

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2024年2月13日提出
【計算期間】	第2計算期間 (自 2022年11月22日 至 2023年11月20日)
【ファンド名】	ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ラップ専用) 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)
【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】	佐竹 優子
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

「ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ラップ専用）」

当ファンドは、外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

「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）」

当ファンドは、外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

## 商品分類表

〈ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ラップ専用)〉

〈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)〉

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信	国内	株式 債券	インデックス型
追加型投信	海外	不動産投信 その他資産 ( )	特殊型
	内外	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 〈ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ラップ専用)〉

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (除く日本)			日経 225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年2回	日本			
	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり (フルヘッジ)	TOPIX
	年6回 (隔月)	欧州			
	年12回 (毎月)	アジア			
		オセアニア			
不動産投信 その他資産 (投資信託証券) (債券 公債)	年12回 (毎月)	中南米			
	日々	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (FTSE世界国債イン デックス(除く日本、 円ヘッジ・円ベース))
資産複合 ( )	その他 ( )	中近東 (中東)			
資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 属性区分表〈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)〉

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (除く日本)			
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年2回	日本			日経 225
不動産投信	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ( )	
その他資産 (投資信託証券) (債券 公債)	年6回 (隔月)	欧州			TOPIX
資産複合 ( )	年12回 (毎月)	アジア			
資産配分固定型 資産配分変更型	年12回 (毎月)	オセアニア			
	日々	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (FTSE世界国債イン デックス(除く日本、 ヘッジなし・円ベース))
	その他 ( )	アフリカ			
		中近東 (中東)			
		エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

## (注1) 商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行なわれないファンド
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
投資対象地域	国内	目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	海外	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	内外	目論見書等において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
投資対象資産	株式	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるもの
	債券	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるもの
	不動産投信（リート）	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるもの
	その他資産	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券、不動産投信（リート）以外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	資産複合	目論見書等において、株式、債券、不動産投信（リート）およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの

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

## (注2) 属性区分の定義

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

投資対象地域	グローバル	目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	日本	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	北米	目論見書等において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	欧州	目論見書等において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アジア	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	オセアニア	目論見書等において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中南米	目論見書等において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アフリカ	目論見書等において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中近東(中東)	目論見書等において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	エマージング	目論見書等において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるもの
投資形態	ファミリーファンド	目論見書等において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。)を投資対象として投資するもの
	ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズ
為替ヘッジ	あり	目論見書等において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるもの
	なし	目論見書等において、為替のヘッジを行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、各ファンドについて5,000億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 >

## 1 当ファンドは、投資者と販売会社が締結する投資一任契約に基づいて、資産を管理する口座の資金を運用するためのファンドです。

- ・当ファンドの購入の申込みを行なう投資者は、販売会社と投資一任契約の資産を管理する口座に関する契約および投資一任契約を締結する必要があります。

## 2 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の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

- 以下の2つのファンドがあります。

### ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ラップ専用)

- ◆FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
- ◆FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)の動きに連動させるため、外貨建資産については為替ヘッジを行ないます。

### 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)

- ◆FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
- ◆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。

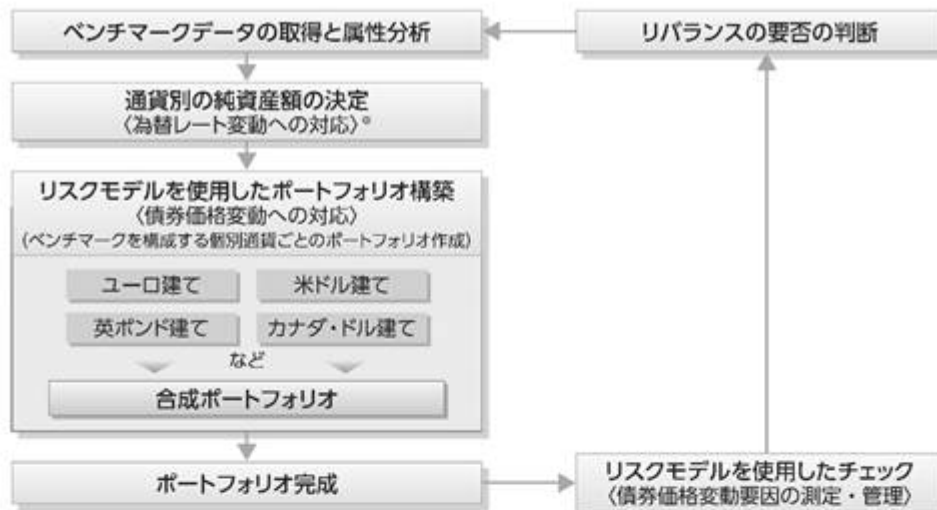
- 各ファンドの略称としてそれぞれ次を用いることがあります。

ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ラップ専用)：為替ヘッジあり

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)：為替ヘッジなし

- 上記の総称を「ダイワ先進国債券インデックス」とします。

## 運用プロセス



※ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ラップ専用）については、為替ヘッジを行なうため為替レート変動への対応を行いません。

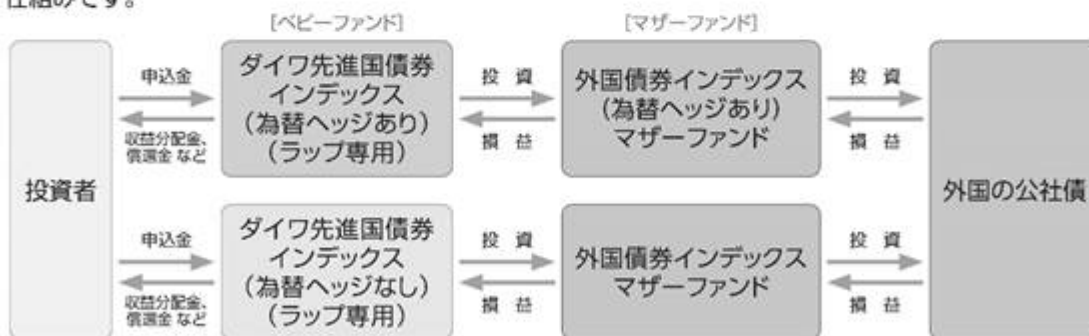
## ●FTSE世界国債インデックスについて

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

## ファンドの仕組み

## ●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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



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

・当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色2.の運用が行なわれないことがあります。

## 分配方針

毎年11月20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。

（注）第1計算期間は、2022年11月20日（休業日の場合翌営業日）までとします。

〔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

（為替ヘッジあり）

- マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使等により取得したものに限り、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

（為替ヘッジなし）

- マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使等により取得したものに限り、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- 投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

### ●基準価額の動きに関する留意点

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

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



## (2) 【ファンドの沿革】

2021年11月19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	<p>販売会社</p> <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、次の業務を行います。</p> <p>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</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	<p>大和アセットマネジメント株式会社</p> <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、次の業務を行います。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 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	<p>三井住友信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行</p> <p>信託契約（ 2）の受託者であり、次の業務を行います。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに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 信託財産の計算</p> <p style="text-align: right;">など</p>
	損益 投資
投資対象	<p>外国の公社債 など</p> <p>（ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）</p>

（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11月末日現在） >

・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

#### ・ 沿革

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

#### ・ 大株主の状況

名 称	住 所	所有 株式数	比率
株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】

< 為替ヘッジあり >

主要投資対象

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

投資態度

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

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

ハ．マザーファンドにおいて、投資成果をFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)の動きに連動させるため、外貨建資産については為替ヘッジを行ないません。

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。

#### <為替ヘッジなし>

##### 主要投資対象

外国債券インデックスマザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券を主要投資対象とします。

##### 投資態度

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないません。

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

## (2)【投資対象】

#### <各ファンド共通>

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)、および 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、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各マザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができます。

1. 転換社債の転換、新株予約権(新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下、会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。))の新株予約権に限ります。)の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。)
6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. コマーシャル・ペーパー
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前.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、新投資口予約権証券、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. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
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. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前15.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書ならびに前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および外国投資証券で投資法人債券に類する証券ならびに前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(新投資口予約権証券、投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を除きます。)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

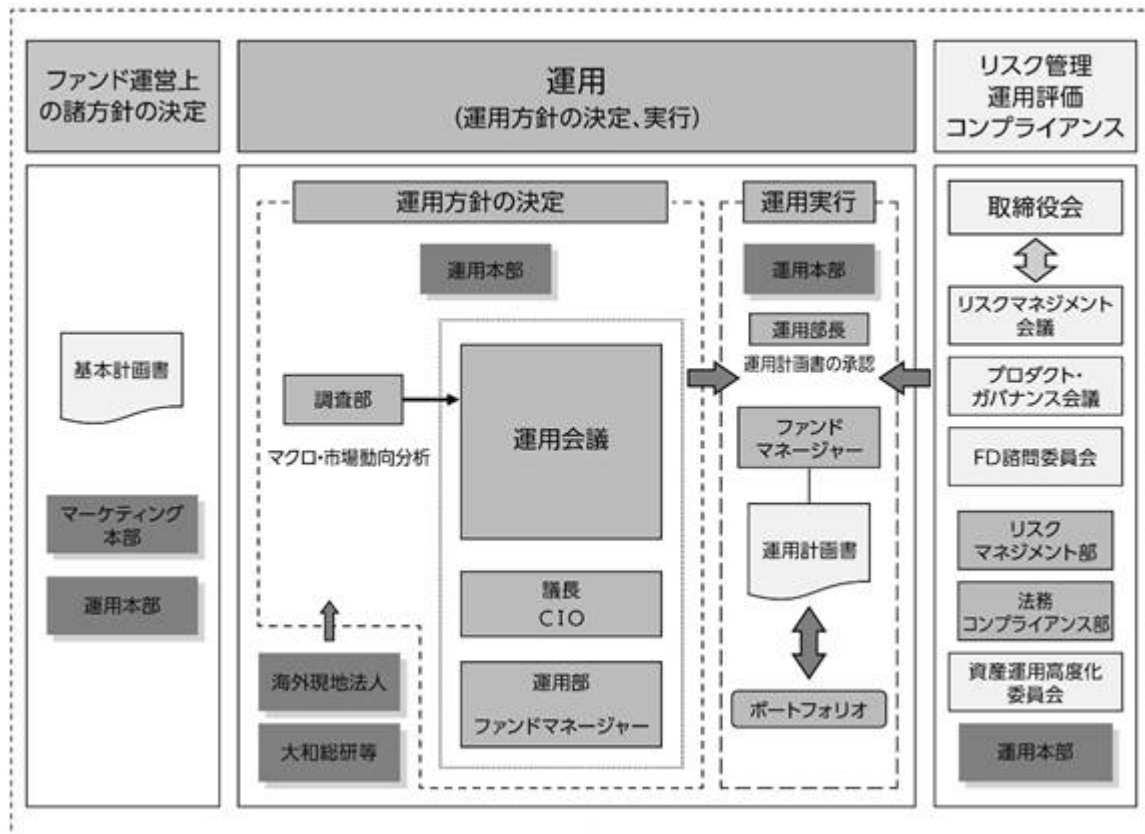
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

