00	95,977,600	
文化シャツタ-	22,400	1,051.00	23,542,400	貸付株式数 8,800株
三協立山	9,100	605.00	5,505,500	
アルインコ	5,500	896.00	4,928,000	貸付株式数 1,800株
東洋シャツタ-	1,600	547.00	875,200	貸付株式数 200株
LIXIL	119,000	2,296.00	273,224,000	
日本フィルコン	4,800	475.00	2,280,000	貸付株式数 2,100株
ノーリツ	9,700	1,541.00	14,947,700	
長府製作所	6,700	1,983.00	13,286,100	
リンナイ	13,100	10,530.00	137,943,000	
ユニプレス	12,700	955.00	12,128,500	
ダイニチ工業	3,800	643.00	2,443,400	貸付株式数 1,300株

日東精工	9,600	515.00	4,944,000	
三洋工業	800	1,687.00	1,349,600	貸付株式数 200株
岡 部	10,700	651.00	6,965,700	
ジーテクト	8,400	1,349.00	11,331,600	
東 プ レ	11,600	1,226.00	14,221,600	
高周波熱錬	11,400	675.00	7,695,000	貸付株式数 300株
東京製綱	4,700	953.00	4,479,100	
サンコール	6,600	712.00	4,699,200	
モリテックスチル	5,900	282.00	1,663,800	貸付株式数 2,300株
パイオラックス	10,000	1,937.00	19,370,000	
エイチワン	6,800	593.00	4,032,400	貸付株式数 100株
日本発条	63,900	940.00	60,066,000	貸付株式数 100株
中央発條	3,600	690.00	2,484,000	
アドバネクス	1,000	1,243.00	1,243,000	貸付株式数 300株
三浦工業	29,700	2,877.00	85,446,900	
タ ク マ	21,700	1,319.00	28,622,300	
テクノプロ・ホールディング グ	43,800	2,995.00	131,181,000	貸付株式数 15,700株
アトラグループ	1,900	184.00	349,600	貸付株式数 600株
インターワークス	2,500	386.00	965,000	貸付株式数 800株
アイ・アールジャパンHD	3,400	2,167.00	7,367,800	貸付株式数 1,300株
K e e P e r 技研	4,700	3,940.00	18,518,000	
ファーストロジック	1,100	792.00	871,200	貸付株式数 400株
三機サービス	1,200	955.00	1,146,000	貸付株式数 400株
G u n o s y	4,100	751.00	3,079,100	貸付株式数 1,600株
デザインワン・ジャパン	2,300	175.00	402,500	貸付株式数 800株
イー・ガーディアン	2,500	2,878.00	7,195,000	
リブセンス	3,700	270.00	999,000	貸付株式数 2,400株 (2,400株)
ジャパンマテリアル	22,500	1,891.00	42,547,500	
ベクトル	10,200	1,095.00	11,169,000	
ウチヤマホールディングス	3,700	298.00	1,102,600	貸付株式数 1,400株
チャームケアコーポレー ション	5,500	1,116.00	6,138,000	貸付株式数 2,100株
キャリアリンク	2,700	2,219.00	5,991,300	貸付株式数 1,000株
I B J	3,900	914.00	3,564,600	貸付株式数 2,000株
アサンテ	3,100	1,608.00	4,984,800	貸付株式数 1,000株
バリューHR	5,700	1,367.00	7,791,900	貸付株式数 2,000株
M & Aキャピタルパート ナー	6,000	3,345.00	20,070,000	貸付株式数 2,300株

ライドオンエクスプレスHD	2,900	1,111.00	3,221,900	貸付株式数	1,100株
E R Iホールディングス	2,100	1,022.00	2,146,200	貸付株式数	800株
アビスト	1,100	2,964.00	3,260,400	貸付株式数	400株
シグマクシス・ホールディング	8,800	1,178.00	10,366,400		
ウィルグループ	5,400	1,328.00	7,171,200		
エスクローAJ	8,100	161.00	1,304,100	貸付株式数	2,900株
メドピア	5,100	1,490.00	7,599,000	貸付株式数	2,000株
レアジョブ	1,400	723.00	1,012,200	貸付株式数	500株
リクルートホールディングス	523,300	4,518.00	2,364,269,400		
エラン	8,600	1,026.00	8,823,600		
ツガミ	15,400	1,195.00	18,403,000		
オークマ	7,200	5,130.00	36,936,000		
芝浦機械	8,600	2,990.00	25,714,000		
アマダ	119,300	1,087.00	129,679,100		
アイダエンジニア	16,500	829.00	13,678,500		
滝澤鉄工所	2,300	1,135.00	2,610,500	貸付株式数	800株
F U J I	30,100	1,995.00	60,049,500		
牧野フライス	7,700	4,310.00	33,187,000	貸付株式数	100株
オーエスジー	30,700	1,844.00	56,610,800		
ダイジェット	900	877.00	789,300		
旭ダイヤモンド	18,900	733.00	13,853,700		
D M G森精機	38,900	1,737.00	67,569,300	貸付株式数	16,600株
ソディック	17,800	803.00	14,293,400		
ディスコ	11,100	33,550.00	372,405,000	貸付株式数	3,100株
日東工器	3,700	1,603.00	5,931,100		
日進工具	6,000	1,090.00	6,540,000	貸付株式数	1,000株
パンチ工業	6,400	430.00	2,752,000		
富士ダイス	3,900	622.00	2,425,800	貸付株式数	1,100株
土木管理総合試験	3,200	316.00	1,011,200		
ネットマーケティング	3,600	899.00	3,236,400	貸付株式数	1,300株
日本郵政	797,500	963.10	768,072,250		
ベルシステム24HLDGS	10,500	1,410.00	14,805,000	貸付株式数	4,100株
鎌倉新書	8,400	636.00	5,342,400	貸付株式数	3,200株 (1,300株)
S M N	1,700	542.00	921,400	貸付株式数	600株
一蔵	1,000	423.00	423,000	貸付株式数	300株

グローバルキッズCOMP	1,100	676.00	743,600		
エアトリ	4,200	2,628.00	11,037,600	貸付株式数	1,600株
アトラエ	5,100	1,459.00	7,440,900		
ストライク	3,200	3,970.00	12,704,000	貸付株式数	1,200株
ソラスト	18,000	834.00	15,012,000		
セラク	2,300	1,056.00	2,428,800	貸付株式数	900株
インソース	8,100	2,674.00	21,659,400	貸付株式数	2,200株
豊田自動織機	54,100	7,560.00	408,996,000		
豊和工業	4,000	827.00	3,308,000		
ニデックオーケー	2,900	1,140.00	3,306,000	貸付株式数	900株
石川製作所	2,100	1,404.00	2,948,400	貸付株式数	700株
東洋機械金属	5,000	572.00	2,860,000	貸付株式数	700株
津田駒工業	1,200	500.00	600,000	貸付株式数	400株
エンシュウ	1,900	772.00	1,466,800	貸付株式数	400株
島精機製作所	11,100	2,191.00	24,320,100		
オプトラン	9,500	2,220.00	21,090,000		
NCホールディングス	2,100	1,977.00	4,151,700	貸付株式数	800株
イワキポンプ	4,900	1,286.00	6,301,400	貸付株式数	1,300株
フリー	6,800	1,012.00	6,881,600	貸付株式数	900株
ヤマシンフィルタ	11,800	319.00	3,764,200	貸付株式数	4,700株
日阪製作所	7,500	827.00	6,202,500		
やまびこ	10,500	1,132.00	11,886,000		
野村マイクロ・サイエンス	2,400	3,545.00	8,508,000	貸付株式数	900株
平田機工	3,300	4,490.00	14,817,000		
ペガサスミシン製造	7,700	910.00	7,007,000		
マルマエ	3,100	1,990.00	6,169,000	貸付株式数	1,200株 (900株)
タツモ	3,500	1,398.00	4,893,000	貸付株式数	1,300株
ナブテスコ	40,300	3,265.00	131,579,500	貸付株式数	15,100株
三井海洋開発	8,000	1,469.00	11,752,000		
レオン自動機	8,100	1,203.00	9,744,300	貸付株式数	100株
S M C	22,400	65,300.00	1,462,720,000		
ホソカワミクロン	4,900	2,567.00	12,578,300		
ユニオンツール	2,800	3,470.00	9,716,000	貸付株式数	1,100株
オイレス工業	9,700	1,493.00	14,482,100	貸付株式数	3,900株
日精エーエスビー	2,900	3,975.00	11,527,500		
サト - ホールディングス	9,900	1,880.00	18,612,000		
技研製作所	6,700	3,145.00	21,071,500		
日本エアテック	3,200	1,044.00	3,340,800	貸付株式数	1,200株
カワタ	2,400	891.00	2,138,400		

日精樹脂工業	4,600	939.00	4,319,400	
オカダアイヨン	2,400	1,450.00	3,480,000	貸付株式数 900株
ワイエイシイホールディングス	3,000	1,384.00	4,152,000	貸付株式数 1,100株
小松製作所	346,500	2,841.50	984,579,750	
住友重機械	40,900	2,864.00	117,137,600	
日立建機	30,600	2,815.00	86,139,000	
日工	9,300	631.00	5,868,300	
巴工業	2,700	2,470.00	6,669,000	貸付株式数 1,200株
井関農機	6,000	1,210.00	7,260,000	貸付株式数 800株
TOWA	6,600	1,801.00	11,886,600	貸付株式数 2,400株
丸山製作所	1,200	1,566.00	1,879,200	貸付株式数 400株
北川鉄工所	3,000	1,322.00	3,966,000	
シンニッタン	8,700	217.00	1,887,900	
ローツェ	3,800	8,350.00	31,730,000	貸付株式数 1,400株
タカキタ	2,500	554.00	1,385,000	貸付株式数 900株
クボタ	341,800	2,099.00	717,438,200	
荏原実業	3,200	2,166.00	6,931,200	
東洋エンジニア	10,100	659.00	6,655,900	
三菱化工機	2,200	2,207.00	4,855,400	
月島機械	11,900	884.00	10,519,600	貸付株式数 4,000株
帝国電機製作所	4,900	1,966.00	9,633,400	
東京機械	3,100	686.00	2,126,600	
新東工業	14,200	702.00	9,968,400	貸付株式数 700株
渋谷工業	6,000	2,335.00	14,010,000	
アイチ コーポレーション	10,700	804.00	8,602,800	貸付株式数 100株
小森コーポレーション	17,400	735.00	12,789,000	貸付株式数 1,300株
鶴見製作所	5,400	2,176.00	11,750,400	貸付株式数 100株
住友精密	1,200	2,500.00	3,000,000	
日本ギア工業	3,400	339.00	1,152,600	貸付株式数 1,300株
酒井重工業	1,200	3,000.00	3,600,000	
荏原製作所	26,200	5,210.00	136,502,000	貸付株式数 11,100株
石井鉄工所	1,000	2,810.00	2,810,000	貸付株式数 300株
西島製作所	6,300	1,387.00	8,738,100	
北越工業	6,500	964.00	6,266,000	
ダイキン工業	83,500	24,130.00	2,014,855,000	
オルガノ	2,200	8,580.00	18,876,000	
ト・ヨ・カネツ	2,600	2,540.00	6,604,000	
栗田工業	38,600	5,350.00	206,510,000	
椿本チエイン	10,000	3,195.00	31,950,000	

大同工業	3,000	723.00	2,169,000	
日機装	15,800	1,013.00	16,005,400	
木村化工機	5,900	763.00	4,501,700	貸付株式数 2,300株
レイズネクスト	10,300	1,173.00	12,081,900	
アネスト岩田	11,800	914.00	10,785,200	貸付株式数 100株
ダイフク	36,100	7,730.00	279,053,000	
サムコ	2,100	3,160.00	6,636,000	貸付株式数 700株
加藤製作所	3,500	754.00	2,639,000	貸付株式数 1,300株
油研工業	1,200	1,803.00	2,163,600	貸付株式数 300株
タダノ	36,900	913.00	33,689,700	貸付株式数 2,000株
フジテック	23,500	2,787.00	65,494,500	貸付株式数 500株
CKD	19,300	1,831.00	35,338,300	貸付株式数 2,100株
キトー	5,800	2,698.00	15,648,400	
平和	21,300	2,063.00	43,941,900	
理想科学工業	6,400	2,399.00	15,353,600	貸付株式数 200株
SANKYO	15,800	3,980.00	62,884,000	
日本金銭機械	7,900	659.00	5,206,100	貸付株式数 700株
マースグループHLDGS	4,900	1,571.00	7,697,900	
フクシマガリレイ	4,700	3,490.00	16,403,000	
オーイズミ	2,800	397.00	1,111,600	
ダイコク電機	3,500	1,290.00	4,515,000	貸付株式数 1,000株
竹内製作所	11,700	2,632.00	30,794,400	
アマノ	20,100	2,525.00	50,752,500	
JUKI	10,000	690.00	6,900,000	貸付株式数 100株
サンデン	11,100	282.00	3,130,200	貸付株式数 4,200株
ジャノメ	6,600	677.00	4,468,200	貸付株式数 800株
ブラザー工業	87,200	2,560.00	223,232,000	
マックス	9,000	1,988.00	17,892,000	
モリタホールディングス	12,300	1,262.00	15,522,600	
グローリー	18,100	2,189.00	39,620,900	
新晃工業	7,100	1,540.00	10,934,000	
大和冷機工業	9,800	1,082.00	10,603,600	
セガサミーホールディングス	68,700	1,981.00	136,094,700	
日本ピストンリング	2,900	1,255.00	3,639,500	
リケン	2,900	2,368.00	6,867,200	
TPR	8,600	1,275.00	10,965,000	
ツバキ・ナカシマ	15,800	1,133.00	17,901,400	
ホシザキ	41,200	3,945.00	162,534,000	
大豊工業	6,200	688.00	4,265,600	

日本精工	130,800	749.00	97,969,200	
N T N	139,700	262.00	36,601,400	
ジェイテクト	65,200	1,019.00	66,438,800	
不二越	4,700	3,755.00	17,648,500	貸付株式数 300株
ミネベアミツミ	121,600	2,347.00	285,395,200	
日本トムソン	17,500	553.00	9,677,500	
T H K	37,000	2,738.00	101,306,000	
ユーシン精機	5,700	708.00	4,035,600	
前澤給装工業	4,900	887.00	4,346,300	貸付株式数 200株
イーグル工業	8,400	1,167.00	9,802,800	
前澤工業	4,600	632.00	2,907,200	
日本ピラ - 工業	6,500	2,529.00	16,438,500	
キッツ	23,400	793.00	18,556,200	
日立	367,700	6,832.00	2,512,126,400	
東芝	133,600	4,941.00	660,117,600	
三菱電機	713,300	1,368.50	976,151,050	
富士電機	42,500	5,790.00	246,075,000	
東洋電機製造	2,300	887.00	2,040,100	
安川電機	75,900	4,525.00	343,447,500	
シンフォニア テクノロ ジー	7,700	1,463.00	11,265,100	貸付株式数 3,200株
明電舎	10,900	1,978.00	21,560,200	
オリジン	1,900	1,417.00	2,692,300	貸付株式数 700株
山洋電気	2,800	5,160.00	14,448,000	
デンヨー	5,300	1,507.00	7,987,100	
PHCホールディングス	11,800	1,523.00	17,971,400	
ベイカレントコンサルティ ング	5,200	40,400.00	210,080,000	
ORCHESTRA HL DGS	1,400	2,586.00	3,620,400	
アイモバイル	3,600	1,352.00	4,867,200	貸付株式数 1,400株
キャリアインデックス	2,500	412.00	1,030,000	
MS - J a p a n	3,000	797.00	2,391,000	貸付株式数 1,100株 (100株)
船場	900	730.00	657,000	貸付株式数 100株
ジャパンエレベーターSH D	23,100	1,830.00	42,273,000	
フルテック	1,100	1,201.00	1,321,100	貸付株式数 300株
グリーンズ	2,700	737.00	1,989,900	
ツナググループHL DGS	2,300	308.00	708,400	貸付株式数 700株

GAMEWITH	2,200	386.00	849,200	貸付株式数	800株
MS&CONSULTING	1,200	628.00	753,600	貸付株式数	200株
ウェルビー	4,800	760.00	3,648,000	貸付株式数	1,800株
エル・ティー・エス	800	2,970.00	2,376,000	貸付株式数	300株 (300株)
ミダックホールディングス	3,300	3,120.00	10,296,000	貸付株式数	1,300株
日総工産	5,700	540.00	3,078,000	貸付株式数	2,100株
キュービーネットHLDGS	3,400	1,325.00	4,505,000		
RPAホールディングス	10,200	304.00	3,100,800	貸付株式数	4,000株
三桜工業	10,700	752.00	8,046,400		
マキタ	86,400	3,148.00	271,987,200		
東芝テック	8,200	3,985.00	32,677,000		
芝浦メカトロニクス	1,400	11,100.00	15,540,000	貸付株式数	500株
マブチモーター	15,900	3,980.00	63,282,000		
日本電産	169,800	8,959.00	1,521,238,200		
ユーエムシーエレクトロニクス	2,600	478.00	1,242,800		
トレックス・セミコンダクター	3,300	2,845.00	9,388,500	貸付株式数	1,300株
東光高岳	4,300	1,871.00	8,045,300	貸付株式数	1,200株
ダブル・スコープ	21,000	2,626.00	55,146,000	貸付株式数	8,700株 (100株)
宮越ホールディングス	3,100	945.00	2,929,500	貸付株式数	100株
ダイヘン	7,000	3,995.00	27,965,000		
ヤーマン	12,500	1,439.00	17,987,500	貸付株式数	4,900株
JVCケンウッド	62,600	195.00	12,207,000		
ミマキエンジニアリング	6,800	654.00	4,447,200		
I-PEX	3,700	1,321.00	4,887,700	貸付株式数	400株
日新電機	17,800	1,432.00	25,489,600		
大崎電気	12,500	512.00	6,400,000	貸付株式数	100株
オムロン	63,600	7,041.00	447,807,600		
日東工業	9,700	2,583.00	25,055,100	貸付株式数	100株
IDEC	9,500	2,929.00	27,825,500	貸付株式数	100株
正興電機製作所	2,600	1,067.00	2,774,200	貸付株式数	800株
不二電機工業	1,500	1,152.00	1,728,000	貸付株式数	500株 (100株)
ジーエス・ユアサコーポ	23,000	2,487.00	57,201,000		
サクサホールディングス	1,700	1,273.00	2,164,100	貸付株式数	600株

メルコホールディングス	2,100	3,185.00	6,688,500	貸付株式数	600株
テクノメディカ	1,700	1,623.00	2,759,100	貸付株式数	600株
ダイヤモンドエレクトリック HD	2,100	1,334.00	2,801,400	貸付株式数	800株
日本電気	90,700	4,990.00	452,593,000		
富士通	68,800	16,055.00	1,104,584,000		
沖電気	29,100	744.00	21,650,400		
岩崎通信機	2,900	767.00	2,224,300	貸付株式数	1,100株
電気興業	3,700	2,402.00	8,887,400		
サンケン電気	6,600	4,635.00	30,591,000		
ナカヨ	1,200	1,075.00	1,290,000	貸付株式数	300株
アイホン	3,400	1,997.00	6,789,800	貸付株式数	100株
ルネサスエレクトロニクス	417,200	1,259.00	525,254,800		
セイコーエプソン	85,400	2,073.00	177,034,200		
ワコム	58,600	788.00	46,176,800	貸付株式数	23,300株
アルバック	15,200	5,480.00	83,296,000		
アクセル	3,000	946.00	2,838,000	貸付株式数	1,100株
E I Z O	5,200	3,740.00	19,448,000		
ジャパンディスプレイ	61,700	59.00	3,640,300		
日本信号	16,300	932.00	15,191,600	貸付株式数	6,400株
京三製作所	15,100	420.00	6,342,000	貸付株式数	4,200株
能美防災	8,700	1,600.00	13,920,000		
ホーチキ	4,800	1,328.00	6,374,400	貸付株式数	300株
星和電機	3,100	444.00	1,376,400	貸付株式数	1,300株
エレコム	17,500	1,587.00	27,772,500		
パナソニック ホールディ ンク	815,400	1,092.00	890,416,800		
シャープ	72,600	935.00	67,881,000	貸付株式数	28,900株
アンリツ	48,400	1,619.00	78,359,600		
富士通ゼネラル	20,700	2,860.00	59,202,000		
ソニーグループ	478,900	10,525.00	5,040,422,500		
T D K	110,700	4,955.00	548,518,500		
帝国通信工業	3,300	1,421.00	4,689,300		
タムラ製作所	27,600	716.00	19,761,600	貸付株式数	10,900株
アルプスアルパイン	62,600	1,211.00	75,808,600		
池上通信機	2,300	599.00	1,377,700	貸付株式数	800株
日本電波工業	7,700	1,559.00	12,004,300	貸付株式数	2,300株
鈴木	3,800	887.00	3,370,600		
メイコー	8,300	2,967.00	24,626,100		
日本トリム	1,500	2,362.00	3,543,000		

ローランド ディー . ジー .	3,600	3,190.00	11,484,000	貸付株式数	700株
フオスタ - 電機	7,200	742.00	5,342,400		
S M K	1,700	2,438.00	4,144,600	貸付株式数	600株
ヨコオ	5,200	2,132.00	11,086,400		
ティアック	12,600	115.00	1,449,000	貸付株式数	4,000株
ホシデン	17,000	1,575.00	26,775,000		
ヒロセ電機	10,600	20,000.00	212,000,000		
日本航空電子	15,400	2,382.00	36,682,800		
T O A	8,300	791.00	6,565,300	貸付株式数	100株
マクセル	14,000	1,449.00	20,286,000		
古野電気	9,200	1,105.00	10,166,000		
スミダコーポレーション	5,800	936.00	5,428,800		
アイコム	2,400	2,529.00	6,069,600	貸付株式数	1,000株
リオン	2,700	2,052.00	5,540,400		
本多通信工業	5,900	704.00	4,153,600	貸付株式数	2,200株
横河電機	70,200	2,402.00	168,620,400		
新電元工業	2,700	3,665.00	9,895,500		
アズビル	44,300	3,905.00	172,991,500		
東亜ディーケーケー	3,900	852.00	3,322,800	貸付株式数	1,500株
日本光電工業	29,400	3,095.00	90,993,000		
チ ノ ー	2,400	1,637.00	3,928,800	貸付株式数	700株
共和電業	7,000	327.00	2,289,000	貸付株式数	3,400株
日本電子材料	3,600	1,504.00	5,414,400	貸付株式数	1,300株
堀場製作所	14,100	6,180.00	87,138,000	貸付株式数	4,900株
アドバンテスト	56,800	7,570.00	429,976,000		
小野測器	2,700	412.00	1,112,400	貸付株式数	700株
エスベック	5,700	1,766.00	10,066,200		
キーエンス	69,300	51,370.00	3,559,941,000		
日置電機	3,300	6,420.00	21,186,000	貸付株式数	800株
シスメックス	54,700	7,901.00	432,184,700		
日本マイクロニクス	10,500	1,383.00	14,521,500		
メガチップス	6,800	2,575.00	17,510,000		
O B A R A G R O U P	3,000	3,265.00	9,795,000	貸付株式数	1,400株
I M A G I C A G R O U P	5,400	910.00	4,914,000	貸付株式数	300株
澤藤電機	1,000	1,221.00	1,221,000	貸付株式数	300株
デンソー	149,600	7,192.00	1,075,923,200		
原田工業	3,600	772.00	2,779,200	貸付株式数	1,200株 (1,000株)

コーセル	8,500	879.00	7,471,500		
イリソ電子工業	6,400	3,985.00	25,504,000	貸付株式数	2,500株
オプテックスグループ	11,700	2,057.00	24,066,900		
千代田インテグレ	2,600	2,207.00	5,738,200		
レーザーテック	31,300	18,550.00	580,615,000		
スタンレー電気	49,300	2,497.00	123,102,100		
岩崎電気	2,500	2,488.00	6,220,000		
ウシオ電機	36,300	1,634.00	59,314,200		
岡谷電機	5,300	242.00	1,282,600	貸付株式数	2,100株
ヘリオステクノH	7,200	371.00	2,671,200	貸付株式数	1,000株
エノモト	2,100	1,511.00	3,173,100		
日本セラミック	6,400	2,593.00	16,595,200		
遠藤照明	3,500	759.00	2,656,500		
古河電池	5,400	1,140.00	6,156,000	貸付株式数	2,100株
双信電機	3,800	434.00	1,649,200	貸付株式数	1,400株
山一電機	5,000	2,021.00	10,105,000		
図 研	5,000	3,470.00	17,350,000	貸付株式数	1,700株
日本電子	14,700	5,610.00	82,467,000		
カ シ オ	47,300	1,290.00	61,017,000		
ファナック	67,100	22,325.00	1,498,007,500		
日本シイエムケイ	13,600	455.00	6,188,000	貸付株式数	5,500株
エンプラス	1,900	4,295.00	8,160,500		
大真空	9,500	946.00	8,987,000	貸付株式数	3,700株
ロ - ム	31,800	10,570.00	336,126,000		
浜松ホトニクス	50,900	5,960.00	303,364,000		
三井ハイテック	6,600	8,420.00	55,572,000	貸付株式数	2,600株
新光電気工業	22,500	3,710.00	83,475,000	貸付株式数	100株
京 セ ラ	107,500	7,688.00	826,460,000		
協栄産業	900	1,421.00	1,278,900		
太陽誘電	34,000	4,140.00	140,760,000		
村田製作所	208,500	7,353.00	1,533,100,500		
双葉電子工業	12,700	648.00	8,229,600		
日東電工	46,200	8,750.00	404,250,000		
北陸電気工業	2,800	1,094.00	3,063,200	貸付株式数	300株
東海理化電機	20,300	1,476.00	29,962,800		
ニチコン	20,300	1,480.00	30,044,000	貸付株式数	8,000株
日本ケミコン	7,200	1,882.00	13,550,400		
K O A	10,600	2,419.00	25,641,400	貸付株式数	3,800株
三井E & S H D	21,700	433.00	9,396,100		
日立造船	60,700	872.00	52,930,400		

三菱重工業	112,200	5,245.00	588,489,000	
川崎重工業	51,900	2,648.00	137,431,200	
I H I	47,800	3,780.00	180,684,000	
名村造船所	20,000	677.00	13,540,000	貸付株式数 7,800株 (7,500株)
サノヤスホールディングス	9,700	122.00	1,183,400	貸付株式数 2,400株
スプリックス	2,500	974.00	2,435,000	貸付株式数 900株
マネジメントソリューションズ	3,600	2,743.00	9,874,800	貸付株式数 1,400株
プロレド・パートナーズ	1,600	523.00	836,800	貸付株式数 600株
AND FACTORY	1,700	365.00	620,500	貸付株式数 800株
テノ・ホールディングス	800	578.00	462,400	貸付株式数 300株
フロンティア・マネジメント	2,200	1,239.00	2,725,800	
ピアラ	1,200	727.00	872,400	貸付株式数 400株
コプロ・ホールディングス	1,500	866.00	1,299,000	
ギークス	1,300	863.00	1,121,900	貸付株式数 400株
カーブスホールディングス	20,000	792.00	15,840,000	貸付株式数 7,900株
フォーラムエンジニアリング	4,500	922.00	4,149,000	
FAST FITNESS JAP	1,300	1,407.00	1,829,100	貸付株式数 500株
日本車輛	2,400	2,102.00	5,044,800	
三菱ロジスネクスト	10,100	819.00	8,271,900	
近畿車輛	1,200	1,005.00	1,206,000	貸付株式数 400株
一家ホールディングス	1,800	675.00	1,215,000	貸付株式数 400株
フルサト・マルカHD	6,700	2,976.00	19,939,200	
ヤマエグループHD	4,300	1,640.00	7,052,000	
藤久ホールディングス	2,400	596.00	1,430,400	貸付株式数 700株
F P G	25,500	1,280.00	32,640,000	貸付株式数 2,900株
島根銀行	2,100	465.00	976,500	貸付株式数 200株
じもとホールディングス	4,900	502.00	2,459,800	
全国保証	18,000	4,690.00	84,420,000	貸付株式数 7,100株
めぶきフィナンシャルG	311,100	263.00	81,819,300	
ジャパンインベストメントA	5,100	1,331.00	6,788,100	貸付株式数 2,300株
東京きらぼしFG	8,800	2,150.00	18,920,000	
九州フィナンシャルG	132,100	362.00	47,820,200	
かんぽ生命保険	75,800	2,137.00	161,984,600	
ゆうちょ銀行	177,800	1,010.00	179,578,000	貸付株式数 70,900株

あんしん保証	3,400	264.00	897,600	貸付株式数	1,000株
富山第一銀行	17,200	405.00	6,966,000		
コンコルディア・フィナンシャル	373,200	436.00	162,715,200		
ジェイリース	2,600	2,573.00	6,689,800	貸付株式数	1,000株
西日本フィナンシャルHD	39,700	723.00	28,703,100		
イントラスト	3,300	594.00	1,960,200		
日本モーゲージサービス	4,200	926.00	3,889,200	貸付株式数	1,600株
C a s a	2,700	832.00	2,246,400	貸付株式数	700株
アルヒ	11,100	1,019.00	11,310,900	貸付株式数	4,400株
プレミアグループ	11,400	1,812.00	20,656,800		
日産自動車	901,800	538.50	485,619,300		
いすゞ自動車	221,400	1,737.00	384,571,800		
トヨタ自動車	3,485,100	2,034.50	7,090,435,950		
日野自動車	95,400	625.00	59,625,000		
三菱自動車工業	283,500	602.00	170,667,000	貸付株式数	101,400株
エフテック	4,700	527.00	2,476,900		
レシップホールディングス	2,900	525.00	1,522,500	貸付株式数	700株
G M B	1,400	702.00	982,800		
ファルテック	1,600	587.00	939,200	貸付株式数	100株
武蔵精密工業	17,000	1,701.00	28,917,000	貸付株式数	6,700株
日産車体	11,400	775.00	8,835,000	貸付株式数	4,100株
新明和工業	20,000	1,052.00	21,040,000		
極東開発工業	12,400	1,374.00	17,037,600		
トピー工業	5,900	1,384.00	8,165,600		
ティラド	2,100	2,692.00	5,653,200		
タチエス	12,600	1,220.00	15,372,000		
N O K	28,900	1,239.00	35,807,100		
フタバ産業	17,100	343.00	5,865,300		
K Y B	6,700	3,400.00	22,780,000		
市光工業	9,600	373.00	3,580,800		
大同メタル工業	14,700	513.00	7,541,100	貸付株式数	800株
プレス工業	34,700	434.00	15,059,800	貸付株式数	10,800株
ミクニ	9,300	321.00	2,985,300		
太平洋工業	14,700	1,075.00	15,802,500		
河西工業	9,200	234.00	2,152,800	貸付株式数	1,200株
アイシン	56,000	4,120.00	230,720,000		
マ ッ ダ	225,100	1,213.00	273,046,300		
今仙電機製作所	5,200	573.00	2,979,600	貸付株式数	1,900株
本田技研	558,900	3,651.00	2,040,543,900		

スズキ	151,500	4,947.00	749,470,500	
S U B A R U	201,000	2,574.00	517,374,000	
安永	3,100	716.00	2,219,600	貸付株式数 1,200株
ヤマハ発動機	99,700	2,860.00	285,142,000	
小糸製作所	38,200	4,755.00	181,641,000	
T B K	7,300	312.00	2,277,600	貸付株式数 800株
エクセディ	11,600	1,787.00	20,729,200	
ミツバ	11,700	418.00	4,890,600	
豊田合成	21,700	2,388.00	51,819,600	
愛三工業	12,200	721.00	8,796,200	
盟和産業	1,100	997.00	1,096,700	貸付株式数 400株
日本プラスト	5,400	450.00	2,430,000	貸付株式数 500株
ヨ ロ ズ	5,900	873.00	5,150,700	貸付株式数 200株
エフ・シー・シー	12,800	1,424.00	18,227,200	貸付株式数 4,500株
新家工業	1,500	1,687.00	2,530,500	
シマノ	26,000	24,255.00	630,630,000	貸付株式数 10,400株
テイ・エス テック	32,500	1,545.00	50,212,500	
3 3 F G	5,900	1,446.00	8,531,400	
第四北越フィナンシャルG	10,600	2,560.00	27,136,000	
ひろぎんH L D G S	96,500	602.00	58,093,000	貸付株式数 2,200株
マーキュリアホールディングス	4,500	629.00	2,830,500	貸付株式数 800株
おきなわF G	6,300	2,084.00	13,129,200	貸付株式数 2,400株
ダイレクトマーケティングミクス	7,400	1,765.00	13,061,000	
ポピンズ	900	1,706.00	1,535,400	貸付株式数 600株
L I T A L I C O	5,900	2,771.00	16,348,900	
十六F G	8,800	2,414.00	21,243,200	
北國F H D	6,300	4,630.00	29,169,000	
ネットプロH D	22,900	514.00	11,770,600	貸付株式数 9,100株
プロクレアホールディングス	7,900	2,069.00	16,345,100	
ジャムコ	4,600	1,177.00	5,414,200	貸付株式数 1,300株
小 野 建	6,900	1,452.00	10,018,800	
はるやまH L D G S	3,100	420.00	1,302,000	貸付株式数 1,200株
南 陽	1,400	1,864.00	2,609,600	
ノ ジ マ	12,200	2,667.00	32,537,400	
佐鳥電機	4,800	1,212.00	5,817,600	
カップ・クリエイト	10,600	1,380.00	14,628,000	貸付株式数 4,200株
エコートレーディング	1,000	551.00	551,000	貸付株式数 500株

伯東	4,400	3,530.00	15,532,000		
コンドーテック	5,500	1,003.00	5,516,500	貸付株式数	2,000株
中山福	3,300	304.00	1,003,200	貸付株式数	1,300株
ライトオン	5,700	683.00	3,893,100	貸付株式数	2,200株
ナガイレーベン	9,100	1,886.00	17,162,600	貸付株式数	3,600株
三菱食品	7,300	3,245.00	23,688,500		
良品計画	86,700	1,230.00	106,641,000		
パリミキホールディングス	9,100	242.00	2,202,200	貸付株式数	3,600株
松田産業	5,500	2,225.00	12,237,500		
第一興商	14,300	3,915.00	55,984,500		
メディパルHD	69,700	1,859.00	129,572,300		
アドヴァングループ	6,300	813.00	5,121,900	貸付株式数	600株
S P K	2,900	1,380.00	4,002,000	貸付株式数	100株
萩原電気HLDGS	2,400	2,267.00	5,440,800		
アルビス	2,100	2,267.00	4,760,700	貸付株式数	700株
アズワン	10,800	6,130.00	66,204,000		
スズデン	2,300	2,082.00	4,788,600		
尾家産業	1,700	855.00	1,453,500	貸付株式数	700株
シモジマ	4,400	1,045.00	4,598,000	貸付株式数	1,600株
ドウシシャ	7,200	1,487.00	10,706,400	貸付株式数	1,900株
小津産業	1,700	1,719.00	2,922,300	貸付株式数	400株
コナカ	7,900	346.00	2,733,400	貸付株式数	3,100株
高速	3,800	1,500.00	5,700,000		
ハウス ローゼ	800	1,621.00	1,296,800	貸付株式数	300株
G - 7ホールディングス	8,300	1,409.00	11,694,700	貸付株式数	200株
たけびし	2,600	1,508.00	3,920,800	貸付株式数	1,000株
イオン北海道	9,800	1,134.00	11,113,200	貸付株式数	4,600株
コジマ	12,900	594.00	7,662,600	貸付株式数	4,400株
ヒマラヤ	2,400	932.00	2,236,800	貸付株式数	900株
コーナン商事	10,700	3,325.00	35,577,500		
ネットワンシステムズ	27,700	2,921.00	80,911,700		
エコス	2,500	1,806.00	4,515,000	貸付株式数	1,000株
ワタミ	9,000	890.00	8,010,000	貸付株式数	3,500株
マルシェ	2,100	454.00	953,400	貸付株式数	900株
リックス	1,600	1,921.00	3,073,600	貸付株式数	600株
システムソフト	22,600	103.00	2,327,800	貸付株式数	5,600株
パンパシフィックHD	150,500	2,514.00	378,357,000		
丸文	5,900	809.00	4,773,100		
西松屋チェーン	14,900	1,541.00	22,960,900	貸付株式数	5,900株

ゼンショーホールディングス	36,800	3,485.00	128,248,000	貸付株式数	14,600株
ハピネット	5,500	1,570.00	8,635,000		
幸楽苑ホールディングス	4,400	1,008.00	4,435,200	貸付株式数	1,700株
ハークスレイ	3,100	480.00	1,488,000	貸付株式数	1,000株
橋本総業HLDGS	1,300	1,990.00	2,587,000		
日本ライフライン	22,400	978.00	21,907,200		
サイゼリヤ	11,200	2,499.00	27,988,800	貸付株式数	3,700株
タカショー	5,900	682.00	4,023,800	貸付株式数	2,300株
V Tホールディングス	28,800	480.00	13,824,000		
アルゴグラフィックス	5,800	3,885.00	22,533,000		
魚力	2,000	2,176.00	4,352,000	貸付株式数	800株
IDOM	22,900	845.00	19,350,500	貸付株式数	9,000株
日本エム・ディ・エム	4,400	1,260.00	5,544,000		
ポプラ	1,800	147.00	264,600	貸付株式数	500株
フジ・コーポレーション	4,100	1,230.00	5,043,000	貸付株式数	1,400株
ユナイテッドアローズ	8,000	1,832.00	14,656,000	貸付株式数	2,800株
進和	4,500	2,131.00	9,589,500	貸付株式数	1,700株
エスケイジャパン	1,900	549.00	1,043,100		
ダイトロン	2,600	2,097.00	5,452,200		
ハイデイ日高	11,000	1,969.00	21,659,000	貸付株式数	4,200株
シークス	9,600	1,074.00	10,310,400		
YU-WA CREATION H	3,900	205.00	799,500	貸付株式数	500株
コロワイド	31,000	1,822.00	56,482,000	貸付株式数	12,300株 (2,200株)
ピーシーデポコーポ	8,400	269.00	2,259,600	貸付株式数	3,000株
田中商事	1,900	567.00	1,077,300	貸付株式数	600株
オーハシテクニカ	3,600	1,390.00	5,004,000		
壱番屋	5,300	4,370.00	23,161,000	貸付株式数	2,100株
白銅	2,400	2,557.00	6,136,800	貸付株式数	900株
トップカルチャー	1,500	205.00	307,500	貸付株式数	200株
PLANT	1,800	664.00	1,195,200	貸付株式数	600株
スギホールディングス	15,000	5,760.00	86,400,000		
ダイコー通産	900	1,117.00	1,005,300	貸付株式数	100株
薬王堂ホールディングス	3,800	2,298.00	8,732,400	貸付株式数	800株
島津製作所	91,300	4,050.00	369,765,000		
J M S	5,900	549.00	3,239,100	貸付株式数	400株
クボテック	2,000	245.00	490,000	貸付株式数	800株
長野計器	5,100	1,059.00	5,400,900		

ブイ・テクノロジー	3,300	2,863.00	9,447,900	貸付株式数	500株
スター精密	12,400	1,812.00	22,468,800		
東京計器	4,900	1,261.00	6,178,900	貸付株式数	1,900株
愛知時計	2,800	1,417.00	3,967,600		
インターアクション	3,800	1,700.00	6,460,000	貸付株式数	1,400株
オーバル	7,400	455.00	3,367,000	貸付株式数	2,900株
東京精密	11,900	4,565.00	54,323,500		
マニー	28,000	1,686.00	47,208,000	貸付株式数	10,500株
ニコン	107,900	1,460.00	157,534,000		
トプコン	36,000	1,862.00	67,032,000		
オリンパス	366,200	2,955.50	1,082,304,100		
理研計器	5,100	4,290.00	21,879,000	貸付株式数	2,100株
S C R E E Nホールディングス	12,100	8,990.00	108,779,000		
キヤノン電子	7,000	1,603.00	11,221,000		
タムロン	4,800	3,020.00	14,496,000		
HOYA	147,600	14,470.00	2,135,772,000		
シード	3,600	555.00	1,998,000	貸付株式数	1,300株
ノーリツ鋼機	6,000	2,545.00	15,270,000		
A & Dホロンホールディングス	8,700	889.00	7,734,300		
朝日インテック	83,900	2,377.00	199,430,300		
キヤノン	348,300	3,221.00	1,121,874,300		
リコー	181,900	1,056.00	192,086,400		
シチズン時計	74,900	599.00	44,865,100		
リズム	2,500	1,425.00	3,562,500	貸付株式数	600株
大研医器	6,100	472.00	2,879,200	貸付株式数	800株
メニコン	23,600	3,385.00	79,886,000	貸付株式数	1,200株
シンシア	700	452.00	316,400	貸付株式数	200株
中本パックス	2,200	1,555.00	3,421,000	貸付株式数	700株
スノーピーク	10,900	2,081.00	22,682,900	貸付株式数	4,300株 (100株)
パラマウントベッドHD	14,700	2,575.00	37,852,500		
トランザクション	4,800	1,020.00	4,896,000	貸付株式数	1,100株
粧美堂	1,500	416.00	624,000	貸付株式数	600株
ニホンフラッシュ	6,000	969.00	5,814,000	貸付株式数	900株
前田工織	6,800	3,315.00	22,542,000	貸付株式数	2,700株
永大産業	7,500	246.00	1,845,000	貸付株式数	2,300株
アートネイチャー	6,400	709.00	4,537,600		
バンダイナムコHLDGS	63,200	9,618.00	607,857,600		