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

### (3) 【運用体制】

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、プロダクト・ガバナンス会議、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会

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

イ．リスクマネジメント会議

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

ロ．プロダクト・ガバナンス会議

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

ハ．FD諮問委員会

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

ニ．資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

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11月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

<各ファンド共通>

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】

マザーファンドの受益証券（信託約款）

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

株式（信託約款）

##### <為替ヘッジあり>

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

ロ．委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

ハ．前ロ．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める株式の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

##### <為替ヘッジなし>

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

ロ．委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の30を超えることとなる投資の指図をしません。

ハ．前ロ．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める株式の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

投資信託証券（信託約款）

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

ロ．前イ．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

投資する株式の範囲（信託約款）

イ．委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するも

のとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

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

#### 信用取引(信託約款)

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行なうことの指図をすることができるものとします。

ロ．前イ．の信用取引の指図は、次の1.から5.までに掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の1.から5.までに掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使により取得可能な株券

#### 先物取引等(信託約款)

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

ロ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引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通貨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。

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(信託約款)

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

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

ハ．スワップ取引の評価は、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。

ニ．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（信託約款）

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引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。
- ニ．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。

#### デリバティブ取引等（信託約款）

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

#### 有価証券の貸付け（信託約款）

- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および投資信託証券を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
  3. 投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
- ロ．前イ．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ハ．委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

#### 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）

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

ハ．前口．においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

#### 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。

<為替ヘッジあり>

<参 考> マザーファンド（外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド）の概要

#### (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、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

ロ．運用の効率化を図るため、債券先物取引を利用することがあります。このため、債券の組入総額および債券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。

ハ．投資成果をFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)の動きに連動させるため、外貨建資産については為替ヘッジを行いません。

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。)

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。 )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、新投資口予約権証券、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。 )
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. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。 )
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. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって第15号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書ならびに前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(新投資口予約権証券および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(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、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、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、委託者は、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、

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、

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、

#### 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、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.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。)の時価総額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、委託者は、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、

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、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、委託者は、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、

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、

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、

<為替ヘッジなし>

<参 考> マザーファンド(外国債券インデックスマザーファンド)の概要

#### (1) 投資方針

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

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

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。

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。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

## 3【投資リスク】

### (1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

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。

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。

「為替ヘッジあり」において、保有実質外貨建資産については、為替変動リスクの低減のために、為替ヘッジを行いません。ただし、影響をすべて排除できるわけではありません。為替ヘッジを行なう際、日本円の金利が組入資産の通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

「為替ヘッジなし」において、保有実質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原則として行いません。そのため基準価額は、為替レートの変動の影響を直接受けます。

## ロ．カントリー・リスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落したり、方針に沿った運用が困難となる場合があります。

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、ご換金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。

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

## 流動性リスクに関する事項

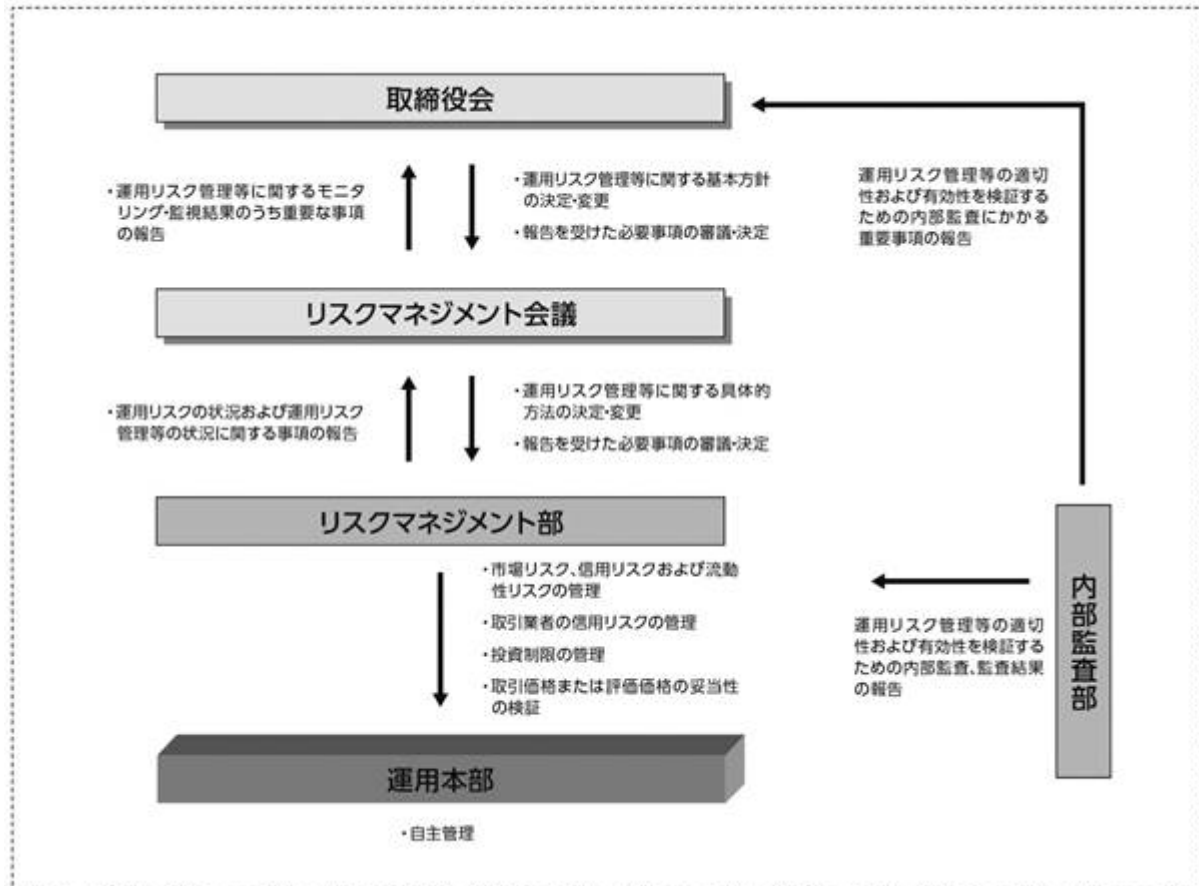


- 当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

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、換金の申込みの受け付けが中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

#### (4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



#### 流動性リスクに対する管理体制

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

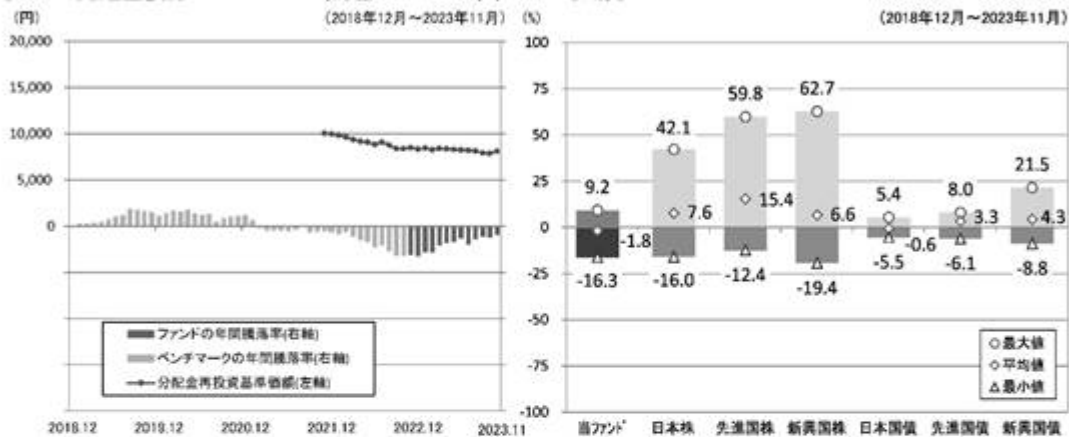
## 参考情報

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

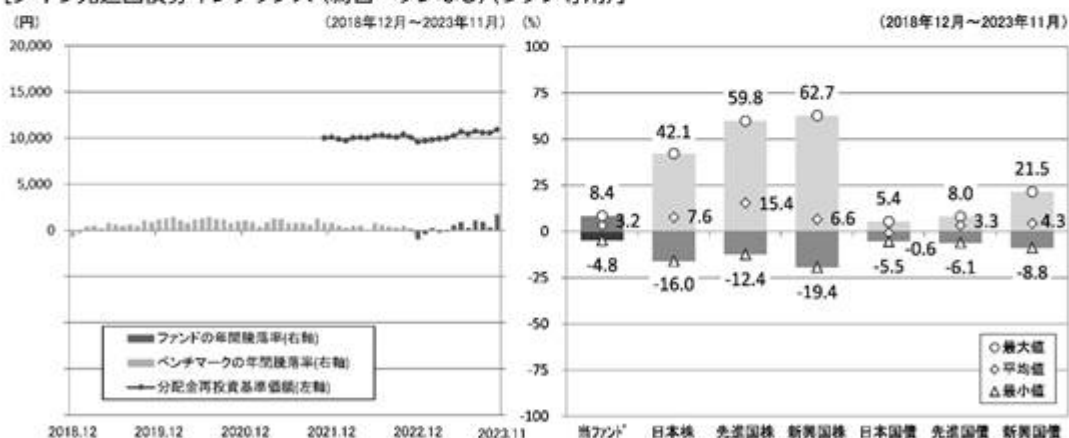
### ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

### 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

#### [ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ラップ専用）]



#### [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）]



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

## ※資産クラスについて

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

## ※指数について

●配当込みTOPIXの指数値および同指数にかかる標準または商標は、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・インデックスーエマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

## (2)【換金（解約）手数料】

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0.066%（税抜0.06%）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、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.03%（税抜）	年率0.01%（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。

#### <マザーファンドより支弁する手数料等>

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

#### (5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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。

#### 八. 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)」について

少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISAの適用対象となります。

当ファンドは、NISAの対象ではありません。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

#### 法人の投資者に対する課税

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

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

#### <注1> 個別元本について

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わせ下さい。

#### <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11月末日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- ( ) 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

## 【ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ラップ専用）】

## (1)【投資状況】（2023年11月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	11,286,871	99.81
内 日本	11,286,871	99.81
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	21,825	0.19
純資産総額	11,308,696	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11月30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	外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	13,366,736	0.8376 11,195,978	0.8444 11,286,871	99.81

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.81%
合計	99.81%

(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 (2022年11月21日)	3,302,643	3,302,643	0.8452	0.8452
2022年11月末日	3,321,296	-	0.8500	-
12月末日	3,262,750	-	0.8344	-
2023年1月末日	3,403,737	-	0.8471	-
2月末日	3,339,520	-	0.8269	-
3月末日	3,411,570	-	0.8413	-
4月末日	4,879,410	-	0.8377	-
5月末日	6,018,115	-	0.8306	-
6月末日	5,991,841	-	0.8248	-
7月末日	7,670,023	-	0.8206	-
8月末日	7,713,277	-	0.8141	-
9月末日	9,697,791	-	0.7920	-
10月末日	9,754,015	-	0.7876	-
第2計算期間末 (2023年11月20日)	11,218,023	11,218,023	0.8034	0.8034
11月末日	11,308,696	-	0.8099	-

## 【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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	15.5
第2計算期間	4.9

## (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	3,907,307	1,000,000
第2計算期間	10,056,120	0

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド

(1) 投資状況(2023年11月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	124,881,940,330	96.20
内 ユーロ	41,884,161,106	32.26
内 中国	9,347,991,752	7.20
内 シンガポール	571,961,797	0.44
内 マレーシア	682,249,126	0.53
内 イスラエル	387,692,944	0.30
内 ノルウェー	189,188,145	0.15
内 スウェーデン	284,631,291	0.22
内 デンマーク	432,578,219	0.33
内 イギリス	6,149,899,263	4.74
内 ポーランド	619,814,501	0.48
内 カナダ	2,549,871,963	1.96
内 アメリカ	58,609,623,332	45.15
内 メキシコ	1,041,732,253	0.80
内 オーストラリア	1,906,260,408	1.47
内 ニュージーランド	224,284,230	0.17
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,933,753,774	3.80
純資産総額	129,815,694,104	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(%)
債券先物取引(買建)	1,985,818,186	1.53
内 ドイツ	146,935,338	0.11
内 アメリカ	1,838,882,848	1.42
為替予約取引(売建)	124,792,001,090	96.13
内 日本	124,792,001,090	96.13

(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) 債券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11月30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	15,800,000	96.21 2,235,776,964	97.10 2,256,388,237	2.500000 2025/01/31	1.74
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	15,300,000	95.24 2,143,107,863	96.11 2,162,706,853	2.125000 2025/05/15	1.67
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	15,500,000	92.95 2,119,033,828	92.33 2,104,786,422	2.625000 2029/02/15	1.62
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	14,000,000	92.86 1,912,030,597	92.93 1,913,430,703	2.250000 2027/08/15	1.47
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	12,850,000	92.85 1,754,819,753	93.41 1,765,346,214	2.000000 2026/11/15	1.36
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	12,000,000	93.00 1,641,301,200	93.88 1,656,937,682	1.625000 2026/02/15	1.28
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,810,000	96.17 1,529,015,828	97.25 1,546,170,058	2.250000 2024/11/15	1.19
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,950,000	108.10 1,422,908,059	106.52 1,402,189,867	6.125000 2027/11/15	1.08
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,800,000	94.82 1,227,175,611	95.51 1,236,222,181	2.250000 2025/11/15	0.95
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	99.88 1,175,254,653	100.57 1,183,266,392	5.000000 2025/10/31	0.91
11	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	89.37 1,051,585,796	90.49 1,064,763,268	0.625000 2026/07/31	0.82
12	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	99.22 1,021,527,539	98.94 1,018,608,290	4.000000 2028/06/30	0.78
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	93.14 958,949,345	93.78 965,548,376	1.875000 2026/06/30	0.74
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,865,000	92.52 934,185,485	93.37 942,747,194	1.625000 2026/05/15	0.73

15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,000,000	90.94 802,481,572	91.60 808,305,544	1.500000 2027/01/31	0.62
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,300,000	86.08 797,566,492	86.57 802,106,543	0.750000 2028/01/31	0.62
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,750,000	91.75 775,945,364	92.54 782,617,562	1.500000 2026/08/15	0.60
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	95.53 772,752,107	96.46 780,282,826	2.000000 2025/02/15	0.60
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,550,000	93.53 763,501,330	93.70 764,880,773	2.375000 2027/05/15	0.59
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,300,000	79.80 739,379,718	78.86 730,716,559	0.625000 2030/08/15	0.56
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	87.80 710,249,563	88.07 712,433,552	1.250000 2028/03/31	0.55
22	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	5,300,000	92.74 722,912,584	90.04 701,843,483	2.875000 2032/05/15	0.54
23	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,500,000	94.31 685,483,972	95.33 692,919,085	1.300000 2026/10/31	0.53
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,400,000	87.96 698,622,503	87.17 692,324,671	1.750000 2029/11/15	0.53
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,000,000	93.37 686,633,062	93.75 689,390,625	2.250000 2027/02/15	0.53
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,820,000	94.65 670,966,636	95.49 676,963,739	2.000000 2025/08/15	0.52
27	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,270,000	121.63 642,400,291	121.17 639,965,576	4.750000 2034/07/04	0.49
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,000,000	87.44 643,056,221	86.94 639,379,471	1.625000 2029/08/15	0.49
29	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,500,000	94.15 623,131,086	93.03 615,693,112	3.375000 2033/05/15	0.47
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,300,000	95.60 604,619,624	94.90 600,161,197	3.125000 2028/11/15	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。

#### □ . 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	96.20%
合計	96.20%

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

## 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
債券先物取引	アメリカ	US LONG BOND MAR 24	買建	2	33,760,386	34,543,066	0.03%
		US 10YR NOTE MAR 24	買建	10	159,851,339	162,236,594	0.12%
		US 5YR NOTE MAR 24	買建	15	233,813,791	236,495,465	0.18%
		US 2YR NOTE MAR 24	買建	40	1,197,673,605	1,204,549,245	0.93%
		US ULTRA T-BOND MAR 24	買建	11	194,921,111	201,058,478	0.15%
	ドイツ	EURO-SCHATZ DEC 23	買建	5	85,089,444	85,123,846	0.07%
		EURO-OAT DEC 23	買建	3	61,081,015	61,811,492	0.05%
為替予約取引	日本	イスラエル・シケル 売/円買 2023年12月	売建	11,775,000	438,559,875	469,549,320	0.36%
		オフショア人民元売/円 買 2023年12月	売建	476,493,000	9,797,077,274	9,810,085,533	7.56%
		ノルウェー・クローネ 売/円買 2023年12月	売建	14,814,000	199,923,818	204,397,646	0.16%
		ニュージーランド・ドル 売/円買 2023年12月	売建	2,964,000	259,708,644	268,583,452	0.21%
		シンガポール・ドル売/ 円買 2023年12月	売建	5,355,000	589,632,624	590,685,952	0.46%
		カナダ・ドル売/円買 2023年12月	売建	24,371,000	2,645,540,288	2,634,916,969	2.03%
		マレーシア・リングイト 売/円買 2023年12月	売建	21,280,000	673,724,800	669,977,392	0.52%
		米ドル売/円買 2023年12 月	売建	390,869,000	58,873,704,780	57,429,287,736	44.24%
		ポーランド・ズロチ売/ 円買 2023年12月	売建	18,011,000	643,352,920	668,777,247	0.52%
		メキシコ・ペソ売/円買 2023年12月	売建	127,900,000	1,061,096,770	1,085,973,320	0.84%

スウェーデン・クローネ 売/円買 2023年12月	売建	20,489,000	276,581,011	290,937,653	0.22%
デンマーク・クローネ 売/円買 2023年12月	売建	25,610,000	547,183,260	554,341,255	0.43%
英ポンド売/円買 2023年 12月	売建	34,853,000	6,371,602,401	6,505,950,259	5.01%
豪ドル売/円買 2023年12 月	売建	19,635,000	1,874,626,099	1,911,887,439	1.47%
ユーロ売/円買 2023年12 月	売建	258,353,000	41,189,606,319	41,696,649,917	32.12%

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

(注2) 債券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。

(参考情報) 運用実績

## ●ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ラップ専用)

2023年11月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	8,099円
純資産総額	11百万円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	2.8%
3カ月間	-0.5%
6カ月間	-2.5%
1年間	-4.7%
3年間	-
5年間	-
設定来	-19.0%



※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	直近1年間分配金合計額: 0円		設定来分配金合計額: 0円	
	第1期 22年11月	第2期 23年11月		
分配金	0円	0円		

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成		通貨別構成		債券ポートフォリオ特性値		組入上位10銘柄	
銘柄数	比率	銘柄数	比率	直接利回り(%)	最終利回り(%)	銘柄	償還日
外国債券・先物	649 97.5%	日本円	97.3%	2.7	3.9	United States Treasury Note/Bond	2025/01/31
		米ドル	1.7%	2.7	3.9	United States Treasury Note/Bond	2025/05/15
コール・ローン、その他	4.0%	ユーロ	0.8%	修正デュレーション	6.5	United States Treasury Note/Bond	2029/02/15
合計	649 -	英ポンド	0.1%	残存年数	8.4	United States Treasury Note/Bond	2027/08/15
		カナダ・ドル	0.1%	格付別構成		United States Treasury Note/Bond	2026/11/15
債券種別構成	比率	豪ドル	0.0%	AAA	75.5%	United States Treasury Note/Bond	2026/02/15
国債	96.0%	マレーシア・リンギット	0.0%	AA	15.4%	United States Treasury Note/Bond	2024/11/15
		イスラエル・シェケル	0.0%	A	9.1%	United States Treasury Note/Bond	2027/11/15
		シンガポール・ドル	0.0%	BBB	-	United States Treasury Note/Bond	2025/11/15
		その他	0.0%	BB	-	US 2YR NOTE MAR 24	-
合計	96.0%	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	13.3%

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

※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

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



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。

・2021年※は設定日(11月19日)から年末、2023年は11月30日までの騰落率を表しています。

・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 【ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ラップ専用)】

## (1) 【投資状況】 (2023年11月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	3,752,650,884	99.80
内 日本	3,752,650,884	99.80
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	7,519,454	0.20
純資産総額	3,760,170,338	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11月30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	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	1,093,939,740	3.4460 3,769,800,351	3.4304 3,752,650,884	99.80

(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	99.80%
合計	99.80%

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

#### ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【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 (2022年11月21日)	469,325,354	469,325,354	1.0092	1.0092
2022年11月末日	505,806,414	-	1.0064	-
12月末日	631,383,408	-	0.9572	-
2023年1月末日	751,618,819	-	0.9684	-
2月末日	844,833,389	-	0.9801	-
3月末日	934,353,250	-	0.9923	-
4月末日	1,115,286,650	-	0.9995	-
5月末日	1,414,970,256	-	1.0253	-
6月末日	1,910,260,352	-	1.0662	-
7月末日	2,259,893,076	-	1.0432	-
8月末日	2,753,235,039	-	1.0715	-
9月末日	3,019,874,802	-	1.0556	-
10月末日	3,317,201,927	-	1.0542	-
第2計算期間末 (2023年11月20日)	3,643,417,785	3,643,417,785	1.0962	1.0962
11月末日	3,760,170,338	-	1.0910	-

## 【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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.9
第2計算期間	8.6