アイフィスジャパン	2,200	598.00	1,315,600	貸付株式数	700株
共立印刷	10,100	131.00	1,323,100	貸付株式数	4,100株
SHOEI	6,700	5,280.00	35,376,000		
フランスベッドHLDGS	10,000	921.00	9,210,000	貸付株式数	3,400株
マーベラス	11,800	665.00	7,847,000		
パイロットコーポレーション	10,000	5,030.00	50,300,000		
萩原工業	4,100	1,056.00	4,329,600	貸付株式数	1,600株
エイベックス	13,000	1,572.00	20,436,000	貸付株式数	4,500株
フジシールインターナショナル	15,800	1,523.00	24,063,400		
タカラトミー	31,600	1,301.00	41,111,600	貸付株式数	3,000株
広済堂ホールディングス	4,800	1,250.00	6,000,000	貸付株式数	1,800株
エステールホールディングス	1,400	624.00	873,600	貸付株式数	700株
レック	8,800	736.00	6,476,800		
タカノ	2,800	755.00	2,114,000	貸付株式数	1,000株
三光合成	8,700	463.00	4,028,100		
プロネクサス	5,800	959.00	5,562,200	貸付株式数	2,300株
ホクシン	5,600	147.00	823,200	貸付株式数	1,700株
ウッドワン	2,300	1,068.00	2,456,400	貸付株式数	500株
大建工業	3,800	1,928.00	7,326,400		
きもと	11,500	249.00	2,863,500		
凸版印刷	99,600	2,222.00	221,311,200		
大日本印刷	82,800	2,924.00	242,107,200		
共同印刷	1,900	2,477.00	4,706,300	貸付株式数	700株
NISSHA	12,100	1,841.00	22,276,100		
光村印刷	400	1,229.00	491,600	貸付株式数	200株
藤森工業	5,900	3,405.00	20,089,500		
ヴィア・ホールディングス	9,500	137.00	1,301,500	貸付株式数	3,800株
TAKARA & COMPANY	4,400	2,063.00	9,077,200	貸付株式数	100株
前澤化成工業	4,300	1,301.00	5,594,300	貸付株式数	1,300株
未来工業	2,700	1,482.00	4,001,400	貸付株式数	1,000株
アシックス	58,600	2,442.00	143,101,200		
ツツミ	1,900	1,967.00	3,737,300	貸付株式数	700株
ウェーブロックHLDGS	3,000	622.00	1,866,000	貸付株式数	1,000株
ジェイエスピー	4,500	1,416.00	6,372,000	貸付株式数	1,400株
ニチハ	9,800	2,697.00	26,430,600		
ローランド	4,600	3,880.00	17,848,000		

エフピコ	14,100	3,280.00	46,248,000		
小松ウオール工業	2,300	1,884.00	4,333,200	貸付株式数	400株
ヤマハ	44,400	5,220.00	231,768,000		
河合楽器	1,900	2,692.00	5,114,800	貸付株式数	400株
クリナップ	7,300	605.00	4,416,500		
ピジョン	40,500	1,984.00	80,352,000	貸付株式数	18,400株
天馬	5,900	2,148.00	12,673,200	貸付株式数	2,200株
兼松サステック	400	1,642.00	656,800	貸付株式数	100株
キングジム	5,600	895.00	5,012,000	貸付株式数	2,200株
象印マホービン	18,900	1,568.00	29,635,200	貸付株式数	1,700株
リンテック	14,600	2,325.00	33,945,000		
信越ポリマー	13,800	1,322.00	18,243,600		
東リ	17,200	202.00	3,474,400		
イトーキ	12,700	415.00	5,270,500		
任天堂	43,200	57,700.00	2,492,640,000		
三菱鉛筆	9,300	1,350.00	12,555,000	貸付株式数	400株
松風	2,600	2,259.00	5,873,400	貸付株式数	1,200株
タカラスタンダード	12,300	1,321.00	16,248,300	貸付株式数	100株
コクヨ	30,600	1,765.00	54,009,000	貸付株式数	12,900株
ナカバヤシ	5,500	506.00	2,783,000	貸付株式数	600株
ニフコ	25,500	3,150.00	80,325,000		
立川ブラインド	2,900	1,023.00	2,966,700	貸付株式数	1,000株
グローブライド	5,700	2,441.00	13,913,700		
オカムラ	21,500	1,284.00	27,606,000		
バルカー	6,200	2,630.00	16,306,000		
MUTOHホールディングス	1,000	1,925.00	1,925,000	貸付株式数	300株
伊藤忠	451,300	3,725.00	1,681,092,500		
丸紅	652,200	1,379.50	899,709,900		
スクロール	11,600	730.00	8,468,000	貸付株式数	4,600株
高島	1,000	2,526.00	2,526,000		
ヨンドシーホールディングス	6,400	1,741.00	11,142,400	貸付株式数	2,400株
三陽商会	3,400	892.00	3,032,800	貸付株式数	800株
長瀬産業	34,200	2,003.00	68,502,600		
ナイガイ	2,300	265.00	609,500	貸付株式数	900株
蝶理	4,200	2,007.00	8,429,400		
豊田通商	67,100	4,790.00	321,409,000		
オンワードホールディングス	41,600	275.00	11,440,000	貸付株式数	16,100株

三共生興	10,100	453.00	4,575,300		
兼 松	26,000	1,483.00	38,558,000		
美 津 濃	6,300	2,607.00	16,424,100		
ツカモトコーポレーション	1,100	1,050.00	1,155,000	貸付株式数	400株
ルックホールディングス	2,100	2,069.00	4,344,900	貸付株式数	800株
三井物産	545,600	3,157.00	1,722,459,200		
日本紙パルプ	3,600	4,320.00	15,552,000		
東京エレクトロン	48,500	41,550.00	2,015,175,000		
カメイ	8,000	1,078.00	8,624,000	貸付株式数	400株
東都水産	400	4,925.00	1,970,000	貸付株式数	100株
OUGホールディングス	1,000	2,912.00	2,912,000	貸付株式数	300株
スターゼン	5,000	2,020.00	10,100,000	貸付株式数	1,900株
セイコーHD	10,900	2,792.00	30,432,800		
山 善	27,200	912.00	24,806,400	貸付株式数	11,600株
椿本興業	1,200	3,675.00	4,410,000	貸付株式数	400株
住友商事	445,500	1,915.00	853,132,500		
B I P R O G Y	23,400	3,065.00	71,721,000		
内田洋行	3,000	4,255.00	12,765,000		
三菱商事	493,700	4,314.00	2,129,821,800		
第一実業	2,900	3,850.00	11,165,000	貸付株式数	100株
キヤノンマーケティングJ PN	15,500	3,135.00	48,592,500	貸付株式数	800株
西華産業	3,100	1,610.00	4,991,000		
佐藤商事	5,000	1,138.00	5,690,000	貸付株式数	2,000株
菱洋エレクトロ	4,400	2,347.00	10,326,800	貸付株式数	1,700株
東京産業	6,300	797.00	5,021,100	貸付株式数	200株
ユアサ商事	6,000	3,555.00	21,330,000		
神鋼商事	1,700	4,100.00	6,970,000		
トルク	1,900	198.00	376,200	貸付株式数	1,100株
阪和興業	13,000	3,620.00	47,060,000		
正栄食品	4,500	3,980.00	17,910,000	貸付株式数	1,800株
カナデン	6,100	1,034.00	6,307,400	貸付株式数	2,400株
菱電商事	5,800	1,595.00	9,251,000	貸付株式数	2,300株
ニプロ	53,000	1,141.00	60,473,000		
岩谷産業	16,700	5,410.00	90,347,000		
ナイス	2,500	1,562.00	3,905,000		
ニチモウ	900	2,580.00	2,322,000		
極東貿易	4,400	1,330.00	5,852,000		
アステナホールディングス	11,600	445.00	5,162,000		
兼松エレクトロニクス	4,100	4,150.00	17,015,000		

三愛オブリ	16,800	1,079.00	18,127,200		
稲畑産業	15,100	2,412.00	36,421,200	貸付株式数	2,000株
G S I クレオス	3,600	1,530.00	5,508,000	貸付株式数	1,400株
明和産業	7,000	785.00	5,495,000	貸付株式数	2,800株
クワザワホールディングス	2,600	430.00	1,118,000	貸付株式数	1,000株
ゴ - ルドウイン	12,400	7,680.00	95,232,000		
ユニ・チャ - ム	132,600	4,637.00	614,866,200		
デサント	12,800	3,465.00	44,352,000		
キ ン グ	3,700	427.00	1,579,900	貸付株式数	1,300株
ワ キ タ	13,700	1,112.00	15,234,400		
ヤマトインタ - ナショナル	5,500	265.00	1,457,500	貸付株式数	2,300株
東邦ホールディングス	20,400	1,828.00	37,291,200		
サンゲツ	18,100	1,612.00	29,177,200		
ミツウロコグループ	8,400	977.00	8,206,800	貸付株式数	700株
シナネンホールディングス	2,500	3,715.00	9,287,500		
伊藤忠エネクス	16,500	1,061.00	17,506,500		
サンリオ	21,200	3,495.00	74,094,000	貸付株式数	8,400株
サンワ テクノス	3,800	1,389.00	5,278,200		
リョーサン	7,700	2,255.00	17,363,500		
新光商事	9,800	960.00	9,408,000		
トーホー	2,900	1,495.00	4,335,500	貸付株式数	1,200株
三信電気	2,800	1,755.00	4,914,000		
東陽テクニカ	7,300	1,300.00	9,490,000		
モスフード サービス	9,900	3,040.00	30,096,000	貸付株式数	3,900株
加賀電子	6,100	4,170.00	25,437,000		
三益半導体	5,900	2,059.00	12,148,100		
都築電気	3,400	1,297.00	4,409,800		
ソーダニツカ	5,800	595.00	3,451,000		
立花エレテック	4,800	1,592.00	7,641,600	貸付株式数	1,800株
木曽路	10,200	2,084.00	21,256,800	貸付株式数	4,000株 (1,200株)
S R S ホールディングス	10,900	860.00	9,374,000	貸付株式数	4,300株 (1,100株)
千 趣 会	12,200	382.00	4,660,400	貸付株式数	4,800株
タカキユー	3,900	86.00	335,400	貸付株式数	2,200株
リテールパートナーズ	10,000	1,031.00	10,310,000	貸付株式数	3,300株
ケーヨー	13,700	880.00	12,056,000	貸付株式数	5,500株
上新電機	7,200	1,852.00	13,334,400	貸付株式数	2,000株
日本瓦斯	36,000	2,156.00	77,616,000		
ロイヤルホールディングス	12,800	2,079.00	26,611,200	貸付株式数	4,600株

東 天 紅	500	848.00	424,000	貸付株式数	100株
いなげや	7,300	1,181.00	8,621,300	貸付株式数	2,900株
チヨダ	6,600	771.00	5,088,600	貸付株式数	2,500株
ライフコーポレーション	5,900	2,603.00	15,357,700		
リンガーハット	8,700	2,071.00	18,017,700	貸付株式数	3,400株
M r M a x H D	9,300	610.00	5,673,000	貸付株式数	500株
テナライド	7,200	308.00	2,217,600	貸付株式数	2,900株
A O K Iホールディングス	14,900	703.00	10,474,700	貸付株式数	2,400株
オークワ	10,500	892.00	9,366,000	貸付株式数	500株
コメリ	11,600	2,567.00	29,777,200		
青山商事	14,600	951.00	13,884,600	貸付株式数	100株
しまむら	8,800	12,370.00	108,856,000		
はせがわ	3,400	365.00	1,241,000		
高 島 屋	50,600	1,583.00	80,099,800		
松 屋	12,700	883.00	11,214,100	貸付株式数	1,700株
エイチ・ツー・オーリテイ リング	32,800	1,018.00	33,390,400	貸付株式数	12,100株
近鉄百貨店	2,100	2,280.00	4,788,000	貸付株式数	900株
丸井グループ	54,400	2,400.00	130,560,000		
クレディセゾン	44,200	1,712.00	75,670,400		
アクシアル リテイリング	5,000	3,295.00	16,475,000	貸付株式数	1,700株
井 筒 屋	3,700	348.00	1,287,600	貸付株式数	1,300株
イオン	248,200	2,624.50	651,400,900	貸付株式数	98,700株
イ ズ ミ	11,900	2,917.00	34,712,300	貸付株式数	1,300株
フォーバル	2,700	981.00	2,648,700	貸付株式数	1,000株
平 和 堂	11,100	1,972.00	21,889,200	貸付株式数	5,200株
フ ジ	16,500	1,902.00	31,383,000	貸付株式数	6,500株
ヤオコー	8,500	6,520.00	55,420,000	貸付株式数	3,300株
ゼビオホールディングス	10,300	939.00	9,671,700		
ケーズホールディングス	64,000	1,215.00	77,760,000		
P A L T A C	10,600	3,960.00	41,976,000	貸付株式数	100株
三谷産業	11,500	304.00	3,496,000	貸付株式数	3,600株
O L Y M P I Cグループ	3,500	589.00	2,061,500	貸付株式数	1,200株
日産東京販売H D	12,500	282.00	3,525,000		
新生銀行	49,200	1,910.00	93,972,000		
あおぞら銀行	42,000	2,643.00	111,006,000		
三菱U F Jフィナンシャル G	4,412,500	711.50	3,139,493,750		
りそなホールディングス	797,900	513.30	409,562,070		
三井住友トラストH D	124,700	4,208.00	524,737,600		

三井住友フィナンシャルG	489,100	4,192.00	2,050,307,200	
千葉銀行	213,000	734.00	156,342,000	
群馬銀行	121,200	377.00	45,692,400	
武蔵野銀行	9,500	1,663.00	15,798,500	
千葉興業銀行	16,100	256.00	4,121,600	貸付株式数 2,000株
筑波銀行	29,800	188.00	5,602,400	貸付株式数 2,500株
七十七銀行	20,100	1,751.00	35,195,100	
秋田銀行	4,400	1,613.00	7,097,200	貸付株式数 100株
山形銀行	7,000	932.00	6,524,000	貸付株式数 600株
岩手銀行	4,700	1,791.00	8,417,700	
東邦銀行	55,100	202.00	11,130,200	貸付株式数 1,200株
東北銀行	3,300	968.00	3,194,400	貸付株式数 1,300株
ふくおかフィナンシャルG	54,400	2,417.00	131,484,800	
静岡銀行	155,400	794.00	123,387,600	
スルガ銀行	63,000	366.00	23,058,000	
八十二銀行	139,400	467.00	65,099,800	
山梨中央銀行	7,600	1,140.00	8,664,000	貸付株式数 800株
大垣共立銀行	12,900	1,696.00	21,878,400	
福井銀行	5,700	1,365.00	7,780,500	貸付株式数 100株
清水銀行	2,500	1,441.00	3,602,500	貸付株式数 100株
富山銀行	1,200	1,750.00	2,100,000	貸付株式数 400株
滋賀銀行	12,300	2,427.00	29,852,100	貸付株式数 1,200株
南都銀行	10,200	1,926.00	19,645,200	貸付株式数 100株
百五銀行	63,000	313.00	19,719,000	
京都銀行	23,400	5,310.00	124,254,000	
紀陽銀行	22,300	1,470.00	32,781,000	
ほくほくフィナンシャルG	42,800	807.00	34,539,600	
山陰合同銀行	41,700	670.00	27,939,000	貸付株式数 3,600株
中国銀行	53,100	900.00	47,790,000	貸付株式数 400株
鳥取銀行	2,400	1,117.00	2,680,800	
伊予銀行	84,800	631.00	53,508,800	
百十四銀行	7,000	1,612.00	11,284,000	
四国銀行	9,500	821.00	7,799,500	貸付株式数 3,300株
阿波銀行	10,000	1,810.00	18,100,000	
大分銀行	4,000	1,840.00	7,360,000	
宮崎銀行	4,100	2,168.00	8,888,800	貸付株式数 100株
佐賀銀行	3,700	1,495.00	5,531,500	貸付株式数 200株
琉球銀行	15,900	761.00	12,099,900	貸付株式数 1,900株
セブン銀行	225,000	259.00	58,275,000	

みずほフィナンシャルG	903,800	1,594.50	1,441,109,100	
高知銀行	2,400	652.00	1,564,800	貸付株式数 400株
山口フィナンシャルG	75,500	744.00	56,172,000	
芙蓉総合リース	6,500	8,000.00	52,000,000	
みずほリース	9,200	3,270.00	30,084,000	
東京センチュリー	11,700	4,755.00	55,633,500	
S B Iホールディングス	93,100	2,649.00	246,621,900	
日本証券金融	29,600	815.00	24,124,000	
アイフル	126,700	383.00	48,526,100	
日本アジア投資	6,600	231.00	1,524,600	
長野銀行	2,300	1,189.00	2,734,700	貸付株式数 700株
名古屋銀行	4,600	3,010.00	13,846,000	
北洋銀行	95,300	220.00	20,966,000	
愛知銀行	2,400	5,500.00	13,200,000	
中京銀行	2,400	1,788.00	4,291,200	
大光銀行	2,200	1,299.00	2,857,800	貸付株式数 400株
愛媛銀行	9,900	843.00	8,345,700	
トマト銀行	2,000	1,017.00	2,034,000	
京葉銀行	32,300	480.00	15,504,000	貸付株式数 11,200株
栃木銀行	34,000	271.00	9,214,000	
北日本銀行	2,100	1,667.00	3,500,700	貸付株式数 800株
東和銀行	12,400	516.00	6,398,400	
福島銀行	8,200	208.00	1,705,600	貸付株式数 300株
大東銀行	3,200	620.00	1,984,000	貸付株式数 1,300株
リコーリース	6,700	3,520.00	23,584,000	
イオンフィナンシャルサー ビス	41,100	1,431.00	58,814,100	
ア コ ム	149,500	322.00	48,139,000	
ジャックス	7,500	3,765.00	28,237,500	
オ リ コ	204,100	116.00	23,675,600	
オリックス	447,800	2,237.50	1,001,952,500	
三菱H Cキャピタル	243,200	667.00	162,214,400	
ジャフコ グループ	26,100	2,199.00	57,393,900	
九州 リースサービス	3,300	597.00	1,970,100	貸付株式数 1,300株
トモニホールディングス	55,500	306.00	16,983,000	
大和証券G本社	483,600	601.20	290,740,320	
野村ホールディングス	1,151,100	492.80	567,262,080	
岡三証券グループ	53,900	327.00	17,625,300	貸付株式数 400株
丸三証券	22,200	465.00	10,323,000	貸付株式数 1,600株
東洋証券	23,000	244.00	5,612,000	貸付株式数 8,900株

東海東京HD	73,500	372.00	27,342,000		
光世証券	1,600	444.00	710,400	貸付株式数	500株
水戸証券	17,500	257.00	4,497,500	貸付株式数	1,400株
いちよし証券	12,600	634.00	7,988,400	貸付株式数	100株
松井証券	36,900	788.00	29,077,200		
SOMPOホールディングス	107,300	5,947.00	638,113,100		
日本取引所グループ	175,500	2,068.50	363,021,750		
マネックスG	63,500	476.00	30,226,000	貸付株式数	25,200株
極東証券	8,500	681.00	5,788,500	貸付株式数	800株
岩井コスモホールディング	7,000	1,241.00	8,687,000		
アイザワ証券グループ	10,000	648.00	6,480,000	貸付株式数	1,700株
フィデアホール	6,800	1,295.00	8,806,000	貸付株式数	200株
池田泉州HD	78,800	208.00	16,390,400		
アニコムホールディングス	23,200	629.00	14,592,800	貸付株式数	8,200株
MS&AD	155,100	4,127.00	640,097,700		
マネーパートナーズGP	8,500	247.00	2,099,500		
スパークス・グループ	35,700	295.00	10,531,500	貸付株式数	12,400株
小林洋行	2,400	220.00	528,000	貸付株式数	200株
第一生命HLDGS	367,200	2,354.50	864,572,400		
東京海上HD	209,800	7,768.00	1,629,726,400		
アドバンテッジリスクマネ	3,900	465.00	1,813,500	貸付株式数	1,400株
イー・ギャランティ	11,200	2,177.00	24,382,400		
アサックス	3,500	582.00	2,037,000	貸付株式数	1,500株
NECキャピタルソリューション	3,100	2,100.00	6,510,000	貸付株式数	300株
T&Dホールディングス	167,700	1,497.00	251,046,900		
アドバンスクリエイト	3,700	1,058.00	3,914,600	貸付株式数	1,400株
三井不動産	294,600	2,850.50	839,757,300		
三菱地所	429,900	1,892.00	813,370,800		
平和不動産	12,100	3,935.00	47,613,500		
東京建物	60,000	2,083.00	124,980,000		
京阪神ビルディング	10,200	1,284.00	13,096,800		
住友不動産	135,800	3,406.00	462,534,800		
太平洋興発	2,600	687.00	1,786,200	貸付株式数	1,000株
テーオーシー	12,200	710.00	8,662,000	貸付株式数	500株
東京楽天地	1,300	4,060.00	5,278,000	貸付株式数	400株
スターツコーポレーション	10,500	2,621.00	27,520,500		
フジ住宅	9,600	642.00	6,163,200	貸付株式数	1,100株

空港施設	8,700	544.00	4,732,800	
明和地所	4,100	611.00	2,505,100	
ゴールドクレスト	6,600	1,704.00	11,246,400	
リログループ	40,100	2,194.00	87,979,400	貸付株式数 200株
エスリード	3,400	1,716.00	5,834,400	
日神グループHLDGS	13,500	427.00	5,764,500	貸付株式数 4,400株
日本エスコン	14,700	790.00	11,613,000	貸付株式数 4,900株
タカラレーベン	32,800	375.00	12,300,000	貸付株式数 200株
AVANTIA	4,200	795.00	3,339,000	貸付株式数 1,200株
イオンモール	38,600	1,633.00	63,033,800	
毎日コムネット	3,400	622.00	2,114,800	貸付株式数 1,000株
ファースト住建	3,400	1,067.00	3,627,800	貸付株式数 1,100株
ランド	437,900	10.00	4,379,000	貸付株式数 159,800株
カチタス	18,800	3,380.00	63,544,000	
東祥	5,500	1,055.00	5,802,500	貸付株式数 1,500株
トーセイ	10,800	1,349.00	14,569,200	貸付株式数 3,600株
穴吹興産	1,800	2,057.00	3,702,600	貸付株式数 600株
サンフロンティア不動産	11,300	1,139.00	12,870,700	
インテリックス	2,500	546.00	1,365,000	貸付株式数 600株
ランドビジネス	3,700	233.00	862,100	貸付株式数 1,100株
サンネクスタグループ	3,000	962.00	2,886,000	貸付株式数 900株
グランディハウス	5,800	550.00	3,190,000	
東武鉄道	69,800	3,240.00	226,152,000	
相鉄ホールディングス	22,900	2,283.00	52,280,700	
東急	178,000	1,623.00	288,894,000	
京浜急行	85,300	1,355.00	115,581,500	貸付株式数 9,700株
小田急電鉄	96,200	1,812.00	174,314,400	
京王電鉄	33,600	5,190.00	174,384,000	
京成電鉄	46,558	3,685.00	171,566,230	
富士急行	7,800	3,935.00	30,693,000	貸付株式数 2,200株
東日本旅客鉄道	116,600	7,000.00	816,200,000	
西日本旅客鉄道	81,100	5,287.00	428,775,700	
東海旅客鉄道	53,800	16,015.00	861,607,000	
西武ホールディングス	92,400	1,315.00	121,506,000	
鴻池運輸	10,700	1,313.00	14,049,100	
西日本鉄道	18,300	2,759.00	50,489,700	
ハマキョウレックス	5,000	3,150.00	15,750,000	
サカイ引越センター	3,500	4,605.00	16,117,500	貸付株式数 1,300株
近鉄グループHLDGS	68,000	4,595.00	312,460,000	
阪急阪神HLDGS	84,400	4,150.00	350,260,000	

南海電鉄	30,300	2,702.00	81,870,600	貸付株式数	11,500株
京阪ホールディングス	28,300	3,435.00	97,210,500		
神戸電鉄	1,700	3,360.00	5,712,000	貸付株式数	600株
名古屋鉄道	70,000	2,055.00	143,850,000		
山陽電鉄	5,200	2,136.00	11,107,200	貸付株式数	2,000株
アルプス物流	5,100	1,086.00	5,538,600		
トランコム	2,000	7,510.00	15,020,000	貸付株式数	700株
ヤマトホールディングス	99,100	2,166.00	214,650,600		
山 九	17,600	4,210.00	74,096,000		
日 新	5,300	1,834.00	9,720,200		
丸 運	3,000	229.00	687,000	貸付株式数	1,400株
丸全昭和運輸	4,900	3,095.00	15,165,500	貸付株式数	1,500株
センコーグループHLDGS	33,400	959.00	32,030,600	貸付株式数	3,500株
トナミホールディングス	1,400	3,560.00	4,984,000		
ニッコンホールディングス	21,800	2,350.00	51,230,000		
日石輸送	800	2,393.00	1,914,400	貸付株式数	200株
福山通運	9,300	3,065.00	28,504,500	貸付株式数	400株
セイノーホールディングス	39,500	1,128.00	44,556,000	貸付株式数	6,500株
エスライン	2,000	808.00	1,616,000	貸付株式数	700株
神奈川中央交通	1,800	3,565.00	6,417,000	貸付株式数	600株
日立物流	13,300	8,810.00	117,173,000		
丸和運輸機関	12,200	1,492.00	18,202,400		
C & F ロジホールディングス	6,100	1,196.00	7,295,600		
日本郵船	60,600	9,420.00	570,852,000		
商船三井	111,700	3,250.00	363,025,000		
川崎汽船	22,300	7,890.00	175,947,000	貸付株式数	600株
NSユニテッド海運	3,400	4,480.00	15,232,000	貸付株式数	1,400株
明治海運	6,900	763.00	5,264,700	貸付株式数	3,000株
飯野海運	28,600	743.00	21,249,800		
共栄タンカー	1,300	893.00	1,160,900	貸付株式数	400株
九州旅客鉄道	48,700	2,897.00	141,083,900		
SGホールディングス	121,500	2,195.00	266,692,500		
NIPPON EXPRESS	23,600	7,480.00	176,528,000		
日本航空	155,700	2,472.00	384,890,400		
ANAホールディングス	172,300	2,596.00	447,290,800		
ビーウィズ	2,000	1,386.00	2,772,000		
パスコ	1,400	1,306.00	1,828,400		

TREホールディングス	13,700	1,651.00	22,618,700	貸付株式数	3,600株
人・夢・技術グループ	2,900	2,680.00	7,772,000	貸付株式数	100株
西本WISMETTACHD	1,700	3,775.00	6,417,500	貸付株式数	600株
シルバーライフ	1,600	1,398.00	2,236,800	貸付株式数	600株
ヤマシタヘルスケアHLDGS	700	1,585.00	1,109,500	貸付株式数	200株
GENKY DRUGSTORES	3,300	3,600.00	11,880,000	貸付株式数	1,300株
コア商事HLDGS	4,800	690.00	3,312,000		
国際紙パルプ商事	14,100	731.00	10,307,100	貸付株式数	5,500株
ナルミヤ・インターナショナル	1,700	850.00	1,445,000	貸付株式数	600株
ブックオフGHD	4,500	1,009.00	4,540,500	貸付株式数	1,800株
ギフトホールディングス	1,400	2,949.00	4,128,600	貸付株式数	400株
三菱倉庫	17,500	3,625.00	63,437,500		
三井倉庫HOLD	7,100	3,325.00	23,607,500		
住友倉庫	21,300	2,129.00	45,347,700		
渋沢倉庫	3,500	2,074.00	7,259,000	貸付株式数	600株
ヤマタネ	3,100	1,581.00	4,901,100	貸付株式数	1,100株
東陽倉庫	10,100	271.00	2,737,100	貸付株式数	3,500株
乾汽船	4,400	1,920.00	8,448,000	貸付株式数	500株
日本トランスシティ	12,800	497.00	6,361,600		
ケイヒン	1,200	1,420.00	1,704,000		
中央倉庫	3,600	926.00	3,333,600	貸付株式数	1,400株
川西倉庫	1,300	1,049.00	1,363,700	貸付株式数	400株
安田倉庫	4,900	920.00	4,508,000		
ファイズホールディングス	1,600	1,034.00	1,654,400	貸付株式数	500株
東洋埠頭	1,800	1,222.00	2,199,600		
上組	34,400	2,668.00	91,779,200		
サンリツ	1,600	680.00	1,088,000	貸付株式数	300株
キムラユニティー	3,800	804.00	3,055,200	貸付株式数	400株
キューソー流通システム	4,200	1,294.00	5,434,800	貸付株式数	1,200株
東海運	4,100	279.00	1,143,900	貸付株式数	1,400株
エーアイティー	4,500	1,489.00	6,700,500	貸付株式数	1,600株
内外トランスライン	2,300	2,160.00	4,968,000	貸付株式数	900株
ショーエイコーポ	2,000	583.00	1,166,000	貸付株式数	800株
日本コンセプト	2,000	1,775.00	3,550,000		
TBSホールディングス	36,600	1,592.00	58,267,200		
日本テレビHLD S	62,800	1,161.00	72,910,800		

朝日放送グループHD	6,100	637.00	3,885,700	貸付株式数	2,500株
テレビ朝日HD	18,000	1,416.00	25,488,000	貸付株式数	3,200株
スカパーJSA THD	63,500	536.00	34,036,000		
テレビ東京HD	4,600	1,919.00	8,827,400		
日本BS放送	2,400	925.00	2,220,000	貸付株式数	900株
ビジョン	8,400	1,282.00	10,768,800	貸付株式数	3,300株
スマートバリュー	1,700	491.00	834,700		
USEN-NEXT HLDGS	5,700	1,987.00	11,325,900	貸付株式数	2,500株
ワイヤレスゲート	3,200	290.00	928,000	貸付株式数	1,100株
コネクシオ	5,300	1,278.00	6,773,400		
日本通信	62,600	225.00	14,085,000	貸付株式数	24,600株
クロップス	1,600	901.00	1,441,600		
日本電信電話	840,900	3,765.00	3,165,988,500		
KDDI	546,900	4,274.00	2,337,450,600		
ソフトバンク	1,135,700	1,505.50	1,709,796,350		
光通信	8,600	17,170.00	147,662,000		
エムティーアイ	5,900	489.00	2,885,100	貸付株式数	2,200株
GMOインターネットグループ	23,600	2,583.00	60,958,800		
ファイバーゲート	3,400	931.00	3,165,400	貸付株式数	1,300株
アイドママーケティングコム	1,700	290.00	493,000	貸付株式数	600株
KADOKAWA	40,400	2,856.00	115,382,400		
学研ホールディングス	10,600	970.00	10,282,000	貸付株式数	2,600株
ゼンリン	12,500	908.00	11,350,000	貸付株式数	4,300株
昭文社ホールディングス	3,300	310.00	1,023,000	貸付株式数	1,300株
インプレスホールディングス	6,200	209.00	1,295,800	貸付株式数	300株
東京電力HD	572,500	501.00	286,822,500	貸付株式数	105,400株
中部電力	215,800	1,396.00	301,256,800		
関西電力	267,200	1,312.00	350,566,400		
中国電力	110,200	814.00	89,702,800	貸付株式数	100株
北陸電力	64,600	502.00	32,429,200		
東北電力	167,100	689.00	115,131,900		
四国電力	63,700	790.00	50,323,000		
九州電力	146,600	818.00	119,918,800	貸付株式数	5,200株
北海道電力	66,100	502.00	33,182,200		
沖縄電力	16,100	1,100.00	17,710,000		
電源開発	56,500	2,089.00	118,028,500		

エフオン	4,600	660.00	3,036,000		
イーレックス	9,900	2,804.00	27,759,600	貸付株式数	4,000株
レノバ	15,000	3,155.00	47,325,000	貸付株式数	6,000株
東京瓦斯	136,100	2,530.00	344,333,000		
大阪瓦斯	128,600	2,261.00	290,764,600		
東邦瓦斯	30,000	2,969.00	89,070,000		
北海道瓦斯	3,700	1,623.00	6,005,100	貸付株式数	400株
広島ガス	12,700	324.00	4,114,800	貸付株式数	1,200株
西部ガスHLDGS	7,400	1,773.00	13,120,200	貸付株式数	600株
静岡ガス	14,500	1,008.00	14,616,000		
メタウォーター	7,800	1,999.00	15,592,200		
アイネット	3,500	1,315.00	4,602,500		
松竹	4,300	11,590.00	49,837,000		
東宝	44,300	5,250.00	232,575,000		
エイチ・アイ・エス	17,100	2,008.00	34,336,800	貸付株式数	7,600株
東映	2,100	17,670.00	37,107,000		
ラックランド	2,100	2,885.00	6,058,500	貸付株式数	800株
NTTデータ	199,700	1,929.00	385,221,300		
共立メンテナンス	13,000	5,500.00	71,500,000	貸付株式数	5,100株
イチネンホールディングス	7,400	1,237.00	9,153,800		
建設技術研究所	3,300	2,822.00	9,312,600		
スペース	4,700	838.00	3,938,600	貸付株式数	500株
アインホールディングス	9,300	6,660.00	61,938,000	貸付株式数	3,500株 (2,000株)
燦ホールディングス	3,200	1,801.00	5,763,200		
ピー・シー・エー	4,400	1,016.00	4,470,400	貸付株式数	1,700株
スバル興業	400	8,820.00	3,528,000	貸付株式数	100株
東京テアトル	3,000	1,210.00	3,630,000	貸付株式数	1,000株
タナベ経営	2,600	621.00	1,614,600	貸付株式数	1,000株
ビジネスB太田昭和	2,500	1,475.00	3,687,500	貸付株式数	600株
ナガワ	2,100	7,560.00	15,876,000	貸付株式数	800株
東京都競馬	5,500	4,100.00	22,550,000		
常磐興産	2,500	1,255.00	3,137,500	貸付株式数	1,000株
カナモト	11,900	2,032.00	24,180,800		
DTS	13,900	3,580.00	49,762,000	貸付株式数	100株
スクウェア・エニックス・HD	34,900	6,030.00	210,447,000		
シーイーシー	8,100	1,277.00	10,343,700		
カプコン	70,700	3,655.00	258,408,500		
西尾レントオール	6,100	2,810.00	17,141,000		

アイ・エス・ピー	3,200	1,222.00	3,910,400	貸付株式数	1,200株
アゴーラ ホスピタリ ティーG	42,700	21.00	896,700	貸付株式数	15,100株
日本空港ビルデング	24,400	5,420.00	132,248,000	貸付株式数	10,300株
トランス・コスモス	9,200	3,720.00	34,224,000	貸付株式数	3,200株
乃村工藝社	31,300	955.00	29,891,500	貸付株式数	700株
ジャステック	3,800	1,187.00	4,510,600	貸付株式数	200株
S C S K	51,800	2,250.00	116,550,000		
藤田観光	2,900	2,596.00	7,528,400	貸付株式数	1,000株
K N T - C Tホールディン グス	4,500	1,585.00	7,132,500	貸付株式数	1,600株
日本管財	7,700	2,610.00	20,097,000	貸付株式数	1,700株
トーカイ	5,800	1,772.00	10,277,600	貸付株式数	100株
白 洋 舎	600	1,315.00	789,000	貸付株式数	300株
セコム	72,000	8,578.00	617,616,000		
N S W	2,900	2,270.00	6,583,000		
セントラル警備保障	3,600	2,337.00	8,413,200	貸付株式数	1,400株
アイネス	6,400	1,514.00	9,689,600	貸付株式数	2,300株
丹青社	13,700	780.00	10,686,000		
メイテック	26,000	2,338.00	60,788,000		
T K C	11,400	3,495.00	39,843,000		
富士ソフト	7,200	8,180.00	58,896,000	貸付株式数	400株
応用地質	6,300	1,825.00	11,497,500		
船井総研ホールディン	13,700	2,365.00	32,400,500		
N S D	23,300	2,519.00	58,692,700		
進学会ホールディングス	2,100	314.00	659,400	貸付株式数	900株
丸紅建材リース	600	1,852.00	1,111,200	貸付株式数	100株
オ オ バ	4,500	699.00	3,145,500	貸付株式数	1,800株
コナミグループ	27,300	7,020.00	191,646,000		
いであ	1,600	1,700.00	2,720,000	貸付株式数	600株
学 究 社	2,200	1,619.00	3,561,800		
ベネッセホールディングス	24,300	2,117.00	51,443,100		
イオンディライト	8,300	2,807.00	23,298,100		
ナック	4,100	928.00	3,804,800	貸付株式数	1,300株
福井コンピュータH L D S	3,400	3,630.00	12,342,000		
ダイセキ	13,300	4,155.00	55,261,500		
ステップ	2,700	1,811.00	4,889,700	貸付株式数	1,000株
日鉄物産	4,500	5,350.00	24,075,000		
泉州電業	1,700	5,470.00	9,299,000	貸付株式数	700株
元気寿司	2,100	2,805.00	5,890,500	貸付株式数	800株

トラスコ中山	14,100	1,926.00	27,156,600	
ヤマダホールディングス	267,200	473.00	126,385,600	
オートバックスセブン	23,400	1,410.00	32,994,000	貸付株式数 9,300株
モリト	5,000	695.00	3,475,000	貸付株式数 600株
アーケランズ	11,900	1,470.00	17,493,000	
ニトリホールディングス	29,900	12,305.00	367,919,500	
グルメ杵屋	6,100	1,029.00	6,276,900	貸付株式数 2,400株 (100株)
愛眼	6,900	179.00	1,235,100	貸付株式数 2,700株
ケーユーホールディングス	4,000	1,129.00	4,516,000	貸付株式数 200株
吉野家ホールディングス	26,300	2,286.00	60,121,800	貸付株式数 10,500株
加藤産業	8,100	3,420.00	27,702,000	
北恵	1,500	738.00	1,107,000	貸付株式数 600株
イノテック	4,400	1,327.00	5,838,800	
イエローハット	12,000	1,826.00	21,912,000	貸付株式数 4,700株
松屋フーズHLDGS	3,600	3,700.00	13,320,000	貸付株式数 1,400株
JBCホールディングス	5,000	1,842.00	9,210,000	
JKホールディングス	5,200	991.00	5,153,200	貸付株式数 2,200株
サガミホールディングス	11,000	1,208.00	13,288,000	貸付株式数 4,300株 (300株)
日伝	5,000	1,799.00	8,995,000	貸付株式数 1,800株
関西フードマーケット	6,100	1,139.00	6,947,900	貸付株式数 2,400株
ミロク情報サービス	6,700	1,474.00	9,875,800	貸付株式数 2,600株
北沢産業	3,600	213.00	766,800	
杉本商事	3,500	1,901.00	6,653,500	貸付株式数 800株
因幡電機産業	18,500	2,709.00	50,116,500	
王将フードサービス	5,000	6,210.00	31,050,000	貸付株式数 1,700株
プレナス	8,400	1,892.00	15,892,800	
ミニストップ	5,500	1,397.00	7,683,500	貸付株式数 2,000株
アークス	13,300	1,999.00	26,586,700	貸付株式数 5,000株
パローホールディングス	15,300	1,699.00	25,994,700	
東テク	2,200	3,390.00	7,458,000	貸付株式数 800株
ミスミグループ本社	94,500	3,340.00	315,630,000	
アルテック	4,200	327.00	1,373,400	
ベルク	3,300	5,320.00	17,556,000	貸付株式数 600株
大庄	3,800	1,078.00	4,096,400	貸付株式数 1,300株
タキヒヨー	1,800	742.00	1,335,600	貸付株式数 800株
ファーストリテイリング	10,100	81,360.00	821,736,000	
ソフトバンクグループ	449,800	5,368.00	2,414,526,400	
蔵王産業	1,300	1,792.00	2,329,600	貸付株式数 500株

スズケン	26,900	3,210.00	86,349,000		
サンドラッグ	28,300	3,385.00	95,795,500		
サクスパーホールディング グ	7,400	625.00	4,625,000	貸付株式数	2,400株
ジェコス	5,100	805.00	4,105,500	貸付株式数	100株
ヤマザワ	1,200	1,300.00	1,560,000	貸付株式数	600株
やまや	1,700	2,569.00	4,367,300	貸付株式数	600株 (100株)
グローセル	8,100	433.00	3,507,300	貸付株式数	3,000株
ペルーナ	16,200	708.00	11,469,600	貸付株式数	100株
合計			187,268,579,370		

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

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

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	326,662,382	473,361,003

コール・ローン	6,604,971,518	4,919,868,759
株式	221,009,477,811	268,032,205,781
投資証券	5,533,293,844	7,280,561,932
派生商品評価勘定	463,357,070	181,856,269
未収入金	11,156,628	13,807,577
未収配当金	391,065,230	543,020,604
差入委託証拠金	4,176,478,425	2,584,711,528
流動資産合計	238,516,462,908	284,029,393,453
資産合計	238,516,462,908	284,029,393,453
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	16,295,870	171,223,399
未払金	6,801,376	-
未払解約金	384,818,700	12,992,200
流動負債合計	407,915,946	184,215,599
負債合計	407,915,946	184,215,599
純資産の部		
元本等		
元本	1 60,251,266,888	65,876,384,035
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	177,857,280,074	217,968,793,819
元本等合計	238,108,546,962	283,845,177,854
純資産合計	238,108,546,962	283,845,177,854
負債純資産合計	238,516,462,908	284,029,393,453

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9月8日 至 2022年9月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
1. 1 期首	2020年9月8日	2021年9月8日
期首元本額	53,173,758,315円	60,251,266,888円
期中追加設定元本額	12,755,960,042円	13,048,541,062円
期中一部解約元本額	5,678,451,469円	7,423,423,915円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国株式インデックスVA	370,726,578円	336,207,237円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	4,507,601円	3,645,389円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	67,214,370円	41,790,479円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	7,853,764円	6,522,948円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	244,897,359円	194,506,793円
外国株式インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	32,564,808円	59,267,896円

ダイワファンドラップ 外国 株式インデックス エマー ジ ングプラス(為替ヘッジな し)	514,519,583円	512,844,484円
ダイワファンドラップ 外国 株式インデックス(為替ヘッ ジなし)	2,486,471,273円	2,922,731,671円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国株式インデックス エマー ジ ングプラス(為替 ヘッジなし)	508,487,417円	649,866,356円
D - I ' s 外国株式インデッ クス	13,686,514円	16,221,194円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2050	24,909,382円	42,984,902円
i F r e e 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	3,609,051,197円	5,464,783,930円
i F r e e 8資産バランス	1,073,964,819円	1,304,789,990円
i F r e e 年金バランス	149,879,817円	234,843,904円
D Cダイワ外国株式インデッ クス	37,152,580,241円	42,376,597,980円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	502,369,024円	516,375,683円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	911,512,276円	985,289,025円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	708,790,899円	813,971,233円
大和D C海外株式インデック スファンド	1,689,461,459円	1,854,332,102円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	12,030,768円	12,334,479円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	9,987,135円	11,668,360円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	725,213,325円	1,175,940,588円
ダイワつみたてインデックス バランス3 0	1,666,762円	1,935,989円
ダイワつみたてインデックス バランス5 0	1,940,773円	2,157,242円
ダイワつみたてインデックス バランス7 0	3,245,810円	4,469,808円

ダイワ先進国株式インデックス(為替ヘッジなし)(投資一任専用)	- 円	2,946,119円
ダイワ世界バランスファンド40VA	114,170,055円	76,187,314円
ダイワ世界バランスファンド60VA	219,165,573円	71,098,436円
ダイワ・バランスファンド35VA	1,583,968,789円	1,260,639,867円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	82,192,459円	66,268,874円
ダイワバランスファンド2020-07(適格機関投資家専用)	211,630,253円	- 円
ダイワバランスファンド2021-02(適格機関投資家専用)	212,845,169円	173,081,567円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	888,805,556円	1,101,819,537円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	278,408,148円	406,624,891円
ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	2,930,323,613円	265,642,951円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,795,347,096円	2,818,337,246円
ダイワライフスタイル25	13,261,214円	10,585,119円
ダイワライフスタイル50	52,019,759円	44,026,353円
ダイワライフスタイル75	41,596,250円	33,046,099円
計	60,251,266,888円	65,876,384,035円
2. 期末日における受益権の総数	60,251,266,888口	65,876,384,035口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 2021年9月8日 至 2022年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	37,922,850,948	47,079,059,401

投資証券	1,112,154,119	1,019,126,579
合計	39,035,005,067	48,098,185,980

(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9月7日まで、及び2021年12月1日から2022年9月7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

1. 株式関連

種 類	2021年9月7日 現在				2022年9月7日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	11,148,930,910	-	11,603,162,105	454,231,195	8,594,315,830	-	8,497,651,250	96,664,580
合計	11,148,930,910	-	11,603,162,105	454,231,195	8,594,315,830	-	8,497,651,250	96,664,580

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

種 類	2021年9月7日 現在				2022年9月7日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		

市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	6,376,718,495	-	6,369,548,500	7,169,995	4,893,979,550	-	5,001,277,000	107,297,450
アメリカ・ドル	4,318,032,880	-	4,302,200,000	15,832,880	2,922,771,240	-	2,998,170,000	75,398,760
イギリス・ポンド	234,506,010	-	235,584,500	1,078,490	241,897,500	-	246,045,000	4,147,500
オーストラリア・ドル	229,508,505	-	233,130,000	3,621,495	327,267,690	-	330,889,500	3,621,810
カナダ・ドル	331,231,180	-	332,880,000	1,648,820	285,344,100	-	292,491,000	7,146,900
スイス・フラン	300,768,000	-	300,350,000	418,000	334,486,740	-	341,337,500	6,850,760
ユーロ	962,671,920	-	965,404,000	2,732,080	782,212,280	-	792,344,000	10,131,720
合計	6,376,718,495	-	6,369,548,500	7,169,995	4,893,979,550	-	5,001,277,000	107,297,450

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
1口当たり純資産額	3.9519円	4.3088円
(1万口当たり純資産額)	(39,519円)	(43,088円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	4,900	167.870	822,563.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	4,100	530.540	2,175,214.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,500	163.530	1,226,475.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,400	95.450	515,430.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,600	150.900	392,340.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	21,100	31.000	654,100.000	
	ABBOTT LABORATORIES	72,366	102.710	7,432,711.860	
	HOWMET AEROSPACE INC	15,583	34.730	541,197.590	
	VERISK ANALYTICS INC	6,500	186.690	1,213,485.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	13,900	35.450	492,755.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	24,700	72.820	1,798,654.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,800	418.890	754,002.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	25,300	89.400	2,261,820.000	
	QORVO INC	4,420	88.800	392,496.000	
	AFLAC INC	25,300	59.530	1,506,109.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	5,100	123.210	628,371.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	7,100	88.930	631,403.000	
	ADOBE INC	19,520	368.300	7,189,216.000	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,600	102.920	885,112.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	4,800	327.810	1,573,488.000	
	GARMIN LTD	6,300	87.790	553,077.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,200	246.170	2,264,764.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	28,200	185.600	5,233,920.000		
WR BERKLEY CORP	8,642	65.700	567,779.400		
AUTOZONE INC	820	2,130.860	1,747,305.200		
DOLLAR TREE INC	9,271	138.310	1,282,272.010		
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	47,800	8.740	417,772.000		
CELANESE CORP	4,450	106.330	473,168.500		

DR HORTON INC	13,816	69.990	966,981.840	
DENTSPLY SIRONA INC	8,900	31.060	276,434.000	
AUTODESK INC	9,000	198.180	1,783,620.000	
MOODY'S CORP	6,900	287.900	1,986,510.000	
DEVON ENERGY CORP	25,900	69.540	1,801,086.000	
ALBEMARLE CORP	4,800	266.700	1,280,160.000	
ATMOS ENERGY CORP	5,800	114.210	662,418.000	
ALLIANT ENERGY CORP	10,200	61.160	623,832.000	
CITIGROUP INC	80,473	48.220	3,880,408.060	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	17,400	238.140	4,143,636.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	21,300	101.560	2,163,228.000	
ALLEGHANY CORP	620	840.400	521,048.000	
DOMINO'S PIZZA INC	1,530	362.770	555,038.100	
HESS CORP	11,600	119.440	1,385,504.000	
DAVITA INC	2,750	88.260	242,715.000	
DANAHER CORP	28,650	272.480	7,806,552.000	
FORTIVE CORP	14,100	63.070	889,287.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	23,100	99.910	2,307,921.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	23,300	85.700	1,996,810.000	
BUNGE LTD	6,300	94.100	592,830.000	
TE CONNECTIVITY LTD	13,195	123.100	1,624,304.500	
APPLE INC	670,000	154.530	103,535,100.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	11,600	97.490	1,130,884.000	
BOEING CO/THE	23,300	152.390	3,550,687.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,215	97.220	604,222.300	
BECTON DICKINSON AND CO	11,799	252.070	2,974,173.930	
LEIDOS HOLDINGS INC	5,400	93.600	505,440.000	
NISOURCE INC	16,500	29.520	487,080.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,300	112.900	598,370.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	31,771	41.140	1,307,058.940	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	173,704	41.100	7,139,234.400	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	53,250	276.590	14,728,417.500	
ANSYS INC	3,600	241.260	868,536.000	
TRUIST FINANCIAL CORP	55,117	46.020	2,536,484.340	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	29,000	94.090	2,728,610.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	88,300	68.650	6,061,795.000	
JPMORGAN CHASE & CO	121,470	113.740	13,815,997.800	

T ROWE PRICE GROUP INC	9,300	118.660	1,103,538.000	
LKQ CORP	11,100	51.270	569,097.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	12,812	71.030	910,036.360	
CADENCE DESIGN SYS INC	11,400	167.820	1,913,148.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,500	268.490	1,208,205.000	
DOLLAR GENERAL CORP	9,400	239.810	2,254,214.000	
SERVICENOW INC	8,300	430.470	3,572,901.000	
CATERPILLAR INC	22,100	180.660	3,992,586.000	
BROWN & BROWN INC	9,700	63.360	614,592.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	10,300	49.060	505,318.000	
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,100	200.160	420,336.000	
CMS ENERGY CORP	12,000	67.370	808,440.000	
MOSAIC CO/THE	14,900	54.010	804,749.000	
DELTA AIR LINES INC	6,200	31.190	193,378.000	
CORNING INC	33,200	32.790	1,088,628.000	
CISCO SYSTEMS INC	171,350	44.470	7,619,934.500	
MORGAN STANLEY	54,152	85.130	4,609,959.760	
MSCI INC	3,400	457.680	1,556,112.000	
FAIR ISAAC CORP	1,100	441.630	485,793.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,300	249.980	324,974.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	9,400	54.800	515,120.000	
BROADCOM INC	16,712	498.200	8,325,918.400	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,000	201.260	1,006,300.000	
ARAMARK	9,600	35.110	337,056.000	
DTE ENERGY COMPANY	7,900	131.200	1,036,480.000	
CENTENE CORP	24,207	88.330	2,138,204.310	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,400	121.490	534,556.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	20,200	35.710	721,342.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,700	180.900	1,573,830.000	
GARTNER INC	3,350	290.420	972,907.000	
SPLUNK INC	6,700	86.980	582,766.000	
DOMINION ENERGY INC	33,541	81.500	2,733,591.500	
MONSTER BEVERAGE CORP	16,400	88.590	1,452,876.000	
SMITH (A.O.) CORP	5,300	55.890	296,217.000	
DEERE & CO	12,000	361.060	4,332,720.000	
QUANTA SERVICES INC	6,000	140.260	841,560.000	
POOL CORP	1,700	335.470	570,299.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	11,684	126.330	1,476,039.720	
VMWARE INC-CLASS A	8,700	114.510	996,237.000	

CABLE ONE INC	200	1,093.180	218,636.000	
BURLINGTON STORES INC	2,700	139.720	377,244.000	
NASDAQ INC	14,300	60.620	866,866.000	
VAIL RESORTS INC	1,700	220.250	374,425.000	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	20,900	8.190	171,171.000	
TARGA RESOURCES CORP	9,000	68.050	612,450.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,000	126.180	378,540.000	
WESTLAKE CORP	1,600	95.680	153,088.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	14,700	97.750	1,436,925.000	
COGNEX CORP	6,900	42.620	294,078.000	
WEBSTER FINANCIAL CORP	7,300	45.000	328,500.000	
TELEFLEX INC	1,900	221.700	421,230.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,500	167.210	585,235.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,100	291.000	902,100.000	
BIO-RAD LABORATORIES-A	900	477.910	430,119.000	
CATALENT INC	6,900	88.970	613,893.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,800	168.270	975,966.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,400	338.690	812,856.000	
CARLISLE COS INC	2,200	297.940	655,468.000	
IDEX CORP	3,100	200.930	622,883.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	32,900	77.770	2,558,633.000	
ROLLINS INC	9,207	35.780	329,426.460	
AMETEK INC	9,600	119.510	1,147,296.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,000	80.230	802,300.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,450	49.000	316,050.000	
HEICO CORP	1,800	149.670	269,406.000	
GENERAC HOLDINGS INC	2,600	225.510	586,326.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,600	436.390	698,224.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,800	80.570	870,156.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,700	363.590	618,103.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	18,260	518.900	9,475,114.000	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	3,250	67.190	218,367.500	
EPAM SYSTEMS INC	2,400	410.830	985,992.000	
RPM INTERNATIONAL INC	5,300	92.580	490,674.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,200	1,634.580	1,961,496.000	
UGI CORP	8,500	38.570	327,845.000	

CUMMINS INC	5,800	212.440	1,232,152.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	32,300	76.840	2,481,932.000	
CDW CORP/DE	5,600	169.370	948,472.000	
SIGNATURE BANK	2,650	168.370	446,180.500	
COSTAR GROUP INC	16,400	76.200	1,249,680.000	
SVB FINANCIAL GROUP	2,400	383.640	920,736.000	
AMERCO	400	524.370	209,748.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,000	272.000	1,088,000.000	
MERCADOLIBRE INC	1,890	857.930	1,621,487.700	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,000	194.410	583,230.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	11,516	126.870	1,461,034.920	
DEXCOM INC	16,200	82.030	1,328,886.000	
NORDSON CORP	2,090	225.550	471,399.500	
COPART INC	8,700	116.460	1,013,202.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,000	134.010	938,070.000	
SEAGEN INC	5,700	149.020	849,414.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,100	238.990	740,869.000	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,300	220.830	728,739.000	
TRANSDIGM GROUP INC	2,090	601.390	1,256,905.100	
BIO-TECHNE CORP	1,580	329.040	519,883.200	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,900	103.020	401,778.000	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	9,000	59.630	536,670.000	
KINDER MORGAN INC	84,381	17.770	1,499,450.370	
HCA HEALTHCARE INC	9,800	200.710	1,966,958.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,600	242.580	388,128.000	
COTERRA ENERGY INC	33,000	29.160	962,280.000	
T-MOBILE US INC	25,927	141.910	3,679,300.570	
ZILLOW GROUP INC - C	6,750	33.500	226,125.000	
COCA-COLA CO/THE	170,450	61.180	10,428,131.000	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	8,800	46.510	409,288.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,950	100.590	699,100.500	
FRANKLIN RESOURCES INC	12,400	25.910	321,284.000	
CSX CORP	89,900	31.490	2,830,951.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,800	226.100	859,180.000	
EXPEDIA GROUP INC	6,325	100.850	637,876.250	
AMAZON.COM INC	378,800	126.110	47,770,468.000	

EDWARDS LIFESCIENCES CORP	25,700	89.060	2,288,842.000	
EXXON MOBIL CORP	174,205	94.950	16,540,764.750	
AES CORP	27,100	26.050	705,955.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,600	274.400	439,040.000	
EOG RESOURCES INC	24,200	120.310	2,911,502.000	
EQT CORP	14,100	45.430	640,563.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,500	88.650	576,225.000	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	500	797.360	398,680.000	
ABIOMED INC	1,900	263.890	501,391.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	6,500	146.020	949,130.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	12,400	129.300	1,603,320.000	
FORD MOTOR CO	163,423	15.030	2,456,247.690	
EXACT SCIENCES CORP	7,100	35.370	251,127.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	6,237	19.090	119,064.330	
ENTEGRIS INC	6,200	93.080	577,096.000	
AERCAP HOLDINGS NV	5,600	43.700	244,720.000	
FORTINET INC	28,200	49.650	1,400,130.000	
MARKEL CORP	550	1,186.660	652,663.000	
NEXTERA ENERGY INC	81,280	87.370	7,101,433.600	
MASIMO CORP	2,200	142.130	312,686.000	
FREEMPORT-MCMORAN INC	59,908	28.120	1,684,612.960	
INSULET CORP	2,900	249.790	724,391.000	
US BANCORP	58,400	45.320	2,646,688.000	
UNITED RENTALS INC	3,000	292.080	876,240.000	
F5 NETWORKS INC	2,500	155.010	387,525.000	
FASTENAL CO	23,800	50.300	1,197,140.000	
FISERV INC	25,433	104.160	2,649,101.280	
GENERAL ELECTRIC CO	45,506	72.160	3,283,712.960	
GENERAL MOTORS CO	57,300	38.710	2,218,083.000	
ZENDESK INC	5,100	76.630	390,813.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	9,800	224.550	2,200,590.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	14,250	326.490	4,652,482.500	
ALPHABET INC-CL A	248,800	106.810	26,574,328.000	
ALPHABET INC-CL C	233,340	107.480	25,079,383.200	
OWENS CORNING	3,900	80.830	315,237.000	
GENERAL MILLS INC	24,900	75.300	1,874,970.000	
FIRSTENERGY CORP	22,418	39.720	890,442.960	
GENUINE PARTS CO	5,950	157.390	936,470.500	
FIFTH THIRD BANCORP	28,400	33.270	944,868.000	

L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	8,050	229.770	1,849,648.500	
HALLIBURTON CO	37,300	29.520	1,101,096.000	
HOME DEPOT INC	42,550	289.540	12,319,927.000	
ASSURANT INC	2,250	158.660	356,985.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	59,500	13.170	783,615.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,710	229.080	391,726.800	
HERSHEY CO/THE	6,000	222.750	1,336,500.000	
HUMANA INC	5,200	479.530	2,493,556.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	10,900	160.750	1,752,175.000	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,320	41.990	139,406.800	
HENRY SCHEIN INC	5,600	70.980	397,488.000	
HP INC	47,300	27.330	1,292,709.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	53,800	13.150	707,470.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	6,828	40.110	273,871.080	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	7,900	63.330	500,307.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,950	40.390	119,150.500	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	15,400	45.040	693,616.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	30,403	37.430	1,137,984.290	
ENPHASE ENERGY INC	5,600	292.820	1,639,792.000	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	37,200	126.720	4,713,984.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	14,300	40.330	576,719.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5,200	59.840	311,168.000	
ZOETIS INC	19,500	156.840	3,058,380.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	9,699	156.520	1,518,087.480	
CHENIERE ENERGY INC	9,500	158.580	1,506,510.000	
ALLEGION PLC	3,650	94.640	345,436.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	12,973	20.070	260,368.110	
WASTE CONNECTIONS INC	10,637	141.300	1,503,008.100	
JUNIPER NETWORKS INC	13,400	27.760	371,984.000	
JM SMUCKER CO/THE	4,400	138.630	609,972.000	
JOHNSON & JOHNSON	108,900	163.180	17,770,302.000	
PLUG POWER INC	21,100	25.850	545,435.000	
ABBVIE INC	73,072	137.590	10,053,976.480	
HOLOGIC INC	10,100	67.510	681,851.000	

KIMBERLY-CLARK CORP	13,900	125.710	1,747,369.000	
KROGER CO	28,600	48.520	1,387,672.000	
KLA CORP	6,200	330.580	2,049,596.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	9,900	417.780	4,136,022.000	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,100	209.040	648,024.000	
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	10,500	37.310	391,755.000	
LOWE'S COS INC	27,200	192.960	5,248,512.000	
ELI LILLY & CO	33,385	306.820	10,243,185.700	
LAM RESEARCH CORP	5,680	426.760	2,423,996.800	
LOEWS CORP	8,600	55.330	475,838.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	6,649	46.040	306,119.960	
MCDONALD'S CORP	30,650	254.390	7,797,053.500	
3M CO	23,490	116.600	2,738,934.000	
META PLATFORMS INC CLASS A	94,800	158.540	15,029,592.000	
S&P GLOBAL INC	14,439	356.790	5,151,690.810	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,600	339.560	882,856.000	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	2,320	278.380	645,841.600	
ALCOA CORP	7,700	47.910	368,907.000	
PHILLIPS 66	19,900	86.760	1,726,524.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	16,050	32.770	525,958.500	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,400	82.200	854,880.000	
METLIFE INC	28,400	65.050	1,847,420.000	
MARVELL TECHNOLOGY INC	35,200	45.090	1,587,168.000	
ARISTA NETWORKS INC	10,200	117.550	1,199,010.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,898	243.570	1,680,145.860	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	900	1,222.710	1,100,439.000	
BAKER HUGHES CO	40,823	24.890	1,016,084.470	
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,800	238.260	1,143,648.000	
MERCK & CO. INC.	104,621	86.420	9,041,346.820	
DUPONT DE NEMOURS INC	20,751	54.250	1,125,741.750	
MASCO CORP	9,800	49.260	482,748.000	
M & T BANK CORP	7,399	179.020	1,324,568.980	
MARSH & MCLENNAN COS	20,770	161.570	3,355,808.900	
BLACK KNIGHT INC	6,350	65.390	415,226.500	
HEICO CORP-CLASS A	3,020	120.000	362,400.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	11,502	152.370	1,752,559.740	

WORKDAY INC-CLASS A	8,200	159.900	1,311,180.000	
WAYFAIR INC- CLASS A	2,900	48.460	140,534.000	
BLOCK INC CLASS A	21,512	65.300	1,404,733.600	
TRANSUNION	8,000	74.570	596,560.000	
VISTRA CORP	17,600	24.340	428,384.000	
NOVOCURE LTD	3,850	79.240	305,074.000	
NETAPP INC	9,200	70.700	650,440.000	
NIKE INC -CL B	52,500	105.150	5,520,375.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,900	239.910	2,375,109.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,900	63.750	1,459,875.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,105	103.400	838,057.000	
ALLY FINANCIAL INC	14,200	32.140	456,388.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,100	479.740	2,926,414.000	
APTIV PLC	11,200	88.910	995,792.000	
NEWMONT CORP	32,811	41.710	1,368,546.810	
MCKESSON CORP	6,100	360.800	2,200,880.000	
XYLEM INC	7,300	92.500	675,250.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	64,100	94.100	6,031,810.000	
NUCOR CORP	11,100	134.450	1,492,395.000	
WESTERN UNION CO	15,246	14.390	219,389.940	
GODADDY INC - CLASS A	6,800	74.180	504,424.000	
NEWELL BRANDS INC	16,442	17.080	280,829.360	
EVERGY INC	9,350	68.020	635,987.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	38,824	66.880	2,596,549.120	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,150	222.520	255,898.000	
OKTA INC	6,200	60.660	376,092.000	
COUPA SOFTWARE INC	2,900	55.820	161,878.000	
LIBERTY BROADBAND-C	5,600	96.490	540,344.000	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	17,305	14.620	252,999.100	
LINDE PLC	20,846	276.940	5,773,091.240	
WIX.COM LTD	2,310	63.200	145,992.000	
EQUITABLE HOLDINGS INC	15,800	29.000	458,200.000	
KKR & CO INC	23,300	48.520	1,130,516.000	
PAYCHEX INC	13,400	121.610	1,629,574.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,700	707.530	1,910,331.000	
ALTRIA GROUP INC	74,900	44.570	3,338,293.000	
P G & E CORP	61,700	12.230	754,591.000	
PFIZER INC	232,113	45.760	10,621,490.880	
CIGNA CORP	13,100	285.250	3,736,775.000	

DELL TECHNOLOGIES -C	11,801	37.290	440,059.290	
XCEL ENERGY INC	22,500	74.440	1,674,900.000	
STERIS PLC	4,100	197.390	809,299.000	
SEA LTD-ADR	15,500	58.420	905,510.000	
FOX CORP - CLASS B	6,033	30.550	184,308.150	
FOX CORP - CLASS A	12,799	32.970	421,983.030	
STRYKER CORP	14,080	202.730	2,854,438.400	
LYFT INC-A	12,500	13.970	174,625.000	
DOW INC	30,118	48.590	1,463,433.620	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,500	66.990	301,455.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	9,400	80.020	752,188.000	
PARKER HANNIFIN CORP	5,300	266.530	1,412,609.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	60,900	28.890	1,759,401.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	9,500	238.990	2,270,405.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	99,267	135.630	13,463,583.210	
EXELON CORP	40,522	43.890	1,778,510.580	
TELADOC HEALTH INC	6,500	29.030	188,695.000	
INGERSOLL-RAND INC	16,808	47.670	801,237.360	
NVR INC	130	4,040.010	525,201.300	
CONOCOPHILLIPS	53,502	108.630	5,811,922.260	
TWILIO INC - A	7,000	65.940	461,580.000	
DOCUSIGN INC	8,300	53.800	446,540.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,100	345.920	726,432.000	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,700	59.700	340,290.000	
PEPSICO INC	57,200	169.510	9,695,972.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,820	137.250	249,795.000	
DROPBOX INC-CLASS A	12,100	21.480	259,908.000	
MONGODB INC	2,800	238.000	666,400.000	
SNAP INC - A	45,800	10.770	493,266.000	
CORTEVA INC	29,868	60.320	1,801,637.760	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	15,500	94.180	1,459,790.000	
AMCOR PLC	61,400	11.850	727,590.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	8,400	171.150	1,437,660.000	
ROKU INC	4,800	63.730	305,904.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,500	148.420	1,113,150.000	

ACCENTURE PLC-CL A	26,200	283.460	7,426,652.000	
PENTAIR PLC	6,675	43.870	292,832.250	
QUALCOMM INC	46,300	126.670	5,864,821.000	
INVESCO LTD	14,100	16.430	231,663.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,550	173.340	442,017.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,600	74.430	788,958.000	
DATADOG INC - CLASS A	10,000	92.330	923,300.000	
PINTEREST INC- CLASS A	23,800	22.100	525,980.000	
AVALARA INC	3,650	91.840	335,216.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,500	573.970	2,582,865.000	
REPUBLIC SERVICES INC	9,100	144.050	1,310,855.000	
BOOKING HOLDINGS INC	1,700	1,814.850	3,085,245.000	
ROSS STORES INC	14,500	86.720	1,257,440.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,830	136.180	521,569.400	
RESMED INC	6,100	220.660	1,346,026.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	4,930	125.370	618,074.100	
ROBERT HALF INTL INC	4,500	77.100	346,950.000	
MODERNA INC	13,900	130.080	1,808,112.000	
HUBSPOT INC	1,880	311.120	584,905.600	
PERKINELMER INC	5,100	132.200	674,220.000	
CARRIER GLOBAL CORP	35,087	40.300	1,414,006.100	
OTIS WORLDWIDE CORP	17,538	72.080	1,264,139.040	
BILL.COM HOLDINGS INC	3,900	148.910	580,749.000	
AVANTOR INC	24,800	24.460	606,608.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	8,000	31.660	253,280.000	
DYNATRACE INC	8,100	38.180	309,258.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	18,300	60.030	1,098,549.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	38,685	21.010	812,771.850	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	11,000	40.850	449,350.000	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	14,400	41.900	603,360.000	
IAC/INTERACTIVECORP	3,230	62.060	200,453.800	
MATCH GROUP INC	11,600	53.830	624,428.000	
CHEVRON CORP	77,218	157.120	12,132,492.160	
ZSCALER INC	3,500	145.030	507,605.000	
EDISON INTERNATIONAL	15,800	65.870	1,040,746.000	
ETSY INC	5,200	103.860	540,072.000	
TESLA INC	109,150	274.420	29,952,943.000	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	9,200	169.800	1,562,160.000	
NORTONLIFELOCK INC	23,600	22.110	521,796.000	

UNITY SOFTWARE INC	7,900	38.670	305,493.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,602	85.300	563,150.600	
SYNOPSYS INC	6,300	326.830	2,059,029.000	
CHEWY INC - CLASS A	3,950	33.030	130,468.500	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	10,500	58.550	614,775.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC- A	4,905	397.000	1,947,285.000	
VIATRIS INC	49,021	9.410	461,287.610	
DOORDASH INC - A	7,850	58.230	457,105.500	
ROBLOX CORP -CLASS A	14,600	37.910	553,486.000	
AIRBNB INC-CLASS A	15,600	113.700	1,773,720.000	
CBRE GROUP INC - A	13,600	76.950	1,046,520.000	
TWITTER INC	26,800	38.650	1,035,820.000	
SOUTHERN CO/THE	44,000	77.780	3,422,320.000	
SYSCO CORP	21,100	80.430	1,697,073.000	
TRAVELERS COS INC/THE	9,903	161.880	1,603,097.640	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,500	43.720	109,300.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,600	54.190	249,274.000	
STEEL DYNAMICS INC	7,850	79.360	622,976.000	
SCHLUMBERGER LTD	58,452	37.360	2,183,766.720	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	6,200	39.440	244,528.000	
AFFIRM HOLDINGS INC	7,700	22.300	171,710.000	
AT&T INC	296,191	16.790	4,973,046.890	
APA CORP	14,400	37.820	544,608.000	
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,050	36.740	222,277.000	
ON SEMICONDUCTOR CORP	18,000	66.050	1,188,900.000	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	8,700	43.600	379,320.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10,200	228.380	2,329,476.000	
SEMPRA ENERGY	13,000	167.830	2,181,790.000	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	7,800	34.960	272,688.000	
CLARIVATE PLC	13,400	11.710	156,914.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	68,500	7.280	498,680.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	8,450	65.350	552,207.500	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	4,900	62.780	307,622.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	38,100	163.100	6,214,110.000	
SALESFORCE.COM INC	41,066	151.720	6,230,533.520	
WESTROCK CO	10,700	39.470	422,329.000	

APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	16,609	55.620	923,792.580	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	28,834	54.990	1,585,581.660	
TERADYNE INC	6,600	82.920	547,272.000	
UNION PACIFIC CORP	25,980	227.980	5,922,920.400	
MARATHON OIL CORP	29,900	25.520	763,048.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	23,988	98.460	2,361,858.480	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	61,479	87.160	5,358,509.640	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	30,400	195.960	5,957,184.000	
IQVIA HOLDINGS INC	7,804	209.660	1,636,186.640	
AMEREN CORPORATION	10,700	92.220	986,754.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	38,766	517.680	20,068,382.880	
APPLOVIN CORP CLASS A	4,900	24.530	120,197.000	
VERISIGN INC	4,100	182.290	747,389.000	
LUCID GROUP INC	16,800	14.610	245,448.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	13,200	33.220	438,504.000	
VALERO ENERGY CORP	16,942	112.780	1,910,718.760	
ULTA BEAUTY INC	2,200	427.820	941,204.000	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	10,888	39.310	428,007.280	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,830	96.230	272,330.900	
ELEVANCE HEALTH INC	10,000	477.000	4,770,000.000	
WALT DISNEY CO/THE	75,262	110.090	8,285,593.580	
WELLS FARGO & CO	156,722	42.880	6,720,239.360	
WASTE MANAGEMENT INC	17,200	169.160	2,909,552.000	
WILLIAMS COS INC	50,400	33.170	1,671,768.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,600	188.040	864,984.000	
WHIRLPOOL CORP	2,400	151.000	362,400.000	
WALMART INC	62,600	132.340	8,284,484.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,700	104.930	912,891.000	
WYNN RESORTS LTD	4,500	58.200	261,900.000	
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	55,900	2.900	162,110.000	
WABTEC CORP	7,111	87.320	620,932.520	
TJX COMPANIES INC	48,400	62.890	3,043,876.000	
WATERS CORP	2,500	297.890	744,725.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,200	289.930	637,846.000	

WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	30,400	35.320	1,073,728.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,863	204.920	996,525.960	
WESTERN DIGITAL CORP	12,700	40.970	520,319.000	
WEC ENERGY GROUP INC	13,000	103.060	1,339,780.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	20,400	63.530	1,296,012.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	68,150	198.640	13,537,316.000	
PPL CORP	30,400	28.820	876,128.000	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	13,524	82.260	1,112,484.240	
PULTEGROUP INC	9,850	39.810	392,128.500	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	95,453	12.630	1,205,571.390	
PPG INDUSTRIES INC	9,800	123.690	1,212,162.000	
NORTHERN TRUST CORP	8,200	93.920	770,144.000	
NVIDIA CORP	103,580	134.650	13,947,047.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	17,113	156.370	2,675,959.810	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES L	3,500	33.070	115,745.000	
TYSON FOODS INC-CL A	12,100	73.060	884,026.000	
NETFLIX INC	18,390	218.390	4,016,192.100	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	16,200	545.150	8,831,430.000	
NRG ENERGY INC	9,850	40.790	401,781.500	
GLOBE LIFE INC	3,855	97.480	375,785.400	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,400	148.160	1,096,384.000	
TEXTRON INC	8,900	61.930	551,177.000	
NEWS CORP - CLASS A	15,287	16.450	251,471.150	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	250	1,859.190	464,797.500	
OMNICOM GROUP	8,300	65.950	547,385.000	
JACOBS SOLUTIONS INC	5,220	119.910	625,930.200	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC CLA	20,900	4.920	102,828.000	
ORACLE CORP	66,233	73.830	4,889,982.390	
MASTERCARD INC - A	35,900	324.080	11,634,472.000	
ONEOK INC	18,500	59.560	1,101,860.000	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	37,352	9.670	361,193.840	
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,400	396.920	1,746,448.000	

YUM! BRANDS INC	11,700	112.560	1,316,952.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	6,600	119.530	788,898.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	7,400	51.650	382,210.000	
BANK OF AMERICA CORP	299,901	33.060	9,914,727.060	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,900	366.720	696,768.000	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,700	88.850	684,145.000	
AMERICAN EXPRESS CO	26,500	148.600	3,937,900.000	
ANALOG DEVICES INC	21,491	148.230	3,185,610.930	
ADVANCED MICRO DEVICES	67,027	78.720	5,276,365.440	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	32,972	52.360	1,726,413.920	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,600	97.650	644,490.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,300	41.830	389,019.000	
AVERY DENNISON CORP	3,430	183.530	629,507.900	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	21,600	62.220	1,343,952.000	
EMERSON ELECTRIC CO	24,600	81.510	2,005,146.000	
AON PLC-CLASS A	8,800	281.230	2,474,824.000	
AMGEN INC	22,600	242.220	5,474,172.000	
EATON CORP PLC	16,536	138.460	2,289,574.560	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,700	244.890	1,640,763.000	
APPLIED MATERIALS INC	36,000	90.290	3,250,440.000	
CME GROUP INC	14,900	198.030	2,950,647.000	
ECOLAB INC	10,600	163.030	1,728,118.000	
EQUIFAX INC	5,100	187.380	955,638.000	
GILEAD SCIENCES INC	51,900	63.390	3,289,941.000	
KEURIG DR PEPPER INC	32,300	37.570	1,213,511.000	
HORMEL FOODS CORP	12,400	46.550	577,220.000	
STATE STREET CORP	15,213	68.060	1,035,396.780	
SCHWAB (CHARLES) CORP	60,140	70.470	4,238,065.800	
BAXTER INTERNATIONAL INC	20,800	54.660	1,136,928.000	
CAMPBELL SOUP CO	8,600	48.810	419,766.000	
CROWN HOLDINGS INC	4,980	92.150	458,907.000	
CARDINAL HEALTH INC	11,300	69.510	785,463.000	
FEDEX CORP	10,200	204.170	2,082,534.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	16,754	102.170	1,711,756.180	
FMC CORP	5,150	105.030	540,904.500	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,513	109.730	1,153,591.490	

CITRIX SYSTEMS INC	5,100	102.770	524,127.000	
INTEL CORP	169,200	30.360	5,136,912.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	16,000	27.000	432,000.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	13,450	65.000	874,250.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	12,900	197.550	2,548,395.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	38,600	6.000	231,600.000	
ILLUMINA INC	6,500	201.020	1,306,630.000	
SEALED AIR CORP	5,800	52.460	304,268.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	14,900	202.300	3,014,270.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,350	118.140	513,909.000	
SNAP-ON INC	2,200	217.110	477,642.000	
CARMAX INC	6,600	85.130	561,858.000	
DUKE ENERGY CORP	31,828	106.760	3,397,957.280	
TARGET CORP	19,400	163.580	3,173,452.000	
DOVER CORP	6,000	128.310	769,860.000	
WW GRAINGER INC	1,900	561.400	1,066,660.000	
CINTAS CORP	3,800	413.650	1,571,870.000	
CONAGRA BRANDS INC	19,900	33.840	673,416.000	
COLOROX COMPANY	5,100	142.710	727,821.000	
ENTERGY CORP	8,400	115.630	971,292.000	
MICROSOFT CORP	294,100	253.250	74,480,825.000	
INCYTE CORP	7,600	69.110	525,236.000	
CVS HEALTH CORP	54,169	98.730	5,348,105.370	
MEDTRONIC PLC	54,998	86.200	4,740,827.600	
MICRON TECHNOLOGY INC	46,200	55.230	2,551,626.000	
BLACKROCK INC	6,300	661.630	4,168,269.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	26,000	31.700	824,200.000	
HASBRO INC	5,400	77.630	419,202.000	
KELLOGG CO	10,400	72.270	751,608.000	
KEYCORP	38,600	17.320	668,552.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC- A	57,211	60.000	3,432,660.000	
COOPER COS INC/THE	2,000	296.180	592,360.000	
CHUBB LTD	17,599	190.430	3,351,377.570	
ARROW ELECTRONICS INC	2,700	100.540	271,458.000	
ALLSTATE CORP	11,400	121.490	1,384,986.000	
EBAY INC	24,900	43.040	1,071,696.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	45,550	91.615	4,173,063.250	

	EASTMAN CHEMICAL CO	5,200	89.680	466,336.000	
	DISH NETWORK CORP-A	9,600	16.660	159,936.000	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,600	246.150	2,363,040.000	
	TRIMBLE INC	10,200	60.220	614,244.000	
	LENNAR CORP-A	10,600	76.540	811,324.000	
	LEAR CORP	2,500	133.630	334,075.000	
	PROGRESSIVE CORP	24,200	122.480	2,964,016.000	
	PACCAR INC	14,437	86.830	1,253,564.710	
	BIOGEN INC	6,100	194.690	1,187,609.000	
	IDEXX LABORATORIES INC	3,500	341.730	1,196,055.000	
	STARBUCKS CORP	47,400	84.520	4,006,248.000	
	PTC INC	4,600	114.710	527,666.000	
	EVERSOURCE ENERGY	14,300	89.150	1,274,845.000	
	INTUIT INC	11,080	418.760	4,639,860.800	
	BORGWARNER INC	9,700	36.440	353,468.000	
	BEST BUY CO INC	8,850	71.380	631,713.000	
	BALL CORP	13,004	55.540	722,242.160	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	59,097	40.380	2,386,336.860	
	ELECTRONIC ARTS INC	11,600	124.730	1,446,868.000	
	VULCAN MATERIALS CO	5,500	164.410	904,255.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	10,600	279.180	2,959,308.000	
	VF CORP	13,400	40.250	539,350.000	
	PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	25,225	22.900	577,652.500	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	2,200	106.150	233,530.000	
	CARNIVAL CORP	40,900	9.440	386,096.000	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	21,800	17.300	377,140.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	184,790	34.740	6,419,604.600	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,700	54.760	476,412.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	48,600	4.770	231,822.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 1,400,891,742.860 (200,495,626,238)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	SHELL PLC	305,297	23.085	7,047,781.240	
	HALEON PLC	204,162	2.542	518,979.800	
	BP PLC	788,177	4.527	3,568,077.270	
	UNILEVER PLC	104,121	39.170	4,078,419.570	
	BARCLAYS PLC	683,263	1.678	1,147,061.920	

ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	336,390	0.767	258,044.760	
PRUDENTIAL PLC	112,204	9.330	1,046,863.320	
NATWEST GROUP PLC	218,395	2.550	556,907.250	
JOHNSON MATTHEY PLC	7,064	19.345	136,653.080	
BAE SYSTEMS PLC	128,820	7.832	1,008,918.240	
AVIVA PLC	115,648	4.360	504,225.280	
AVEVA GROUP PLC	4,948	28.400	140,523.200	
GSK	165,976	13.474	2,236,360.620	
INFORMA PLC	60,095	5.522	331,844.590	
MELROSE INDUSTRIES PLC	178,792	1.357	242,710.140	
AUTO TRADER GROUP PLC	38,002	6.390	242,832.780	
DCC PLC	3,964	49.180	194,949.520	
OCADO GROUP PLC	23,827	7.348	175,080.790	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,900	104.200	302,180.000	
HALMA PLC	15,260	20.810	317,560.600	
ENTAIN PLC	24,059	12.115	291,474.780	
JD SPORTS FASHION PLC	99,700	1.265	126,120.500	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	30,168	6.142	185,291.850	
M&G PLC	104,504	2.040	213,188.160	
RELX PLC	78,540	22.390	1,758,510.600	
DIAGEO PLC	93,276	37.615	3,508,576.740	
RIO TINTO PLC	45,886	47.335	2,172,013.810	
STANDARD CHARTERED PLC	104,659	6.026	630,675.130	
TESCO PLC	306,336	2.559	783,913.820	
SMITH & NEPHEW PLC	35,311	10.850	383,124.350	
GLENCORE PLC	402,288	4.868	1,958,539.120	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,250	8.350	110,637.500	
SMITHS GROUP PLC	15,383	14.945	229,898.930	
PEARSON PLC	28,363	8.960	254,132.480	
SAINSBURY (J) PLC	71,864	2.099	150,842.530	
NEXT PLC	5,311	61.880	328,644.680	
TAYLOR WIMPEY PLC	146,673	1.080	158,406.840	
WHITBREAD PLC	8,127	25.680	208,701.360	
BUNZL PLC	13,562	28.330	384,211.460	
VODAFONE GROUP PLC	1,081,003	1.131	1,223,479.190	
CRODA INTERNATIONAL PLC	5,601	66.260	371,122.260	
KINGFISHER PLC	78,711	2.463	193,865.190	
WPP PLC	45,847	7.438	341,009.980	