## (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	468,244,226	4,188,788
第2計算期間	2,940,386,492	81,824,774

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。



## （参考）マザーファンド

## 外国債券インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況（2023年11月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	274,718,308,956	96.96
内 ユーロ	91,801,136,408	32.40
内 中国	18,643,275,169	6.58
内 シンガポール	1,104,228,727	0.39
内 マレーシア	1,338,933,437	0.47
内 イスラエル	809,921,956	0.29
内 ノルウェー	470,635,236	0.17
内 スウェーデン	541,938,072	0.19
内 デンマーク	864,665,581	0.31
内 イギリス	13,765,099,582	4.86
内 ポーランド	1,199,821,622	0.42
内 カナダ	5,034,152,450	1.78
内 アメリカ	132,119,911,225	46.63
内 メキシコ	2,353,161,590	0.83
内 オーストラリア	4,059,779,390	1.43
内 ニュージーランド	611,648,511	0.22
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	8,616,985,194	3.04
純資産総額	283,335,294,150	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）	1,995,802,213	0.70
内 日本	1,995,802,213	0.70

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

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

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

## (2) 投資資産（2023年11月30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	9,700,000	102.59 1,463,669,702	98.77 1,409,074,875	4.125000 2032/11/15	0.50
2	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,400,000	85.43 1,306,721,656	83.48 1,276,941,746	1.875000 2032/02/15	0.45
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	82.21 1,293,759,788	81.06 1,275,725,771	1.125000 2031/02/15	0.45
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	92.61 1,293,954,950	88.86 1,241,618,620	2.750000 2032/08/15	0.44
5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,300,000	92.98 1,271,789,589	90.04 1,231,536,677	2.875000 2032/05/15	0.43
6	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	81.65 1,236,942,235	80.39 1,217,794,898	1.250000 2031/08/15	0.43
7	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	81.92 1,204,927,091	80.62 1,185,722,461	1.375000 2031/11/15	0.42
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	80.69 1,163,103,389	79.93 1,152,034,312	0.875000 2030/11/15	0.41
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	98.67 1,161,011,747	94.06 1,106,695,867	3.500000 2033/02/15	0.39
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,800,000	96.09 1,102,338,412	93.03 1,067,201,395	3.375000 2033/05/15	0.38
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,700,000	84.81 1,085,177,173	83.35 1,066,483,546	1.625000 2031/05/15	0.38
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	91.87 1,044,380,928	93.37 1,061,397,388	1.625000 2026/05/15	0.37
13	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	93.82 965,875,459	96.81 996,669,858	3.875000 2033/08/15	0.35
14	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,899,000	102.76 979,119,540	100.18 954,500,545	2.750000 2027/10/25	0.34
15	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	89.29 919,293,390	91.11 938,019,813	1.125000 2026/10/31	0.33
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	79.30 933,012,080	78.86 927,894,044	0.625000 2030/08/15	0.33
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	94.46 930,779,557	94.06 926,838,081	2.875000 2028/08/15	0.33
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	94.65 904,830,526	94.30 901,484,684	2.875000 2028/05/15	0.32

19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	92.84 901,191,720	92.33 896,231,637	2.625000 2029/02/15	0.32
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	85.09 876,044,515	86.57 891,229,493	0.750000 2028/01/31	0.31
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	90.33 863,561,949	93.09 889,908,069	0.250000 2025/06/30	0.31
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,400,000	93.27 877,930,247	93.70 882,024,675	2.375000 2027/05/15	0.31
23	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	99.57 878,628,351	99.80 880,655,160	4.375000 2026/08/15	0.31
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,350,000	94.24 880,120,854	94.06 878,495,878	2.750000 2028/02/15	0.31
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	90.21 862,443,481	91.60 875,664,339	1.500000 2027/01/31	0.31
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,921,000	95.78 834,132,020	97.25 846,889,261	2.250000 2024/11/15	0.30
27	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	40,000,000	99.92 823,438,776	99.73 821,832,357	2.670000 2033/05/25	0.29
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	94.50 811,649,916	95.51 820,401,992	2.250000 2025/11/15	0.29
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	94.82 807,180,917	96.11 818,153,416	2.125000 2025/05/15	0.29
30	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	93.37 823,924,378	92.53 816,564,995	2.750000 2029/05/31	0.29

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	96.96%
合計	96.96%

(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	豪ドル買/円売 2023年12月	買建	79,000	7,724,319	7,697,515	0.00%
		英ポンド買/円売 2023年12月	買建	262,000	49,001,213	48,927,699	0.02%
		ユーロ買/円売 2023年12月	買建	2,113,000	342,932,188	341,128,996	0.12%
		カナダ・ドル買/円売 2023年12月	買建	266,000	28,848,147	28,769,881	0.01%
		イスラエル・シケル買/円売 2023年12月	買建	557,000	20,745,465	22,211,377	0.01%
		オフショア人民元買/円売 2023年12月	買建	50,589,000	1,040,150,311	1,041,531,390	0.37%
		シンガポール・ドル買/円売 2023年12月	買建	147,000	16,185,993	16,214,908	0.01%
		米ドル買/円売 2023年12月	買建	3,329,000	493,745,664	489,320,447	0.17%

(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

## ●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)

2023年11月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	10,910円
純資産総額	37億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	3.5%
3カ月間	1.8%
6カ月間	6.4%
1年間	8.4%
3年間	-
5年間	-
設定来	9.1%



※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	
	22年11月	23年11月								
分配金	0円	0円								

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	償還日	比率
外国債券	974	96.8%	米ドル	47.5%	直接利回り(%)	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2032/11/15	0.5%
			ユーロ	33.1%	最終利回り(%)	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2032/02/15	0.4%
コール・ローン、その他		3.2%	オフショア人民元	7.1%	修正デュレーション	United States Treasury Note/Bond	2031/02/15	0.4%
合計	974	100.0%	英ポンド	5.1%	残存年数	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2032/08/15	0.4%
債券種別構成			カナダ・ドル	2.0%	格付別構成	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2032/05/15	0.4%
国債		96.8%	豪ドル	1.5%	AAA	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2031/08/15	0.4%
			メキシコ・ペソ	0.9%	AA	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2031/11/15	0.4%
			マレーシア・リンギット	0.5%	A	United States Treasury Note/Bond	2030/11/15	0.4%
			ポーランド・ズロチ	0.5%	BBB	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2033/02/15	0.4%
			その他	1.9%	BB	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2033/05/15	0.4%
合計		96.8%	合計	100.0%	合計	合計		4.3%

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

## 年間収益率の推移

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



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。

・2021年※は設定日(11月19日)から年末、2023年は11月30日までの騰落率を表しています。

・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

(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
ダイワ先進国債券インデックス (為替ヘッジあり)(ラップ専用)	0.08%	0.07%	0.02%
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)	0.09%	0.07%	0.02%

※対象期間は2022年11月22日～2023年11月20日です。

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

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。

<為替ヘッジあり>

ただし、販売会社は、次のイ・およびロ・に掲げる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。

イ．ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行またはシカゴ商品取引所における米国債先物取引の休業日と同じ日付の日

ロ．前イ．のほか、一部解約金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託会社が定める日

<為替ヘッジなし>

ただし、販売会社は、次のイ・およびロ・に掲げる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。

イ．ニューヨーク証券取引所の休業日と同じ日付の日

ロ．前イ．のほか、一部解約金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託会社が定める日

<各ファンド共通>

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（当初自己設定については1万口当たり1万円）です。

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

委託会社の各営業日の午後3時までには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。

#### <為替ヘッジあり>

ただし、販売会社は、次のイ・およびロ・に掲げる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。

イ．ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行またはシカゴ商品取引所における米国債先物取引の休業日と同じ日付の日

ロ．前イ．のほか、一部解約金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託会社が定める日

#### <為替ヘッジなし>

ただし、販売会社は、次のイ・およびロ・に掲げる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。

イ．ニューヨーク証券取引所の休業日と同じ日付の日

ロ．前イ．のほか、一部解約金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託会社が定める日

#### <各ファンド共通>

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） 0120-106338（営業日の9:00～17:00）

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約請求の受け付けを中止することができるほか、すでに受け付けた一部解約請求を取消することができるものとします。一部解約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請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約請求を受け付けたものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。



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

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

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

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

(注1)当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

(注2)マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・外国の公社債：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。
  1. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く。)
  2. 価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号(コールセンター)

0120-106338(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11月21日から翌年11月20日までとします。ただし、第1計算期間は、2021年11月19日から2022年11月20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ます。

2. 委託会社は、前1.の事項(前1.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1.の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。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っ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っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っ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っ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】

#### 【ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ラップ専用)】

(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2期計算期間(2022年11月22日から2023年11月20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】

ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ラップ専用)

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 2022年11月21日現在	第2期 2023年11月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	7,355	24,798
親投資信託受益証券	3,296,106	11,195,978
流動資産合計	3,303,461	11,220,776
資産合計	3,303,461	11,220,776
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	215	839
未払委託者報酬	416	1,655
その他未払費用	187	259
流動負債合計	818	2,753
負債合計	818	2,753
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 3,907,307	1 13,963,427
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2 604,664	2 2,745,404
元本等合計	3,302,643	11,218,023
純資産合計	3,302,643	11,218,023
負債純資産合計	3,303,461	11,220,776

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	2021年11月19日 至 2022年11月21日	自	2022年11月22日 至 2023年11月20日
営業収益				
有価証券売買等損益		265,908		326,062
営業収益合計		265,908		326,062
営業費用				
受託者報酬		215		1,237
委託者報酬		596		2,407
その他費用		367		440
営業費用合計		1,178		4,084
営業利益又は営業損失（ ）		267,086		330,146
経常利益又は経常損失（ ）		267,086		330,146
当期純利益又は当期純損失（ ）		267,086		330,146
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（ ）		51,711		-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		604,664
剰余金増加額又は欠損金減少額		77,089		-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		77,089		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		466,378		1,810,594
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		466,378		1,810,594
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		604,664		2,745,404

## (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2期	
	自2022年11月22日 至2023年11月20日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2022年11月20日が休日のため、前計算期間末日を2022年11月21日としております。このため、当計算期間は364日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区分	第1期	第2期
	2022年11月21日現在	2023年11月20日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円	3,907,307円
期中追加設定元本額	3,907,307円	10,056,120円
期中一部解約元本額	1,000,000円	- 円
2. 計算期間末日における受益権の総数	3,907,307口	13,963,427口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は604,664円でありま す。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,745,404円でありま す。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第1期	第2期
	自2021年11月19日 至2022年11月21日	自2022年11月22日 至2023年11月20日



1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（0円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は0円（1万口当たり0.00円）であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（0円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は0円（1万口当たり0.00円）であり、分配を行っておりません。
------------	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第2期 自2022年11月22日 至2023年11月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第2期 2023年11月20日現在
----	----------------------

1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載してあります。  (2)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1期 2022年11月21日現在	第2期 2023年11月20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	209,122	326,062
合計	209,122	326,062

## (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1期 2022年11月21日現在	第2期 2023年11月20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2期 自2022年11月22日 至2023年11月20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1期 2022年11月21日現在	第2期 2023年11月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8452円 (8,452円)	0.8034円 (8,034円)

## (4)【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	13,366,736	11,195,978	
親投資信託受益証券 合計			11,195,978	
合計			11,195,978	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

「外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2022年11月21日現在 金額 (円)	2023年11月20日現在 金額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,133,531,624	2,255,138,976