UNITED UTILITIES GROUP PLC	27,881	10.655	297,072.050	
SEVERN TRENT PLC	10,232	27.930	285,779.760	
RENTOKIL INITIAL PLC	74,706	5.302	396,091.210	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	29,182	64.580	1,884,573.560	
ST JAMES'S PLACE PLC	21,732	11.070	240,573.240	
SCHRODERS PLC	4,650	26.840	124,806.000	
SSE PLC	43,575	16.870	735,110.250	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	39,500	4.222	166,769.000	
ASTRAZENECA PLC	63,233	105.140	6,648,317.620	
FERGUSON PLC	8,777	98.940	868,396.380	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	239,689	2.580	618,397.620	
3I GROUP PLC	39,073	11.750	459,107.750	
ASHTED GROUP PLC	17,854	42.070	751,117.780	
SAGE GROUP PLC/THE	40,114	7.178	287,938.290	
NATIONAL GRID PLC	148,817	10.790	1,605,735.430	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,850,013	0.452	1,289,060.870	
IMPERIAL BRANDS PLC	38,161	19.275	735,553.270	
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	4,232	35.730	151,209.360	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	87,850	34.795	3,056,740.750	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,800	15.095	208,311.000	
HSBC HOLDINGS PLC	819,921	5.337	4,375,918.370	
ANGLO AMERICAN PLC	51,856	28.065	1,455,338.640	
MONDI PLC	19,853	14.680	291,442.040	
COMPASS GROUP PLC	72,800	18.435	1,342,068.000	
PERSIMMON PLC	12,832	14.970	192,095.040	
BT GROUP PLC	345,300	1.421	490,843.950	
COCA-COLA HBC AG-DI	7,800	19.500	152,100.000	
BURBERRY GROUP PLC	16,061	17.140	275,285.540	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	7,523	45.840	344,854.320	
INTERTEK GROUP PLC	6,481	39.450	255,675.450	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	13,450	79.680	1,071,696.000	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	6,600	12.920	85,272.000	
ADMIRAL GROUP PLC	7,500	21.690	162,675.000	
ANTOFAGASTA PLC	15,300	11.240	171,972.000	
ABRDN PLC	84,362	1.517	127,977.150	

	EXPERIAN PLC	37,575	26.080	979,956.000	
イギリス・ボンド 小計				イギリス・ボンド 72,608,185.920 (11,932,429,275)	
イスラエル・ シュケル		株	イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	51,498	20.170	1,038,714.660	
	AZRIELI GROUP LTD	1,826	268.100	489,550.600	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	4,541	154.900	703,400.900	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	89,000	5.970	531,330.000	
	ICL GROUP LTD	30,461	32.450	988,459.450	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,100	686.000	754,600.000	
	BANK HAPOALIM BM	54,645	34.150	1,866,126.750	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	66,426	34.870	2,316,274.620	
	NICE LTD	2,731	700.000	1,911,700.000	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,407	138.000	884,166.000		
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル 11,484,322.980 (480,222,707)	
オーストラリ ア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	THE LOTTERY CORPORATION LTD	84,950	4.380	372,081.000	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	105,094	3.630	381,491.220	
	BHP GROUP LTD	197,318	37.270	7,354,041.860	
	SOUTH32 LTD	177,077	4.140	733,098.780	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	74,059	35.080	2,597,989.720	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	66,005	16.440	1,085,122.200	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	125,031	30.240	3,780,937.440	
	WESTPAC BANKING CORP	136,277	21.270	2,898,611.790	
	SANTOS LTD	125,413	7.940	995,779.220	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	116,889	22.590	2,640,522.510	
	RIO TINTO LTD	14,467	90.800	1,313,603.600	
	ORIGIN ENERGY LTD	68,887	5.930	408,499.910	
	AURIZON HOLDINGS LTD	67,600	3.660	247,416.000	
	XERO LTD	5,135	84.200	432,367.000	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	7,900	26.140	206,506.000	
COLES GROUP LTD	52,080	17.600	916,608.000		
WISETECH GLOBAL LTD	5,400	57.760	311,904.000		

IDP EDUCATION LTD	7,900	27.770	219,383.000	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	44,584	7.350	327,692.400	
EVOLUTION MINING LTD	65,600	2.210	144,976.000	
REECE LTD	10,500	14.850	155,925.000	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	51,260	7.390	378,811.400	
SEEK LTD	12,845	20.900	268,460.500	
TREASURY WINE ESTATES LTD	27,529	13.250	364,759.250	
NEWCREST MINING LTD	34,097	17.050	581,353.850	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	66,519	96.110	6,393,141.090	
AMPOL LTD	8,800	33.020	290,576.000	
ORICA LTD	17,751	14.900	264,489.900	
QBE INSURANCE GROUP LTD	56,269	12.090	680,292.210	
WOOLWORTHS GROUP LTD	47,331	36.870	1,745,093.970	
QANTAS AIRWAYS LTD	35,469	5.090	180,537.210	
TELSTRA CORP LTD	156,394	3.890	608,372.660	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	17,415	33.210	578,352.150	
MACQUARIE GROUP LTD	14,198	178.180	2,529,799.640	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	22,909	34.550	791,505.950	
CSL LTD	18,775	294.000	5,519,850.000	
WESFARMERS LTD	44,206	46.020	2,034,360.120	
COCHLEAR LTD	2,510	211.660	531,266.600	
BLUESCOPE STEEL LTD	17,800	16.040	285,512.000	
SUNCORP GROUP LTD	48,015	10.780	517,601.700	
ASX LTD	7,365	75.230	554,068.950	
COMPUTERSHARE LTD	20,689	24.100	498,604.900	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	96,410	4.640	447,342.400	
SONIC HEALTHCARE LTD	17,328	32.230	558,481.440	
BRAMBLES LTD	56,158	12.050	676,703.900	
MINERAL RESOURCES LTD	6,666	60.340	402,226.440	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,973	70.750	493,339.750	
REA GROUP LTD	2,023	122.480	247,777.040	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,200	60.150	132,330.000	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 56,079,567.670 (5,388,685,658)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル

ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	33,500	58.790	1,969,465.000	
IMPERIAL OIL LTD	9,500	63.310	601,445.000	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	800	1,935.570	1,548,456.000	
RESTAURANT BRANDS INTERN	11,687	77.050	900,483.350	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	17,900	40.540	725,666.000	
INTACT FINANCIAL CORP	7,150	194.770	1,392,605.500	
BCE INC	4,930	62.780	309,505.400	
FRANCO-NEVADA CORP	7,800	157.410	1,227,798.000	
SUNCOR ENERGY INC	58,230	40.880	2,380,442.400	
METRO INC/CN	9,600	70.350	675,360.000	
NATIONAL BANK OF CANADA	13,400	86.900	1,164,460.000	
BANK OF NOVA SCOTIA	48,200	70.680	3,406,776.000	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	36,600	61.360	2,245,776.000	
TORONTO-DOMINION BANK	73,700	84.110	6,198,907.000	
GREAT-WEST LIFECO INC	11,400	30.630	349,182.000	
ROYAL BANK OF CANADA	57,550	122.500	7,049,875.000	
TOURMALINE OIL CORP	12,900	77.930	1,005,297.000	
TC ENERGY CORP	39,750	61.930	2,461,717.500	
PEMBINA PIPELINE CORP	22,329	45.520	1,016,416.080	
BARRICK GOLD CORP	72,100	19.490	1,405,229.000	
CAE INC	12,600	23.210	292,446.000	
THOMSON REUTERS CORP	6,812	145.320	989,919.840	
EMPIRE CO LTD 'A'	6,500	37.440	243,360.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,500	108.690	380,415.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	6,150	64.200	394,830.000	
HYDRO ONE LTD	13,100	35.470	464,657.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	6,760	115.840	783,078.400	
NORTHLAND POWER INC	9,400	44.270	416,138.000	
WSP GLOBAL INC	5,000	156.100	780,500.000	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,300	101.890	336,237.000	
PARKLAND CORP	5,800	31.530	182,874.000	
QUEBECOR INC -CL B	6,000	27.670	166,020.000	
EMERA INC	10,400	61.440	638,976.000	
TFI INTERNATIONAL INC	3,300	131.690	434,577.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,800	40.440	194,112.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	14,400	55.390	797,616.000	
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,600	85.590	136,944.000	

IVANHOE MINES LTD-CL A	24,600	8.090	199,014.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	18,517	53.940	998,806.980	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	26,700	17.880	477,396.000	
AIR CANADA	6,500	17.290	112,385.000	
KINROSS GOLD CORP	53,000	4.310	228,430.000	
BANK OF MONTREAL	27,300	120.500	3,289,650.000	
POWER CORP OF CANADA	22,200	33.280	738,816.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	46,300	39.250	1,817,275.000	
NUTRIEN LTD	22,319	119.240	2,661,317.560	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,300	50.560	267,968.000	
CAMECO CORP	15,800	37.710	595,818.000	
FIRSTSERVICE CORP	1,500	157.980	236,970.000	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	7,100	37.560	266,676.000	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	5,300	23.190	122,907.000	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,600	37.510	97,526.000	
TELUS CORP	10,800	29.150	314,820.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	19,400	43.530	844,482.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,200	156.030	343,266.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	46,600	70.720	3,295,552.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,000	642.650	642,650.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	11,300	71.920	812,696.000	
WESTON (GEORGE) LTD	2,937	150.760	442,782.120	
PAN AMERICAN SILVER CORP	7,800	19.360	151,008.000	
BLACKBERRY LTD	22,400	7.330	164,192.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	23,800	57.190	1,361,122.000	
ENBRIDGE INC	82,100	53.680	4,407,128.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	57,125	62.110	3,548,033.750	
MANULIFE FINANCIAL CORP	78,000	22.280	1,737,840.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	11,300	8.510	96,163.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	37,720	96.650	3,645,638.000	
IA FINANCIAL CORP INC	4,400	69.230	304,612.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,500	39.240	294,300.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	23,750	153.010	3,633,987.500	
CGI INC - CLASS A	8,700	101.790	885,573.000	
ONEX CORPORATION	2,900	64.730	187,717.000	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	19,000	33.400	634,600.000	

	IGM FINANCIAL INC	3,100	35.670	110,577.000	
	TMX GROUP LTD	2,300	131.630	302,749.000	
	OPEN TEXT CORP	11,000	38.730	426,030.000	
	SAPUTO INC	10,200	33.300	339,660.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	23,300	20.830	485,339.000	
	FORTIS INC	19,300	58.050	1,120,365.000	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	4,400	91.010	400,444.000	
	LUNDIN MINING CORP	24,600	6.690	164,574.000	
	CENOVUS ENERGY INC	55,500	23.980	1,330,890.000	
	DOLLARAMA INC	11,200	80.090	897,008.000	
	ALTAGAS LTD	11,100	28.570	317,127.000	
	KEYERA CORP	8,800	31.290	275,352.000	
	ARC RESOURCES LTD	28,600	18.030	515,658.000	
カナダ・ドル 小計				カナダ・ドル 92,212,453.380 (10,016,116,685)	
シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD	107,400	3.670	394,158.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	50,800	27.100	1,376,680.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	77,900	32.540	2,534,866.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,975	5.320	287,147.000	
	KEPPEL CORP LTD	62,700	7.450	467,115.000	
	UOL GROUP LTD	20,000	6.950	139,000.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	8.310	133,791.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	145,700	12.020	1,751,314.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	238,000	0.770	183,260.000	
	VENTURE CORP LTD	11,200	17.530	196,336.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	355,350	2.670	948,784.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	62,700	3.760	235,752.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,700	9.450	337,365.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	80,000	4.020	321,600.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 9,307,168.500 (946,073,679)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	UBS GROUP AG-REG	140,483	15.390	2,162,033.370	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,180	389.000	459,020.000	

EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	280	669.500	187,460.000	
ADECCO GROUP AG-REG	6,360	30.600	194,616.000	
ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	28,061	323.550	9,079,136.550	
SIKA AG-REG	5,834	217.800	1,270,645.200	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	4	104,700.000	418,800.000	
ABB LTD-REG	65,605	27.040	1,773,959.200	
SWISS RE AG	12,047	79.200	954,122.400	
NESTLE SA-REG	112,433	112.420	12,639,717.860	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	900	931.800	838,620.000	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,601	170.500	272,970.500	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	104,049	5.000	520,245.000	
JULIUS BAER GROUP LTD	8,708	47.200	411,017.600	
SGS SA-REG	252	2,193.000	552,636.000	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	934	165.000	154,110.000	
TEMENOS AG - REG	2,500	78.620	196,550.000	
VAT GROUP AG	1,050	231.000	242,550.000	
ALCON INC	19,959	65.500	1,307,314.500	
SIG GROUP N AG	13,000	22.680	294,840.000	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,159	227.400	263,556.600	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,010	428.600	2,575,886.000	
BALOISE HOLDING AG - REG	1,800	137.800	248,040.000	
CLARIANT AG-REG	8,678	17.990	156,117.220	
NOVARTIS AG-REG	86,320	79.170	6,833,954.400	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	141	1,982.000	279,462.000	
BACHEM HOLDING AG-REG B	1,250	60.400	75,500.000	
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	20,849	106.450	2,219,376.050	
SWISSCOM AG-REG	1,036	503.800	521,936.800	
GEBERIT AG-REG	1,433	444.400	636,825.200	
GIVAUDAN-REG	369	3,090.000	1,140,210.000	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	4,389	109.400	480,156.600	
SONOVA HOLDING AG-REG	2,110	250.000	527,500.000	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,929	47.390	328,365.310	
LONZA GROUP AG-REG	2,974	513.000	1,525,662.000	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,900	42.300	80,370.000	
HOLCIM LTD	21,829	44.570	972,918.530	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,237	509.400	630,127.800	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,135	212.300	453,260.500	

	SWISS PRIME SITE-REG	3,025	83.350	252,133.750	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	42	10,260.000	430,920.000	
スイス・フラン	小計			スイス・フラン 54,562,642.940 (7,926,315,140)	
スウェーデン・ クローナ		株	スウェーデン・クロー ナ	スウェーデン・クローナ	
	SAGAX CLASS B	7,924	227.800	1,805,087.200	
	INVESTOR CLASS A	21,458	178.500	3,830,253.000	
	VOLVO CAR CLASS B	24,808	58.600	1,453,748.800	
	ERICSSON LM-B SHS	125,588	78.360	9,841,075.680	
	VOLVO AB-B SHS	64,930	165.500	10,745,915.000	
	SKF AB-B SHARES	16,495	155.350	2,562,498.250	
	ELECTROLUX AB-SER B	8,600	126.780	1,090,308.000	
	SWEDISH MATCH AB	65,778	108.150	7,113,890.700	
	TELE2 AB-B SHS	24,423	113.550	2,773,231.650	
	GETINGE AB-B SHS	9,200	208.800	1,920,960.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN- A	70,028	105.550	7,391,455.400	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	62,759	86.340	5,418,612.060	
	SWEDBANK AB - A SHARES	38,966	139.750	5,445,498.500	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	31,425	113.520	3,567,366.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	26,069	149.100	3,886,887.900	
	SKANSKA AB-B SHS	14,638	155.400	2,274,745.200	
	SANDVIK AB	45,700	161.800	7,394,260.000	
	INVESTOR AB-B SHS	78,394	169.920	13,320,708.480	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	115,575	109.080	12,606,921.000	
	VOLVO AB-A SHS	8,000	171.400	1,371,200.000	
	HOLMEN AB-B SHARES	3,906	442.200	1,727,233.200	
	SECURITAS AB-B SHS	11,950	91.200	1,089,840.000	
	TELIA CO AB	110,667	37.140	4,110,172.380	
	ALFA LAVAL AB	12,700	284.500	3,613,150.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	67,161	98.070	6,586,479.270	
	ASSA ABLOY AB-B	43,126	215.100	9,276,402.600	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	5,243	231.300	1,212,705.900	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	26,268	58.290	1,531,161.720	
	INDUTRADE AB	11,371	190.950	2,171,292.450	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	7,032	229.000	1,610,328.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,000	431.700	1,295,100.000	

	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	5,700	205.900	1,173,630.000	
	LIFCO AB-B SHS	9,500	167.850	1,594,575.000	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	65,208	104.700	6,827,277.600	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	26,204	227.600	5,964,030.400	
	EMBRACER GROUP AB	26,594	65.760	1,748,821.440	
	BOLIDEN AB	11,387	335.700	3,822,615.900	
	EPIROC AB-A	27,436	164.200	4,504,991.200	
	EPIROC AB-B	16,780	147.250	2,470,855.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	17,050	69.680	1,188,044.000	
	NORDEA BANK ABP	146,748	99.380	14,583,816.240	
	EQT AB	12,318	234.300	2,886,107.400	
	EVOLUTION AB	7,867	850.300	6,689,310.100	
	KINNEVIK AB - B	10,431	151.050	1,575,602.550	
	HEXAGON AB-B SHS	83,750	109.600	9,179,000.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,200	229.400	1,422,280.000	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 205,669,445.170 (2,723,063,454)	
デンマーク・クローネ		株	デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	NOVO NORDISK A/S-B	70,105	781.600	54,794,068.000	
	DANSKE BANK A/S	29,678	98.580	2,925,657.240	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	131	15,810.000	2,071,110.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	43,042	175.600	7,558,175.200	
	GN STORE NORD A/S	5,465	210.200	1,148,743.000	
	CARLSBERG AS-B	4,180	940.600	3,931,708.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	8,800	412.400	3,629,120.000	
	COLOPLAST-B	5,112	875.000	4,473,000.000	
	DSV PANALPINA A/S	8,280	1,047.500	8,673,300.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	370	1,400.000	518,000.000	
	DEMANT A/S	4,275	229.900	982,822.500	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	230	16,285.000	3,745,550.000	
	TRYG A/S	14,990	168.350	2,523,566.500	
	PANDORA A/S	4,000	434.000	1,736,000.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,300	426.000	1,831,800.000	
	GENMAB A/S	2,829	2,685.000	7,595,865.000	
	ORSTED A/S	8,140	698.000	5,681,720.000	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 113,820,205.440 (2,165,998,510)	

ニュージーランド・ドル		株	ニュージーランド・ドル	ニュージーランド・ドル	
	MERIDIAN ENERGY LTD	52,500	5.000	262,500.000	
	MERCURY NZ LTD	30,000	6.040	181,200.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	80,530	5.435	437,680.550	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	52,113	7.600	396,058.800	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	24,200	18.900	457,380.000		
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 1,734,819.350 (149,437,339)	
ノルウェー・クローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	DNB BANK	40,025	181.150	7,250,528.750	
	NORSK HYDRO ASA	57,866	63.560	3,677,962.960	
	ORKLA ASA	32,317	82.080	2,652,579.360	
	TELENOR ASA	29,131	105.800	3,082,059.800	
	EQUINOR ASA	42,051	374.000	15,727,074.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,124	398.200	2,836,776.800	
	MOWI ASA	17,800	196.900	3,504,820.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	8,050	201.200	1,619,660.000	
	AKER BP ASA	13,597	349.000	4,745,353.000	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	3,723	338.400	1,259,863.200	
	SALMAR ASA	2,452	632.000	1,549,664.000	
ADEVINTA ASA	12,000	78.400	940,800.000		
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 48,847,141.870 (694,606,357)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	29,169	19.346	564,303.470	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	17,902	24.985	447,281.470	
	BAYER AG-REG	39,442	51.510	2,031,657.420	
	EVONIK INDUSTRIES AG	8,000	18.660	149,280.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	81,328	8.358	679,739.420	
	COMMERZBANK AG	42,031	7.038	295,814.170	
	VOLKSWAGEN AG	1,200	193.350	232,020.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	7,451	148.820	1,108,857.820	
	SIEMENS AG-REG	30,742	103.520	3,182,411.840	
	E.ON SE	90,136	8.874	799,866.860	
UNIPER SE	6,650	4.734	31,481.100		

BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,293	72.820	967,996.260	
GEA GROUP AG	5,800	32.390	187,862.000	
CONTINENTAL AG	4,342	56.260	244,280.920	
BASF SE	36,875	42.050	1,550,593.750	
ALLIANZ SE-REG	16,411	169.140	2,775,756.540	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	7,168	62.500	448,000.000	
RHEINMETALL AG	1,813	156.400	283,553.200	
RWE AG	25,791	38.320	988,311.120	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	21,950	5.950	130,602.500	
BRENNTAG SE	6,090	67.020	408,151.800	
FRESENIUS SE & CO KGAA	16,483	25.110	413,888.130	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,839	21.920	84,150.880	
SAP SE	41,960	85.510	3,587,999.600	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,625	247.700	1,393,312.500	
ZALANDO SE	8,783	23.050	202,448.150	
HEIDELBERGCEMENT AG	5,708	45.760	261,198.080	
KION GROUP AG	2,700	38.080	102,816.000	
COVESTRO AG	7,300	30.080	219,584.000	
RATIONAL AG	190	487.600	92,644.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,210	421.500	510,015.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	6,035	69.300	418,225.500	
DELIVERY HERO SE	6,443	44.400	286,069.200	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,592	122.900	195,656.800	
BECHTLE AG	3,238	38.220	123,756.360	
NEMETSCHEK SE	2,284	56.980	130,142.320	
SCOUT24 AG	3,600	58.040	208,944.000	
AROUNDTOWN SA	38,000	2.830	107,540.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	11,097	49.230	546,305.310	
KNORR-BREMSE AG	2,800	47.370	132,636.000	
HELLOFRESH SE	6,516	24.960	162,639.360	
SIEMENS ENERGY AG	17,290	14.140	244,480.600	
BEIERSDORF AG	3,980	101.350	403,373.000	
MERCK KGAA	5,189	173.050	897,956.450	
ADIDAS AG	7,200	144.360	1,039,392.000	
PUMA SE	4,163	60.820	253,193.660	
HENKEL AG & CO KGAA	4,101	60.550	248,315.550	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	130,122	18.828	2,449,937.010	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	8,070	34.250	276,397.500	

MERCEDES-BENZ GROUP N AG	32,500	55.240	1,795,300.000	
QIAGEN N.V.	9,105	46.120	419,922.600	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	52,430	24.325	1,275,359.750	
HANNOVER RUECK SE	2,378	151.900	361,218.200	
DEUTSCHE POST AG-REG	39,796	35.790	1,424,298.840	
DEUTSCHE BOERSE AG	7,628	167.350	1,276,545.800	
MTU AERO ENGINES AG	2,104	171.950	361,782.800	
SYMRISE AG	5,228	104.050	543,973.400	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	41,312	2.539	104,891.160	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	2,200	69.100	152,020.000	
VONOVIA SE	28,770	26.530	763,268.100	
LEG IMMOBILIEN SE	2,800	74.800	209,440.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	34,900	17.348	605,445.200	
NN GROUP NV	11,292	40.750	460,149.000	
ARCELORMITTAL	25,700	22.720	583,904.000	
HEINEKEN NV	10,407	90.240	939,127.680	
AEGON NV	72,059	4.435	319,581.660	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	41,983	27.300	1,146,135.900	
AKZO NOBEL N.V.	7,100	62.800	445,880.000	
KONINKLIJKE DSM NV	7,017	125.250	878,879.250	
WOLTERS KLUWER	10,540	99.340	1,047,043.600	
ING GROEP NV	156,862	8.640	1,355,287.680	
KONINKLIJKE KPN NV	132,781	3.170	420,915.770	
ASML HOLDING NV	16,320	478.600	7,810,752.000	
ABN AMRO BANK NV-CVA	16,700	9.616	160,587.200	
IMCD NV	2,246	133.100	298,942.600	
ADYEN NV	870	1,493.400	1,299,258.000	
JUST EAT TAKEAWAY	7,220	16.034	115,765.480	
PROSUS NV	35,480	58.230	2,066,000.400	
JDE PEET'S NV	3,700	30.860	114,182.000	
ASM INTERNATIONAL NV	1,883	270.600	509,539.800	
RANDSTAD NV	4,720	46.300	218,536.000	
HEINEKEN HOLDING NV	4,250	70.900	301,325.000	
OCI NV	4,386	37.220	163,246.920	
TOTALENERGIES SE	99,542	51.710	5,147,316.820	
MICHELIN (CGDE)	26,740	23.900	639,086.000	

AIR LIQUIDE SA	20,995	121.660	2,554,251.700	
KERING	3,004	499.500	1,500,498.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	21,787	118.580	2,583,502.460	
BOUYGUES SA	9,062	29.590	268,144.580	
BNP PARIBAS	44,602	46.560	2,076,669.120	
THALES SA	4,291	123.000	527,793.000	
DANONE	25,708	50.880	1,308,023.040	
CARREFOUR SA	24,454	16.395	400,923.330	
VIVENDI	29,591	8.802	260,459.980	
L'OREAL	9,688	343.650	3,329,281.200	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	19,987	39.975	798,980.320	
LEGRAND SA	10,737	73.660	790,887.420	
PERNOD RICARD SA	8,411	185.650	1,561,502.150	
EURAZEO SE	1,724	59.000	101,716.000	
SOCIETE GENERALE SA	31,964	22.660	724,304.240	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	11,146	638.100	7,112,262.600	
ACCOR SA	6,717	23.650	158,857.050	
CAPGEMINI SE	6,574	174.850	1,149,463.900	
VALEO SA	8,400	17.980	151,032.000	
PUBLICIS GROUPE	9,179	49.740	456,563.460	
BUREAU VERITAS SA	11,605	24.620	285,715.100	
EIFFAGE	3,285	87.100	286,123.500	
SODEXO SA	3,491	77.900	271,948.900	
IPSEN	1,400	99.250	138,950.000	
AMUNDI SA	2,250	51.050	114,862.500	
TELEPERFORMANCE	2,315	287.800	666,257.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,600	43.500	156,600.000	
EURONEXT NV	3,300	71.780	236,874.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	5,296	66.360	351,442.560	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,100	371.300	408,430.000	
SEB SA	997	70.550	70,338.350	
ESSILORLUXOTTICA	11,549	148.800	1,718,491.200	
DASSAULT AVIATION SA	1,000	136.500	136,500.000	
WORLDLINE SA	9,606	43.890	421,607.340	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	4,163	32.280	134,381.640	
AXA SA	76,206	23.775	1,811,797.650	
EDENRED	10,044	50.980	512,043.120	
RENAULT SA	7,755	28.335	219,737.920	

HERMES INTERNATIONAL	1,272	1,271.500	1,617,348.000
STMICROELECTRONICS NV	27,439	34.920	958,169.880
REMY COINTREAU	900	175.700	158,130.000
DASSAULT SYSTEMES SE	26,758	38.825	1,038,879.350
WENDEL	930	76.800	71,424.000
ORANGE	80,096	10.194	816,498.620
ALSTOM	12,525	20.310	254,382.750
SANOFI	45,721	80.550	3,682,826.550
VINCI SA	21,423	93.270	1,998,123.210
AIRBUS SE	23,736	97.090	2,304,528.240
VEOLIA ENVIRONNEMENT	26,179	21.830	571,487.570
CREDIT AGRICOLE SA	49,128	9.118	447,949.100
BIOMERIEUX	1,691	90.780	153,508.980
ENGIE	73,328	12.126	889,175.320
EDF	22,120	11.990	265,218.800
SAFRAN SA	13,722	101.140	1,387,843.080
ARKEMA	2,395	82.560	197,731.200
ADP	1,110	133.300	147,963.000
GETLINK SE	17,345	18.005	312,296.720
BOLLORE	35,675	4.802	171,311.350
UCB SA	4,976	69.620	346,429.120
KBC GROUP NV	9,843	47.900	471,479.700
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,200	75.060	315,252.000
SOLVAY SA	2,984	79.760	238,003.840
UMICORE	8,269	30.630	253,279.470
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	34,872	49.220	1,716,399.840
AGEAS	6,290	39.780	250,216.200
D'ETEREN GROUP	1,036	153.300	158,818.800
PROXIMUS	6,035	12.430	75,015.050
ELIA GROUP SA/NV	1,333	144.500	192,618.500
SOFINA	600	193.300	115,980.000
ARGENX SE	2,229	377.700	841,893.300
PRYSMIAN SPA	10,040	30.980	311,039.200
ASSICURAZIONI GENERALI	44,600	14.600	651,160.000
MEDIOBANCA SPA	24,407	7.964	194,377.340
TENARIS SA	18,608	13.795	256,697.360
UNICREDIT SPA	83,217	9.770	813,030.090
TELECOM ITALIA SPA	378,782	0.203	76,892.740
INTESA SANPAOLO	663,075	1.703	1,129,747.180

ATLANTIA SPA	19,531	22.800	445,306.800	
POSTE ITALIANE SPA	21,074	7.980	168,170.520	
MONCLER SPA	8,261	43.640	360,510.040	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	4,217	40.890	172,433.130	
ENI SPA	101,329	11.952	1,211,084.200	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	21,064	9.552	201,203.320	
DIASORIN SPA	1,000	133.500	133,500.000	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	12,800	9.360	119,808.000	
NEXI SPA	19,900	8.374	166,642.600	
AMPLIFON SPA	4,700	25.860	121,542.000	
ENEL SPA	326,535	4.677	1,527,367.460	
SNAM SPA	79,350	4.713	373,976.550	
TERNA SPA	55,464	7.114	394,570.890	
EXOR NV	4,273	62.980	269,113.540	
CNH INDUSTRIAL NV	40,265	12.205	491,434.320	
FINECOBANK SPA	23,200	10.845	251,604.000	
STELLANTIS NV	88,350	13.000	1,148,550.000	
FERRARI NV	5,061	191.800	970,699.800	
TELEFONICA SA	210,478	4.061	854,751.150	
ENDESA SA	12,100	17.020	205,942.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	267,700	4.492	1,202,642.250	
IBERDROLA SA	239,538	10.470	2,507,962.860	
REPSOL SA	57,201	13.475	770,783.470	
GRIFOLS SA	11,830	11.450	135,453.500	
BANCO SANTANDER SA	682,335	2.410	1,644,427.350	
AMADEUS IT GROUP SA	18,086	51.640	933,961.040	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,300	27.440	282,632.000	
CAIXABANK SA	174,927	3.007	526,005.480	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,876	22.390	198,733.640	
AENA SME SA	2,900	120.400	349,160.000	
CELLNEX TELECOM SA	21,460	36.970	793,376.200	
ACCIONA SA	1,028	194.300	199,740.400	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	43,794	21.490	941,133.060	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	9,414	17.930	168,793.020	
ENAGAS SA	9,884	17.975	177,664.900	

	RED ELECTRICA CORPORACION SA	15,700	18.295	287,231.500	
	FERROVIAL SA	19,018	24.840	472,407.120	
	UPM-KYMMENE OYJ	21,428	33.060	708,409.680	
	NOKIA OYJ	217,254	5.002	1,086,704.500	
	WARTSILA OYJ ABP	19,124	7.950	152,035.800	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	21,400	14.135	302,489.000	
	ELISA OYJ	5,725	52.140	298,501.500	
	SAMPO OYJ-A SHS	19,622	44.190	867,096.180	
	FORTUM OYJ	16,900	9.200	155,480.000	
	KESKO OYJ-B SHS	10,400	20.810	216,424.000	
	KONE OYJ-B	13,375	38.850	519,618.750	
	NESTE OYJ	16,985	47.570	807,976.450	
	ORION OYJ-CLASS B	4,000	44.770	179,080.000	
	VERBUND AG	2,740	85.000	232,900.000	
	OMV AG	5,650	41.460	234,249.000	
	ERSTE GROUP BANK AG	13,546	22.600	306,139.600	
	VOESTALPINE AG	4,250	20.500	87,125.000	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	9,948	32.670	325,001.160	
	KINGSPAN GROUP PLC	6,076	57.340	348,397.840	
	JERONIMO MARTINS	11,416	22.100	252,293.600	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	109,400	4.775	522,385.000	
	GALP ENERGIA SGPS SA	20,196	10.955	221,247.180	
	EDP RENOVAVEIS SA	11,594	23.790	275,821.260	
	KERRY GROUP PLC-A	6,272	100.650	631,276.800	
	CRH PLC	30,632	35.830	1,097,544.560	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,704	117.500	787,720.000	
	ユーロ 小計			ユーロ 161,642,323.980 (22,880,470,959)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	58,000	44.600	2,586,800.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	94,000	42.350	3,980,900.000	
	MTR CORP	66,500	39.550	2,630,075.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	60,500	93.300	5,644,650.000	
	SINO LAND CO	142,000	11.540	1,638,680.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	111,669	48.550	5,421,529.950	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	21,500	55.000	1,182,500.000	

CLP HOLDINGS LTD	70,000	65.350	4,574,500.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	59,507	25.300	1,505,527.100	
HONG KONG & CHINA GAS	482,475	7.440	3,589,614.000	
HANG SENG BANK LTD	32,900	121.700	4,003,930.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	63,500	25.500	1,619,250.000	
WH GROUP LTD	361,000	5.200	1,877,200.000	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	51,100	306.800	15,677,480.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	87,000	13.060	1,136,220.000	
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	78,000	14.300	1,115,400.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	45,000	18.340	825,300.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	91,169	52.900	4,822,840.100	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	26,500	45.100	1,195,150.000	
AIA GROUP LTD	509,600	74.450	37,939,720.000	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	54,000	17.520	946,080.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	72,000	37.350	2,689,200.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	74,100	21.800	1,615,380.000	
ESR CAYMAN LTD	86,200	21.700	1,870,540.000	
SANDS CHINA LTD	104,400	16.860	1,760,184.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	82,000	14.520	1,190,640.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	57,500	90.550	5,206,625.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	159,000	26.750	4,253,250.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 122,499,165.150 (2,233,159,780)	
合計			268,032,205,781 [268,032,205,781]	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,837	1,209,017.810	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	13,607	1,374,851.280	
		BOSTON PROPERTIES INC	6,200	502,386.000	
		VORNADO REALTY TRUST	6,297	165,862.980	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,500	1,438,065.000	

EQUITY RESIDENTIAL	14,800	1,108,816.000	
EQUINIX INC	3,808	2,406,046.720	
AMERICAN TOWER CORP	18,900	4,804,002.000	
HOST HOTELS & RESORTS INC	29,043	493,731.000	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	13,000	467,740.000	
KIMCO REALTY CORP	25,000	532,250.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	15,500	368,745.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	11,000	536,800.000	
INVITATION HOMES INC	25,200	962,136.000	
VICI PROPERTIES INC	39,800	1,320,166.000	
VENTAS INC	16,500	792,990.000	
WEYERHAEUSER CO	30,814	1,034,117.840	
CROWN CASTLE INTL CORP	17,900	3,029,217.000	
IRON MOUNTAIN INC	11,800	610,414.000	
SUN COMMUNITIES INC	5,000	773,650.000	
PROLOGIS INC	30,602	3,788,527.600	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6,400	977,088.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	4,200	546,378.000	
DUKE REALTY CORP	15,900	931,104.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,700	728,406.000	
WELLTOWER INC	18,800	1,434,064.000	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	21,900	573,123.000	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,800	803,568.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	7,200	512,640.000	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	71,600	467,548.000	
REALTY INCOME CORP	24,895	1,686,636.250	
PUBLIC STORAGE	6,500	2,205,970.000	
REGENCY CENTERS CORP	6,300	386,442.000	
UDR INC	12,900	594,432.000	
WP CAREY INC	8,000	679,760.000	
DIGITAL REALTY TRUST INC	11,800	1,407,740.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	5,600	1,133,832.000	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	24,200	342,914.000	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 43,131,177.480 (6,172,934,121)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	

	LAND SECURITIES GROUP PLC	28,317	180,945.630	
	SEGRO PLC	48,274	446,244.850	
	BRITISH LAND CO PLC	35,395	147,703.330	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 774,893.810 (127,346,048)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	40,978	345,444.540	
	LENDLEASE GROUP	25,300	254,265.000	
	TRANSURBAN GROUP	119,689	1,640,936.190	
	APA GROUP	45,041	476,984.190	
	SCENTRE GROUP	203,007	584,660.160	
	GPT GROUP	73,031	305,269.580	
	MIRVAC GROUP	144,900	299,943.000	
	STOCKLAND	91,123	322,575.420	
	GOODMAN GROUP	65,537	1,233,406.340	
	VICINITY CENTRES	151,865	291,580.800	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 5,755,065.220 (553,004,217)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,400	150,552.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5,800	116,116.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 266,668.000 (28,965,478)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	144,500	410,380.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	220,070	453,344.200	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	140,800	240,768.000	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	101,300	188,418.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 1,292,910.200 (131,424,321)	
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,600	232,622.000	
	GECINA SA	1,817	165,074.450	

	KLEPIERRE	8,527	171,904.320	
	COVIVIO	2,000	109,100.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	6,192	182,168.640	
ユーロ	小計		ユーロ 860,869.410 (121,856,065)	
香港・ドル	LINK REIT	90,800	5,602,360.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	107,000	654,840.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	163,000	1,698,460.000	
香港・ドル	小計		香港・ドル 7,955,660.000 (145,031,682)	
投資証券	合計		7,280,561,932 [7,280,561,932]	
合計			7,280,561,932 [7,280,561,932]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式	602銘柄	97.0%	74.8%
	投資証券	38銘柄		
イギリス・ポンド	株式	79銘柄	98.9%	4.4%
	投資証券	3銘柄		
イスラエル・シケル	株式	10銘柄	100%	0.2%
オーストラリア・ドル	株式	49銘柄	90.7%	2.2%
	投資証券	10銘柄		
カナダ・ドル	株式	86銘柄	99.7%	3.6%
	投資証券	2銘柄		
シンガポール・ドル	株式	14銘柄	87.8%	0.4%
	投資証券	4銘柄		
スイス・フラン	株式	41銘柄	100%	2.9%
スウェーデン・クローナ	株式	46銘柄	100%	1.0%
デンマーク・クローネ	株式	17銘柄	100%	0.8%
ニュージーランド・ドル	株式	5銘柄	100%	0.1%

ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	100%	-%	0.3%
ユーロ	株式	223銘柄	99.5%	0.5%	8.4%
	投資証券	5銘柄			
香港・ドル	株式	28銘柄	93.9%	6.1%	0.9%
	投資証券	3銘柄			

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	405,543,839	778,690,457
コール・ローン	106,816,729	618,308,382
株式	14,034,335,290	18,427,388,822
投資証券	923,364,411	2,245,381,056
派生商品評価勘定	452,366	13,485,160
未収入金	339,197	-
未収配当金	22,968,247	93,117,070
差入委託証拠金	229,479,606	737,829,681
流動資産合計	15,723,299,685	22,914,200,628
資産合計	15,723,299,685	22,914,200,628
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	21,179,107	100,875,270
未払解約金	22,665,493	16,723,723
その他未払費用	117,723	836,493
流動負債合計	43,962,323	118,435,486
負債合計	43,962,323	118,435,486
純資産の部		

元本等			
元本	1	8,253,886,066	11,245,719,039
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		7,425,451,296	11,550,046,103
元本等合計		15,679,337,362	22,795,765,142
純資産合計		15,679,337,362	22,795,765,142
負債純資産合計		15,723,299,685	22,914,200,628

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9月8日 至 2022年9月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p>

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
1. 1 期首	2020年9月8日	2021年9月8日
期首元本額	7,158,803,351円	8,253,886,066円
期中追加設定元本額	2,620,236,717円	3,465,779,206円
期中一部解約元本額	1,525,154,002円	473,946,233円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
新興国株式インデックスファン ド（F0Fs用）（適格機関投 資家専用）	34,644,316円	51,752,959円
ダイワファンドラップ 外国 株式インデックス エマー ジングプラス（為替ヘッジな し）	271,787,874円	286,946,745円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国株式インデックス エマージングプラス（為替 ヘッジなし）	265,300,187円	348,893,955円
D - I ' s 新興国株式イン デックス	126,209,823円	133,154,678円
i F r e e 新興国株式イン デックス	3,578,372,062円	4,525,037,082円
i F r e e 8資産バランス ダイワ新興国株式インデック ス（為替ヘッジなし）（投資 一任専用）	2,270,739,389円	2,879,253,653円
新興国株式ファンダメンタ ル・インデックスファンド （為替ヘッジなし/適格機関 投資家専用）	- 円	5,497,605円
新興国株式ファンダメンタ ル・インデックスファン ド	54,696,935円	1,226,097,453円
D Cダイワ新興国株式ファン ダメンタル・インデックス ファンド	1,177,816,189円	1,336,122,468円
ダイワ・インデックスセレク ト 新興国株式	378,607,518円	358,090,070円
ダイワ・ノーロード 新興国 株式ファンド	95,711,773円	94,872,371円
計	8,253,886,066円	11,245,719,039円
2. 期末日における受益権の総数	8,253,886,066口	11,245,719,039口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年9月8日 至 2022年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	4,682,407	87,652,364
投資証券	26,914,179	11,226,905
合計	31,596,586	76,425,459

（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（2021年7月6日から2021年9月7日まで、及び2022年7月6日から2022年9月7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

1. 株式関連

種 類	2021年9月7日 現在				2022年9月7日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	728,741,047	-	708,174,313	20,566,734	2,061,200,643	-	1,960,325,373	100,875,270
合計	728,741,047	-	708,174,313	20,566,734	2,061,200,643	-	1,960,325,373	100,875,270