コール・ローン		7,767,835,496	708,504,072
国債証券		112,421,872,013	125,538,926,579
派生商品評価勘定		4,197,931,608	408,811,567
未収入金		308,641,607	780,311
未収利息		712,365,843	843,297,474
前払費用		34,689,992	50,729,668
差入委託証拠金		346,413,932	261,197,345
流動資産合計		126,923,282,115	130,067,385,992
資産合計		126,923,282,115	130,067,385,992
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		69,372,459	1,418,449,116
未払金		-	554,551
未払解約金		6,563,951,198	153,984,659
流動負債合計		6,633,323,657	1,572,988,326
負債合計		6,633,323,657	1,572,988,326
純資産の部			
元本等			
元本	1	136,580,451,522	153,399,280,199
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )	2	16,290,493,064	24,904,882,533
元本等合計		120,289,958,458	128,494,397,666
純資産合計		120,289,958,458	128,494,397,666
負債純資産合計		126,923,282,115	130,067,385,992

## 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11月22日 至2023年11月20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>
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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2022年11月21日現在	2023年11月20日現在
1. 1 期首	2021年11月19日	2022年11月22日
期首元本額	124,209,020,067円	136,580,451,522円
期中追加設定元本額	35,944,681,049円	35,271,292,742円
期中一部解約元本額	23,573,249,594円	18,452,464,065円

期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワバランスファンド2023-01 (適格機関投資家専用)	-円	2,303,831,989円
ダイワファンドラップ 外国債券 インデックス(為替ヘッジあ り)	110,929,426,327円	116,007,438,232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(為替 ヘッジあり)	4,275,965,566円	4,845,754,053円
ダイワ先進国債券インデックス (為替ヘッジあり)(ラップ専 用)	3,742,598円	13,366,736円
ダイワバランスファンド2021-02 (適格機関投資家専用)	3,372,552,461円	3,577,386,838円
ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジあり)(ダイワS MA専用)	17,998,764,570円	24,350,173,920円
ダイワバランスファンド2023-08 (適格機関投資家専用)	-円	2,301,328,431円
計	136,580,451,522円	153,399,280,199円
2. 期末日における受益権の総数	136,580,451,522口	153,399,280,199口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その 差額は16,290,493,064円であ ります。	貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その 差額は24,904,882,533円であ 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2022年11月22日 至2023年11月20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>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における債券先物取引を利用しております。また、信託財産の効率的な運用に資すること、および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	2023年11月20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	2022年11月21日現在	2023年11月20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	2,382,917,338	1,876,745,292
合計	2,382,917,338	1,876,745,292

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 債券関連

種類	2022年11月21日現在				2023年11月20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								
債券先物取引								
買建	1,977,533,850	-	1,908,205,167	69,328,683	2,023,934,117	-	1,999,090,053	24,844,064
合計	1,977,533,850	-	1,908,205,167	69,328,683	2,023,934,117	-	1,999,090,053	24,844,064

(注)

### 1. 時価の算定方法

債券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. 債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## 2. 通貨関連

種類	2022年11月21日現在				2023年11月20日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								



為替予約取引								
売建	117,705,624,269	-	113,507,736,437	4,197,887,832	125,435,707,123	-	126,420,500,608	984,793,485
アメリカ・ドル	58,853,170,169	-	55,690,668,360	3,162,501,809	58,873,704,780	-	58,464,895,151	408,809,629
イギリス・ポンド	5,618,230,378	-	5,477,072,020	141,158,358	6,371,602,401	-	6,490,907,705	119,305,304
イスラエル・シェケル	523,588,698	-	501,227,730	22,360,968	438,559,875	-	473,824,822	35,264,947
オーストラリア・ドル	2,055,441,161	-	2,023,273,520	32,167,641	1,874,626,099	-	1,912,017,030	37,390,931
オフショア・人民元	4,279,772,154	-	4,151,367,570	128,404,584	9,797,077,274	-	9,876,413,358	79,336,084
カナダ・ドル	2,449,642,075	-	2,361,000,490	88,641,585	2,645,540,288	-	2,656,553,543	11,013,255
シンガポール・ドル	429,402,747	-	418,095,700	11,307,047	589,632,624	-	596,315,128	6,682,504
スウェーデン・クローナ	340,765,632	-	334,101,370	6,664,262	276,581,011	-	291,312,602	14,731,591
デンマーク・クローネ	573,067,290	-	566,023,770	7,043,520	547,183,260	-	560,672,047	13,488,787
ニュージーランド・ドル	259,816,649	-	259,860,425	43,776	259,708,644	-	265,977,504	6,268,860
ノルウェー・クローネ	292,633,024	-	281,616,720	11,016,304	199,923,818	-	204,996,132	5,072,314
ポーランド・ズロチ	630,101,485	-	625,824,654	4,276,831	643,352,920	-	669,267,146	25,914,226
マレーシア・リンギット	720,844,248	-	712,037,424	8,806,824	667,511,040	-	680,640,800	13,129,760
メキシコ・ペソ	1,180,085,068	-	1,141,864,269	38,220,799	1,061,096,770	-	1,106,961,710	45,864,940
ユーロ	39,499,063,491	-	38,963,702,415	535,361,076	41,189,606,319	-	42,169,745,930	980,139,611
合計	117,705,624,269	-	113,507,736,437	4,197,887,832	125,435,707,123	-	126,420,500,608	984,793,485

## (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)

	2022年11月21日現在	2023年11月20日現在
1口当たり純資産額	0.8807円	0.8376円
(1万口当たり純資産額)	(8,807円)	(8,376円)

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	8,950,000.000	9,466,683.500	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,823,543.000	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	1,400,000.000	1,536,332.000	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	630,000.000	666,540.000	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	2,000,000.000	2,017,020.000	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	300,000.000	315,561.000	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	430,000.000	377,105.700	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,410,000.000	1,362,356.100	

4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,390,000.000	1,380,631.400	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	2,270,000.000	2,276,605.700	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	600,000.000	528,066.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	670,000.000	535,564.500	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	1,500,000.000	1,120,890.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,000,000.000	744,860.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,000,000.000	1,577,020.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,500,000.000	1,887,525.000	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	1,100,000.000	933,537.000	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	1,532,000.000	1,322,483.680	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	1,000,000.000	845,740.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	2,200,000.000	1,785,652.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	940,000.000	730,793.600	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	10,810,000.000	10,497,591.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,500,000.000	1,898,475.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,500,000.000	5,292,320.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	1,100,000.000	761,013.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	15,300,000.000	14,660,460.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	370,000.000	279,738.500	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	4,820,000.000	4,583,482.600	

2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	8,800,000.000	8,365,104.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	2,000,000.000	1,505,500.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	12,000,000.000	11,203,800.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	300,000.000	204,930.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	6,865,000.000	6,370,582.700	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	1,070,000.000	728,766.300	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,750,000.000	5,284,825.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	500,000.000	322,665.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	12,850,000.000	11,913,749.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	730,230.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	5,000,000.000	4,652,200.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	900,000.000	671,058.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	5,550,000.000	5,161,389.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	950,000.000	707,731.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	14,000,000.000	12,909,120.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	1,000,000.000	708,650.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	700,000.000	495,782.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	4,000,000.000	3,731,480.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	15,800,000.000	15,309,568.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	1,000,000.000	742,200.000	

2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,500,000.000	2,418,450.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	1,000,000.000	759,600.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	3,300,000.000	3,084,312.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	4,000,000.000	3,726,560.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	1,800,000.000	1,334,178.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	4,300,000.000	4,041,312.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	1,850,000.000	1,470,842.500	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	15,500,000.000	14,161,575.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	1,500,000.000	1,111,305.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	1,000,000.000	944,680.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	2,000,000.000	1,446,560.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	2,300,000.000	2,065,584.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	7,000,000.000	6,523,370.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	5,000,000.000	4,296,250.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	300,000.000	189,630.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,400,000.000	4,649,454.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	1,300,000.000	845,429.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	4,500,000.000	3,779,280.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,000,000.000	5,455,500.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	2,500,000.000	1,485,475.000	

0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	3,000,000.000	2,354,640.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	2,000,000.000	964,100.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,200,000.000	3,045,016.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	2,000,000.000	1,859,960.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	6,300,000.000	4,903,857.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	700,000.000	349,055.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	500,000.000	290,250.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,000,000.000	1,835,920.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	5,000,000.000	3,943,350.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	3,800,000.000	2,033,646.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	4,500,000.000	3,860,505.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	4,000,000.000	3,648,320.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	6,300,000.000	5,404,203.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	4,100,000.000	2,344,339.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	4,900,000.000	3,917,599.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,000,000.000	1,817,140.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	1,000,000.000	869,840.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	2,400,000.000	1,581,456.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	1,000,000.000	908,590.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	5,500,000.000	4,797,870.000	

1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	4,600,000.000	3,783,040.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	3,000,000.000	2,611,380.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	2,400,000.000	1,551,408.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,600,000.000	1,120,048.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	1,000,000.000	868,320.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	1,500,000.000	1,299,315.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	3,500,000.000	3,177,930.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	4,700,000.000	3,725,455.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	3,900,000.000	2,295,579.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	5,750,000.000	3,659,070.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	8,000,000.000	7,187,760.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	2,000,000.000	1,707,140.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	1,000,000.000	856,770.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	2,400,000.000	2,157,840.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	4,000,000.000	3,180,000.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	3,100,000.000	1,763,714.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	2,000,000.000	1,326,200.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	4,000,000.000	3,468,320.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	3,900,000.000	3,209,622.000	
2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	2,500,000.000	1,564,925.000	

2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	1,000,000.000	704,980.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	2,500,000.000	2,195,875.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250415	2,000,000.000	1,933,620.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	5,300,000.000	4,705,976.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	2,300,000.000	1,661,750.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,000,000.000	809,410.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	4,000,000.000	3,661,680.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	4,500,000.000	3,943,170.000	
3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	2,000,000.000	1,483,980.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	1,200,000.000	1,161,420.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	3,000,000.000	2,957,460.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	4,000,000.000	3,897,320.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	3,000,000.000	2,701,620.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	700,000.000	676,669.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	4,000,000.000	3,710,000.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	1,000,000.000	882,890.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	1,800,000.000	1,513,440.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	4,500,000.000	4,126,635.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	2,800,000.000	2,355,920.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630	7,000,000.000	6,865,810.000	



	3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815	2,000,000.000	1,909,060.000	
	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815	600,000.000	552,984.000	
	4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	1,700,000.000	1,652,383.000	
	5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251031	8,000,000.000	8,014,160.000	
アメリカ・ドル 小計			394,037,970.780 (59,085,993,719)	
イギリス・ポ ンド	2% United Kingdom Gilt 20250907	1,350,000.000	1,293,030.000	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	810,000.000	522,117.900	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,775,000.000	1,656,376.750	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	650,000.000	365,462.500	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	820,000.000	598,928.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	900,000.000	482,220.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	650,000.000	588,672.500	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	800,000.000	717,336.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	517,000.000	243,915.430	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	700,000.000	410,074.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20541022	350,000.000	183,578.500	
	0.875% United Kingdom Gilt 20291022	800,000.000	671,392.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,000,000.000	603,800.000	
	0.375% United Kingdom Gilt 20301022	400,000.000	313,920.000	
	0.5% United Kingdom Gilt 20611022	850,000.000	255,977.500	

0.125% United Kingdom Gilt 20280131	500,000.000	425,485.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	370,000.000	148,055.500	
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	950,000.000	634,467.000	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	1,700,000.000	1,280,440.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20460131	500,000.000	245,565.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20261022	1,000,000.000	896,350.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,200,000.000	586,200.000	
0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	2,000,000.000	1,673,640.000	
0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	500,000.000	371,165.000	
1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	200,000.000	102,260.000	
1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	1,500,000.000	1,184,355.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	400,000.000	148,808.000	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	1,100,000.000	1,096,590.000	
3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	400,000.000	374,184.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	700,000.000	608,160.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	963,000.000	1,049,487.030	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	400,000.000	406,972.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,275,000.000	1,280,865.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	915,000.000	913,353.000	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	550,000.000	570,174.000	

	4.25% United Kingdom Gilt 20551207	850,000.000	814,028.000	
	4.25% United Kingdom Gilt 20461207	770,000.000	736,158.500	
	4.25% United Kingdom Gilt 20271207	300,000.000	302,046.000	
	4.5% United Kingdom Gilt 20421207	911,000.000	908,886.480	
	4.75% United Kingdom Gilt 20301207	907,500.000	950,687.920	
	4.25% United Kingdom Gilt 20491207	543,000.000	518,087.160	
	4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,130,000.000	1,103,795.300	
	4.5% United Kingdom Gilt 20340907	600,000.000	615,420.000	
	4% United Kingdom Gilt 20600122	527,000.000	486,252.360	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,000,000.000	972,050.000	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	700,000.000	613,179.000	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	875,000.000	725,725.000	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	838,900.000	699,189.590	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	740,000.000	634,032.000	
	イギリス・ポンド 小計		32,982,913.920 (6,157,580,200)	
イスラエル・ シュケル	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,200,000.000	1,313,832.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	500,000.000	481,590.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	4,000,000.000	3,763,120.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	1,200,000.000	1,013,688.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,000,000.000	924,210.000	

	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	1,700,000.000	1,406,869.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,000,000.000	689,150.000	
イスラエル・シケル 小計			9,592,459.000 (386,849,483)	
オーストラリア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	889,000.000	907,651.220	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	320,000.000	305,737.600	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,800,000.000	1,775,610.000	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	359,000.000	360,389.330	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,398,000.000	2,406,656.780	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	725,000.000	663,889.750	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	800,000.000	673,392.000	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	684,000.000	575,818.560	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,300,000.000	1,235,936.000	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	658,000.000	608,044.640	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	775,000.000	578,088.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,250,000.000	1,172,112.500	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,100,000.000	1,891,155.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	510,000.000	388,926.000	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	1,800,000.000	1,470,816.000	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	850,000.000	660,926.000	
1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	900,000.000	481,536.000		

	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,800,000.000	1,443,312.000	
	3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,000,000.000	882,740.000	
	3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	1,000,000.000	939,730.000	
	オーストラリア・ドル 小計		19,422,467.380 (1,895,050,143)	
オフショア・人民元	3.22% China Government Bond 20251206	3,000,000.000	3,064,470.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	6,500,000.000	6,741,865.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	11,000,000.000	11,464,750.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	15,000,000.000	15,399,150.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	3,000,000.000	3,070,650.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	5,300,000.000	5,481,896.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	8,000,000.000	8,107,760.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	6,000,000.000	6,011,460.000	
	1.99% China Government Bond 20250409	12,000,000.000	11,937,960.000	
	3.02% China Government Bond 20251022	13,000,000.000	13,199,810.000	
	3.28% China Government Bond 20271203	14,000,000.000	14,501,060.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	6,000,000.000	6,284,220.000	
	3.81% China Government Bond 20500914	7,000,000.000	8,005,200.000	
	3.01% China Government Bond 20280513	8,000,000.000	8,189,920.000	
	3.72% China Government Bond 20510412	9,600,000.000	10,816,608.000	
	3.02% China Government Bond 20310527	8,800,000.000	9,052,912.000	

2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	5,000,000.000	5,042,500.000	
2.9% CHINA GOVERNMENT BOND 20260505	7,000,000.000	7,100,520.000	
2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	13,000,000.000	13,126,100.000	
3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	6,500,000.000	6,817,720.000	
3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	6,000,000.000	6,344,040.000	
4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	4,400,000.000	5,211,668.000	
3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	6,000,000.000	6,887,880.000	
3.77% CHINA GOVERNMENT BOND 20250308	5,000,000.000	5,117,900.000	
3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	4,800,000.000	5,108,400.000	
2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	3,500,000.000	3,563,630.000	
3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	3,300,000.000	3,622,080.000	
2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	5,300,000.000	5,386,443.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	1,800,000.000	1,809,630.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	4,000,000.000	4,051,160.000	
3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,000,000.000	5,281,650.000	
2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	9,000,000.000	9,067,140.000	
2.24% CHINA GOVERNMENT BOND 20250525	25,000,000.000	24,951,000.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	3,000,000.000	3,023,970.000	
2.5% CHINA GOVERNMENT BOND 20270725	12,000,000.000	12,018,360.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	7,000,000.000	7,011,830.000	

2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20250825	15,000,000.000	14,964,600.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	2,000,000.000	1,987,300.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	3,000,000.000	3,001,260.000	
2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	4,000,000.000	3,995,080.000	
3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	2,000,000.000	2,030,080.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	12,000,000.000	12,133,800.000	
2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20251125	14,000,000.000	13,975,920.000	
2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	13,000,000.000	13,120,770.000	
2.29% CHINA GOVERNMENT BOND 20241225	10,000,000.000	10,000,800.000	
2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	4,000,000.000	4,084,800.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	8,000,000.000	8,076,960.000	
3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	3,000,000.000	3,137,790.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	5,000,000.000	4,999,800.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	6,000,000.000	5,995,140.000	
2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	20,000,000.000	19,921,800.000	
2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	16,000,000.000	15,835,360.000	
2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	15,000,000.000	14,917,650.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	6,000,000.000	5,984,880.000	
2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	15,000,000.000	15,040,650.000	
オフショア・人民元 小計		455,077,752.000 (9,446,594,991)	

カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	460,000.000	387,504.000	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	907,000.000	997,509.530	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,050,000.000	1,220,835.000	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	300,000.000	340,281.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	620,000.000	648,563.400	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	140,000.000	138,140.800	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	500,000.000	435,010.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,492,000.000	1,441,078.040	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,920,000.000	1,797,388.800	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	930,000.000	841,854.600	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	600,000.000	556,134.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	1,520,000.000	1,110,390.400	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	300,000.000	278,319.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	1,700,000.000	1,456,441.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	900,000.000	839,160.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	1,500,000.000	1,201,875.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	2,000,000.000	1,709,320.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	1,250,000.000	847,362.500	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	1,500,000.000	1,372,800.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,000,000.000	847,250.000	



	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	500,000.000	437,760.000	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,000,000.000	907,770.000	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250201	2,000,000.000	1,975,820.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250801	1,500,000.000	1,473,825.000	
カナダ・ドル 小計			23,262,392.070 (2,541,416,333)	
シンガポール・ ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	203,000.000	205,699.900	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	600,000.000	596,280.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	239,000.000	232,090.510	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	420,000.000	434,603.400	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	500,000.000	498,150.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	400,000.000	393,320.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	300,000.000	288,300.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	200,000.000	194,800.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	660,000.000	609,840.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	350,000.000	280,000.000	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	400,000.000	363,600.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	170,000.000	137,205.300	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	1,000,000.000	947,500.000	
シンガポール・ドル 小計			5,181,389.110 (578,087,583)	
スウェーデン・ クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	2,520,000.000	2,743,801.200	

	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	3,820,000.000	3,773,434.200	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	4,780,000.000	4,527,138.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	2,550,000.000	2,344,215.000	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	500,000.000	485,165.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	3,000,000.000	2,693,550.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	4,000,000.000	3,332,160.000	
スウェーデン・クローナ 小計			19,899,463.400 (283,567,353)	
デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	5,740,000.000	6,844,089.000	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	2,830,000.000	2,764,485.500	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	3,200,000.000	2,942,976.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	1,700,000.000	1,499,077.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	2,400,000.000	1,172,880.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	2,000,000.000	1,614,500.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20241115	3,000,000.000	2,903,820.000	
デンマーク・クローネ 小計			19,741,827.500 (432,938,277)	
ニュージーランド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	1,000,000.000	992,880.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	300,000.000	269,094.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	300,000.000	232,935.000	
	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	500,000.000	459,260.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	500,000.000	396,760.000	

	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	200,000.000	131,150.000	
ニュージーランド・ドル 小計			2,482,079.000 (223,287,827)	
ノルウェー・ク ローネ	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	150,000.000	145,600.500	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	1,430,000.000	1,357,613.400	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,000,000.000	2,815,440.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	2,000,000.000	1,863,700.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	2,000,000.000	1,805,600.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	2,500,000.000	2,166,025.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	2,000,000.000	1,680,000.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	2,000,000.000	1,780,540.000	
ノルウェー・クローネ 小計			13,614,518.900 (188,833,377)	
ポーランド・ズ ロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	2,640,000.000	2,465,812.800	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	1,815,000.000	1,654,880.700	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	2,300,000.000	2,016,824.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	1,800,000.000	1,392,660.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	900,000.000	782,190.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,000,000.000	755,840.000	
	7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	2,000,000.000	2,178,840.000	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	1,000,000.000	1,039,690.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	600,000.000	611,862.000	

	2.75% Poland Government Bond 20280425	1,800,000.000	1,628,118.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	2,230,000.000	2,159,130.600	
ポーランド・ズロチ 小計			16,685,848.100 (621,791,455)	
マレーシア・リンギット	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,760,000.000	1,823,096.000	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,000,000.000	1,019,200.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	1,950,000.000	1,967,550.000	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,400,000.000	1,393,462.000	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,500,000.000	1,500,585.000	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	700,000.000	759,885.000	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,150,000.000	1,159,349.500	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	500,000.000	509,895.000	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	1,420,000.000	1,492,874.400	
	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	500,000.000	504,875.000	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,000,000.000	1,069,300.000	
	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	1,600,000.000	1,747,152.000	
	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	1,500,000.000	1,514,865.000	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,200,000.000	1,201,908.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,277,341.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,400,000.000	1,316,700.000	
4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	1,400,000.000	1,330,140.000		