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

種 類	2021年9月7日 現在				2022年9月7日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	500,619	-	500,547	72	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	500,619	-	500,547	72	-	-	-	-
買 建	80,777,040	-	80,616,961	160,079	614,274,530	-	627,759,690	13,485,160
アメリカ・ドル	80,777,040	-	80,616,961	160,079	614,274,530	-	627,759,690	13,485,160
合計	81,277,659	-	81,117,508	160,007	614,274,530	-	627,759,690	13,485,160

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
1口当たり純資産額	1.8996円	2.0271円
(1万口当たり純資産額)	(18,996円)	(20,271円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	JOYY INC-ADR	3,400	28.030	95,302.000	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	14,600	26.200	382,520.000	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF	29,000	0.000	0.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	32,900	9.810	322,749.000	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	51,600	5.210	268,836.000	
	CANADIAN SOLAR INC	4,400	44.790	197,076.000	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	33,000	3.930	129,690.000	
	SBERBANK ROSSII	698,708	0.000	0.000	
	JINKOSOLAR HOLDING ADR REP LTD	3,000	58.960	176,880.000	
	BANK VTB	382,434,000	0.000	0.000	
	NK LUKOIL	23,088	0.000	0.000	
	MOBILNYE TELESISTEMY	70,700	0.000	0.000	
	NK ROSNEFT	97,499	0.000	0.000	
	MAGNIT	4,678	0.000	0.000	
	SURGUTNEFTEGAZ	360,750	0.000	0.000	
	TATNEFT	57,648	0.000	0.000	
	TRIP.COM GROUP LTD-ADR	17,600	24.910	438,416.000	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	7,290	0.000	0.000	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	18,293	0.000	0.000	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	4	0.000	0.000	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	2,698	0.000	0.000	
	GAZPROM PJSC-SPON ADR	426,739	0.000	0.000	
	SEVERSTAL - GDR REG S	13,460	0.000	0.000	
TATNEFT PJSC - PREF	21,009	0.000	0.000		
SISTEMA PJSFC	319,200	0.000	0.000		
INTER RAO UES PJSC	2,726,100	0.000	0.000		
ALROSA PJSC	180,310	0.000	0.000		

	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	56,619	0.000	0.000	
	AEROFLOT PJSC	164,910	0.000	0.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 2,011,469.000 (287,881,443)	
インド・ルピー		株	インド・ルピー	インド・ルピー	
	PIRAMAL PHARMA LTD	22,068	217.862	4,807,789.650	
	TATA STEEL LTD	455,770	108.600	49,496,622.000	
	AXIS BANK LTD	55,955	750.000	41,966,250.000	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,550	8,888.750	22,666,312.500	
	TATA POWER CO LTD	62,546	247.350	15,470,753.100	
	BANK OF BARODA	101,129	133.450	13,495,665.050	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	9,866	2,573.100	25,386,204.600	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	58,785	238.950	14,046,675.750	
	STATE BANK OF INDIA	79,856	537.800	42,946,556.800	
	NTPC LTD	193,405	168.450	32,579,072.250	
	JSW STEEL LTD	32,741	684.550	22,412,851.550	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	141,550	225.050	31,855,827.500	
	INDIAN OIL CORP LTD	239,492	70.700	16,932,084.400	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	76,540	324.250	24,818,095.000	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	30,388	436.700	13,270,439.600	
	ULTRATECH CEMENT LTD	1,597	6,495.500	10,373,313.500	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	5,517	1,009.400	5,568,859.800	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	9,020	1,384.750	12,490,445.000	
	TECH MAHINDRA LTD	13,202	1,063.700	14,042,967.400	
	YES BANK LTD	878,240	16.750	14,710,520.000	
	TATA MOTORS LTD-A-DVR	28,175	225.950	6,366,141.250	
	REC LTD	96,688	107.950	10,437,469.600	
	COAL INDIA LTD	177,398	232.700	41,280,514.600	
	INDUS TOWERS LTD	41,172	200.850	8,269,396.200	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE L	78,703	136.000	10,703,608.000	
	GAIL INDIA LTD	210,454	93.050	19,582,744.700	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	70,318	430.950	30,303,542.100	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	14,811	1,723.050	25,520,093.550	
	WIPRO LTD	15,583	404.450	6,302,544.350	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	14,439	3,127.050	45,151,474.950	
	INFOSYS LTD	53,775	1,455.100	78,248,002.500	

	LARSEN & TOUBRO LTD	20,147	1,962.300	39,534,458.100		
	TATA MOTORS LTD	138,711	457.750	63,494,960.250		
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	37,593	2,448.500	92,046,460.500		
	ICICI BANK LTD	28,764	883.650	25,417,308.600		
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	74,902	2,596.850	194,509,258.700		
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	247,158	132.100	32,649,571.800		
	ITC LTD	96,471	327.150	31,560,487.650		
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	38,870	1,306.400	50,779,768.000		
	HERO MOTOCORP LTD	6,406	2,866.550	18,363,119.300		
	BHARTI AIRTEL LTD	44,067	761.250	33,546,003.750		
	UPL LTD	17,176	738.100	12,677,605.600		
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	15,416	887.750	13,685,554.000		
	HCL TECHNOLOGIES LTD	19,604	937.800	18,384,631.200		
	VEDANTA LTD	86,058	263.850	22,706,403.300		
インド・ルピー 小計				インド・ルピー 1,360,858,428.000 (2,449,545,171)		
インドネシア・ルピア			株	インドネシア・ルピア	インドネシア・ルピア	
		ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	529,900	6,900.000	3,656,310,000.000	
		TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,326,700	4,510.000	5,983,417,000.000	
		BANK NEGARA INDONESIA PERSER	315,500	8,750.000	2,760,625,000.000	
		BANK CENTRAL ASIA TBK PT	741,500	8,275.000	6,135,912,500.000	
		BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	482,200	8,825.000	4,255,415,000.000	
		BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,585,600	4,560.000	7,230,336,000.000	
	ADARO ENERGY TBK PT	950,900	4,040.000	3,841,636,000.000		
インドネシア・ルピア 小計				インドネシア・ルピア 33,863,651,500.000 (325,091,054)		
オフショア・人民元			株	オフショア・人民元	オフショア・人民元	
		INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	111,200	17.060	1,897,072.000	
		BANK OF BEIJING CO LTD -A	186,000	4.170	775,620.000	
		PING AN INSURANCE GROUP CO- A	55,900	43.900	2,454,010.000	
		IND & COMM BK OF CHINA-A	327,800	4.360	1,429,208.000	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	13,000	17.470	227,110.000		

GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	6,700	31.840	213,328.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	700	1,845.000	1,291,500.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	15,900	31.000	492,900.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	56,400	17.630	994,332.000	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	291,900	7.260	2,119,194.000	
CITIC SECURITIES CO-A	21,500	19.480	418,820.000	
CHINA MERCHANTS BANK-A	55,400	33.620	1,862,548.000	
PING AN BANK CO LTD-A	87,500	12.500	1,093,750.000	
GF SECURITIES CO LTD-A	14,800	16.760	248,048.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	507,900	5.240	2,661,396.000	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	15,000	25.690	385,350.000	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	94,500	15.420	1,457,190.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	43,900	3.610	158,479.000	
CHINA COAL ENERGY CO-A	26,200	11.070	290,034.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	17,160	13.390	229,772.400	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	107,900	3.270	352,833.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	70,400	4.570	321,728.000	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	13,500	16.630	224,505.000	
YANKUANG ENERGY GROUP LTD A	4,100	54.860	224,926.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	30,600	5.500	168,300.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	1,152,200	2.840	3,272,248.000	
BANK OF CHINA LTD-A	352,800	3.070	1,083,096.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	284,900	4.410	1,256,409.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	395,500	4.600	1,819,300.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	38,800	32.880	1,275,744.000	
CHINA VANKE CO LTD -A	74,200	17.850	1,324,470.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	33,300	21.080	701,964.000	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	48,700	4.630	225,481.000	
CHINA MINSHENG BANKING-A	463,900	3.630	1,683,957.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	435,600	2.890	1,258,884.000	
CRRC CORP LTD-A	143,200	5.000	716,000.000	

	CHINA UNITED NETWORK-A	249,500	3.580	893,210.000	
	CGN POWER CO LTD-A	18,900	2.860	54,054.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD-A	21,300	13.180	280,734.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD-A	33,500	9.460	316,910.000	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	226,100	5.870	1,327,207.000	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	123,100	5.430	668,433.000	
	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	10,200	29.090	296,718.000	
	HUAXIA BANK CO LTD-A	158,300	5.200	823,160.000	
	BYD CO LTD -A	1,000	272.940	272,940.000	
	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	7,100	13.980	99,258.000	
	WEICHAI POWER CO LTD-A	23,700	11.600	274,920.000	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	26,900	8.840	237,796.000	
	HUANENG POWER INTL INC-A	45,600	8.890	405,384.000	
	POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	95,300	4.490	427,897.000	
	オフショア・人民元 小計			オフショア・人民元 42,988,127.400 (881,235,118)	
サウジアラビア・リアル		株	サウジアラビア・リアル	サウジアラビア・リアル	
	SAUDI ARABIAN MINING	12,808	72.600	929,860.800	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	24,757	99.900	2,473,224.300	
	SAUDI TELECOM CO	44,160	40.050	1,768,608.000	
	AL RAJHI BANK	26,906	86.400	2,324,678.400	
	RIYAD BANK	25,245	34.900	881,050.500	
	ETIHAD ETISALAT CO	16,510	37.700	622,427.000	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	7,259	50.400	365,853.600	
	ALINMA BANK	18,842	36.200	682,080.400	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	28,652	67.600	1,936,875.200	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	59,707	37.150	2,218,115.050	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	27,576	14.240	392,682.240	
	SAUDI ELECTRICITY CO	39,494	25.000	987,350.000	
	サウジアラビア・リアル 小計			サウジアラビア・リアル 15,582,805.490 (594,328,201)	

シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	YANGZIJANG FINANCIAL HOLDING	126,000	0.380	47,880.000	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	126,000	0.915	115,290.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 163,170.000 (16,586,230)	
タイ・パーツ		株	タイ・パーツ	タイ・パーツ	
	SCB X PUBLIC COMPANY LIMITED NON-V	173,500	111.500	19,345,250.000	
	THAI OIL PCL	11,701	5.884	68,849.260	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	27,100	137.000	3,712,700.000	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	53,400	356.000	19,010,400.000	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	38,500	151.000	5,813,500.000	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	74,700	151.000	11,279,700.000	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	3,168,300	1.270	4,023,741.000	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	113,300	41.250	4,673,625.000	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	42,300	193.500	8,185,050.000	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	742,400	16.900	12,546,560.000	
	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	496,400	14.500	7,197,800.000	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	206,100	29.000	5,976,900.000	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	82,100	165.500	13,587,550.000	
	IRPC PCL - NVDR	1,120,200	3.320	3,719,064.000	
	PTT PCL-NVDR	989,800	37.250	36,870,050.000	
	THAI OIL PCL-NVDR	137,700	59.000	8,124,300.000	
	CP ALL PCL-NVDR	182,700	59.500	10,870,650.000	
	BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	52,700	137.000	7,219,900.000	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	467,200	8.750	4,088,000.000	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	400,600	25.750	10,315,450.000		
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	211,900	44.500	9,429,550.000		
タイ・パーツ 小計				タイ・パーツ 206,058,589.260 (801,567,912)	
チリ・ペソ		株	チリ・ペソ	チリ・ペソ	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE	241	78,025.000	18,804,025.000	

	CENCOSUD SA	67,112	1,348.000	90,466,976.000	
	BANCO SANTANDER CHILE	4,776,855	36.990	176,695,866.450	
	ENEL AMERICAS SA	1,363,294	100.900	137,556,364.600	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	1,872	93,100.000	174,283,200.000	
	FALABELLA SA	55,841	2,225.000	124,246,225.000	
	BANCO DE CHILE	2,286,572	87.500	200,075,050.000	
チリ・ペソ 小計				チリ・ペソ 922,127,707.050 (147,766,354)	
トルコ・リラ		株	トルコ・リラ	トルコ・リラ	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	426,852	25.880	11,046,929.760	
	AKBANK T.A.S.	578,132	15.570	9,001,515.240	
	TURKIYE IS BANKASI-C	810,236	10.530	8,531,785.080	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	195,633	23.120	4,523,034.960	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	20,407	335.800	6,852,670.600	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,293	31.780	3,695,791.540	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	208,202	27.640	5,754,703.280	
	TURKIYE HALK BANKASI	335,645	10.850	3,641,748.250	
	YAPI VE KREDI BANKASI	421,052	8.280	3,486,310.560	
	KOC HOLDING AS	122,698	49.060	6,019,563.880	
	TURK HAVA YOLLARI AO	121,946	73.650	8,981,322.900	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	35,699	113.000	4,033,987.000	
トルコ・リラ 小計				トルコ・リラ 75,569,363.050 (593,196,829)	
ブラジル・リアル		株	ブラジル・リアル	ブラジル・リアル	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	26,500	6.580	174,370.000	
	ENERGISA SA-UNITS	14,700	43.600	640,920.000	
	RUMO SA	57,400	20.210	1,160,054.000	
	VIBRA ENERGIA SA	121,100	18.590	2,251,249.000	
	VIA SA	226,500	2.890	654,585.000	
	NATURA &CO HOLDING SA	41,200	14.770	608,524.000	
	TIM SA	52,626	12.150	639,405.900	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	55,500	7.810	433,455.000	

PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	394,400	32.100	12,660,240.000	
USINAS SIDER MINAS GER-PF A	31,200	8.120	253,344.000	
BANCO BRADESCO SA-PREF	489,359	19.230	9,410,373.570	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	430,236	26.730	11,500,208.280	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	37,900	13.190	499,901.000	
VALE SA	188,490	63.670	12,001,158.300	
GERDAU SA-PREF	68,500	24.100	1,650,850.000	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	264,300	35.900	9,488,370.000	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	109,173	11.860	1,294,791.780	
ITAUSA SA	132,320	9.250	1,223,960.000	
BRASKEM SA-PREF A	16,600	31.780	527,548.000	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	26,900	46.920	1,262,148.000	
BANCO DO BRASIL S.A.	134,000	39.630	5,310,420.000	
COSAN SA	45,100	18.830	849,233.000	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	58,400	45.160	2,637,344.000	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	108,400	6.960	754,464.000	
EMBRAER SA	48,900	13.050	638,145.000	
METALURGICA GERDAU SA-PREF	129,800	10.210	1,325,258.000	
CCR SA	87,200	13.920	1,213,824.000	
BRF SA	86,300	16.380	1,413,594.000	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	29,000	49.100	1,423,900.000	
LOJAS RENNEN S.A.	27,775	26.030	722,983.250	
JBS SA	84,100	29.030	2,441,423.000	
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS	11,500	8.370	96,255.000	
SUZANO SA	15,845	44.980	712,708.100	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	147,500	12.390	1,827,525.000	
CIELO SA	318,928	5.120	1,632,911.360	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	45,700	24.920	1,138,844.000	
SUL AMERICA SA - UNITS	34,318	24.690	847,311.420	
CIA ENERGETICA DE MINAS GER	27,630	18.150	501,484.500	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	40,700	29.720	1,209,604.000	
TELEFONICA BRASIL S.A.	36,300	42.100	1,528,230.000	

	KLABIN SA - UNIT	32,500	18.700	607,750.000	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	119,200	13.410	1,598,472.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	49,900	22.780	1,136,722.000	
	COGNA EDUCACAO	445,300	2.560	1,139,968.000	
	BANCO BRADESCO S.A.	152,221	15.910	2,421,836.110	
	AMBEV SA	200,900	15.560	3,126,004.000	
ブラジル・リアル 小計				ブラジル・リアル 106,591,669.570 (2,904,111,356)	
マレーシア・リンギット		株	マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	MALAYAN BANKING BHD	76,300	8.900	679,070.000	
	PUBLIC BANK BERHAD	188,600	4.660	878,876.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	80,700	8.990	725,493.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	110,400	5.460	602,784.000	
マレーシア・リンギット 小計				マレーシア・リンギット 2,886,223.000 (91,707,715)	
メキシコ・ペソ		株	メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	1,135,400	17.480	19,846,792.000	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	123,600	25.000	3,090,000.000	
	CEMEX SAB-CPO	1,182,319	7.630	9,021,093.970	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICANO-UBD	92,800	129.040	11,974,912.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	19,700	138.360	2,725,692.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	73,600	77.490	5,703,264.000	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	170,300	70.570	12,018,071.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	86,900	121.660	10,572,254.000	
メキシコ・ペソ 小計				メキシコ・ペソ 74,952,078.970 (532,227,217)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	CHINA CONCH ENVIRONMENT PROTECTION	51,000	6.360	324,360.000	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	598,000	4.490	2,685,020.000	
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	204,000	14.540	2,966,160.000	

CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	217,000	3.620	785,540.000	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	120,000	9.640	1,156,800.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	149,200	10.660	1,590,472.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	3,389,800	3.670	12,440,566.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	38,500	15.540	598,290.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	65,200	314.200	20,485,840.000	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	544,000	4.420	2,404,480.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	186,000	15.800	2,938,800.000	
PETROCHINA CO LTD-H	2,358,000	3.760	8,866,080.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	20,000	34.500	690,000.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	237,120	2.080	493,209.600	
HUANENG POWER INTL INC-H	462,000	4.240	1,958,880.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	74,000	29.600	2,190,400.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	62,000	12.740	789,880.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	4,387,000	4.750	20,838,250.000	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	635,000	3.390	2,152,650.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	84,500	14.980	1,265,810.000	
GF SECURITIES CO LTD-H	64,600	10.580	683,468.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	66,600	10.420	693,972.000	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	25,500	36.800	938,400.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	643,000	4.660	2,996,380.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	246,500	26.050	6,421,325.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	161,120	7.800	1,256,736.000	
SINOPHARM GROUP CO-H	52,000	16.620	864,240.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	176,000	32.550	5,728,800.000	
YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LTD	102,000	35.450	3,615,900.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	188,500	3.930	740,805.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	36,000	29.500	1,062,000.000	
BYD CO LTD-H	6,500	220.800	1,435,200.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,632,000	2.510	9,116,320.000	

CHINA RESOURCES CEMENT	142,000	4.720	670,240.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	74,700	17.880	1,335,636.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	773,000	2.440	1,886,120.000	
CITIC LTD	178,000	8.090	1,440,020.000	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	145,000	7.390	1,071,550.000	
IND & COMM BK OF CHINA-H	4,730,000	3.900	18,447,000.000	
CHINA TOWER CORP LTD-H	1,716,000	0.970	1,664,520.000	
XIAOMI CORP-CLASS B	353,600	10.940	3,868,384.000	
MEITUAN-CLASS B	18,900	173.400	3,277,260.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	353,100	88.050	31,090,455.000	
JD.COM INC - CL A	31,695	236.600	7,499,037.000	
NETEASE INC	27,200	138.800	3,775,360.000	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	287,000	1.510	433,370.000	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	72,600	24.850	1,804,110.000	
BAIDU INC-CLASS A	68,650	137.500	9,439,375.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	317,500	22.100	7,016,750.000	
CRRC CORP LTD - H	286,000	2.890	826,540.000	
CGN POWER CO LTD-H	629,000	1.880	1,182,520.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	427,000	45.700	19,513,900.000	
CHINA COAL ENERGY CO-H	152,000	7.730	1,174,960.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	746,000	4.580	3,416,680.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	65,550	10.420	683,031.000	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	1,172,580	2.470	2,896,272.600	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	465,000	2.350	1,092,750.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	10,000	89.950	899,500.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	196,100	16.220	3,180,742.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	114,000	6.730	767,220.000	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	12,200	72.350	882,670.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	52,000	32.450	1,687,400.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	260,000	8.780	2,282,800.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	57,000	11.440	652,080.000	

	WEICHA I POWER CO LTD-H	110,000	10.280	1,130,800.000	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	425,000	4.500	1,912,500.000	
	SUNNY OPTICAL TECH	6,000	102.100	612,600.000	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	264,000	2.900	765,600.000	
	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	202,800	16.180	3,281,304.000	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	95,800	11.320	1,084,456.000	
	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	351,000	11.100	3,896,100.000	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	21,300	114.500	2,438,850.000	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	178,000	6.630	1,180,140.000	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	104,000	8.760	911,040.000	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	272,000	7.470	2,031,840.000	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,025,100	4.440	4,551,444.000	
	CHINA EVERGRANDE GROUP	142,000	1.650	234,300.000	
	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	357,000	2.730	974,610.000	
	CHINA MERCHANTS BANK-H	140,000	38.700	5,418,000.000	
	BANK OF CHINA LTD-H	4,755,000	2.700	12,838,500.000	
	CITIC SECURITIES CO LTD-H	70,000	15.720	1,100,400.000	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	424,000	2.410	1,021,840.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	172,000	5.030	865,160.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	94,000	3.650	343,100.000	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	89,500	26.400	2,362,800.000	
	香港・ドル 小計			香港・ドル 307,988,670.200 (5,614,633,458)	
台湾・ドル		株	台湾・ドル	台湾・ドル	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	32,000	111.500	3,568,000.000	
	SINO-AMERICAN SILICON PRODUC	18,000	163.500	2,943,000.000	
	TAIWAN CEMENT	177,247	39.850	7,063,292.950	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	173,000	82.400	14,255,200.000	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	25,000	86.000	2,150,000.000	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	65,112	66.400	4,323,436.800	
	FORMOSA PLASTICS CORP	120,600	89.800	10,829,880.000	

NAN YA PLASTICS CORP	101,140	67.800	6,857,292.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	50,390	68.200	3,436,598.000	
CHINA STEEL CORP	496,686	29.200	14,503,231.200	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	54,616	67.800	3,702,964.800	
DELTA ELECTRONICS INC	55,000	257.500	14,162,500.000	
YAGEO CORPORATION	16,000	316.000	5,056,000.000	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	57,000	55.200	3,146,400.000	
ACER INC	204,000	21.200	4,324,800.000	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	63,000	48.150	3,033,450.000	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	10,000	330.000	3,300,000.000	
QUANTA COMPUTER INC	114,000	79.500	9,063,000.000	
AUO CORP	707,000	17.500	12,372,500.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	104,400	121.500	12,684,600.000	
MEDIATEK INC	23,003	629.000	14,468,887.000	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	33,000	164.500	5,428,500.000	
EVERGREEN MARINE CORP LTD	27,000	80.800	2,181,600.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	234,434	56.900	13,339,294.600	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	289,838	44.250	12,825,331.500	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	627,000	13.150	8,245,050.000	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	213,610	27.800	5,938,358.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	250,682	20.850	5,226,719.700	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	226,517	35.350	8,007,375.950	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	245,583	15.200	3,732,861.600	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,108,231	8.510	9,431,045.810	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	220,180	17.700	3,897,186.000	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	447,028	23.400	10,460,455.200	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	175,658	26.600	4,672,502.800	
LARGAN PRECISION CO LTD	4,000	1,930.000	7,720,000.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	13,000	251.500	3,269,500.000	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	14,000	139.000	1,946,000.000	
WISTRON CORP	138,110	26.950	3,722,064.500	
INNOLUX CORP	775,000	11.850	9,183,750.000	
PEGATRON CORP	64,000	64.500	4,128,000.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	26,033	192.500	5,011,352.500	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	156,560	27.450	4,297,572.000	

	POWERTECH TECHNOLOGY INC	48,400	82.300	3,983,320.000	
	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	43,000	82.400	3,543,200.000	
	COMPAL ELECTRONICS	174,000	22.750	3,958,500.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	322,000	489.000	157,458,000.000	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	305,902	108.500	33,190,367.000	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	17,000	279.000	4,743,000.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	29,760	255.000	7,588,800.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	330,000	39.950	13,183,500.000	
台湾・ドル 小計				台湾・ドル 515,558,239.910 (2,396,881,813)	
南アフリカ・ランド		株	南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
	GOLD FIELDS LTD	25,882	139.520	3,611,056.640	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,313	2,141.960	2,812,393.480	
	STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	971,870	2.310	2,245,019.700	
	OLD MUTUAL LTD	181,777	10.510	1,910,476.270	
	VODACOM GROUP LTD	15,379	129.160	1,986,351.640	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	15,454	217.630	3,363,254.020	
	NEDBANK GROUP LTD	17,894	207.840	3,719,088.960	
	BIDVEST GROUP LTD	8,912	220.000	1,960,640.000	
	BID CORP LTD	8,649	330.250	2,856,332.250	
	STANDARD BANK GROUP LTD	33,084	154.970	5,127,027.480	
	SASOL LTD	32,210	334.940	10,788,417.400	
	REMGRO LTD	13,567	132.790	1,801,561.930	
	DISCOVERY LTD	13,047	123.150	1,606,738.050	
	EXXARO RESOURCES LTD	10,192	223.450	2,277,402.400	
	KUMBA IRON ORE LTD	2,667	379.630	1,012,473.210	
	SANLAM LTD	51,373	54.820	2,816,267.860	
	FIRSTRAND LTD	125,395	65.530	8,217,134.350	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	45,423	61.920	2,812,592.160	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	14,347	131.410	1,885,339.270	
	ABSA GROUP LTD	25,800	182.970	4,720,626.000	
	NASPERS LTD-N SHS	3,759	2,376.610	8,933,676.990	
	MTN GROUP LTD	54,377	130.240	7,082,060.480	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	11,250	183.900	2,068,875.000	

	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	13,742	144.370	1,983,932.540	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	13,952	234.330	3,269,372.160	
	MR PRICE GROUP LTD	8,172	195.000	1,593,540.000	
	SIBANYE STILLWATER LTD	87,407	38.580	3,372,162.060	
南アフリカ・ランド	小計			南アフリカ・ランド 95,833,812.300 (790,628,951)	
合計				18,427,388,822 [18,427,388,822]	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	871,600	アメリカ・ドル 15,688,800.000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 15,688,800.000 (2,245,381,056)	
投資証券	合計			2,245,381,056 [2,245,381,056]	
合計				2,245,381,056 [2,245,381,056]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 29銘柄 投資証券 1銘柄	11.4%	88.6%	12.3%
インド・ルピー	株式 45銘柄	100%	-%	11.8%
インドネシア・ルピア	株式 7銘柄	100%	-%	1.6%
オフショア・人民元	株式 50銘柄	100%	-%	4.3%
サウジアラビア・リアル	株式 12銘柄	100%	-%	2.9%
シンガポール・ドル	株式 2銘柄	100%	-%	0.1%
タイ・バーツ	株式 21銘柄	100%	-%	3.9%
チリ・ペソ	株式 7銘柄	100%	-%	0.7%
トルコ・リラ	株式 12銘柄	100%	-%	2.9%

ブラジル・リアル	株式	46銘柄	100%	-%	14.0%
マレーシア・リングgit	株式	4銘柄	100%	-%	0.4%
メキシコ・ペソ	株式	8銘柄	100%	-%	2.6%
香港・ドル	株式	85銘柄	100%	-%	27.1%
台湾・ドル	株式	50銘柄	100%	-%	11.6%
南アフリカ・ランド	株式	27銘柄	100%	-%	3.8%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	157,536,907	164,605,297
国債証券	29,570,161,880	37,201,380,950
地方債証券	1,872,143,200	1,548,421,000
特殊債券	729,574,600	726,038,000
社債券	1,026,234,000	1,303,681,800
未収利息	69,688,654	83,832,759
前払費用	3,414,413	3,727,566
流動資産合計	33,428,753,654	41,031,687,372
資産合計	33,428,753,654	41,031,687,372
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,051,120	9,035,925
流動負債合計	2,051,120	9,035,925
負債合計	2,051,120	9,035,925
純資産の部		
元本等		
元本	1 25,844,711,462	32,762,371,290
剰余金		

期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,581,991,072	8,260,280,157
元本等合計	33,426,702,534	41,022,651,447
純資産合計	33,426,702,534	41,022,651,447
負債純資産合計	33,428,753,654	41,031,687,372

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
1. 1 期首	2020年9月8日	2021年9月8日
期首元本額	17,672,155,283円	25,844,711,462円
期中追加設定元本額	8,590,816,286円	7,633,598,641円
期中一部解約元本額	418,260,107円	715,938,813円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
日本債券インデックスファン ド（F0Fs用）（適格機関投資 家専用）	639,795,959円	1,292,691,182円
i F r e e 日本債券イン デックス	2,898,539,667円	3,747,353,142円
i F r e e 8資産バランス	3,248,738,657円	4,429,046,104円

ダイワ・ライフ・バランス30	8,098,255,357円	9,585,582,965円
ダイワ・ライフ・バランス50	5,338,209,559円	6,689,354,190円
ダイワ・ライフ・バランス70	1,709,300,327円	2,215,298,175円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	1,344,364,000円	1,593,229,026円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	1,019,443,177円	1,261,226,070円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	365,817,220円	481,374,711円
ダイワつみたてインデックス日本債券	646,104,950円	1,117,014,257円
ダイワつみたてインデックスバランス30	27,871,552円	36,029,294円
ダイワつみたてインデックスバランス50	11,656,233円	14,606,942円
ダイワつみたてインデックスバランス70	7,792,902円	12,321,449円
ダイワ世界バランスファンド40VA	289,059,335円	214,981,632円
ダイワ世界バランスファンド60VA	199,762,567円	72,262,151円
計	25,844,711,462円	32,762,371,290円
2. 期末日における受益権の総数	25,844,711,462口	32,762,371,290口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年9月8日 至 2022年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、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。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	68,499,480	1,335,017,330
地方債証券	7,682,300	19,831,000
特殊債券	2,708,900	9,283,700
社債券	3,261,700	22,741,500
合計	82,152,380	1,386,873,530

(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9月7日まで、及び2021年12月1日から2022年9月7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

2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2934円 (12,934円)	1.2521円 (12,521円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	4 2 9 2年国債	180,000,000	180,268,200	
	4 3 0 2年国債	250,000,000	250,387,500	
	4 3 1 2年国債	150,000,000	150,240,000	
	4 3 3 2年国債	250,000,000	250,420,000	
	4 3 4 2年国債	50,000,000	50,085,000	
	4 3 5 2年国債	30,000,000	30,051,600	
	4 3 6 2年国債	200,000,000	200,344,000	
	4 3 7 2年国債	120,000,000	120,207,600	
	4 3 8 2年国債	20,000,000	20,036,200	
	4 3 9 2年国債	390,000,000	390,702,000	
	1 3 8 5年国債	560,000,000	561,579,200	
	1 3 9 5年国債	640,000,000	642,003,200	
	1 4 0 5年国債	470,000,000	471,630,900	
	1 4 1 5年国債	620,000,000	622,461,400	
	1 4 2 5年国債	320,000,000	321,424,000	
	1 4 3 5年国債	580,000,000	582,865,200	
	1 4 4 5年国債	530,000,000	532,877,900	
	1 4 5 5年国債	590,000,000	593,404,300	
	1 4 6 5年国債	360,000,000	362,188,800	
	1 4 7 5年国債	466,000,000	467,398,000	
	1 4 8 5年国債	460,000,000	461,306,400	
	1 4 9 5年国債	450,000,000	450,999,000	
	1 5 0 5年国債	240,000,000	240,307,200	
	1 5 1 5年国債	360,000,000	360,162,000	
	1 5 3 5年国債	370,000,000	369,644,800	
	1 4 0年国債	30,000,000	38,076,900	

2	40年国債	48,000,000	58,662,240	
3	40年国債	19,000,000	23,342,070	
4	40年国債	54,000,000	66,179,700	
5	40年国債	61,000,000	71,717,700	
6	40年国債	40,000,000	45,897,200	
7	40年国債	41,000,000	45,019,640	
8	40年国債	40,000,000	40,774,400	
9	40年国債	40,000,000	29,950,000	
10	40年国債	91,000,000	80,129,140	
11	40年国債	85,000,000	72,213,450	
12	40年国債	99,000,000	75,193,470	
13	40年国債	252,000,000	190,345,680	
14	40年国債	273,000,000	220,477,530	
15	40年国債	95,000,000	83,836,550	
332	10年国債	65,000,000	65,600,600	
333	10年国債	83,000,000	83,895,570	
334	10年国債	320,000,000	323,964,800	
335	10年国債	210,000,000	212,543,100	
337	10年国債	300,000,000	302,709,000	
338	10年国債	80,000,000	81,003,200	
339	10年国債	135,000,000	136,863,000	
340	10年国債	190,000,000	192,831,000	
341	10年国債	15,000,000	15,190,050	
342	10年国債	140,000,000	140,890,400	
343	10年国債	270,000,000	271,738,800	
344	10年国債	90,000,000	90,545,400	
345	10年国債	410,000,000	412,193,500	
346	10年国債	250,000,000	251,187,500	
347	10年国債	400,000,000	401,528,000	
348	10年国債	430,000,000	431,401,800	
349	10年国債	380,000,000	380,999,400	
350	10年国債	430,000,000	430,825,600	
351	10年国債	440,000,000	440,506,000	
352	10年国債	500,000,000	500,300,000	
353	10年国債	440,000,000	439,859,200	
354	10年国債	410,000,000	409,335,800	
355	10年国債	320,000,000	319,030,400	
356	10年国債	360,000,000	358,246,800	
357	10年国債	360,000,000	357,541,200	

358	10年国債	380,000,000	376,621,800
359	10年国債	390,000,000	386,123,400
360	10年国債	400,000,000	395,584,000
361	10年国債	460,000,000	454,581,200
362	10年国債	410,000,000	405,030,800
363	10年国債	330,000,000	325,746,300
364	10年国債	355,000,000	350,605,100
365	10年国債	335,000,000	331,341,800
366	10年国債	340,000,000	340,476,000
367	10年国債	360,000,000	358,452,000
2	30年国債	9,000,000	10,453,770
3	30年国債	4,000,000	4,633,120
4	30年国債	8,000,000	9,726,880
5	30年国債	8,000,000	9,343,520
6	30年国債	9,000,000	10,769,220
7	30年国債	12,000,000	14,342,280
10	30年国債	25,000,000	26,999,750
11	30年国債	9,000,000	10,283,580
12	30年国債	11,000,000	13,051,720
13	30年国債	11,000,000	12,948,760
14	30年国債	22,000,000	26,923,160
15	30年国債	21,000,000	25,990,650
16	30年国債	26,000,000	32,249,620
17	30年国債	17,000,000	20,931,250
18	30年国債	20,000,000	24,417,000
19	30年国債	15,000,000	18,342,600
20	30年国債	16,000,000	20,013,280
21	30年国債	16,000,000	19,635,840
22	30年国債	17,000,000	21,335,340
23	30年国債	16,000,000	20,112,480
24	30年国債	15,000,000	18,884,250
25	30年国債	17,000,000	20,953,350
26	30年国債	32,000,000	39,937,600
27	30年国債	32,000,000	40,439,360
28	30年国債	34,000,000	43,054,200
29	30年国債	43,000,000	53,847,610
30	30年国債	56,000,000	69,325,200
31	30年国債	76,000,000	92,924,440
32	30年国債	45,000,000	55,762,200

33	30年国債	95,000,000	113,054,750
34	30年国債	110,000,000	134,416,700
35	30年国債	120,000,000	142,840,800
36	30年国債	138,000,000	164,304,180
37	30年国債	155,000,000	181,770,050
38	30年国債	90,000,000	103,854,600
39	30年国債	105,000,000	123,057,900
40	30年国債	80,000,000	92,243,200
41	30年国債	80,000,000	90,621,600
42	30年国債	85,000,000	96,221,700
43	30年国債	95,000,000	107,469,700
44	30年国債	85,000,000	96,089,100
45	30年国債	90,000,000	98,109,900
46	30年国債	98,000,000	106,714,160
47	30年国債	105,000,000	116,364,150
48	30年国債	110,000,000	117,357,900
49	30年国債	120,000,000	127,857,600
50	30年国債	110,000,000	103,348,300
51	30年国債	105,000,000	87,434,550
52	30年国債	120,000,000	104,526,000
53	30年国債	95,000,000	84,440,750
54	30年国債	118,000,000	109,573,620
55	30年国債	96,000,000	88,920,000
56	30年国債	100,000,000	92,299,000
57	30年国債	105,000,000	96,665,100
58	30年国債	140,000,000	128,427,600
59	30年国債	97,000,000	86,597,720
60	30年国債	100,000,000	93,308,000
61	30年国債	95,000,000	84,163,350
62	30年国債	82,000,000	68,720,920
63	30年国債	110,000,000	89,357,400
64	30年国債	90,000,000	72,849,600
65	30年国債	86,000,000	69,640,220
66	30年国債	115,000,000	93,166,100
67	30年国債	140,000,000	118,785,800
68	30年国債	96,000,000	81,274,560
69	30年国債	106,000,000	92,180,780
70	30年国債	166,000,000	143,923,660
71	30年国債	66,000,000	57,107,820

7 2	3 0 年国債	203,000,000	175,294,560	
7 3	3 0 年国債	120,000,000	103,521,600	
7 4	3 0 年国債	155,000,000	144,308,100	
7 5	3 0 年国債	160,000,000	160,000,000	
6 5	2 0 年国債	42,000,000	43,089,480	
6 6	2 0 年国債	30,000,000	30,739,500	
6 7	2 0 年国債	19,000,000	19,583,300	
6 8	2 0 年国債	25,000,000	25,882,250	
6 9	2 0 年国債	12,000,000	12,405,120	
7 0	2 0 年国債	18,000,000	18,801,000	
7 1	2 0 年国債	17,000,000	17,695,810	
7 2	2 0 年国債	53,000,000	55,369,100	
7 5	2 0 年国債	14,000,000	14,778,960	
7 6	2 0 年国債	25,000,000	26,264,250	
7 8	2 0 年国債	17,000,000	17,945,540	
7 9	2 0 年国債	14,000,000	14,817,740	
8 1	2 0 年国債	65,000,000	69,131,400	
8 2	2 0 年国債	28,000,000	29,864,800	
8 5	2 0 年国債	31,000,000	33,385,450	
8 6	2 0 年国債	6,000,000	6,504,180	
8 7	2 0 年国債	35,000,000	37,817,150	
8 8	2 0 年国債	33,000,000	35,964,720	
8 9	2 0 年国債	15,000,000	16,290,750	
9 2	2 0 年国債	60,000,000	65,465,400	
9 3	2 0 年国債	18,000,000	19,634,760	
9 4	2 0 年国債	45,000,000	49,290,750	
9 5	2 0 年国債	30,000,000	33,266,700	
9 6	2 0 年国債	63,000,000	69,258,420	
9 7	2 0 年国債	25,000,000	27,719,250	
9 8	2 0 年国債	64,000,000	70,639,360	
9 9	2 0 年国債	53,000,000	58,723,470	
1 0 0	2 0 年国債	35,000,000	39,116,350	
1 0 1	2 0 年国債	18,000,000	20,315,340	
1 0 2	2 0 年国債	10,000,000	11,338,200	
1 0 3	2 0 年国債	21,000,000	23,689,260	
1 0 4	2 0 年国債	64,000,000	71,459,200	
1 0 5	2 0 年国債	38,000,000	42,595,720	
1 0 6	2 0 年国債	16,000,000	18,031,040	
1 0 7	2 0 年国債	40,000,000	44,994,000	

108	20年国債	68,000,000	75,641,160	
109	20年国債	60,000,000	66,918,000	
110	20年国債	27,000,000	30,463,020	
111	20年国債	35,000,000	39,856,250	
112	20年国債	40,000,000	45,281,200	
113	20年国債	70,000,000	79,443,700	
114	20年国債	45,000,000	51,173,550	
115	20年国債	42,000,000	48,063,540	
116	20年国債	27,000,000	30,993,570	
117	20年国債	77,000,000	87,818,500	
118	20年国債	13,000,000	14,775,800	
119	20年国債	23,000,000	25,789,670	
120	20年国債	98,000,000	108,387,020	
123	20年国債	42,000,000	48,383,160	
124	20年国債	100,000,000	114,385,000	
125	20年国債	25,000,000	29,119,500	
126	20年国債	21,000,000	24,109,050	
127	20年国債	110,000,000	125,365,900	
128	20年国債	32,000,000	36,583,680	
129	20年国債	95,000,000	107,790,800	
130	20年国債	28,000,000	31,889,760	
131	20年国債	150,000,000	169,512,000	
132	20年国債	25,000,000	28,365,500	
133	20年国債	150,000,000	171,558,000	
134	20年国債	15,000,000	17,187,750	
135	20年国債	20,000,000	22,730,600	
136	20年国債	180,000,000	202,897,800	
137	20年国債	18,000,000	20,491,740	
139	20年国債	250,000,000	282,220,000	
140	20年国債	100,000,000	113,968,000	
141	20年国債	48,000,000	54,757,440	
142	20年国債	185,000,000	212,890,600	
143	20年国債	100,000,000	113,152,000	
144	20年国債	130,000,000	145,772,900	
145	20年国債	190,000,000	217,097,800	
146	20年国債	190,000,000	217,246,000	
147	20年国債	220,000,000	249,306,200	
148	20年国債	195,000,000	218,879,700	
149	20年国債	195,000,000	219,008,400	