マレーシア・リングット 小計			21,588,177.900 (691,160,627)	
メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	24,200,000.000	22,228,910.000	
	8% Mexican Bonos 20471107	11,450,000.000	9,818,260.500	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	10,000,000.000	8,525,900.000	
	10% Mexican Bonos 20241205	6,340,000.000	6,289,660.400	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	20,800,000.000	19,541,184.000	
	10% Mexican Bonos 20361120	2,750,000.000	2,869,020.000	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	6,500,000.000	6,274,775.000	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	5,000,000.000	4,593,450.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	22,700,000.000	20,734,407.000	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	14,050,000.000	11,863,539.000	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	10,300,000.000	9,149,593.000	
メキシコ・ペソ 小計			121,888,698.900 (1,060,967,990)	
ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	190,000.000	162,216.300	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	800,000.000	769,160.000	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	180,000.000	170,118.000	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	270,000.000	186,729.300	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	200,000.000	183,142.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	150,000.000	123,358.500	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	446,435.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	300,000.000	261,993.000	
	0.125% Finland Government Bond 20360415	350,000.000	238,402.500	
	0.25% Finland Government Bond 20400915	150,000.000	90,957.000	

0.125% Finland Government Bond 20520415	200,000.000	86,094.000	
0.125% Finland Government Bond 20310915	200,000.000	160,086.000	
FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	400,000.000	368,704.000	
1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	300,000.000	263,976.000	
1.2% Austria Government Bond 20251020	540,000.000	521,559.000	
0.75% Austria Government Bond 20261020	490,000.000	460,247.200	
1.5% Austria Government Bond 20470220	270,000.000	188,395.200	
1.5% Austria Government Bond 20861102	280,000.000	154,028.000	
0.5% Austria Government Bond 20270420	1,000,000.000	922,780.000	
2.1% Austria Government Bond 21170920	200,000.000	136,704.000	
0.75% Austria Government Bond 20280220	600,000.000	549,294.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	700,000.000	618,184.000	
Austria Government Bond 20300220	450,000.000	374,103.000	
0.75% Austria Government Bond 20510320	600,000.000	322,728.000	
0.85% Austria Government Bond 21200630	100,000.000	41,587.000	
Austria Government Bond 20310220	1,000,000.000	804,380.000	
Austria Government Bond 20250420	400,000.000	382,348.000	
0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	200,000.000	136,424.000	
0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	150,000.000	61,668.000	
1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	200,000.000	147,652.000	

2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	800,000.000	784,496.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,000,000.000	963,780.000	
1% Belgium Government Bond 20310622	300,000.000	259,239.000	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	460,000.000	377,075.800	
1% Belgium Government Bond 20260622	595,000.000	566,588.750	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	500,000.000	338,520.000	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	730,000.000	679,644.600	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	310,000.000	226,712.300	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	400,000.000	314,784.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	880,000.000	804,707.200	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	500,000.000	424,465.000	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	100,000.000	90,007.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	350,000.000	233,177.000	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	900,000.000	749,007.000	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	600,000.000	364,272.000	
Belgium Government Bond 20271022	300,000.000	268,689.000	
Belgium Government Bond 20311022	400,000.000	314,960.000	
0.65% Belgium Government Bond 20710622	270,000.000	103,118.400	
0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	700,000.000	555,618.000	
1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	400,000.000	236,816.000	

3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	600,000.000	590,808.000	
3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	800,000.000	734,696.000	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	455,000.000	514,568.600	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	800,000.000	895,400.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	800,000.000	877,208.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	2,096,000.000	2,541,064.640	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	2,000,000.000	2,387,740.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	3,270,000.000	3,906,374.700	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	1,390,000.000	1,579,415.300	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,020,000.000	1,203,498.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,810,000.000	2,271,260.400	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	656,000.000	694,198.880	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,098,000.000	1,041,837.300	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	1,475,000.000	1,397,680.500	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	1,190,000.000	1,150,979.900	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	3,400,000.000	3,284,094.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	883,000.000	838,558.610	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	1,350,000.000	1,254,676.500	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,000,000.000	927,130.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,100,000.000	2,876,490.000	



1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	1,160,000.000	845,953.200	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,050,000.000	966,136.500	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	1,000,000.000	901,510.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	1,800,000.000	1,607,058.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	500,000.000	435,045.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,600,000.000	775,888.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	700,000.000	601,867.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	300,000.000	221,451.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	700,000.000	586,705.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	200,000.000	143,012.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	3,000,000.000	2,656,320.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	400,000.000	195,008.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,600,000.000	1,324,192.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	1,500,000.000	1,223,955.000	
1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	1,100,000.000	1,029,996.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	800,000.000	640,352.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	1,000,000.000	978,290.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	900,000.000	412,956.000	
2.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250612	800,000.000	795,544.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	1,800,000.000	1,723,338.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	1,000,000.000	936,350.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	1,000,000.000	925,750.000	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	1,000,000.000	985,860.000	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	2,715,000.000	2,862,750.300	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,600,000.000	3,139,578.000	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	1,210,000.000	1,381,989.400	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,232,000.000	1,313,459.840	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	1,265,000.000	1,352,538.000	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	2,143,000.000	2,425,897.430	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,000,000.000	1,073,700.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	2,410,000.000	2,399,757.500	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	1,340,000.000	1,278,735.200	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	2,186,000.000	2,134,825.740	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	2,000,000.000	1,965,600.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,400,000.000	3,268,148.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	1,600,000.000	1,446,864.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,400,000.000	3,199,808.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	2,150,000.000	1,699,811.500	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	800,000.000	498,224.000	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	370,000.000	342,039.100	

1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	500,000.000	401,315.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	2,200,000.000	2,063,688.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	1,700,000.000	1,265,123.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	3,000,000.000	2,735,400.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	1,800,000.000	1,493,100.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	2,750,000.000	2,482,755.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	1,350,000.000	872,140.500	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	2,000,000.000	1,762,180.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	3,000,000.000	2,874,270.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	2,400,000.000	2,023,752.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	1,100,000.000	548,933.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	1,000,000.000	630,190.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	3,000,000.000	2,449,890.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	200,000.000	69,732.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	1,600,000.000	1,263,520.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	500,000.000	455,605.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	1,000,000.000	487,620.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	1,600,000.000	1,241,648.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	1,000,000.000	753,210.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	1,500,000.000	1,373,895.000	

2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	1,500,000.000	1,376,340.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	800,000.000	704,256.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260924	1,000,000.000	987,610.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	580,000.000	641,277.000	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	800,000.000	882,952.000	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,180,000.000	1,290,766.600	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	390,000.000	379,060.500	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	910,000.000	868,986.300	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,670,000.000	1,570,301.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	970,000.000	903,147.600	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	900,000.000	822,924.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	700,000.000	610,022.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	250,000.000	169,592.500	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	750,000.000	626,017.500	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	400,000.000	177,220.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	700,000.000	566,965.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	300,000.000	260,991.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	1,500,000.000	1,408,500.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	1,300,000.000	1,069,198.000	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	400,000.000	320,008.000	

7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	2,700,000.000	2,979,477.000	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	1,135,000.000	1,256,569.850	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	2,000,000.000	1,978,120.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	905,000.000	726,642.600	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	920,000.000	892,142.400	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,500,000.000	1,249,950.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	900,000.000	874,323.000	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	300,000.000	218,151.000	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	450,000.000	353,839.500	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	700,000.000	461,671.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,200,000.000	1,033,104.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,700,000.000	1,626,407.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	950,000.000	783,341.500	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,050,000.000	1,946,024.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	700,000.000	579,285.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	1,500,000.000	1,408,395.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	900,000.000	864,729.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,300,000.000	1,276,678.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	700,000.000	634,998.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	500,000.000	436,260.000	

3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,100,000.000	1,057,925.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	1,400,000.000	1,351,252.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	500,000.000	412,790.000	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	500,000.000	430,040.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	250,000.000	166,952.500	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	500,000.000	359,590.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	500,000.000	413,835.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	600,000.000	516,138.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,000,000.000	937,290.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	700,000.000	466,249.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,000,000.000	806,390.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	400,000.000	222,912.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	200,000.000	130,188.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,000,000.000	777,350.000	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	200,000.000	116,212.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	450,000.000	245,529.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	300,000.000	237,252.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,000,000.000	777,150.000	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	500,000.000	423,050.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	200,000.000	121,414.000	

2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	500,000.000	475,770.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	700,000.000	614,978.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	400,000.000	344,464.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	1,200,000.000	1,160,520.000	
4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	600,000.000	610,062.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	1,500,000.000	1,500,645.000	
3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,300,000.000	1,288,924.000	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	1,000,000.000	953,730.000	
3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	500,000.000	494,020.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	1,840,000.000	1,983,078.400	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	1,488,000.000	1,685,189.760	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,300,000.000	1,456,728.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	1,650,000.000	1,743,027.000	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	1,270,000.000	1,209,979.800	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,140,000.000	1,185,771.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,900,000.000	2,950,315.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	714,000.000	741,503.280	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	3,250,000.000	3,319,355.000	

4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,080,000.000	2,180,152.000	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	525,000.000	526,816.500	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,370,000.000	1,345,792.100	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,000,000.000	1,109,200.000	
5% Belgium Government Bond 20350328	750,000.000	867,645.000	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	965,000.000	1,048,482.150	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	700,000.000	723,779.000	
4% Belgium Government Bond 20320328	300,000.000	320,277.000	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	390,000.000	395,588.700	
3% Belgium Government Bond 20340622	300,000.000	293,439.000	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	680,000.000	660,252.800	
2% IRISH TREASURY 20450218	510,000.000	398,361.000	
1% IRISH TREASURY 20260515	520,000.000	496,168.400	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	500,000.000	414,480.000	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	736,536.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	150,000.000	129,217.500	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	1,100,000.000	989,725.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	300,000.000	273,795.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	400,000.000	264,108.000	
IRISH TREASURY 20311018	200,000.000	159,456.000	



0.55% IRISH TREASURY 20410422	200,000.000	126,648.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	380,000.000	423,441.600	
4.15% Austria Government Bond 20370315	800,000.000	869,720.000	
4.85% Austria Government Bond 20260315	700,000.000	728,140.000	
3.8% Austria Government Bond 20620126	170,000.000	184,142.300	
3.15% Austria Government Bond 20440620	500,000.000	483,085.000	
2.4% Austria Government Bond 20340523	630,000.000	586,189.800	
4% Finland Government Bond 20250704	200,000.000	202,454.000	
2.75% Finland Government Bond 20280704	120,000.000	119,440.800	
2.625% Finland Government Bond 20420704	460,000.000	414,906.200	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,420,000.000	1,609,896.600	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	3,100,000.000	3,022,159.000	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	910,000.000	838,692.400	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,400,000.000	1,359,652.000	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,100,000.000	904,464.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,480,000.000	1,243,362.800	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	4,500,000.000	4,268,520.000	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	2,100,000.000	1,988,259.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	820,000.000	741,009.400	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	1,170,000.000	1,097,343.000	

1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	1,650,000.000	1,531,728.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,050,000.000	818,160.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	800,000.000	731,480.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	400,000.000	330,312.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	900,000.000	773,820.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,000,000.000	842,310.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	100,000.000	49,783.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	1,800,000.000	1,574,766.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	950,000.000	624,321.000	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	800,000.000	631,904.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	200,000.000	88,028.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	2,000,000.000	1,755,880.000	
0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	1,000,000.000	682,300.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	500,000.000	302,750.000	
0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	1,000,000.000	802,920.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	400,000.000	350,188.000	
2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	600,000.000	557,898.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	600,000.000	547,278.000	
3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	1,500,000.000	1,454,100.000	
3.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20331031	500,000.000	498,470.000	