150	20年国債	225,000,000	250,112,250	
151	20年国債	260,000,000	282,859,200	
152	20年国債	200,000,000	217,532,000	
153	20年国債	225,000,000	247,365,000	
154	20年国債	205,000,000	222,828,850	
155	20年国債	220,000,000	233,409,000	
156	20年国債	200,000,000	196,346,000	
157	20年国債	210,000,000	200,071,200	
158	20年国債	225,000,000	222,662,250	
159	20年国債	220,000,000	220,143,000	
160	20年国債	190,000,000	192,281,900	
161	20年国債	145,000,000	144,314,150	
162	20年国債	210,000,000	208,418,700	
163	20年国債	160,000,000	158,337,600	
164	20年国債	230,000,000	223,555,400	
165	20年国債	155,000,000	150,167,100	
166	20年国債	215,000,000	214,073,350	
167	20年国債	160,000,000	153,971,200	
168	20年国債	185,000,000	174,578,950	
169	20年国債	155,000,000	143,320,750	
170	20年国債	175,000,000	161,157,500	
171	20年国債	130,000,000	119,225,600	
172	20年国債	215,000,000	199,934,950	
173	20年国債	165,000,000	152,821,350	
174	20年国債	210,000,000	193,859,400	
175	20年国債	165,000,000	154,515,900	
176	20年国債	150,000,000	139,915,500	
177	20年国債	180,000,000	164,484,000	
178	20年国債	190,000,000	176,502,400	
179	20年国債	190,000,000	176,065,400	
180	20年国債	140,000,000	136,766,000	
181	20年国債	150,000,000	148,998,000	
1	フィリピン共和国	100,000,000	99,727,400	
国債証券 合計			37,201,380,950	
地方債証券	751 東京都公債	100,000,000	101,022,400	
	27-15 北海道公債	100,000,000	100,543,000	
	3-5 北海道公債	100,000,000	97,828,700	
	222 神奈川県公債	100,000,000	99,973,600	
	401 大阪府公債	100,000,000	101,310,800	

	3 兵庫県公債 12年	100,000,000	101,337,600	
	11 兵庫県公債 20年	100,000,000	111,421,600	
	28 - 1 静岡県公債	100,000,000	100,077,400	
	9 埼玉県 20年	100,000,000	113,820,200	
	22 - 1 福岡県 15年	100,000,000	105,163,000	
	29 - 6 千葉県公債	100,000,000	100,373,800	
	168 共同発行地方	100,000,000	100,426,300	
	27 - 1 滋賀県公債	100,000,000	101,345,200	
	25 - 6 大阪市公債	100,000,000	100,840,300	
	11 名古屋市 20年	100,000,000	112,937,100	
地方債証券 合計			1,548,421,000	
特殊債券	47 日本政策投資CO	100,000,000	104,555,300	
	81 政保道路機構	100,000,000	112,668,700	
	241 政保道路機構	100,000,000	101,225,300	
	261 政保道路機構	100,000,000	101,262,200	
	65 地方公共団体	100,000,000	100,948,100	
	127 都市再生	100,000,000	99,643,600	
	80 住宅支援機構	100,000,000	105,734,800	
特殊債券 合計			726,038,000	
社債券	20 成田国際空港	100,000,000	99,693,800	
	25 西日本高速道	100,000,000	100,897,500	
	14 セブンアンドアイ	100,000,000	99,922,100	
	18 楽天グループ	100,000,000	95,245,500	
	17 パナソニック	100,000,000	100,580,800	
	6 楽天カード	100,000,000	97,374,700	
	5 NTTファイナンス	100,000,000	98,865,900	
	7 三井住友海上	100,000,000	99,743,300	
	80 三菱地所	100,000,000	109,168,600	
	32 東日本旅客鉄道	100,000,000	103,342,600	
	9 ソフトバンク	100,000,000	98,778,500	
	497 関西電力	100,000,000	102,056,200	
	65 東京瓦斯	100,000,000	98,012,300	
社債券 合計			1,303,681,800	
合計			40,779,521,750	

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。

「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9月7日現在	2022年9月7日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	3,741,013,085	5,136,837,121
コール・ローン	1,176,672,553	418,459,889
国債証券	226,941,943,997	241,423,721,923
派生商品評価勘定	2,355,749	7,686,476
未収入金	600,311	-
未収利息	1,134,314,909	1,347,969,651
前払費用	23,265,639	78,126,707
流動資産合計	233,020,166,243	248,412,801,767
資産合計	233,020,166,243	248,412,801,767
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	501,792	-
未払金	3,279,982,788	4,013,342,648
未払解約金	261,036,765	23,785,636
流動負債合計	3,541,521,345	4,037,128,284
負債合計	3,541,521,345	4,037,128,284
純資産の部		
元本等		
元本	1 73,446,052,175	75,361,838,720
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	156,032,592,723	169,013,834,763
元本等合計	229,478,644,898	244,375,673,483
純資産合計	229,478,644,898	244,375,673,483
負債純資産合計	233,020,166,243	248,412,801,767

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
1. 1 期首	2020年9月8日	2021年9月8日
期首元本額	69,294,023,744円	73,446,052,175円
期中追加設定元本額	12,397,440,575円	9,117,900,857円

期中一部解約元本額	8,245,412,144円	7,202,114,312円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックス V A	512,609,280円	456,914,944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	9,695,471円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	83,767,450円	56,708,153円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	22,513,805円	21,013,629円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	306,378,425円	262,492,877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)	179,493,449円	305,013,468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)	507,539,232円	583,870,307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)	2,222,567,014円	2,544,715,025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 エマーキングプラス(為替 ヘッジなし)	828,065,947円	612,608,084円
D-I's 外国債券インデッ クス	1,025,990円	1,038,760円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	5,228,333円	11,777,227円
iFree 外国債券イン デックス	1,440,562,083円	2,011,137,086円
iFree 8資産バランス	1,345,747,943円	1,749,743,615円
iFree 年金バランス	188,922,736円	314,594,981円
DCダイワ外国債券インデッ クス	49,667,564,680円	50,731,627,427円

ダイワ・ライフ・バランス30	916,471,858円	1,031,504,692円
ダイワ・ライフ・バランス50	553,687,283円	662,725,726円
ダイワ・ライフ・バランス70	355,583,319円	440,285,503円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	558,715,222円	628,690,680円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	423,101,565円	500,135,582円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	152,013,664円	190,959,697円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	26,730,544円	31,998,294円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	9,205,366円	13,493,031円
ダイワつみたてインデックス外国債券	486,527,537円	1,206,742,268円
ダイワつみたてインデックスバランス30	3,149,570円	3,883,659円
ダイワつみたてインデックスバランス50	1,212,872円	1,440,814円
ダイワつみたてインデックスバランス70	1,621,513円	2,450,390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)	- 円	71,874,140円
ダイワ世界バランスファンド40VA	167,650,251円	118,041,581円
ダイワ世界バランスファンド60VA	137,927,578円	47,489,426円
ダイワ・バランスファンド35VA	3,980,210,426円	3,385,180,844円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	240,831,046円	210,337,455円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	145,184,441円	149,237,588円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	41,586,662円	48,968,243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）	1,960,405,575円	1,150,326,488円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,845,944,132円	5,690,808,040円
ダイワライフスタイル25	33,184,771円	29,029,179円
ダイワライフスタイル50	65,028,843円	58,273,398円
ダイワライフスタイル75	17,335,260円	15,010,948円
計	73,446,052,175円	75,361,838,720円
2. 期末日における受益権の総数	73,446,052,175口	75,361,838,720口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年9月8日 至 2022年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、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。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
-----------------	--

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	6,813,464,607	37,637,641,822
合計	6,813,464,607	37,637,641,822

（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9月7日まで、及び2021年12月1日から2022年9月7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9月7日 現在				2022年9月7日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	53,533,019	-	53,489,082	43,937	-	-	-	-
イギリス・ポンド	10,500,199	-	10,488,641	11,558	-	-	-	-
イスラエル・ シェケル	43,032,820	-	43,000,441	32,379	-	-	-	-
買 建	991,025,375	-	992,835,395	1,810,020	531,234,144	-	538,920,620	7,686,476

アメリカ・ドル	558,486,044	-	557,984,252	501,792	91,373,287	-	91,951,414	578,127
イギリス・ポンド	-	-	-	-	25,835,812	-	26,075,871	240,059
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	27,119,320	-	27,431,976	312,656
オフショア・人民元	-	-	-	-	129,704,724	-	132,267,240	2,562,516
カナダ・ドル	19,249,917	-	19,360,484	110,567	-	-	-	-
シンガポール・ドル	30,874,510	-	30,925,692	51,182	41,723,036	-	42,696,978	973,942
デンマーク・クローネ	52,836,670	-	53,128,660	291,990	8,766,342	-	8,901,500	135,158
ポーランド・ズロチ	-	-	-	-	20,476,366	-	20,719,338	242,972
メキシコ・ペソ	14,064,415	-	14,167,315	102,900	22,089,227	-	22,764,695	675,468
ユーロ	315,513,819	-	317,268,992	1,755,173	164,146,030	-	166,111,608	1,965,578
合計	1,044,558,394	-	1,046,324,477	1,853,957	531,234,144	-	538,920,620	7,686,476

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
1口当たり純資産額	3.1245円	3.2427円

(1万口当たり純資産額)

(31,245円)

(32,427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	4,976,664.570	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,174,252.370	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	4,832,916.800	
		6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	921,459.150	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	795,568.900	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	809,371.980	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	851,109.420	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,739,727.350	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,329,797.280	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	1,006,269.880	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	611,617.320	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	586,708.740	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	1,049,409.110	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,228,537.530	

4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,195,807.200	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,342,616.000	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,154,157.300	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	1,855,230.360	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,125,682.890	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,590,530.370	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,448,169.360	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,497,869.100	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,524,099.560	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,327,533.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,483,259.700	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,207,552.500	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	4,461,833.760	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,387,015.900	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,370,989.140	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,989,378.600	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	3,141,170.760	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	2,070,657.430	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	3,222,770.710	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	3,116,700.330	

2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	6,034,877.940	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,730,660.220	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	5,768,771.090	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,408,955.960	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,542,397.010	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	2,052,988.630	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,576,332.840	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	1,835,000.000	1,607,918.750	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,492,605.200	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,606,097.500	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,606,808.800	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	582,028.800	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,560,317.880	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	2,553,563.160	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,218,731.420	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	2,308,903.470	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	4,996,242.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	2,182,494.600	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,350,296.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,448,712.650	

2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	4,985,710.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,448,225.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	872,810.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,449,711.800	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,460,725.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,451,448.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,438,534.400	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	2,058,652.050	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,254,897.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	4,550,000.000	4,455,769.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,090,496.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,757,960.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	2,929,920.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240531	5,300,000.000	5,167,871.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,337,936.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,574,556.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	2,926,170.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	1,450,000.000	1,217,826.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	1,939,360.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,432,800.000	

2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,181,550.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	2,102,525.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,409,735.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,104,736.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,720,592.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	6,115,304.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,537,834.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,648,295.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,654,040.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	2,833,590.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	3,455,910.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,288,230.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	1,865,401.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,484,254.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	2,934,360.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,481,714.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,220,000.000	3,752,803.800	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,452,325.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,575,808.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,517,560.000	

3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,458,975.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	2,980,290.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,458,575.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	3,974,040.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,626,000.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,888,811.200	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	2,938,800.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,000,000.000	1,985,920.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,500,000.000	1,457,805.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,473,025.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,277,722.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	3,945,600.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,425,575.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	4,218,579.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,413,850.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,247,134.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,391,975.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	4,079,631.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,645,564.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,431,085.000	

2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,690,604.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,853,750.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,392,795.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,638,328.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	5,500,000.000	5,326,365.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,351,750.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,187,747.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	3,547,014.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,578,184.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	3,830,000.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,323,225.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	2,881,860.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	958,980.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,781,300.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,850,000.000	5,257,687.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	3,569,760.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,854,360.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	2,871,540.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,327,925.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,402,725.000	

1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,700,000.000	1,615,918.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,387,850.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	5,971,355.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	3,925,530.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	271,005.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	4,903,392.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	1,500,000.000	1,389,015.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,409,616.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,544,108.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,484,837.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,096,616.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	3,313,576.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	3,303,500.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,049,095.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,745,000.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	6,500,000.000	5,929,170.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,043,355.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,091,314.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,484,960.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,312,100.000	

1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,700,000.000	4,101,070.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	5,000,000.000	3,269,500.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,029,110.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230915	2,000,000.000	1,932,500.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	6,500,000.000	5,878,405.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,430,280.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,172,960.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20231015	4,200,000.000	4,046,070.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20231115	7,700,000.000	7,413,637.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	8,089,508.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,606,560.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,442,160.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	4,458,216.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,479,322.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,605,912.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,323,000.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20231215	3,000,000.000	2,875,770.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,312,100.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,000,000.000	900,780.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20240115	4,000,000.000	3,822,160.000	

0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,069,700.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	4,123,510.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	8,982,971.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,000,000.000	4,766,000.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,489,450.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,416,750.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,499,291.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,700,450.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240315	2,000,000.000	1,904,060.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,546,240.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,625,600.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20240415	3,000,000.000	2,853,750.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	7,583,268.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240515	5,100,000.000	4,830,210.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,070,700.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,314,680.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	5,059,456.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	3,007,624.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	4,000,000.000	3,539,360.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	3,971,000.000	

0.25% United States Treasury Note/Bond 20240615	2,000,000.000	1,889,060.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,413,650.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,527,700.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240715	5,500,000.000	5,195,300.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240815	3,000,000.000	2,825,850.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,645,511.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	6,900,000.000	4,972,830.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	3,700,000.000	2,665,998.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,367,180.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,340,600.000	
0.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20230831	3,000,000.000	2,901,210.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,366,400.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,485,150.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240915	7,500,000.000	7,044,675.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,391,750.000	
0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,150,525.000	
0.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20230930	1,500,000.000	1,449,075.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241015	2,000,000.000	1,883,740.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241115	2,000,000.000	1,883,580.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	9,000,000.000	7,602,120.000	

1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	5,600,000.000	3,909,024.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	3,014,040.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20231031	4,000,000.000	3,860,600.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,304,360.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	4,000,000.000	3,632,800.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,646,240.000	
0.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20231130	5,000,000.000	4,821,850.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	4,980,024.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241215	2,200,000.000	2,079,154.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20231231	2,500,000.000	2,412,100.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	4,000,000.000	3,530,280.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,641,560.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250115	1,000,000.000	945,850.000	
0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240131	3,000,000.000	2,891,940.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	7,400,000.000	6,524,136.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250215	3,700,000.000	3,523,954.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,878,041.000	
2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	3,900,000.000	2,990,637.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	2,012,675.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,546,450.000	

1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240229	4,000,000.000	3,885,600.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	1,000,000.000	933,590.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250315	5,000,000.000	4,785,150.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,806,380.000	
2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,794,100.000	
2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240331	2,000,000.000	1,961,640.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250415	2,000,000.000	1,954,060.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	9,300,000.000	8,937,393.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250515	3,000,000.000	2,938,920.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	4,426,950.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,393,875.000	
2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240430	4,500,000.000	4,427,550.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,893,110.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,906,250.000	
2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240531	4,500,000.000	4,424,040.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	2,000,000.000	1,913,340.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,927,880.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250615	2,000,000.000	1,963,740.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,950,120.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,970,930.000	

	3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250715	3,000,000.000	2,954,400.000	
	2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	3,940,574.000	
	3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240630	1,000,000.000	991,090.000	
	3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250815	2,500,000.000	2,469,375.000	
	2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	3,100,000.000	2,946,674.000	
	3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	1,700,000.000	1,548,445.000	
	3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	1,000,000.000	948,040.000	
	3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240731	3,970,000.000	3,933,555.400	
	2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,193,041.600	
	3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240831	3,890,000.000	3,871,522.500	
	3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,463,950.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 882,786,245.040 (126,344,367,390)	
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	895,331.730	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,282,000.000	1,092,058.880	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,386,637.150	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	1,198,771.200	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,167,598.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	1,247,669.200	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,410,000.000	1,300,950.600	

1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,392,345.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,040,000.000	656,302.400	
1% United Kingdom Gilt 20240422	1,800,000.000	1,739,574.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	867,146.500	
1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	568,327.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20291022	800,000.000	694,488.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20250607	1,900,000.000	1,783,530.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	828,656.500	
0.375% United Kingdom Gilt 20301022	2,300,000.000	1,875,788.000	
0.5% United Kingdom Gilt 20611022	1,700,000.000	695,198.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,362,645.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,377,280.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	559,658.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,700,000.000	1,212,457.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20240131	1,300,000.000	1,245,452.000	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	1,959,475.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20460131	500,000.000	295,660.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20261022	500,000.000	449,210.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20510731	300,000.000	184,098.000	
0.25% UNITED KINGDOM GILT 20250131	100,000.000	93,220.000	

1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	900,000.000	640,593.000	
0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	700,000.000	598,892.000	
0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	300,000.000	236,421.000	
1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	300,000.000	194,148.000	
1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	1,100,000.000	911,955.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	820,000.000	412,435.400	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,111,943.300	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	2,240,000.000	2,466,732.800	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,538,460.800	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,362,000.000	1,493,596.440	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	1,588,653.470	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	2,036,465.480	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,541,585.640	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,304,651.040	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	2,442,202.560	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,600,000.000	1,811,728.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,543,872.510	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	1,600,317.120	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,753,206.000	
4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	1,371,173.300	

	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,752,740.880	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,670,976.320	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,866,000.000	1,803,936.840	
	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,582,000.000	1,568,220.780	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	1,507,718.520	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,084,137.600	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,524,000.000	1,529,974.080	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 65,646,265.040 (10,788,307,197)	
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	2,028,168.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,600,000.000	2,084,272.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20240331	2,000,000.000	2,028,840.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,223,042.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,723,428.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,492,208.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,149,552.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20231130	1,500,000.000	1,482,585.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,074,488.000	
	0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	1,600,000.000	1,503,696.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,351,874.000	

	0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	183,858.000	
	0.4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20241031	900,000.000	853,110.000	
	1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	300,000.000	257,049.000	
イスラエル・シケル 小計			イスラエル・シケル 21,436,170.000 (896,364,167)	
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	2,107,265.940	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	573,000.000	570,685.080	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,334,813.820	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,798,000.000	1,798,737.180	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,349,745.940	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,748,000.000	1,803,481.520	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,099,465.920	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,170,353.150	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	727,325.280	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,620,736.480	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,106,566.080	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,065,264.200	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,441,215.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,806,387.000	

	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,666,057.800	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,170,018.600	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,389,661.200	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	1,700,000.000	1,369,469.000	
	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,253,312.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,629,900.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	880,600.000	
	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,600,000.000	1,452,640.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	1,988,325.000	
	0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,072,464.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,600,000.000	1,341,648.000	
	3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,300,000.000	1,217,476.000	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 38,433,614.190 (3,693,085,987)	
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	5,368,116.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,210,650.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,234,200.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,177,500.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,373,200.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	8,000,000.000	8,266,720.000	

2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,278,330.000	
2.68% China Government Bond 20300521	6,500,000.000	6,517,290.000	
2.88% China Government Bond 20231105	37,000,000.000	37,450,290.000	
3.02% China Government Bond 20251022	18,000,000.000	18,447,660.000	
3.28% China Government Bond 20271203	9,000,000.000	9,389,250.000	
3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	13,079,125.000	
3.03% China Government Bond 20260311	7,000,000.000	7,190,540.000	
3.81% China Government Bond 20500914	7,300,000.000	8,220,311.000	
3.01% China Government Bond 20280513	7,000,000.000	7,195,160.000	
3.72% China Government Bond 20510412	8,000,000.000	8,879,280.000	
3.02% China Government Bond 20310527	5,800,000.000	5,953,410.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,562,595.000	
2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,077,300.000	
3.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20240622	11,000,000.000	11,326,700.000	
3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,833,245.000	
3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20240921	15,000,000.000	15,529,500.000	
3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,346,200.000	
3.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20250607	17,000,000.000	17,724,880.000	
3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,782,555.000	
4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	4,500,000.000	5,241,015.000	

	3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	6,300,000.000	7,127,127.000	
	3.77% CHINA GOVERNMENT BOND 20250308	11,000,000.000	11,491,920.000	
	3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	6,500,000.000	6,785,220.000	
	2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,610,385.000	
	3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	3,500,000.000	3,789,590.000	
	2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	4,000,000.000	4,065,480.000	
	2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	5,000,000.000	5,000,450.000	
	2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	7,200,000.000	7,245,432.000	
	2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	15,191,100.000	
	3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	2,500,000.000	2,616,425.000	
	2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	5,059,350.000	
	2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	4,000,000.000	4,038,480.000	
	2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	4,000,000.000	4,029,880.000	
	オフショア・人民元 小計		オフショア・人民元 334,705,861.000 (6,861,302,797)	
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	547,591.550	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,133,910.160	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,369,587.210	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,216,889.520	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	1,011,147.500	

3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	1,007,291.370	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,379,302.550	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,238,864.200	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,118,430.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	906,528.570	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,119,323.200	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	609,030.500	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	1,300,000.000	1,278,173.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,893,837.100	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,151,728.800	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,176,180.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,344,616.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	2,990,494.500	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	700,000.000	661,689.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,645,043.600	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,609,160.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	1,882,965.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240401	1,200,000.000	1,139,148.000	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	273,879.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	2,959,972.000	

0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241001	1,000,000.000	944,080.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	1,450,000.000	1,048,147.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,000,000.000	964,190.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	200,000.000	183,050.000	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240201	3,000,000.000	2,881,530.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,100,000.000	1,816,059.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250401	200,000.000	189,906.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240501	400,000.000	386,392.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,351,440.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	94,092.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	400,000.000	390,288.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240801	200,000.000	196,826.000	
3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20251001	1,000,000.000	984,220.000	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	270,000.000	253,767.600	
3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241101	360,000.000	355,536.000	
カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 46,704,305.930 (5,073,021,710)	
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	788,675.200	
3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	923,000.000	925,916.680	
2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	798,078.500	

	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	380,568.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	582,484.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	618,437.500	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	517,188.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	647,408.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	437,625.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	680,437.500	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	539,000.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	490,000.000	484,267.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	316,750.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	420,120.000	
	0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	750,000.000	696,525.000	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	532,674.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	200,000.000	154,756.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	186,960.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	230,438.400	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	220,000.000	221,423.400	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 10,159,732.180 (1,032,736,777)	
スウェーデン・ クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,655,000.000	スウェーデン・クローナ 5,732,958.350	

	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	8,025,000.000	7,964,331.000	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	7,629,025.600	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	6,844,335.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,694,278.000	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,396,690.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	5,850,368.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,268,150.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 46,380,135.950 (614,073,000)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	デンマーク・クローネ 18,355,853.340	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	4,876,142.120	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	6,060,382.440	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,785,381.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	8,590,000.000	7,822,225.800	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	2,087,330.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	416,990.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20241115	1,000,000.000	971,000.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 45,375,304.700 (863,492,048)	
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	4,080,135.150	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,184,217.350	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,073,003.200	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,148,379.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,252,830.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,465,770.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	6,800,000.000	5,868,060.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	2,929,640.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	1,700,000.000	1,527,450.000	
	ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 34,529,484.700 (491,009,272)	
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	3,769,472.400	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	2,641,561.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,870,000.000	2,690,251.900	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	3,908,784.000	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	3,400,000.000	3,118,718.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	2,000,000.000	1,740,100.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,078,400.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	1,714,240.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20240725	1,000,000.000	882,880.000	

	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,800,000.000	1,236,330.000	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	500,000.000	442,550.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	806,829.470	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,125,000.000	2,065,967.500	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,046,691.500	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	4,186,532.900	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 34,329,308.670 (1,025,780,342)	
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	2,348,629.290	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,218,110.900	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,555,816.680	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,316,744.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	736,219.340	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,382,977.050	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,873,816.440	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,382,277.000	
	4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,072,590.750	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,764,010.350	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,215,595.800	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	958,978.800	

3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,563,547.000	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	1,550,000.000	1,571,328.000	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,196,830.600	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,051,107.500	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,215,144.000	
4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,243,632.000	
4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	636,582.000	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	656,246.500	
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,303,485.800	
4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,268,172.000	
3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	401,156.000	
3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,248,767.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,612,695.000	
4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,438,556.500	
2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,617,588.000	
3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	500,000.000	481,910.000	
4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	400,000.000	412,696.000	
4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	516,325.000	
マレーシア・リングット 小計		マレーシア・リングット 39,261,535.300 (1,247,507,801)	
メキシコ・ペソ 5.75% Mexican Bonos 20260305	メキシコ・ペソ 37,290,000.000	メキシコ・ペソ 33,378,279.000	

	8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	19,346,790.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	23,800,000.000	23,074,100.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	6,075,650.000	
	5% MEXICAN BONOS 20250306	1,000,000.000	900,300.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	3,000,000.000	2,726,250.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	28,033,000.000	27,368,617.900	
	10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	24,109,873.620	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	26,292,716.800	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,633,880.620	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	28,821,058.320	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	18,003,147.900	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	32,515,000.000	30,089,706.150	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	21,654,000.000	19,075,658.220	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	7,209,974.400	
	メキシコ・ペソ 小計		メキシコ・ペソ 276,106,002.930 (1,960,601,117)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	328,510.000	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	275,303.250	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	783,912.600	
	Finland Government Bond 20230915	700,000.000	693,854.000	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	296,820.000	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	755,448.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	415,362.500	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	463,390.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	454,945.000	
	Finland Government Bond 20240915	200,000.000	195,628.000	
	0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	231,108.100	

0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	274,028.000	
Finland Government Bond 20300915	500,000.000	427,785.000	
0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	213,964.000	
0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	505,734.000	
FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	187,884.000	
0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	308,848.500	
1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	300,000.000	282,504.000	
1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	266,384.700	
1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,366,464.520	
0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,091,657.000	
1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	652,585.920	
1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	163,848.000	
0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,216,435.200	
2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	448,729.200	
0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,134,408.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,170,982.400	
Austria Government Bond 20240715	800,000.000	783,944.000	
Austria Government Bond 20300220	980,000.000	845,122.600	
0.75% Austria Government Bond 20510320	700,000.000	457,940.000	
Austria Government Bond 20401020	400,000.000	254,744.000	

0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	155,323.000	
Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	1,007,064.000	
Austria Government Bond 20250420	480,000.000	462,883.200	
0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	445,494.000	
0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	149,940.000	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	300,000.000	267,339.000	
0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	500,000.000	444,045.000	
1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	300,000.000	264,855.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,675,332.930	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,631,228.480	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	965,329.780	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,463,000.000	1,437,953.440	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	1,002,042.000	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	643,570.600	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	940,000.000	933,307.200	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,058,222.000	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,035,079.500	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	521,901.400	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	518,286.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,415,112.600	

1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	592,442.500	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,411,680.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	564,102.000	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,062,815.200	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	585,935.200	
Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,100,580.000	
Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,325,120.000	
0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	246,980.000	
0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	400,000.000	334,044.000	
1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	578,320.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,044,790.320	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,444,699.320	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,630,332.440	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,126,880.500	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,603,589.990	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	4,008,973.440	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	3,085,611.300	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,271,000.000	4,213,211.550	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	1,808,108.250	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,536,331.500	

3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,974,000.000	2,488,365.180	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	3,210,442.560	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,583,603.280	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	3,104,639.520	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,610,513.840	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	4,042,000.000	4,045,031.500	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,164,732.040	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,129,027.780	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,368,000.000	2,316,567.040	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,309,406.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	4,200,000.000	4,019,988.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,172,455.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	2,770,000.000	2,516,849.700	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,814,082.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	3,100,000.000	2,899,337.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,200,000.000	2,046,440.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,723,790.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,850,000.000	1,778,143.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,575,857.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,100,000.000	1,697,262.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,865,460.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,605,348.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,070,604.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	900,000.000	795,474.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	1,400,000.000	1,109,472.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,837,460.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	688,897.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	3,600,000.000	3,150,828.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	613,319.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	1,800,000.000	1,557,450.000	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	400,000.000	358,552.000	
1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	700,000.000	706,426.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230915	100,000.000	99,461.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	1,200,000.000	721,164.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231215	4,200,000.000	4,164,090.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240315	100,000.000	98,792.000	
0.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240614	100,000.000	98,664.000	
0.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240913	530,000.000	522,781.400	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,900,000.000	1,888,163.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	1,920,000.000	1,895,712.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,663,841.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,334,864.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,223,870.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	96,801.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,111,076.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	1,300,000.000	1,234,272.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	100,000.000	94,191.000	
1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	100,000.000	99,590.000	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,452,009.000	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	4,089,184.110	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	3,227,000.000	4,280,454.150	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,346,537.630	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	2,292,000.480	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,850,580.500	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	3,297,000.000	3,426,769.920	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	4,083,078.720	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	2,284,279.630	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	3,907,090.060	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,899,000.000	6,211,941.950	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	3,088,000.000	3,450,068.000	

2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	6,086,000.000	6,211,310.740	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	5,339,773.030	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	4,899,000.000	4,954,211.730	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,412,277.640	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	5,036,115.280	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,954,316.800	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	4,387,000.000	4,232,533.730	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	3,597,555.170	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	1,095,896.440	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	3,835,147.500	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	2,330,141.900	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,301,740.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	2,279,725.500	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	5,114,340.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	3,509,259.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,659,385.500	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	3,400,000.000	3,349,204.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,850,000.000	2,251,443.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	4,350,000.000	3,999,085.500	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	4,330,000.000	4,185,724.400	

FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,686,760.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,733,189.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	2,855,970.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,566,972.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	4,000,000.000	3,418,320.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	1,480,000.000	653,553.200	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240225	100,000.000	98,720.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	1,500,000.000	997,755.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,820,714.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	3,100,000.000	2,885,201.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	1,500,000.000	915,525.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	2,100,000.000	1,713,537.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250225	100,000.000	96,728.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	200,000.000	167,048.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	300,000.000	284,391.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	500,000.000	491,275.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,366,127.990	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	2,165,950.800	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	2,184,539.630	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,543,866.240	

2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	2,188,778.430	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,540,495.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,739,669.940	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,938,000.000	1,870,480.080	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,120,514.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,382,486.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,285,348.500	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,088,628.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	695,592.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,223,628.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	749,824.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,250,000.000	687,150.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,110,928.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	654,300.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	808,416.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	100,000.000	95,528.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	600,000.000	524,046.000	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	906,000.000	979,386.000	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,307,247.000	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,794,501.840	

2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,824,230.960	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,339,524.210	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,424,377.340	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,724,130.450	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	2,891,000.000	2,834,856.780	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,289,787.100	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,290,202.100	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	1,901,961.600	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,001,185.920	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	1,550,000.000	1,531,632.500	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	739,251.920	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,303,485.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,457,285.900	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,294,696.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,250,000.000	1,138,800.000	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,579,877.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,575,056.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,139,697.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	1,985,004.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,264,705.000	

2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,485,459.500	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	2,200,000.000	2,216,500.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,543,521.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,189,075.600	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,650,000.000	1,596,870.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	1,855,787.000	
1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	2,200,000.000	2,185,128.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,048,214.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,104,625.000	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,629,725.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,239,654.000	
0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,155,067.500	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,146,953.500	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,113,060.000	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	1,500,000.000	1,472,550.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,640,440.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,806,693.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	1,986,820.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,579,793.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,067,895.000	

0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,900,000.000	1,515,041.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240115	1,100,000.000	1,071,906.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	747,000.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	470,995.000	
0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,618,439.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,376,946.000	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	700,000.000	443,163.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	997,051.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240415	1,500,000.000	1,452,345.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	294,133.200	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	683,808.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,485,192.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,000,000.000	959,190.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240130	1,200,000.000	1,169,688.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	3,100,000.000	2,778,499.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,700,000.000	1,308,745.000	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	900,000.000	749,538.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241215	300,000.000	284,721.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	539,944.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231129	200,000.000	195,600.000	

1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	275,682.000	
1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250815	500,000.000	480,035.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	769,512.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	300,000.000	264,801.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	300,000.000	271,809.000	
1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240530	100,000.000	99,268.000	
2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	200,000.000	194,704.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	3,254,000.000	3,651,671.340	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,354,070.720	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,092,825.300	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,523,318.900	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,755,508.400	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	2,297,353.800	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,252,683.620	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,513,595.520	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,198,774.700	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,605,499.200	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	1,999,213.230	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,275,002.480	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,268,592.710	

3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,329,705.900	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,052,300.940	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,422,992.320	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	1,962,253.400	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,107,336.230	
4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	906,438.000	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	756,624.530	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,544,686.850	
3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	791,282.160	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,135,275.340	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	628,657.760	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	998,488.610	
2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	843,858.400	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,055,746.160	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	501,006.000	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	762,848.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	684,390.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	716,617.500	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	906,195.500	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	468,498.000	
0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	275,537.500	
0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	467,555.000	
0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	694,944.000	
IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	663,672.000	
0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	282,624.000	
0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	83,085.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,003,983.750	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,665,201.860	

4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	979,650.000	
3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	443,324.180	
3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	814,553.490	
1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	968,321.480	
2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	776,435.550	
1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	940,509.160	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	718,772.540	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	410,815.120	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	417,610.490	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	537,881.910	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,258,326.760	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	2,048,272.000	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	1,985,186.880	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,228,189.920	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	2,748,332.130	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,869,567.040	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	1,539,925.000	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,576,979.200	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,861,677.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,681,067.500	

1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	1,991,903.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,311,704.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,200,000.000	1,098,204.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,781,506.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,524,336.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	2,250,000.000	1,994,220.000	
0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	2,300,000.000	2,251,815.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,490,404.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,360,000.000	1,184,396.800	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	2,500,000.000	2,411,625.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	833,672.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,265,120.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,189,904.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	949,637.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	470,875.000	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,788,644.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20240531	300,000.000	293,508.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	345,962.500	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	500,000.000	446,710.000	
0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	900,000.000	660,834.000	

0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,577,893.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	413,124.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	900,000.000	825,615.000	
0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,749,279.000	
1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	600,000.000	438,390.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20250531	100,000.000	95,567.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	100,000.000	90,321.000	
2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,000,000.000	979,980.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,773,888.790	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	2,007,453.000	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	2,158,000.000	2,702,182.860	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	1,767,697.900	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,426,750.540	
4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,789,000.000	3,034,013.650	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,271,422.100	
4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	1,971,603.140	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,069,607.900	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	1,717,901.520	
3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,051,971.700	
2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,157,372.630	
グーロ 小計			グーロ

		568,930,217.720 (80,532,072,318)
国債証券 合計		241,423,721,923 [241,423,721,923]
合計		241,423,721,923 [241,423,721,923]

- (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 265銘柄	100%	52.3%
イギリス・ポンド	国債証券 54銘柄	100%	4.5%
イスラエル・シケル	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 39銘柄	100%	2.8%
カナダ・ドル	国債証券 40銘柄	100%	2.1%
シンガポール・ドル	国債証券 20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%
ノルウェー・クローネ	国債証券 9銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 15銘柄	100%	0.4%
マレーシア・リングgit	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 359銘柄	100%	33.4%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
--	-------------	-------------

	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	136,516,124	295,135,776
コール・ローン	226,415,371	242,233,592
国債証券	21,361,895,992	26,564,405,009
派生商品評価勘定	226,141	1,409,927
未収入金	22,337,536	21,074,757
未収利息	292,092,457	380,147,146
前払費用	22,637,518	47,887,203
その他未収収益	1,193	-
流動資産合計	22,062,122,332	27,552,293,410
資産合計	22,062,122,332	27,552,293,410
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	115,549	-
未払金	49,272,743	207,104,049
未払解約金	21,986,798	988,682
流動負債合計	71,375,090	208,092,731
負債合計	71,375,090	208,092,731
純資産の部		
元本等		
元本	1 15,130,772,827	18,186,563,538
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	6,859,974,415	9,157,637,141
元本等合計	21,990,747,242	27,344,200,679
純資産合計	21,990,747,242	27,344,200,679
負債純資産合計	22,062,122,332	27,552,293,410

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9月8日 至 2022年9月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
1. 1 期首	2020年9月8日	2021年9月8日
期首元本額	12,256,994,427円	15,130,772,827円
期中追加設定元本額	3,515,963,600円	3,902,208,938円
期中一部解約元本額	642,185,200円	846,418,227円
期末元本額の内訳		
ファンド名		

新興国債券インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投 資家専用)	157,594,408円	261,076,057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)	273,518,080円	321,919,003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 エマーキングプラス(為替 ヘッジなし)	449,770,342円	338,976,765円
D-I's 新興国債券イン デックス	58,097,550円	60,023,406円
iFree 新興国債券イン デックス	4,062,915,785円	5,324,895,015円
iFree 8資産バランス ダイワ新興国債券インデック ス(為替ヘッジなし)(投資 一任専用)	2,915,477,206円	3,823,114,293円
DCダイワ新興国債券イン デックスファンド	- 円	1,392,324円
ダイワ・インデックスセレク ト 新興国債券	7,016,649,882円	7,877,006,947円
ダイワ・ノーロード 新興国 債券ファンド	163,614,930円	146,620,019円
計	33,134,644円	31,539,709円
2. 期末日における受益権の総数	15,130,772,827円	18,186,563,538円
	15,130,772,827口	18,186,563,538口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年9月8日
	至 2022年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、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。</p> <p>外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	39,729,405	187,739,598
合計	39,729,405	187,739,598

(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(2021年7月6日から2021年9月7日まで、及び2022年7月6日から2022年9月7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9月7日 現在				2022年9月7日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売 建	41,754,042	-	41,789,644	35,602	-	-	-	-
アメリカ・ドル	20,557,732	-	20,557,544	188	-	-	-	-
ブラジル・ リアル	21,196,310	-	21,232,100	35,790	-	-	-	-
買 建	135,757,370	-	135,903,564	146,194	96,822,776	-	98,232,703	1,409,927
コロンビア・ ペソ	20,557,732	-	20,509,208	48,524	-	-	-	-
チェコ・コルナ	7,936,519	-	7,910,614	25,905	-	-	-	-
トルコ・リラ	25,736,895	-	25,776,475	39,580	-	-	-	-
ポーランド・ ズロチ	5,913,389	-	5,908,059	5,330	43,586,860	-	43,987,837	400,977
メキシコ・ペソ	23,758,495	-	23,940,140	181,645	20,134,540	-	20,562,114	427,574
ルーマニア・ レイ	51,854,340	-	51,859,068	4,728	-	-	-	-
南アフリカ・ ランド	-	-	-	-	33,101,376	-	33,682,752	581,376
合計	177,511,412	-	177,693,208	110,592	96,822,776	-	98,232,703	1,409,927

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
1口当たり純資産額	1.4534円	1.5035円
(1万口当たり純資産額)	(14,534円)	(15,035円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	インドネシア・ルピア		インドネシア・ルピア	インドネシア・ルピア	
		8.25% Indonesia Treasury Bond 20360515	8,250,000,000.000	8,893,912,500.000	
		8.75% Indonesia Treasury Bond 20310515	8,000,000,000.000	8,821,760,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20320815	5,500,000,000.000	5,636,400,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20380515	7,300,000,000.000	7,474,105,000.000	
		8.125% Indonesia Treasury Bond 20240515	10,000,000,000.000	10,406,200,000.000	

8.375% Indonesia Treasury Bond 20390415	4,700,000,000.000	5,187,672,000.000	
8.25% Indonesia Treasury Bond 20290515	12,000,000,000.000	12,823,440,000.000	
7% Indonesia Treasury Bond 20300915	14,300,000,000.000	14,161,147,000.000	
6.5% Indonesia Treasury Bond 20250615	13,700,000,000.000	13,828,369,000.000	
7.5% Indonesia Treasury Bond 20350615	9,300,000,000.000	9,527,292,000.000	
7.5% Indonesia Treasury Bond 20400415	11,500,000,000.000	11,808,200,000.000	
5.5% Indonesia Treasury Bond 20260415	14,400,000,000.000	13,949,280,000.000	
6.5% Indonesia Treasury Bond 20310215	15,800,000,000.000	15,149,198,000.000	
6.25% Indonesia Treasury Bond 20360615	4,300,000,000.000	3,973,802,000.000	
6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20320415	12,600,000,000.000	11,929,428,000.000	
5.125% INDONESIA TREASURY BOND 20270415	9,000,000,000.000	8,451,180,000.000	
7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20420615	5,700,000,000.000	5,661,981,000.000	
6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20370715	2,700,000,000.000	2,524,041,000.000	
11% Indonesia Treasury Bond 20250915	3,600,000,000.000	4,074,192,000.000	
10.5% Indonesia Treasury Bond 20300815	3,480,000,000.000	4,181,602,800.000	
9.5% Indonesia Treasury Bond 20310715	2,970,000,000.000	3,432,963,600.000	
8.375% Indonesia Treasury Bond 20260915	12,824,000,000.000	13,638,195,760.000	
8.25% Indonesia Treasury Bond 20320615	4,750,000,000.000	5,110,572,500.000	
7% Indonesia Treasury Bond 20270515	12,530,000,000.000	12,688,128,600.000	
5.625% Indonesia Treasury Bond 20230515	6,910,000,000.000	6,962,239,600.000	

	6.125% Indonesia Treasury Bond 20280515	11,450,000,000.000	11,108,561,000.000	
	6.625% Indonesia Treasury Bond 20330515	7,075,000,000.000	6,836,006,500.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20340315	12,520,000,000.000	13,600,350,800.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20240315	15,150,000,000.000	15,753,273,000.000	
	9% Indonesia Treasury Bond 20290315	10,620,000,000.000	11,727,028,800.000	
	インドネシア・ルピア 小計		インドネシア・ルピア 279,320,522,460.000 (2,681,477,015)	
ウルグアイ・ペソ	8.5% Uruguay Government International Bond 20280315	2,800,000.000	2,511,712.000	
	8.25% Uruguay Government International Bond 20310521	7,000,000.000	5,860,540.000	
	ウルグアイ・ペソ 小計		ウルグアイ・ペソ 8,372,252.000 (29,381,581)	
エジプト・ポンド	16.1% ARAB REP EGYPT 20290507	1,500,000.000	1,365,750.000	
	14.35% ARAB REP EGYPT 20240910	1,000,000.000	939,090.000	
	14.4% ARAB REP EGYPT 20290910	4,000,000.000	3,620,920.000	
	13.536% ARAB REP EGYPT 20250114	1,500,000.000	1,376,700.000	
	14.664% ARAB REP EGYPT 20301006	4,500,000.000	3,858,255.000	
	14.556% ARAB REP EGYPT 20271013	2,000,000.000	1,764,200.000	
	14.369% ARAB REP EGYPT 20251020	9,000,000.000	8,245,440.000	
	14.292% ARAB REP EGYPT 20280105	6,000,000.000	5,167,680.000	
	14.06% ARAB REP EGYPT 20260112	10,000,000.000	8,950,300.000	

	14.483% ARAB REP EGYPT 20260406	9,000,000.000	8,107,020.000	
	14.563% ARAB REP EGYPT 20260706	1,000,000.000	910,220.000	
	14.531% ARAB REP EGYPT 20240914	8,300,000.000	7,837,358.000	
	エジプト・ポンド 小計		エジプト・ポンド 52,142,933.000 (387,656,636)	
オフショア・人民元		オフショア・人民元	オフショア・人民元	
	3.29% China Government Bond 20231018	1,700,000.000	1,729,121.000	
	3.22% China Government Bond 20251206	3,700,000.000	3,819,621.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	4,800,000.000	5,002,224.000	
	3.19% China Government Bond 20240411	4,000,000.000	4,080,360.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,900,000.000	6,176,356.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	4,800,000.000	4,970,400.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	4,200,000.000	4,330,620.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	5,700,000.000	5,890,038.000	
	2.94% China Government Bond 20241017	4,500,000.000	4,586,445.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	4,800,000.000	4,902,768.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	8,000,000.000	8,021,280.000	
	1.99% China Government Bond 20250409	6,500,000.000	6,469,775.000	
	2.36% China Government Bond 20230702	6,150,000.000	6,188,929.500	
	2.88% China Government Bond 20231105	4,900,000.000	4,959,633.000	
	3.02% China Government Bond 20251022	7,000,000.000	7,174,090.000	

	3.28% China Government Bond 20271203	5,000,000.000	5,216,250.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	6,300,000.000	6,591,879.000	
	3.03% China Government Bond 20260311	3,900,000.000	4,006,158.000	
	3.81% China Government Bond 20500914	5,800,000.000	6,531,206.000	
	2.84% China Government Bond 20240408	4,000,000.000	4,056,920.000	
	3.01% China Government Bond 20280513	5,000,000.000	5,139,400.000	
	3.72% China Government Bond 20510412	2,000,000.000	2,219,820.000	
	3.02% China Government Bond 20310527	7,000,000.000	7,185,150.000	
	2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	2,500,000.000	2,534,775.000	
	2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	1,800,000.000	1,836,126.000	
	3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	1,000,000.000	1,082,740.000	
	2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	1,000,000.000	1,016,370.000	
	2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	3,500,000.000	3,544,590.000	
	2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	2,200,000.000	2,209,768.000	
	3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	1,000,000.000	1,046,570.000	
	オフショア・人民元 小計		オフショア・人民元 132,519,382.500 (2,716,581,081)	
コロンビア・ペ ソ		コロンビア・ペソ	コロンビア・ペソ	
	9.85% Colombia Government International Bond 20270628	90,000,000.000	82,109,700.000	
	4.375% Colombia Government International Bond 20230321	45,000,000.000	43,542,000.000	
	10% Colombian TES 20240724	3,850,000,000.000	3,748,167,500.000	
	6% Colombian TES 20280428	4,870,000,000.000	3,665,015,900.000	

	7.5% Colombian TES 20260826	4,710,000,000.000	4,048,951,500.000	
	7.75% Colombian TES 20300918	3,600,000,000.000	2,774,376,000.000	
	7% Colombian TES 20320630	4,650,000,000.000	3,263,137,500.000	
	6.25% Colombian TES 20251126	3,700,000,000.000	3,153,658,000.000	
	7.25% Colombian TES 20341018	4,200,000,000.000	2,873,136,000.000	
	5.75% Colombian TES 20271103	3,200,000,000.000	2,429,184,000.000	
	7.25% Colombian TES 20501026	3,610,000,000.000	2,136,614,600.000	
	6.25% Colombian TES 20360709	1,900,000,000.000	1,138,575,000.000	
	7% COLOMBIAN TES 20310326	4,400,000,000.000	3,184,632,000.000	
	9.25% COLOMBIAN TES 20420528	1,500,000,000.000	1,139,670,000.000	
	コロンビア・ペソ 小計		コロンビア・ペソ 33,680,769,700.000 (1,075,797,465)	
タイ・パーツ		タイ・パーツ	タイ・パーツ	
	4.875% Thailand Government Bond 20290622	36,050,000.000	41,360,886.000	
	3.625% Thailand Government Bond 20230616	23,300,000.000	23,758,078.000	
	3.85% Thailand Government Bond 20251212	31,610,000.000	33,590,050.400	
	3.65% Thailand Government Bond 20310620	28,700,000.000	31,132,325.000	
	3.4% Thailand Government Bond 20360617	29,600,000.000	30,054,360.000	
	2.125% Thailand Government Bond 20261217	35,400,000.000	35,578,770.000	
	3.775% Thailand Government Bond 20320625	37,500,000.000	40,777,875.000	
	2.875% Thailand Government Bond 20460617	34,900,000.000	31,310,186.000	
	2.4% Thailand Government Bond 20231217	37,500,000.000	38,017,875.000	
	2.875% Thailand Government Bond 20281217	34,500,000.000	35,732,340.000	
	3.3% Thailand Government Bond 20380617	40,500,000.000	40,005,495.000	
	1.45% Thailand Government Bond 20241217	42,000,000.000	41,783,280.000	
	1.6% Thailand Government Bond 20291217	36,500,000.000	34,396,140.000	

	1.6% Thailand Government Bond 20350617	15,500,000.000	12,894,605.000	
	0.95% Thailand Government Bond 20250617	34,000,000.000	33,256,760.000	
	0.75% Thailand Government Bond 20240617	39,900,000.000	39,335,814.000	
	1.585% Thailand Government Bond 20351217	32,900,000.000	27,253,044.000	
	2% Thailand Government Bond 20311217	44,000,000.000	41,869,960.000	
	2% Thailand Government Bond 20420617	19,000,000.000	15,050,280.000	
	1% THAILAND GOVERNMENT BOND 20270617	48,000,000.000	45,675,360.000	
	0.75% THAILAND GOVERNMENT BOND 20240917	24,000,000.000	23,606,160.000	
	タイ・パーツ 小計		タイ・パーツ 696,439,643.400 (2,709,150,213)	
チェコ・コルナ		チェコ・コルナ	チェコ・コルナ	
	2.5% Czech Republic Government Bond 20280825	19,600,000.000	17,177,636.000	
	5.7% Czech Republic Government Bond 20240525	12,100,000.000	12,038,774.000	
	2.4% Czech Republic Government Bond 20250917	21,100,000.000	19,341,526.000	
	1% Czech Republic Government Bond 20260626	23,900,000.000	20,499,986.000	
	0.95% Czech Republic Government Bond 20300515	22,000,000.000	16,672,040.000	
	0.45% Czech Republic Government Bond 20231025	11,900,000.000	11,109,602.000	
	0.25% Czech Republic Government Bond 20270210	22,500,000.000	18,228,825.000	
	2.75% Czech Republic Government Bond 20290723	24,500,000.000	21,536,235.000	
	2% Czech Republic Government Bond 20331013	19,000,000.000	14,728,990.000	
	1.2% Czech Republic Government Bond 20310313	16,200,000.000	12,256,110.000	

	0.05% Czech Republic Government Bond 20291129	10,000,000.000	7,150,000.000	
	4.2% Czech Republic Government Bond 20361204	9,500,000.000	9,069,840.000	
	1.75% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20320623	14,500,000.000	11,215,750.000	
	1.25% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20250214	17,500,000.000	15,667,925.000	
	1.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20400424	10,000,000.000	6,220,400.000	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20241212	5,000,000.000	4,396,250.000	
	3.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20350530	6,000,000.000	5,358,000.000	
	6% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20260226	11,000,000.000	11,214,500.000	
	チェコ・コルナ 小計		チェコ・コルナ 233,882,389.000 (1,344,613,243)	
チリ・ペソ		チリ・ペソ	チリ・ペソ	
	4.5% BONOS TESORERIA PESOS 20260301	500,000,000.000	455,165,000.000	
	5% BONOS TESORERIA PESOS 20350301	720,000,000.000	634,723,200.000	
	6% BONOS TESORERIA PESOS 20430101	590,000,000.000	564,936,800.000	
	4.7% BONOS TESORERIA PESOS 20300901	455,000,000.000	406,023,800.000	
	2.5% BONOS TESORERIA PESOS 20250301	850,000,000.000	750,422,500.000	
	2.3% BONOS TESORERIA PESOS 20281001	250,000,000.000	195,437,500.000	
	5% BONOS TESORERIA PESOS 20281001	200,000,000.000	182,860,000.000	
	チリ・ペソ 小計		チリ・ペソ 3,189,568,800.000 (511,112,452)	
トルコ・リラ		トルコ・リラ	トルコ・リラ	
	10.4% Turkey Government Bond 20240320	3,380,000.000	3,262,409.800	

	9% Turkey Government Bond 20240724	1,630,000.000	1,564,800.000	
	8% Turkey Government Bond 20250312	2,690,000.000	2,508,478.800	
	10.6% Turkey Government Bond 20260211	2,570,000.000	2,567,018.800	
	11% Turkey Government Bond 20270224	2,970,000.000	3,029,400.000	
	10.5% Turkey Government Bond 20270811	2,500,000.000	2,364,200.000	
	12.4% Turkey Government Bond 20280308	2,000,000.000	2,103,040.000	
	16.2% Turkey Government Bond 20230614	2,800,000.000	2,837,548.000	
	12.6% Turkey Government Bond 20251001	6,100,000.000	6,313,927.000	
	11.7% Turkey Government Bond 20301113	8,400,000.000	8,974,392.000	
	トルコ・リラ 小計		トルコ・リラ 35,525,214.400 (278,862,276)	
ドミニカ・ペソ	9.75% Dominican Republic International Bond 20260605	ドミニカ・ペソ 11,000,000.000	ドミニカ・ペソ 10,813,000.000	
	ドミニカ・ペソ 小計		ドミニカ・ペソ 10,813,000.000 (29,093,458)	
ハンガリー・ フォリント		ハンガリー・フォリント	ハンガリー・フォリント	
	3% Hungary Government Bond 20240626	98,500,000.000	84,986,785.000	
	3% Hungary Government Bond 20271027	270,000,000.000	194,337,900.000	
	2.75% Hungary Government Bond 20261222	130,000,000.000	94,186,300.000	
	6.75% Hungary Government Bond 20281022	88,000,000.000	75,714,320.000	
	3% Hungary Government Bond 20300821	225,000,000.000	150,144,750.000	
	2.5% Hungary Government Bond 20241024	220,000,000.000	182,985,000.000	

	3.25% Hungary Government Bond 20311022	272,000,000.000	178,608,800.000	
	1.5% Hungary Government Bond 20230823	40,000,000.000	36,762,000.000	
	1% Hungary Government Bond 20251126	200,000,000.000	145,260,000.000	
	3% Hungary Government Bond 20381027	202,000,000.000	104,488,540.000	
	1.5% Hungary Government Bond 20260422	169,000,000.000	121,629,300.000	
	2% Hungary Government Bond 20290523	135,000,000.000	86,373,000.000	
	2.25% Hungary Government Bond 20330420	215,000,000.000	120,217,250.000	
	1.5% Hungary Government Bond 20260826	100,000,000.000	69,995,000.000	
	3% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20410425	70,000,000.000	34,286,000.000	
	2.25% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20340622	75,000,000.000	39,967,500.000	
	4.5% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20280323	100,000,000.000	76,771,000.000	
	6% Hungary Government Bond 20231124	131,800,000.000	123,470,240.000	
	5.5% Hungary Government Bond 20250624	282,500,000.000	241,678,750.000	
	ハンガリー・フォロント 小計		ハンガリー・フォロント 2,161,862,435.000 (757,518,759)	
フィリピン・ペソ	6.25% Philippine Government International Bond 20360114	フィリピン・ペソ 10,000,000.000	フィリピン・ペソ 9,755,700.000	
	フィリピン・ペソ 小計		フィリピン・ペソ 9,755,700.000 (24,497,538)	
ブラジル・リアル	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20250101	ブラジル・リアル 10,890,000.000	ブラジル・リアル 10,454,182.200	

	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20270101	12,350,000.000	11,635,058.500	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20290101	8,100,000.000	7,450,704.000	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20310101	4,600,000.000	4,158,262.000	
	10% BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F 20330101	1,800,000.000	1,601,136.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20230701	20,400,000.000	18,392,028.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20240101	29,400,000.000	25,022,046.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20240701	10,200,000.000	8,247,006.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20250701	13,900,000.000	10,150,336.000	
	ブラジル・レアル 小計		ブラジル・レアル 97,110,758.700 (2,645,802,043)	
ペルー・ソル	5.7% Peru Government Bond 20240812	ペルー・ソル 730,000.000	ペルー・ソル 718,889.400	
	6.35% Peru Government Bond 20280812	2,870,000.000	2,679,719.000	
	6.15% Peru Government Bond 20320812	2,550,000.000	2,195,473.500	
	5.94% Peru Government Bond 20290212	2,700,000.000	2,433,888.000	
	5.4% Peru Government Bond 20340812	2,050,000.000	1,605,765.000	
	5.35% Peru Government Bond 20400812	1,000,000.000	720,980.000	
	8.2% Peru Government Bond 20260812	2,075,000.000	2,164,079.750	
	6.9% Peru Government Bond 20370812	2,065,000.000	1,806,400.050	
	6.95% Peru Government Bond 20310812	2,570,000.000	2,388,326.700	
	ペルー・ソル 小計		ペルー・ソル 16,713,521.400 (613,195,701)	

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	7,490,000.000	6,450,388.000	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	5,240,000.000	4,366,492.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	4,700,000.000	4,405,639.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	8,250,000.000	6,662,700.000	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	5,600,000.000	5,136,712.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	4,700,000.000	4,089,235.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	5,600,000.000	3,879,680.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	5,700,000.000	4,441,440.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	3,900,000.000	2,678,715.000	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,009,340.000	
	4% Poland Government Bond 20231025	4,530,000.000	4,404,156.600	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	5,700,000.000	4,757,847.000	
3.25% Poland Government Bond 20250725	6,150,000.000	5,608,185.000		
ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 59,890,529.600 (1,789,564,959)		
マレーシア・リングgit		マレーシア・リングgit	マレーシア・リングgit	
	4.258% Malaysia Government Investment Issue 20270726	1,800,000.000	1,833,732.000	
	4.094% Malaysia Government Investment Issue 20231130	2,000,000.000	2,025,600.000	
	4.369% Malaysia Government Investment Issue 20281031	3,500,000.000	3,579,135.000	
4.128% Malaysia Government Investment Issue 20250815	1,900,000.000	1,932,015.000		

4.13% Malaysia Government Investment Issue 20290709	1,600,000.000	1,615,536.000	
3.655% Malaysia Government Investment Issue 20241015	2,700,000.000	2,714,310.000	
3.726% Malaysia Government Investment Issue 20260331	4,200,000.000	4,202,058.000	
3.465% Malaysia Government Investment Issue 20301015	5,100,000.000	4,898,958.000	
3.422% Malaysia Government Investment Issue 20270930	3,500,000.000	3,434,795.000	
3.447% Malaysia Government Investment Issue 20360715	3,100,000.000	2,835,167.000	
4.417% MALAYSIA T-BILL 20410930	3,300,000.000	3,290,199.000	
3.99% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20251015	2,300,000.000	2,327,324.000	
3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,450,000.000	2,424,838.500	
3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	3,250,000.000	3,229,005.000	
4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,740,000.000	1,765,665.000	
3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	3,350,000.000	3,402,092.500	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	2,300,000.000	2,291,697.000	
3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,400,000.000	1,411,900.000	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	3,800,000.000	3,833,212.000	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	1,720,000.000	1,743,667.200	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	2,520,000.000	2,534,464.800	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	2,600,000.000	2,734,810.000	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,500,000.000	1,518,930.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	1,400,000.000	1,408,848.000	

	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	2,000,000.000	2,019,220.000	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,950,000.000	2,941,681.000	
	3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	3,300,000.000	3,309,537.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	2,000,000.000	1,921,180.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	3,500,000.000	3,225,390.000	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	3,600,000.000	3,312,756.000	
	2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	2,900,000.000	2,606,114.000	
	3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	1,000,000.000	963,820.000	
	4.193% MALAYSIAN GOVERNMENT 20321007	1,000,000.000	1,012,530.000	
	4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	1,100,000.000	1,134,914.000	
	マレーシア・リングット 小計		マレーシア・リングット 85,435,101.000 (2,714,640,530)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	52,400,000.000	46,903,240.000	
	8% Mexican Bonos 20471107	29,300,000.000	26,613,190.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	39,000,000.000	37,810,500.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	13,000,000.000	11,283,350.000	
	5% MEXICAN BONOS 20250306	10,700,000.000	9,633,210.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	5,500,000.000	4,998,125.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	27,250,000.000	26,604,175.000	
	10% Mexican Bonos 20241205	26,550,000.000	26,761,869.000	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	40,030,000.000	37,632,203.000	
	10% Mexican Bonos 20361120	11,890,000.000	12,908,140.700	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	35,230,000.000	34,367,921.900	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	29,100,000.000	27,727,935.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	44,350,000.000	41,041,933.500	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	26,120,000.000	23,009,891.600	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	10,430,000.000	9,466,268.000	
	メキシコ・ペソ 小計		メキシコ・ペソ	

			376,761,952.700 (2,675,348,950)	
ルーマニア・レイ		ルーマニア・レイ	ルーマニア・レイ	
	5.85% Romania Government Bond 20230426	1,430,000.000	1,416,929.800	
	4.75% Romania Government Bond 20250224	2,450,000.000	2,283,571.500	
	5.8% Romania Government Bond 20270726	2,100,000.000	1,924,167.000	
	3.25% Romania Government Bond 20240429	1,600,000.000	1,495,312.000	
	4.25% Romania Government Bond 20230628	1,500,000.000	1,463,940.000	
	5% Romania Government Bond 20290212	2,600,000.000	2,223,988.000	
	4.85% Romania Government Bond 20260422	1,600,000.000	1,452,080.000	
	3.65% Romania Government Bond 20310924	2,900,000.000	2,116,652.000	
	4.5% Romania Government Bond 20240617	2,500,000.000	2,372,025.000	
	4.4% Romania Government Bond 20230925	2,400,000.000	2,332,008.000	
	3.65% Romania Government Bond 20250728	2,300,000.000	2,063,215.000	
	4% Romania Government Bond 20231025	1,600,000.000	1,544,544.000	
	4.15% Romania Government Bond 20280126	1,600,000.000	1,344,368.000	
	3.7% Romania Government Bond 20241125	1,300,000.000	1,200,043.000	
	3.25% Romania Government Bond 20260624	2,100,000.000	1,795,080.000	
	4.15% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20301024	2,500,000.000	1,952,725.000	
	4.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20341011	800,000.000	600,072.000	
	2.5% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20271025	1,300,000.000	1,013,519.000	

	6.7% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20320225	2,000,000.000	1,833,400.000	
ルーマニア・レイ	小計		ルーマニア・レイ 32,427,639.300 (947,237,286)	
ロシア・ルーブル		ロシア・ルーブル	ロシア・ルーブル	
	8.15% Russian Federal Bond - OFZ 20270203	46,760,000.000	0.000	
	7% Russian Federal Bond - OFZ 20230125	24,400,000.000	0.000	
	7.05% Russian Federal Bond - OFZ 20280119	46,160,000.000	0.000	
	7% Russian Federal Bond - OFZ 20230816	33,800,000.000	0.000	
	8.5% Russian Federal Bond - OFZ 20310917	43,000,000.000	0.000	
	7.75% Russian Federal Bond - OFZ 20260916	45,600,000.000	0.000	
	7.4% Russian Federal Bond - OFZ 20221207	54,000,000.000	0.000	
	7.7% Russian Federal Bond - OFZ 20330323	46,100,000.000	0.000	
	7.1% Russian Federal Bond - OFZ 20241016	48,600,000.000	0.000	
	6.5% Russian Federal Bond - OFZ 20240228	48,000,000.000	0.000	
	7.25% Russian Federal Bond - OFZ 20340510	55,000,000.000	0.000	
	6.9% Russian Federal Bond - OFZ 20290523	49,000,000.000	0.000	
	7.95% Russian Federal Bond - OFZ 20261007	46,000,000.000	0.000	
	7.4% Russian Federal Bond - OFZ 20240717	55,000,000.000	0.000	
	7.15% Russian Federal Bond - OFZ 20251112	59,000,000.000	0.000	
	7.65% Russian Federal Bond - OFZ 20300410	65,000,000.000	0.000	

	7.7% Russian Federal Bond - OFZ 20390316	38,000,000.000	0.000	
	6% Russian Federal Bond - OFZ 20271006	68,000,000.000	0.000	
	4.5% Russian Federal Bond - OFZ 20250716	71,000,000.000	0.000	
	6.1% Russian Federal Bond - OFZ 20350718	63,000,000.000	0.000	
	5.7% Russian Federal Bond - OFZ 20280517	65,000,000.000	0.000	
	6.9% RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 20310723	74,000,000.000	0.000	
	6.7% RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 20290314	50,000,000.000	0.000	
	ロシア・ルーブル 小計		ロシア・ルーブル 0.000 (-)	
南アフリカ・ラ ンド		南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	55,450,000.000	58,322,310.000	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	14,720,000.000	9,670,304.000	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	13,280,000.000	8,322,576.000	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	19,540,000.000	15,451,255.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	55,520,000.000	43,474,936.000	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	36,400,000.000	29,008,980.000	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	45,900,000.000	40,027,095.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	35,900,000.000	28,222,785.000	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	39,900,000.000	33,565,875.000	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	34,800,000.000	29,325,960.000	

	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	29,100,000.000	23,744,145.000	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 319,136,221.000 (2,632,873,823)	
国債証券 合計			26,564,405,009 [26,564,405,009]	
合計			26,564,405,009 [26,564,405,009]	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
インドネシア・ルピア	国債証券 30銘柄	100%	10.1%
ウルグアイ・ペソ	国債証券 2銘柄	100%	0.1%
エジプト・ポンド	国債証券 12銘柄	100%	1.5%
オフショア・人民元	国債証券 30銘柄	100%	10.2%
コロンビア・ペソ	国債証券 14銘柄	100%	4.0%
タイ・バーツ	国債証券 21銘柄	100%	10.2%
チェコ・コルナ	国債証券 18銘柄	100%	5.1%
チリ・ペソ	国債証券 7銘柄	100%	1.9%
トルコ・リラ	国債証券 10銘柄	100%	1.0%
ドミニカ・ペソ	国債証券 1銘柄	100%	0.1%
ハンガリー・フォリント	国債証券 19銘柄	100%	2.9%
フィリピン・ペソ	国債証券 1銘柄	100%	0.1%
ブラジル・リアル	国債証券 9銘柄	100%	10.0%
ペルー・ソル	国債証券 9銘柄	100%	2.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	100%	6.7%
マレーシア・リングgit	国債証券 34銘柄	100%	10.2%
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	100%	10.1%
ルーマニア・レイ	国債証券 19銘柄	100%	3.6%
ロシア・ルーブル	国債証券 23銘柄	-%	-%
南アフリカ・ランド	国債証券 11銘柄	100%	9.9%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ」-REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	9,049,899,340	6,400,084,818
投資証券	2 475,939,964,100	492,034,040,000
未収入金	1,022,517,459	-
未収配当金	5,258,663,033	5,861,732,424
前払金	-	21,280,000
流動資産合計	491,271,043,932	504,317,137,242
資産合計	491,271,043,932	504,317,137,242
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	57,176,000	10,696,000
前受金	7,840,000	-
未払金	573,923,700	891,530,150
未払解約金	591,401,000	125,915,000
流動負債合計	1,230,340,700	1,028,141,150
負債合計	1,230,340,700	1,028,141,150
純資産の部		
元本等		
元本	1 138,556,634,922	145,851,213,788
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	351,484,068,310	357,437,782,304
元本等合計	490,040,703,232	503,288,996,092
純資産合計	490,040,703,232	503,288,996,092
負債純資産合計	491,271,043,932	504,317,137,242

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
1. 1 期首	2020年9月8日	2021年9月8日
期首元本額	130,880,999,900円	138,556,634,922円
期中追加設定元本額	33,975,234,504円	32,886,466,478円
期中一部解約元本額	26,299,599,482円	25,591,887,612円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ - R E I Tオープン	5,124,278,617円	4,583,372,818円
ダイワJ - R E I Tオープン （毎月分配型）	122,438,993,777円	129,070,791,974円
ダイワJ - R E I Tオープン （年1回決算型）	338,225,196円	353,397,764円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2050	6,504,394円	12,620,822円

	iFree J-REITインデックス	483,006,494円	615,985,156円
	iFree 8資産バランス	1,197,273,510円	1,629,952,741円
	DC・ダイワJ-REITオープン	5,394,658,162円	5,475,869,799円
	DCダイワ・ターゲットイヤー2030	5,225,396円	6,439,997円
	DCダイワ・ターゲットイヤー2040	4,036,190円	5,780,467円
	ダイワ国内REITインデックス(投資一任専用)	-円	760,588円
	ダイワ・ノーロードJ-REITファンド	99,168,219円	95,858,215円
	ダイワファンドラップJ-REITインデックス	1,827,586,069円	2,250,728,619円
	ダイワJ-REITインデックス(ダイワSMA専用)	148,721,866円	321,441,449円
	ダイワファンドラップオンラインJ-REITインデックス	487,256,716円	493,895,828円
	ダイワ・インデックスセレクトJ-REIT	1,001,700,316円	934,317,551円
	計	138,556,634,922円	145,851,213,788円
2.	期末日における受益権の総数	138,556,634,922口	145,851,213,788口
3.	2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 6,000,300,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 5,512,900,000円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 2021年9月8日 至 2022年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	41,211,046,557	35,210,143,742
合計	41,211,046,557	35,210,143,742

(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(2021年3月16日から2021年9月7日まで、及び2022年3月16日から2022年9月7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

不動産投信関連

種類	2021年9月7日 現在				2022年9月7日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
不動産投信 指数先物取 引								
買 建	12,026,560,000	-	11,970,000,000	56,560,000	11,266,080,000	-	11,256,000,000	10,080,000
合計	12,026,560,000	-	11,970,000,000	56,560,000	11,266,080,000	-	11,256,000,000	10,080,000

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
1口当たり純資産額	3.5368円	3.4507円
(1万口当たり純資産額)	(35,368円)	(34,507円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	8,897	1,076,537,000	
	サンケイリアルエステート	14,021	1,362,841,200	
	SOSILA物流リート投	20,460	3,183,576,000	
	東海道リート投資法	5,307	652,761,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	15,112	10,336,608,000	
	森ヒルズリート	51,466	8,141,921,200	
	産業ファンド	65,405	12,001,817,500	
	アドバンス・レジデンス	43,761	15,994,645,500	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	31,390	7,028,221,000	
	A P I 投資法人	23,107	10,028,438,000	
	G L P 投資法人	134,785	22,576,487,500	
	コンフォリア・レジデンシャル	20,360	6,810,420,000	
	日本プロロジスリート	71,717	25,100,950,000	
	星野リゾート・リート	7,655	4,906,855,000	
	ONE リート投資法人	7,634	2,064,997,000	
	イオンリート投資	48,448	7,688,697,600	
	ヒューリックリート投資法	40,949	6,858,957,500	
	日本リート投資法人	14,216	5,394,972,000	
	積水ハウス・リート投資	133,007	11,265,692,900	
	トーセイ・リート投資法人	9,709	1,354,405,500	
	ケネディクス商業リート	18,395	5,222,340,500	
	ヘルスケア&メディカル投資	10,791	2,042,736,300	
	サムティ・レジデンシャル	11,377	1,448,292,100	
	野村不動産マスターF	141,533	23,621,857,700	
	いちごホテルリート投資	7,251	696,096,000	
	ラサールロジポート投資	53,579	9,113,787,900	
	スターアジア不動産投	54,646	3,185,861,800	
	マリモ地方創生リート	5,466	730,804,200	
	三井不ロジパーク	17,289	9,232,326,000	
	大江戸温泉リート	7,064	467,636,800	
	投資法人みらい	53,172	2,706,454,800	
	森トラスト・ホテルリート投	10,269	1,326,754,800	
	三菱地所物流REIT	13,505	6,374,360,000	
CREロジスティクスファンド	16,950	3,598,485,000		
ザイマックス・リート	7,099	902,992,800		
タカラレーベン不動産投	19,168	2,068,227,200		

アドバンス・ロジスティクス投資法人	17,066	2,679,362,000	
日本ビルファンド	51,058	35,332,136,000	
ジャパンリアルエステイト	43,767	28,185,948,000	
日本都市ファンド投資法人	220,829	23,849,532,000	
オリックス不動産投資	87,206	16,577,860,600	
日本プライムリアルティ	29,932	12,257,154,000	
NTT都市開発リート投資法人	42,072	6,327,628,800	
東急リアル・エステート	29,344	5,821,849,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	29,985	3,337,330,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人	98,528	14,917,139,200	
森トラスト総合リート	31,280	4,516,832,000	
インヴィンシブル投資法人	192,637	8,110,017,700	
フロンティア不動産投資	16,239	8,655,387,000	
平和不動産リート	29,911	4,657,142,700	
日本ロジスティクスファンド投資法人	29,511	9,738,630,000	
福岡リート投資法人	22,636	3,852,647,200	
ケネディクス・オフィス投資法人	12,862	9,132,020,000	
いちごオフィスリート投資法人	35,862	3,098,476,800	
大和証券オフィス投資法人	9,148	6,421,896,000	
阪急阪神リート投資法人	19,769	3,066,171,900	
スターツプロシード投資法人	6,816	1,746,940,800	
大和ハウスリート投資法人	65,973	20,946,427,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	141,140	9,597,520,000	
大和証券リビング投資法人	59,216	7,307,254,400	
ジャパンエクセレント投資法人	40,150	5,331,920,000	
投資証券 合計		492,034,040,000	
合計		492,034,040,000	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	248,399,636	74,710,050
コール・ローン	276,222,106	391,063,474
投資信託受益証券	565,003,409	215,350,274
投資証券	44,420,137,328	28,450,235,525
派生商品評価勘定	42,304,577	26,940,392
未収入金	1,180,796	2,265,504
未収配当金	38,645,017	37,509,927
差入委託証拠金	352,988,631	153,269,526
流動資産合計	45,944,881,500	29,351,344,672
資産合計	45,944,881,500	29,351,344,672
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	699,877	18,933,792
未払金	42,622,634	23,905,272
未払解約金	14,072,300	10,693,400
流動負債合計	57,394,811	53,532,464
負債合計	57,394,811	53,532,464
純資産の部		
元本等		
元本	1 15,069,273,862	8,693,888,748
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	30,818,212,827	20,603,923,460
元本等合計	45,887,486,689	29,297,812,208
純資産合計	45,887,486,689	29,297,812,208
負債純資産合計	45,944,881,500	29,351,344,672

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

3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
1. 1 期首	2020年9月8日	2021年9月8日
期首元本額	12,710,434,181円	15,069,273,862円
期中追加設定元本額	4,942,761,042円	3,730,828,656円
期中一部解約元本額	2,583,921,361円	10,106,213,770円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス（為替 ヘッジあり）	6,320,386,503円	- 円
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス（為替 ヘッジなし）	1,145,157,463円	1,176,483,696円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス（為替ヘッジあり）	339,268,737円	- 円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国REITインデッ クス（為替ヘッジなし）	285,819,023円	248,948,856円
D-I's グローバルREI Tインデックス	2,091,742円	1,759,240円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	6,536,630円	11,103,225円
iFree 外国REITイ ンデックス	540,457,173円	751,034,351円
iFree 8資産バランス グローバル・リート・イン デックスファンド(資産形成 型)	1,418,312,242円	1,670,709,367円
グローバル・リート・イン デックスファンド(毎月決算 型)	209,938,602円	297,799,642円
DCダイワ・グローバルRE ITインデックスファンド	102,389,007円	169,492,850円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	3,118,282,148円	3,881,909,848円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	6,128,053円	6,608,803円
ダイワ海外REITインデッ クス(為替ヘッジなし)(投 資一任専用)	4,881,134円	5,880,786円
ダイワバランスファンド 2020-07(適格機関投資家専 用)	- 円	668,798円
ダイワバランスファンド 2021-02(適格機関投資家専 用)	183,749,014円	- 円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	184,925,099円	149,216,410円
ダイワ・ノーロード グロー バルREITファンド	247,424,169円	247,102,074円
ダイワ外国REITインデッ クス(為替ヘッジあり)(ダ イワSMA専用)	62,138,978円	71,228,327円
ダイワ外国REITインデッ クス(為替ヘッジなし)(ダ イワSMA専用)	875,372,290円	- 円
計	16,015,855円	3,942,475円
2. 期末日における受益権の総数	15,069,273,862円	8,693,888,748円
	15,069,273,862口	8,693,888,748口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年9月8日 至 2022年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2022年9月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	20,910,225	4,618,296
投資証券	8,958,970,297	4,775,509,350
合計	8,979,880,522	4,780,127,646

（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9月7日まで、及び2021年12月1日から2022年9月7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

1. 不動産投信関連

種 類	2021年9月7日 現在				2022年9月7日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	860,954,445	-	902,772,136	41,817,691	637,488,489	-	636,360,256	1,128,233
合計	860,954,445	-	902,772,136	41,817,691	637,488,489	-	636,360,256	1,128,233

（注） 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

種 類	2021年9月7日 現在				2022年9月7日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買 建	262,061,691	-	261,848,700	212,991	380,076,867	-	389,211,700	9,134,833
アメリカ・ドル	168,396,315	-	167,917,500	478,815	319,999,460	-	328,371,000	8,371,540
ユーロ	93,665,376	-	93,931,200	265,824	60,077,407	-	60,840,700	763,293
合計	262,061,691	-	261,848,700	212,991	380,076,867	-	389,211,700	9,134,833

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2021年9月7日現在	2022年9月7日現在
1口当たり純資産額	3.0451円	3.3699円
(1万口当たり純資産額)	(30,451円)	(33,699円)

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REAL ESTATE ETF	16,230.000	アメリカ・ドル 1,504,683.300	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 1,504,683.300 (215,350,274)	
投資信託受益証券 合計				215,350,274 [215,350,274]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	19,596	333,523.920	
		URBAN EDGE PROPERTIES	15,882	251,253.240	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	16,400	254,528.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	20,841	4,316,796.330	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	48,889	4,939,744.560	
		BOSTON PROPERTIES INC	21,264	1,723,021.920	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	22,688	203,965.120	
		VORNADO REALTY TRUST	23,721	624,811.140	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	13,078	230,957.480	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	12,500	643,500.000	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	3,326	174,881.080	
		EQUITY RESIDENTIAL	50,962	3,818,073.040	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	31,700	491,033.000	
		EPR PROPERTIES	11,184	470,734.560	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,900	104,325.000	
		CITY OFFICE REIT INC	6,000	67,740.000	
		GLOBAL NET LEASE INC	14,833	196,685.580	
		EQUINIX INC	13,537	8,553,218.080	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11,929	315,999.210	
		CHATHAM LODGING TRUST	6,665	79,580.100	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8,200	659,690.000			
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	18,500	310,245.000			
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,500	126,035.000			
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	7,800	38,688.000			

HOST HOTELS & RESORTS INC	106,372	1,808,324.000	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	43,973	1,582,148.540	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	21,000	275,940.000	
RLJ LODGING TRUST	24,821	290,902.120	
FARMLAND PARTNERS INC	4,500	65,655.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	33,500	553,755.000	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	9,300	118,296.000	
KIMCO REALTY CORP	92,028	1,959,276.120	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	8,300	88,312.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	56,654	1,347,798.660	
WHITESTONE REIT	6,400	62,400.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	34,974	1,706,731.200	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	17,700	210,807.000	
PARK HOTELS & RESORTS INC	34,780	476,138.200	
INVITATION HOMES INC	90,843	3,468,385.740	
JBG SMITH PROPERTIES	15,732	338,238.000	
ALEXANDER & BALDWIN INC	10,400	188,760.000	
CLIPPER REALTY INC	1,890	15,592.500	
GLADSTONE LAND CORP	4,251	98,623.200	
AMERICOLD REALTY TRUST	40,095	1,171,976.850	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	9,000	60,660.000	
VICI PROPERTIES INC	143,365	4,755,417.050	
BRT APARTMENTS CORP	1,600	36,816.000	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4,189	369,972.480	
SAFEHOLD INC	2,257	79,807.520	
NECESSITY RETAIL REIT INC CLASS A	19,143	138,021.030	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	20,343	454,259.190	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	5,750	116,552.500	
STORE CAPITAL CORP	37,570	1,005,748.900	
CREATIVE MEDIA AND COMMUNITY TRUST	2,100	14,721.000	
BROADSTONE NET LEASE INC	25,200	477,792.000	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	14,668	110,596.720	
LIFE STORAGE INC	12,513	1,623,561.750	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,574	209,118.140	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	32,919	636,324.270	
PARAMOUNT GROUP INC	24,493	171,695.930	

EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	19,500	138,840.000	
NETSTREIT CORP	6,900	135,240.000	
APARTMENT INCOME REIT CO	23,401	977,459.770	
CTO REALTY GROWTH INC	2,580	53,122.200	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	24,579	1,523,652.210	
STAG INDUSTRIAL INC	26,666	816,246.260	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	1,500	27,105.000	
INDUS REALTY TRUST INC	861	51,926.910	
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2,300	33,465.000	
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	16,969	557,092.270	
ORION OFFICE REIT INC	7,823	76,821.860	
DIGITAL CORE REIT UNITS	49,400	38,038.000	
VENTAS INC	59,513	2,860,194.780	
CARETRUST REIT INC	14,404	305,220.760	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	9,500	247,570.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	44,610	967,144.800	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	6,654	116,844.240	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	34,343	500,377.510	
UMH PROPERTIES INC	7,244	128,653.440	
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	3,600	106,200.000	
IRON MOUNTAIN INC	43,286	2,239,184.780	
TERRENO REALTY CORP	11,250	674,887.500	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	19,993	808,916.780	
SUN COMMUNITIES INC	18,094	2,799,684.620	
ACADIA REALTY TRUST	13,611	216,414.900	
ALEXANDER'S INC	300	67,959.000	
PROLOGIS INC	110,013	13,619,609.400	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	22,071	3,369,579.570	
BRANDYWINE REALTY TRUST	24,642	197,875.260	
SAUL CENTERS INC	1,800	78,912.000	
VERIS RESIDENTIAL INC	11,900	159,936.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	15,831	2,059,454.790	
COUSINS PROPERTIES INC	22,155	595,747.950	
SITE CENTERS CORP	27,078	348,764.640	
DUKE REALTY CORP	57,200	3,349,632.000	
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,178	1,012,018.180	

ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,734	2,626,038.520	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	19,607	1,000,153.070	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,607	1,094,536.330	
GETTY REALTY CORP	5,803	176,991.500	
WELLTOWER INC	67,576	5,154,697.280	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	80,321	2,102,000.570	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	15,700	470,843.000	
SERVICE PROPERTIES TRUST	24,600	161,868.000	
EQUITY COMMONWEALTH	16,775	445,208.500	
KILROY REALTY CORP	15,609	760,002.210	
LTC PROPERTIES INC	5,708	249,439.600	
LXP INDUSTRIAL TRUST	42,695	433,354.250	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,178	2,875,768.980	
MACERICH CO/THE	31,979	296,125.540	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	25,715	1,830,908.000	
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,800	438,668.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	26,220	1,171,509.600	
REALTY INCOME CORP	89,525	6,065,318.750	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	16,710	425,603.700	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	1,133	4,146.780	
PUBLIC STORAGE	22,706	7,705,962.280	
REGENCY CENTERS CORP	23,126	1,418,548.840	
RPT REALTY	11,600	110,548.000	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,016	226,591.440	
SL GREEN REALTY CORP	9,538	428,828.480	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	32,900	46,389.000	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	4,100	67,199.000	
UDR INC	44,567	2,053,647.360	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,800	89,190.000	
WP CAREY INC	28,743	2,442,292.710	
WASHINGTON REIT	12,600	249,606.000	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4,700	43,193.000	
AGREE REALTY CORP	11,200	852,544.000	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	35,006	1,121,242.180	
CUBESMART	33,358	1,553,148.480	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	32,026	341,076.900	
DIGITAL REALTY TRUST INC	42,396	5,057,842.800	
EXTRA SPACE STORAGE INC	20,029	4,055,271.630	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4,575	42,730.500	

	CENTERSPACE	2,160	164,656.800	
	KITE REALTY GROUP TRUST	32,569	629,233.080	
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,200	52,096.000	
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,521	103,408.330	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	30,242	256,452.160	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	89,322	1,265,692.740	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	13,105	40,625.500	
	DOUGLAS EMMETT INC	26,186	524,767.440	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	287,362	142,244.190	
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	110,200	71,079.000	
	EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	0.000	
	PRIME US REIT	79,100	48,646.500	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 155,265,882.870 (22,221,653,156)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	ASSURA PLC	427,180	273,395.200	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	83,320	79,070.680	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	56,200	40,407.800	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	118,460	79,842.040	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	75,640	65,050.400	
	REGIONAL REIT LTD	59,840	40,092.800	
	NEWRIVER REIT PLC	42,860	32,830.760	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	132,590	154,865.120	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	85,980	60,529.920	
	CUSTODIAN REIT PLC	60,900	61,996.200	
	PRS REIT PLC/THE	75,872	74,885.660	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	53,280	61,698.240	
	LXI REIT PLC	275,918	413,877.000	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	51,240	42,273.000	
	AEW UK REIT PLC	21,930	22,982.640	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	128,420	127,906.320	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	194,253	238,931.190	
	HOME REIT PLC	117,587	134,049.180	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	111,857	714,766.230	
	SEGRE PLC	180,719	1,670,566.430	
	HAMMERSON PLC	482,269	103,639.600	
	UNITE GROUP PLC/THE	59,830	629,411.600	

	BRITISH LAND CO PLC	139,900	583,802.700	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	36,781	187,767.000	
	DERWENT LONDON PLC	17,260	415,620.800	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	193,120	263,801.920	
	WORKSPACE GROUP PLC	20,759	106,493.670	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	32,544	336,179.520	
	SHAFTESBURY PLC	41,750	169,505.000	
	BIG YELLOW GROUP PLC	26,760	330,486.000	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	149,787	309,160.360	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	78,138	38,365.750	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	280,618	458,529.810	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 8,322,780.540 (1,367,765,754)	
イスラエル・ シュケル	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	31,070	311,321.400	
	REIT 1 LTD	26,100	540,270.000	
イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 851,591.400 (35,609,721)	
オーストラリ ア・ドル	DEXUS/AU	163,650	1,379,569.500	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	38,400	67,200.000	
	HOME CONSORTIUM LTD	25,790	123,792.000	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY UN	53,900	44,737.000	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	46,820	168,083.800	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	199,444	155,566.320	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	88,000	271,040.000	
	RURAL FUNDS GROUP	53,875	137,920.000	
	WAYPOINT REIT	113,781	291,279.360	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	94,122	419,784.120	
	CENTURIA OFFICE REIT	62,250	99,911.250	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	89,450	161,457.250	
	HOMEEO DAILY NEEDS REIT	234,898	305,367.400	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	165,430	449,969.600	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	41,377	144,405.730		

	NATIONAL STORAGE REIT	167,575	402,180.000	
	DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	31,510	84,131.700	
	GDI PROPERTY GROUP	71,460	64,314.000	
	SCENTRE GROUP	799,116	2,301,454.080	
	ARENA REIT	56,810	232,352.900	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	27,160	88,813.200	
	BWP TRUST	77,951	306,347.430	
	GPT GROUP	292,210	1,221,437.800	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	83,410	338,644.600	
	MIRVAC GROUP	600,551	1,243,140.570	
	STOCKLAND	362,431	1,283,005.740	
	ABACUS PROPERTY GROUP	65,960	176,772.800	
	GOODMAN GROUP	259,400	4,881,908.000	
	VICINITY CENTRES	597,686	1,147,557.120	
	CHARTER HALL GROUP	71,052	913,018.200	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	59,590	249,682.100	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 19,154,843.570 (1,840,588,918)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	2,300	10,350.000	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	5,100	18,156.000	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	6,200	20,212.000	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	4,300	42,312.000	
	PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	6,741	89,116.020	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	8,400	91,056.000	
	SLATE GROCERY REIT	4,000	56,720.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,000	135,440.000	
	SLATE OFFICE REIT	5,100	22,695.000	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,800	41,636.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	17,000	214,200.000	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	15,000	274,200.000	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	6,100	36,722.000	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2,700	36,018.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5,200	382,096.000	

	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	19,900	235,616.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	9,700	118,243.000	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	17,700	268,155.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	25,300	345,851.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	2,700	43,794.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	7,400	120,324.000	
	PLAZA RETAIL REIT	7,000	28,420.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11,500	319,010.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	13,400	593,352.000	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	19,966	247,778.060	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	24,000	480,480.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,300	59,565.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,200	154,496.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	7,200	110,952.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	10,100	311,989.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 4,908,954.080 (533,210,592)	
シンガポール・ ドル			シンガポール・ドル	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	49,300	33,524.000	
	KEPPEL DC REIT	204,483	388,517.700	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	170,976	47,873.280	
	AIMS APAC REIT	64,300	88,091.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	436,290	588,991.500	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	73,800	57,195.000	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	262,440	213,888.600	
	EC WORLD REIT	36,500	19,892.500	
	IREIT GLOBAL	71,624	39,751.320	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	512,177	1,454,582.680	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	777,122	1,600,871.320	
	SUNTEC REIT	327,400	520,566.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	482,600	825,246.000	
	KEPPEL REIT	317,600	339,832.000	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	312,656	337,668.480	
	ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T	820,702	332,384.310	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	127,700	163,456.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	166,176	378,881.280	

	STARHILL GLOBAL REIT	198,400	114,080.000	
	CAPITALAND CHINA TRUST	159,142	171,873.360	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	62,600	299,228.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	300,969	773,490.330	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	329,284	612,468.240	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	147,800	91,636.000	
	SPH REIT	134,400	125,664.000	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	337,763	126,661.120	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 9,746,314.020 (990,712,819)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	119,250	153,832.500	ニュージーランド・ドル
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	261,440	269,283.200	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	80,260	215,899.400	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	172,800	374,976.000	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	213,350	283,755.500	
ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 1,297,746.600 (111,787,892)	
ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	5,124	104,632.080	ユーロ
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1,820	15,269.800	
	HAMBORNER REIT AG	9,070	74,374.000	
	WERELDHAVE NV	5,160	67,957.200	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	15,915	804,821.550	
	NSI NV	2,271	65,859.000	
	VASTNED RETAIL NV	2,320	50,112.000	
	ICADE	4,098	183,590.400	
	CARMILA	5,780	92,480.000	
	ALTAREA	550	72,160.000	
	GECINA SA	7,453	677,105.050	
	KLEPIERRE	26,957	543,453.120	
	COVIVIO	6,222	339,410.100	
	MERCIALYS	6,370	50,991.850	
	AEDIFICA	5,376	505,881.600	
COFINIMMO	3,882	395,575.800		
BEFIMMO	3,130	148,362.000		

	INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	3,030	72,568.500	
	RETAIL ESTATES	1,457	90,042.600	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	19,268	566,864.560	
	CARE PROPERTY INVEST	3,450	72,622.500	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	2,670	102,795.000	
	MONTEA NV	1,310	115,542.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,930	22,869.000	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	7,500	34,575.000	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	34,559	202,861.330	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	43,870	401,410.500	
	CROMWELL REIT EUR	43,520	86,169.600	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	54,940	65,378.600	
ユーロ 小計			ユーロ 6,025,734.740 (852,942,753)	
韓国・ウォン	SK REITS LTD	8,700	48,198,000.000	韓国・ウォン
	D&D PLATFORM REIT LTD	8,000	35,880,000.000	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT LTD	3,930	18,471,000.000	
	NH ALL ONE REIT LTD	4,130	18,275,250.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8,260	65,749,600.000	
	LOTTE REIT CO LTD	17,135	86,360,400.000	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	13,090	58,250,500.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	5,600	27,048,000.000	
	JR REIT XXVII	16,350	74,065,500.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	5,990	31,627,200.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	20,740	111,581,200.000	
韓国・ウォン 小計			韓国・ウォン 575,506,650.000 (59,622,489)	
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	321,000	773,610.000	香港・ドル
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	142,000	515,460.000	
	FORTUNE REIT	233,000	1,477,220.000	
	PROSPERITY REIT	174,000	384,540.000	
	LINK REIT	322,400	19,892,080.000	
	CHAMPION REIT	268,000	892,440.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 23,935,350.000 (436,341,431)	

投資証券 合計		28,450,235,525	
		[28,450,235,525]	
合計		28,665,585,799	
		[28,665,585,799]	

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

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託 受益証券 1銘柄 投資証券 147銘柄	1.0%	99.0%	78.2%
イギリス・ポンド	投資証券 33銘柄	-%	100%	4.8%
イスラエル・シケル	投資証券 2銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券 31銘柄	-%	100%	6.4%
カナダ・ドル	投資証券 30銘柄	-%	100%	1.9%
シンガポール・ドル	投資証券 26銘柄	-%	100%	3.5%
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	-%	100%	0.4%
ユーロ	投資証券 29銘柄	-%	100%	3.0%
韓国・ウォン	投資証券 11銘柄	-%	100%	0.2%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	-%	100%	1.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2022年9月8日から2023年3月7日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

iFree 8資産バランス

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	当中間計算期間末 2023年3月7日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	584,938,290
親投資信託受益証券	50,175,045,333
流動資産合計	50,759,983,623
資産合計	50,759,983,623
負債の部	
流動負債	
未払解約金	27,493,348
未払受託者報酬	5,137,743
未払委託者報酬	51,377,848
その他未払費用	1,091,901
流動負債合計	85,100,840
負債合計	85,100,840
純資産の部	
元本等	
元本	1 34,021,256,538
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	16,653,626,245
（分配準備積立金）	6,262,766,533
元本等合計	50,674,882,783
純資産合計	50,674,882,783
負債純資産合計	50,759,983,623

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間
	自 2022年9月8日
	至 2023年3月7日
営業収益	
受取利息	164
有価証券売買等損益	388,899,140
営業収益合計	388,898,976
営業費用	
支払利息	112,583
受託者報酬	5,137,743
委託者報酬	51,377,848
その他費用	1,091,901
営業費用合計	57,720,075
営業損失()	446,619,051
経常損失()	446,619,051
中間純損失()	446,619,051
一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	37,971,121
期首剰余金又は期首欠損金()	15,326,332,462
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,271,914,453
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,271,914,453
剰余金減少額又は欠損金増加額	535,972,740
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	535,972,740
中間剰余金又は中間欠損金()	16,653,626,245

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2022年9月8日 至 2023年3月7日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2023年3月7日現在
1. 1 期首元本額	30,252,717,145円
期中追加設定元本額	4,831,348,796円
期中一部解約元本額	1,062,809,403円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	34,021,256,538口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2022年9月8日 至 2023年3月7日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2023年3月7日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2023年3月7日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2023年3月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,4895円 (14,895円)

(参考)

当ファンドは、「トピックス・インデックス・マザーファンド」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」受益証券、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)」受益証券、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」受益証券、「ダイワ」-REITマザーファンド」受益証券及び「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年3月7日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,594,974,644

株式	2 3	212,146,534,100
未収入金		180,671,400
未収配当金		354,476,675
未収利息		737,102
その他未収収益	4	47,251,065
流動資産合計		224,324,644,986
資産合計		224,324,644,986
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		108,350
前受金		161,512,400
未払解約金		275,487,200
受入担保金		7,709,189,565
流動負債合計		8,146,297,515
負債合計		8,146,297,515
純資産の部		
元本等		
元本	1	150,771,134,832
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		65,407,212,639
元本等合計		216,178,347,471
純資産合計		216,178,347,471
負債純資産合計		224,324,644,986

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2022年9月8日 至 2023年3月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2023年3月7日現在
1. 1 期首	2022年9月8日
期首元本額	145,845,153,885円
期中追加設定元本額	11,054,796,985円
期中一部解約元本額	6,128,816,038円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
トピックス・インデックス	2,894,049,969円
ファンド	
ダイワ・トピックス・イン	4,714,630,213円
デックスファンドVA	
適格機関投資家専用・ダイ	916,069円
ワ・トピックスインデックス	
ファンドVA2	
ダイワ国内重視バランスファ	21,533,126円
ンド30VA(一般投資家私	
募)	
ダイワ国内重視バランスファ	252,807,798円
ンド50VA(一般投資家私	
募)	

ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	20,111,604円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	496,080,863円
日本株式インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	532,251,333円
D-I's TOPIXイン デックス	20,607,721円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	233,057,359円
iFree TOPIXイン デックス	6,488,985,948円
iFree 8資産バランス	4,438,382,830円
iFree 年金バランス	824,673,330円
DCダイワ日本株式インデッ クス	69,769,417,902円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	3,290,947,423円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	4,798,421,673円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	4,758,092,926円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	6,845,301,706円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	58,355,225円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	72,452,390円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	3,066,174,854円
ダイワつみたてインデックス バランス30	12,196,465円
ダイワつみたてインデックス バランス50	10,691,283円
ダイワつみたてインデックス バランス70	26,881,534円
ダイワ国内株式インデックス (ラップ専用)	3,306,262,319円

	ダイワ世界バランスファンド 40VA	72,720,123円
	ダイワ世界バランスファンド 60VA	32,498,143円
	ダイワ・バランスファンド3 5VA	4,725,498,780円
	ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専用)	448,785,650円
	ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専用)	61,211,240円
	ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専用)	97,779,371円
	ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	202,935,026円
	ダイワファンドラップTOP PIXインデックス	11,827,426,338円
	ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	2,272,716,861円
	ダイワファンドラップオンラ インTOPPIXインデック ス	3,151,162,158円
	ダイワ・インデックスセレク トTOPPIX	1,213,228,036円
	ダイワライフスタイル25	131,545,673円
	ダイワライフスタイル50	543,827,507円
	ダイワライフスタイル75	418,018,080円
	DC・ダイワ・トピックス・ インデックス(確定拠出年金 専用ファンド)	8,618,497,983円
	計	150,771,134,832円
2.	期末日における受益権の総数	150,771,134,832口
3.	2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行って おります。 株式 7,417,239,900円
4.	3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとお り差入を行っております。

株式 1,034,950,000円

5. 4 その他未収収益

貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分46,270,723円が含まれております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	2023年3月7日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	3,983,340,000	-	3,983,340,000	0
合計	3,983,340,000	-	3,983,340,000	0

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

（1口当たり情報）

	2023年3月7日現在
1口当たり純資産額	1.4338円
（1万口当たり純資産額）	（14,338円）

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年3月7日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	401,288,264
コール・ローン	5,387,122,471
株式	297,564,931,330
投資証券	7,159,756,457
派生商品評価勘定	375,204,504
未収入金	370,617
未収配当金	449,109,540
差入委託証拠金	5,502,650,879
流動資産合計	316,840,434,062
資産合計	316,840,434,062
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	38,564,816
未払解約金	101,491,700
流動負債合計	140,056,516
負債合計	140,056,516
純資産の部	

元本等		
元本	1	71,766,958,692
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		244,933,418,854
元本等合計		316,700,377,546
純資産合計		316,700,377,546
負債純資産合計		316,840,434,062

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2022年9月8日 至 2023年3月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2023年3月7日現在
1. 1 期首	2022年9月8日
期首元本額	65,876,384,035円
期中追加設定元本額	7,213,977,000円
期中一部解約元本額	1,323,402,343円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国株式インデックス	293,132,448円
VA	

ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	3,459,588円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	34,702,114円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	6,474,561円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	158,781,159円
外国株式インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投資 家専用)	79,534,880円
ダイワバランスファンド 2023-01(適格機関投資家専 用)	105,598,925円
ダイワファンドラップ 外国 株式インデックス エマー ジ ングプラス(為替ヘッジな し)	562,712,349円
ダイワファンドラップ 外国 株式インデックス(為替ヘッ ジなし)	3,282,196,744円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国株式インデックス エマージングプラス(為替 ヘッジなし)	640,982,515円
D-I's 外国株式インデッ クス	18,529,259円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	50,227,188円
iFree 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	6,422,199,330円
iFree 8資産バランス	1,435,913,299円
iFree 年金バランス	266,064,767円
DCダイワ外国株式インデッ クス	44,955,656,549円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	533,967,199円

ダイワ・ライフ・バランス50	1,037,486,954円
ダイワ・ライフ・バランス70	854,342,563円
大和DC海外株式インデックスファンド	1,939,675,454円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	12,495,713円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	12,692,228円
ダイワつみたてインデックス外国株式	1,572,975,878円
ダイワつみたてインデックスバランス30	1,975,251円
ダイワつみたてインデックスバランス50	2,334,836円
ダイワつみたてインデックスバランス70	4,825,040円
ダイワ先進国株式インデックス(為替ヘッジなし)(投資一任専用)	5,034,580円
ダイワ世界バランスファンド40VA	70,036,162円
ダイワ世界バランスファンド60VA	52,168,940円
ダイワ・バランスファンド35VA	1,138,821,033円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	61,806,037円
ダイワバランスファンド2021-02(適格機関投資家専用)	160,746,206円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,233,671,860円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	436,305,897円
ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	1,292,053,900円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,939,012,439円

ダイワライフスタイル25	10,628,108円
ダイワライフスタイル50	43,977,192円
ダイワライフスタイル75	33,759,547円
計	71,766,958,692円
2. 期末日における受益権の総数	71,766,958,692口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種 類	2023年3月7日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	11,639,446,354	-	11,965,437,942	325,991,588
合計	11,639,446,354	-	11,965,437,942	325,991,588

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

種 類	2023年3月7日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	5,009,100,790	-	5,019,748,890	10,648,100
アメリカ・ドル	2,549,832,720	-	2,546,672,440	3,160,280
イギリス・ポンド	375,089,520	-	375,015,000	74,520
オーストラリア・ドル	363,768,400	-	365,200,000	1,431,600
カナダ・ドル	496,646,500	-	497,635,500	989,000
スイス・フラン	433,608,900	-	437,892,600	4,283,700
ユーロ	790,154,750	-	797,333,350	7,178,600
合計	5,009,100,790	-	5,019,748,890	10,648,100

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

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

(1口当たり情報)

	2023年3月7日現在
1口当たり純資産額	4.4129円
(1万口当たり純資産額)	(44,129円)

「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年3月7日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	850,960,383
コール・ローン	760,865,533
株式	21,264,080,721
投資証券	2,196,228,307
派生商品評価勘定	37,909,279
未収配当金	36,203,686
差入委託証拠金	627,463,278
流動資産合計	25,773,711,187
資産合計	25,773,711,187
負債の部	
流動負債	
未払解約金	8,900,868
流動負債合計	8,900,868
負債合計	8,900,868
純資産の部	
元本等	

元本	1	12,661,139,083
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		13,103,671,236
元本等合計		25,764,810,319
純資産合計		25,764,810,319
負債純資産合計		25,773,711,187

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2022年9月8日 至 2023年3月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2023年3月7日現在
1. 1 期首	2022年9月8日
期首元本額	11,245,719,039円
期中追加設定元本額	1,639,224,082円
期中一部解約元本額	223,804,038円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
新興国株式インデックスファ	
ンド（F0Fs用）（適格機関投	72,803,826円
資家専用）	

ダイワファンドラップ 外国 株式インデックス エマー ジ ングプラス(為替ヘッジな し)	306,079,644円
ダイワファンドラップオンラ イン 外国株式インデックス エマージングプラス(為替 ヘッジなし)	344,981,887円
D-I's 新興国株式イン デックス	135,127,489円
iFree 新興国株式イン デックス	5,086,580,964円
iFree 8資産バランス ダイワ新興国株式インデッ クス(為替ヘッジなし)(投資 一任専用)	3,119,730,848円 5,889,201円
新興国株式ファンダメンタ ル・インデックスファンド (為替ヘッジなし/適格機関 投資家専用)	1,681,309,577円
DCダイワ新興国株式ファン ダメンタル・インデックス ファンド	1,445,549,952円
ダイワ・インデックスセレク ト 新興国株式	353,798,804円
ダイワ・ノーロード 新興国 株式ファンド	109,286,891円
計	12,661,139,083円
2. 期末日における受益権の総数	12,661,139,083口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2023年3月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種 類	2023年3月7日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	1,901,698,664	-	1,939,205,202	37,506,538
合計	1,901,698,664	-	1,939,205,202	37,506,538

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

種 類	2023年3月7日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				

買 建	836,341,709	-	836,744,450	402,741
アメリカ・ドル	836,341,709	-	836,744,450	402,741
合計	836,341,709	-	836,744,450	402,741

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2023年3月7日現在
1口当たり純資産額	2.0350円
(1万口当たり純資産額)	(20,350円)

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年3月7日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	176,951,474

国債証券		39,943,051,540
地方債証券		1,563,652,712
特殊債券		719,193,100
社債券		1,173,100,200
未収入金		128,222,900
未収利息		87,929,201
前払費用		4,716,417
流動資産合計		43,796,817,544
資産合計		43,796,817,544
負債の部		
流動負債		
未払金		131,785,368
未払解約金		9,264,597
流動負債合計		141,049,965
負債合計		141,049,965
純資産の部		
元本等		
元本	1	35,502,729,838
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		8,153,037,741
元本等合計		43,655,767,579
純資産合計		43,655,767,579
負債純資産合計		43,796,817,544

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2022年9月8日 至 2023年3月7日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2023年3月7日現在
1. 1 期首	2022年9月8日
期首元本額	32,762,371,290円
期中追加設定元本額	3,133,248,673円
期中一部解約元本額	392,890,125円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
日本債券インデックスファン ド（F0Fs用）（適格機関投資 家専用）	1,761,627,133円
i F r e e 日本債券イン デックス	3,616,197,178円
i F r e e 8資産バランス	5,037,408,601円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	10,194,704,731円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	7,267,691,414円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,402,714,684円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽 / 安定コース）	1,671,577,720円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽 / 6分散コー ス）	1,314,749,411円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト（六つの羽 / 成長コース）	510,024,189円
ダイワつみたてインデックス 日本債券	1,396,664,360円

ダイワつみたてインデックス バランス30	38,197,721円
ダイワつみたてインデックス バランス50	16,210,331円
ダイワつみたてインデックス バランス70	13,604,690円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	206,095,231円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	55,262,444円
計	35,502,729,838円
2. 期末日における受益権の総数	35,502,729,838口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2023年3月7日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2023年3月7日現在
1口当たり純資産額	1.2296円
(1万口当たり純資産額)	(12,296円)

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年3月7日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		1,908,711,889
コール・ローン		1,479,804,429
国債証券		233,732,530,805
派生商品評価勘定		2,185,633
未収入金		169,708
未収利息		1,542,638,170
前払費用		76,933,808
流動資産合計		238,742,974,442
資産合計		238,742,974,442
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		607,021
未払金		7,167
未払解約金		114,982,811
流動負債合計		115,596,999
負債合計		115,596,999
純資産の部		
元本等		
元本	1	77,726,363,607
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		160,901,013,836
元本等合計		238,627,377,443
純資産合計		238,627,377,443
負債純資産合計		238,742,974,442

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2023年3月7日現在
1. 1 期首	2022年9月8日
期首元本額	75,361,838,720円
期中追加設定元本額	4,839,770,170円
期中一部解約元本額	2,475,245,283円

期末元本額の内訳

ファンド名

ダイワ外国債券インデックス V A	445,970,695円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	9,071,985円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	49,091,639円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	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)	224,994,953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)	411,471,121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)	632,575,610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)	2,837,008,389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)	619,792,367円
D-I's 外国債券インデッ クス	1,356,076円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	14,158,137円
iFree 外国債券イン デックス	2,210,522,760円
iFree 8資産バランス	2,021,103,394円
iFree 年金バランス	375,120,232円
DCダイワ外国債券インデッ クス	50,894,133,627円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	1,113,732,170円

ダイワ・ライフ・バランス50	727,965,005円
ダイワ・ライフ・バランス70	481,043,278円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	670,219,158円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	527,306,345円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	204,455,763円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	33,860,673円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	14,948,281円
ダイワつみたてインデックス外国債券	1,511,654,119円
ダイワつみたてインデックスバランス30	4,160,460円
ダイワつみたてインデックスバランス50	1,622,524円
ダイワつみたてインデックスバランス70	2,727,034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)	282,581,745円
ダイワ世界バランスファンド40VA	115,508,229円
ダイワ世界バランスファンド60VA	36,873,180円
ダイワ・バランスファンド35VA	3,231,562,538円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	199,538,920円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	154,368,349円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	55,955,238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)	1,738,581,409円

ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,744,946,560円
ダイワライフスタイル25	29,483,691円
ダイワライフスタイル50	61,256,769円
ダイワライフスタイル75	15,847,449円
計	77,726,363,607円
2. 期末日における受益権の総数	77,726,363,607口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	2023年3月7日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	1,275,533,271	-	1,277,111,883	1,578,612
アメリカ・ドル	222,723,071	-	222,452,319	270,752
イギリス・ポンド	25,842,685	-	25,777,700	64,985

オーストラリア・ドル	33,707,655	-	33,616,688	90,967
オフショア・人民元	665,496,822	-	665,357,430	139,392
カナダ・ドル	120,613,557	-	120,607,001	6,556
メキシコ・ペソ	66,834,554	-	68,039,675	1,205,121
ユーロ	140,314,927	-	141,261,070	946,143
合計	1,275,533,271	-	1,277,111,883	1,578,612

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2023年3月7日現在
1口当たり純資産額	3.0701円
(1万口当たり純資産額)	(30,701円)

「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年3月7日現在
--	-------------

	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	289,657,685
コール・ローン	218,297,659
国債証券	29,473,072,782
派生商品評価勘定	412,699
未収入金	292,716
未収利息	437,686,730
前払費用	39,270,202
流動資産合計	30,458,690,473
資産合計	30,458,690,473
負債の部	
流動負債	
未払金	143,834,290
未払解約金	819,439
流動負債合計	144,653,729
負債合計	144,653,729
純資産の部	
元本等	
元本	1 19,900,516,066
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	10,413,520,678
元本等合計	30,314,036,744
純資産合計	30,314,036,744
負債純資産合計	30,458,690,473

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2022年9月8日 至 2023年3月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2023年3月7日現在
1. 1 期首	2022年9月8日
期首元本額	18,186,563,538円
期中追加設定元本額	2,010,030,559円
期中一部解約元本額	296,078,031円
期末元本額の内訳	
ファンド名	

新興国債券インデックスファン ド(F0Fs用)(適格機関投 資家専用)	333,426,572円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス エマー ジングプラス(為替ヘッジな し)	322,147,183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 エマーシングプラス(為替 ヘッジなし)	315,263,366円
D-I's 新興国債券イン デックス	58,911,657円
iFree 新興国債券イン デックス	6,027,987,658円
iFree 8資産バランス ダイワ新興国債券インデック ス(為替ヘッジなし)(投資 一任専用)	4,122,768,548円 1,919,355円
DCダイワ新興国債券イン デックスファンド	8,540,792,721円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券	140,450,834円
ダイワ・ノーロード 新興国 債券ファンド	36,848,172円
計	19,900,516,066円
2. 期末日における受益権の総数	19,900,516,066口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年3月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	2023年3月7日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	113,286,871	-	113,699,570	412,699
タイ・パーツ	25,145,600	-	25,214,080	68,480
チェコ・コロナ	22,030,888	-	22,123,861	92,973
トルコ・リラ	47,120,101	-	47,206,782	86,681
ルーマニア ・レイ	18,990,282	-	19,154,847	164,565
合計	113,286,871	-	113,699,570	412,699

（注） 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

（1口当たり情報）

	2023年3月7日現在
1口当たり純資産額	1.5233円
（1万口当たり純資産額）	（15,233円）

「ダイワ」-REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年3月7日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		4,510,356,913
投資証券	2	459,049,938,720
未収入金		14,728,476
未収配当金		6,455,070,575
流動資産合計		470,030,094,684
資産合計		470,030,094,684
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		41,496,000
前受金		9,520,000
未払金		503,930,298
未払解約金		262,259,000
流動負債合計		817,205,298
負債合計		817,205,298
純資産の部		
元本等		
元本	1	147,624,769,326
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		321,588,120,060
元本等合計		469,212,889,386
純資産合計		469,212,889,386

負債純資産合計	470,030,094,684
---------	-----------------

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2023年3月7日現在
1. 1 期首	2022年9月8日
期首元本額	145,851,213,788円
期中追加設定元本額	14,704,117,757円
期中一部解約元本額	12,930,562,219円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワJ - R E I Tオープン	4,473,704,391円

	ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	130,354,231,834円
	ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	369,090,180円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	15,893,751円
	iFree J-REITイ ンデックス	628,697,534円
	iFree 8資産バランス	1,947,814,883円
	DC・ダイワJ-REIT オープン	5,560,940,226円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	7,125,486円
	DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	6,706,231円
	ダイワ国内REITインデッ クス(投資一任専用)	1,142,539円
	ダイワ・ノーロード J-R EITファンド	102,346,603円
	ダイワファンドラップ J- REITインデックス	2,340,748,133円
	ダイワJ-REITインデッ クス(ダイワSMA専用)	387,552,114円
	ダイワファンドラップオンラ イン J-REITインデッ クス	503,883,547円
	ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	924,891,874円
	計	147,624,769,326円
2.	期末日における受益権の総数	147,624,769,326口
3.	2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 4,669,500,000円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2023年3月7日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。

2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
-----------------	--

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

種 類	2023年3月7日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買 建	10,196,480,000	-	10,155,600,000	40,880,000
合計	10,196,480,000	-	10,155,600,000	40,880,000

（注） 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

（1口当たり情報）

	2023年3月7日現在
1口当たり純資産額	3.1784円

(1万口当たり純資産額)

(31,784円)

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年3月7日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
預金		129,473,628
コール・ローン		647,500,522
投資信託受益証券		2,104,068,161
投資証券		26,934,038,843
派生商品評価勘定		12,870,600
未収入金		69,229,212
未収配当金		56,991,327
差入委託証拠金		195,367,580
流動資産合計		30,149,539,873
資産合計		30,149,539,873
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		12,159,186
未払金		58,434,726
未払解約金		5,212,000
流動負債合計		75,805,912
負債合計		75,805,912
純資産の部		
元本等		
元本	1	9,456,157,963
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		20,617,575,998
元本等合計		30,073,733,961
純資産合計		30,073,733,961
負債純資産合計		30,149,539,873

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2022年9月8日 至 2023年3月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2023年3月7日現在
1. 1 期首	2022年9月8日
期首元本額	8,693,888,748円
期中追加設定元本額	1,031,709,506円
期中一部解約元本額	269,440,291円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワバランスファンド	94,614,727円
2023-01(適格機関投資家専用)	
ダイワファンドラップ 外国	1,303,338,673円
REITインデックス(為替	
ヘッジなし)	
ダイワファンドラップオンラ	255,319,243円
イン 外国REITインデッ	
クス(為替ヘッジなし)	
D-I's グローバルREIT	1,869,964円
インデックス	
DCダイワ・ターゲットイ	13,844,382円
ヤー2050	
iFree 外国REITイ	762,522,259円
ンデックス	
iFree 8資産バランス	1,967,098,281円
グローバル・リート・イン	351,050,152円
デックスファンド(資産形成	
型)	
グローバル・リート・イン	201,959,327円
デックスファンド(毎月決算	
型)	
DCダイワ・グローバルRE	4,013,053,441円
ITインデックスファンド	
DCダイワ・ターゲットイ	7,170,142円
ヤー2030	
DCダイワ・ターゲットイ	6,800,949円
ヤー2040	
ダイワ海外REITインデッ	999,917円
クス(為替ヘッジなし)(投	
資一任専用)	

ダイワバランスファンド 2021-02（適格機関投資家専用）	145,688,609円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	253,260,696円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	73,633,275円
ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）	3,933,926円
計	9,456,157,963円
2. 期末日における受益権の総数	9,456,157,963口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 不動産投信関連

種 類	2023年3月7日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引				

不動産投信 指数先物取引				
買 建	1,048,658,514	-	1,048,272,809	385,705
合計	1,048,658,514	-	1,048,272,809	385,705

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

種 類	2023年3月7日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	653,564,990	-	654,662,109	1,097,119
アメリカ・ドル	470,680,082	-	470,115,681	564,401
ユーロ	182,884,908	-	184,546,428	1,661,520
合計	653,564,990	-	654,662,109	1,097,119

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2023年3月7日現在
1口当たり純資産額	3.1803円
(1万口当たり純資産額)	(31,803円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2023年3月31日

資産総額	50,842,489,279円
負債総額	24,949,100円
純資産総額（ - ）	50,817,540,179円
発行済数量	34,577,843,861口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.4697円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2023年3月31日

資産総額	224,043,291,720円
負債総額	7,334,855,540円
純資産総額（ - ）	216,708,436,180円
発行済数量	152,457,614,475口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.4214円

(参考) ダイワJ - R E I Tマザーファンド

純資産額計算書

2023年3月31日

資産総額	458,081,493,290円
負債総額	902,400,282円
純資産総額（ - ）	457,179,093,008円
発行済数量	146,728,925,877口
1単位当たり純資産額（ / ）	3.1158円

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）

純資産額計算書

2023年3月31日

資産総額	44,488,619,715円
負債総額	8,738,432円
純資産総額(-)	44,479,881,283円
発行済数量	35,592,094,680口
1単位当たり純資産額(/)	1.2497円

(参考) ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2023年3月31日

資産総額	27,034,904,819円
負債総額	1,464,340,624円
純資産総額(-)	25,570,564,195円
発行済数量	12,881,149,912口
1単位当たり純資産額(/)	1.9851円

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2023年3月31日

資産総額	315,716,122,470円
負債総額	68,881,652円
純資産総額(-)	315,647,240,818円
発行済数量	72,888,493,597口
1単位当たり純資産額(/)	4.3305円

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2023年3月31日

資産総額	28,545,191,098円
負債総額	97,279,965円
純資産総額(-)	28,447,911,133円

発行済数量	9,668,511,626口
1単位当たり純資産額(/)	2.9423円

(参考) ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2023年3月31日

資産総額	30,911,928,813円
負債総額	457,743円
純資産総額(-)	30,911,471,070円
発行済数量	20,128,854,507口
1単位当たり純資産額(/)	1.5357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

2023年3月31日

資産総額	245,360,879,085円
負債総額	68,398,129円
純資産総額(-)	245,292,480,956円
発行済数量	78,668,628,803口
1単位当たり純資産額(/)	3.1180円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典
ありません。

(3) 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認め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、）に支払います。

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2023年3月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間に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

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. 商品会議

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

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。

2023年3月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	95	342,454
追加型株式投資信託	779	21,519,615
株式投資信託 合計	874	21,862,069
単位型公社債投資信託	84	165,976
追加型公社債投資信託	14	1,365,455
公社債投資信託 合計	98	1,531,431
総合計	972	23,393,501

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	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	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					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	11,749	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)

	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。

剰余金の配当の総額	9,388百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,599円
基準日	2021年3月31日
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。

剰余金の配当の総額	12,737百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,883円
基準日	2022年3月31日
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係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

市場リスクの管理

() 為替変動リスクの管理

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

() 価格変動リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。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、コマースナル・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いません。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、記載していません。

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、記載していません。

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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(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		当事業年度	
	(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		(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		当事業年度	
	(2021年3月31日)		(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	(株)大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 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(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料(注2)	14,917	未払手数料	3,321
							不動産の賃借料(注4)	527	長期差入保証金	1,054
同一の親会社をもつ会社	株大和総研ビジネス・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(株)	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(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料(注2) 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	(株)大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守(注4)	1,065	未払費用	91

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

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いません。

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	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		
ソフトウェア		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 資本準備金	利益剰余金 利益準備金	利益剰余金		株主資本合計
				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ェアについては、社内における利用可能期間（5年間）に基づく定額法によっております。

3．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 収益及び費用の計上基準

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

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

(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いません。

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 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。

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

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

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

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

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

5【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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】

	名 称	資本金の額 (2022年03月末日現在)	事業の内容	備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	(注6)	
再信託受託会社	株式会社日本カスト ディ銀行	51,000百万円	(注6)	

販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	(注1)	
	岩井コスモ証券株式会社	13,500百万円	(注1)	
	S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	(注1)	
	株式会社 S B I 証券	48,323百万円	(注1)	
	auカブコム証券株式会社	7,196百万円	(注1)	
	岡三証券株式会社	5,000百万円	(注1)	
	O K B 証券株式会社	1,500百万円	(注1)	
	京銀証券株式会社	3,000百万円	(注1)	
	篠山証券株式会社	100百万円	(注1)	
	静岡東海証券株式会社	600百万円	(注1)	
	GMOクリック証券株式会社	4,346百万円	(注1)	
	立花証券株式会社	6,695百万円	(注1)	
	第四北越証券株式会社	600百万円	(注1)	
	東海東京証券株式会社	6,000百万円	(注1)	
	西日本シティTT証券株式会社	3,000百万円	(注1)	
	野村証券株式会社	10,000百万円	(注1)	
	播陽証券株式会社	112百万円	(注1)	
	百五証券株式会社	3,000百万円	(注1)	
	ほくほくTT証券株式会社	1,250百万円	(注1)	
	松井証券株式会社	11,945百万円	(注1)	
	マネックス証券株式会社	12,200百万円	(注1)	
	むさし証券株式会社	5,000百万円	(注1)	
	楽天証券株式会社	17,495百万円	(注1)	
	ワイエム証券株式会社	1,270百万円	(注1)	
	株式会社愛知銀行	18,000百万円	(注3)	
	株式会社イオン銀行	51,250百万円	(注3)	
	株式会社SBI新生銀行	512,204百万円	(注3)	
	株式会社大垣共立銀行	46,773百万円	(注3)	
	株式会社沖縄銀行	22,725百万円	(注3)	
	株式会社香川銀行	12,000百万円	(注3)	
	株式会社関西みらい銀行	38,971百万円	(注3)	
	株式会社北九州銀行	10,000百万円	(注3)	
	株式会社きらやか銀行	24,200百万円	(注3)	
株式会社高知銀行	19,544百万円	(注3)		
株式会社佐賀共栄銀行	2,679百万円	(注3)		
株式会社静岡銀行	90,845百万円	(注3)		
株式会社静岡中央銀行	2,000百万円	(注3)		
株式会社島根銀行	7,886百万円	(注3)		

株式会社清水銀行	10,816百万円	(注3)	
信金中央金庫	690,998百万円	(注4)	(*1)
スルガ銀行株式会社	30,043百万円	(注3)	
全国信用協同組合連合会	111,875百万円	(注5)	
株式会社但馬銀行	5,481百万円	(注3)	
株式会社大東銀行	14,743百万円	(注3)	
株式会社千葉銀行	145,069百万円	(注3)	
株式会社中京銀行	31,879百万円	(注3)	
株式会社筑波銀行	48,868百万円	(注3)	
株式会社東邦銀行	23,519百万円	(注3)	
株式会社徳島大正銀行	11,036百万円	(注3)	
株式会社鳥取銀行	9,061百万円	(注3)	
株式会社トマト銀行	17,810百万円	(注3)	
株式会社富山第一銀行	10,182百万円	(注3)	
株式会社長崎銀行	7,621百万円	(注3)	
株式会社長野銀行	13,017百万円	(注3)	
株式会社名古屋銀行	25,090百万円	(注3)	
株式会社西日本シティ銀行	85,745百万円	(注3)	
株式会社百五銀行	20,000百万円	(注3)	
株式会社福井銀行	17,965百万円	(注3)	
株式会社福島銀行	18,682百万円	(注3)	
PayPay銀行株式会社	37,250百万円	(注3)	
株式会社豊和銀行	12,495百万円	(注3)	
株式会社みちのく銀行	36,986百万円	(注3)	
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958百万円	(注3)	
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279百万円	(注6)	
株式会社武蔵野銀行	45,743百万円	(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。
- (*1) 出資金を記載しています。

2【関係業務の概要】

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

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

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

3【資本関係】

委託会社は、播陽証券株式会社の株式を6,500株所有しています。

委託会社は、むさし証券株式会社の株式を41,500株所有しています。

第3【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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

- ・ 委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。
 - ・ ファンドの形態等を記載することがあります。
 - ・ 図案を採用することがあります。
 - ・ ファンドの管理番号等を記載することがあります。
 - ・ 委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。
 - ・ UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。
 - ・ 「iFreeのポイント」を記載することがあります。
- (2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。
 - (3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。
 - (4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

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

2022年10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	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iFree 8資産バランスの2021年9月8日から2022年9月7日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、iFree 8資産バランスの2022年9月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうかを検討すること、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	公認会計士	間瀬 友未
業務執行社員		
指定有限責任社員	公認会計士	深井 康治
業務執行社員		

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年4月21日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	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
--------------------	-------	-------

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている i F r e e 8 資産バランスの2022年9月8日から2023年3月7日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、i F r e e 8 資産バランスの2023年3月7日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年9月8日から2023年3月7日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。