	5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	680,000.000	797,667.200	
	4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	900,000.000	936,702.000	
	4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	800,000.000	885,472.000	
	4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	500,000.000	543,425.000	
	4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,000,000.000	2,042,980.000	
	5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,000,000.000	1,068,140.000	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	790,000.000	907,986.500	
	ユーロ 小計		256,480,415.930 (41,944,807,221)	
国債証券 合計			125,538,926,579 [125,538,926,579]	
合計			125,538,926,579 [125,538,926,579]	

(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 132銘柄	100%	47.1%
イギリス・ポンド	国債証券 49銘柄	100%	4.9%
イスラエル・シケル	国債証券 7銘柄	100%	0.3%
オーストラリア・ドル	国債証券 20銘柄	100%	1.5%
オフショア・人民元	国債証券 55銘柄	100%	7.5%
カナダ・ドル	国債証券 24銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券 13銘柄	100%	0.5%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	100%	0.2%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.3%
ニュージーランド・ドル	国債証券 6銘柄	100%	0.2%

ノルウェー・クローネ	国債証券	8銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券	11銘柄	100%	0.5%
マレーシア・リングgit	国債証券	17銘柄	100%	0.6%
メキシコ・ペソ	国債証券	11銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券	275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。

【ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ラップ専用)】

(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2期計算期間(2022年11月22日から2023年11月20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】

ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ラップ専用)

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 2022年11月21日現在	第2期 2023年11月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,203,770	9,005,963
親投資信託受益証券	468,399,316	3,636,161,376
流動資産合計	469,603,086	3,645,167,339
資産合計	469,603,086	3,645,167,339
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	203,465	821,115
未払受託者報酬	22,028	275,030
未払委託者報酬	44,048	550,062
その他未払費用	8,191	103,347
流動負債合計	277,732	1,749,554
負債合計	277,732	1,749,554
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,465,055,438	1,323,617,156
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	4,269,916	319,800,629
(分配準備積立金)	-	211,069,311
元本等合計	469,325,354	3,643,417,785
純資産合計	469,325,354	3,643,417,785
負債純資産合計	469,603,086	3,645,167,339

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	2021年11月19日 至 2022年11月21日	自	2022年11月22日 至 2023年11月20日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		3,477,740		218,210,546
<b>営業収益合計</b>		<b>3,477,740</b>		<b>218,210,546</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		48		1,391
受託者報酬		22,029		365,189
委託者報酬		44,229		730,372
その他費用		8,371		136,784
<b>営業費用合計</b>		<b>74,677</b>		<b>1,233,736</b>
営業利益又は営業損失( )		3,552,417		216,976,810
経常利益又は経常損失( )		3,552,417		216,976,810
当期純利益又は当期純損失( )		3,552,417		216,976,810
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( )		26,792		2,485,263
期首剰余金又は期首欠損金( )		-		4,269,916
剰余金増加額又は欠損金減少額		7,881,938		102,307,860
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		7,881,938		102,307,860
剰余金減少額又は欠損金増加額		32,813		1,268,694
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		32,813		1,268,694
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )		4,269,916		319,800,629

## (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2期	
	自2022年11月22日 至2023年11月20日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日  2022年11月20日が休日のため、前計算期間末日を2022年11月21日としております。このため、当計算期間は364日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区分	第1期	第2期
	2022年11月21日現在	2023年11月20日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円	465,055,438円
期中追加設定元本額	468,244,226円	2,940,386,492円
期中一部解約元本額	4,188,788円	81,824,774円
2. 計算期間末日における受益権の総数	465,055,438口	3,323,617,156口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第1期	第2期
	自2021年11月19日 至2022年11月21日	自2022年11月22日 至2023年11月20日



1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,269,969円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は4,269,969円(1万口当たり91.82円)であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(211,069,311円)、投資信託約款に規定される収益調整金(108,734,002円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象額は319,803,313円(1万口当たり962.21円)であり、分配を行っておりません。
------------	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第2期 自2022年11月22日 至2023年11月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第2期 2023年11月20日現在
----	----------------------

1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載してあります。  (2)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1期 2022年11月21日現在	第2期 2023年11月20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	3,484,246	218,148,554
合計	3,484,246	218,148,554

## (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1期 2022年11月21日現在	第2期 2023年11月20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2期 自2022年11月22日 至2023年11月20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1期 2022年11月21日現在	第2期 2023年11月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0092円 (10,092円)	1.0962円 (10,962円)

## (4)【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	1,054,968,920	3,636,161,376	
親投資信託受益証券 合計			3,636,161,376	
合計			3,636,161,376	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

## 「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2022年11月21日現在 金額(円)	2023年11月20日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,562,978,003	3,779,074,990

コール・ローン	1,131,654,336	1,437,705,971
国債証券	237,462,418,880	276,160,468,142
派生商品評価勘定	2,185,657	10,923,078
未収入金	30,062	60,472
未収利息	1,438,832,981	1,944,411,641
前払費用	64,728,740	91,692,916
流動資産合計	241,662,828,659	283,424,337,210
資産合計	241,662,828,659	283,424,337,210
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	16,537,040	1,528,032
未払金	2,300,900,990	14,604
未払解約金	43,933,415	76,164,686
流動負債合計	2,361,371,445	77,707,322
負債合計	2,361,371,445	77,707,322
純資産の部		
元本等		
元本	1 75,484,506,549	82,208,146,502
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	163,816,950,665	201,138,483,386
元本等合計	239,301,457,214	283,346,629,888
純資産合計	239,301,457,214	283,346,629,888
負債純資産合計	241,662,828,659	283,424,337,210

## 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11月22日 至2023年11月20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	2022年11月21日現在	2023年11月20日現在
1. 1 期首	2021年11月19日	2022年11月22日
期首元本額	73,889,122,178円	75,484,506,549円
期中追加設定元本額	8,925,489,384円	12,035,029,399円
期中一部解約元本額	7,330,105,013円	5,311,389,446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	452,580,047円	395,652,560円
A		

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	7,360,920円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	51,739,813円	40,271,896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	15,130,453円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	243,846,488円	208,578,007円
外国債券インデックスファンド (F0Fs用)(適格機関投資家専 用)	349,083,397円	553,069,362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)	588,202,188円	793,707,293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)	2,653,358,666円	3,698,973,787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)	613,621,065円	851,048,131円
D-I's 外国債券インデック ス	995,400円	2,618,634円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	12,334,091円	19,502,573円
iFree 外国債券インデック ス	2,022,631,352円	2,166,657,241円
iFree 8資産バランス	1,840,847,318円	2,269,049,826円
iFree 年金バランス	341,626,333円	493,313,849円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2060	-円	308,799円
DCダイワ外国債券インデック ス	50,405,715,947円	51,172,279,741円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,052,124,222円	1,152,950,202円
ダイワ・ライフ・バランス50	667,240,115円	805,022,331円
ダイワ・ライフ・バランス70	445,387,714円	618,200,036円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	636,346,880円	690,058,072円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	500,072,837円	543,788,498円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	191,039,281円	216,687,940円

D Cダイワ・ターゲットイヤー 2030	31,889,215円	36,688,293円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2040	13,535,056円	18,557,309円
ダイワつみたてインデックス外 国債券	1,359,836,510円	1,909,981,179円
ダイワつみたてインデックスバ ランス30	3,867,501円	4,562,903円
ダイワつみたてインデックスバ ランス50	1,486,066円	1,890,987円
ダイワつみたてインデックスバ ランス70	2,487,135円	3,202,454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)	147,750,715円	1,054,968,920円
ダイワ世界バランスファンド4 0VA	115,798,326円	94,695,151円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	36,264,152円	25,462,305円
ダイワ・バランスファンド35 VA	3,287,759,159円	2,845,728,279円
ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	199,558,499円	177,059,877円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	150,571,932円	160,623,011円
ダイワ・ノーロード 外国債券 ファンド	48,744,127円	65,939,635円
ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワS MA専用)	1,181,992,785円	3,202,219,324円
ダイワ投信倶楽部外国債券イン デックス	5,703,699,281円	5,789,526,269円
ダイワライフスタイル25	28,405,151円	26,967,380円
ダイワライフスタイル50	58,280,872円	59,333,115円
ダイワライフスタイル75	14,921,193円	16,509,960円
計	75,484,506,549円	82,208,146,502円
2. 期末日における受益権の総数	75,484,506,549口	82,208,146,502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2022年11月22日 至2023年11月20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>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年11月20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	2022年11月21日現在	2023年11月20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	42,581,651,281	9,168,439,224
合計	42,581,651,281	9,168,439,224

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種類	2022年11月21日現在				2023年11月20日現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)		(円)		(円)	
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買建	2,721,863,278	-	2,707,511,895	14,351,383	1,439,968,373	-	1,449,363,419	9,395,046
アメリカ・ドル	1,334,421,356	-	1,329,965,500	4,455,856	202,898,874	-	201,629,390	1,269,484
イギリス・ ポンド	130,224,332	-	130,089,610	134,722	11,612,556	-	11,546,675	65,881
イスラエル・ シェケル	-	-	-	-	20,745,465	-	22,413,624	1,668,159
オーストラリ ア・ドル	75,686,858	-	75,005,160	681,698	-	-	-	-
オフショア・ 人民元	88,623,078	-	85,964,149	2,658,929	1,040,150,311	-	1,048,573,379	8,423,068
カナダ・ドル	152,228,589	-	148,595,900	3,632,689	13,786,205	-	13,843,596	57,391
シンガポー ル・ドル	51,909,276	-	50,542,400	1,366,876	16,185,993	-	16,369,434	183,441
メキシコ・ペソ	32,514,295	-	31,461,216	1,053,079	-	-	-	-
ユーロ	856,255,494	-	855,887,960	367,534	134,588,969	-	134,987,321	398,352
合計	2,721,863,278	-	2,707,511,895	14,351,383	1,439,968,373	-	1,449,363,419	9,395,046

## (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)

	2022年11月21日現在	2023年11月20日現在
1口当たり純資産額	3,1702円	3,4467円
(1万口当たり純資産額)	(31,702円)	(34,467円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	876,007.350	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	749,930.570	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	762,641.820	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	783,529.320	

5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,529,678.000	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,186,007.760	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	890,933.890	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	538,278.480	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	514,941.420	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	919,962.510	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,071,552.690	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,040,697.400	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,169,114.100	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,003,192.600	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	1,614,286.340	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	983,198.290	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,386,412.820	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,257,649.140	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,305,595.200	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,335,126.870	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,162,421.500	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,297,345.050	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,056,151.800	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	3,908,917.060	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,214,121.800	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,070,627.260	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,735,012.980	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	2,727,625.380	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	1,796,402.440	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	2,796,862.180	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	2,700,392.820	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,499,681.760	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	5,749,883.100	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,085,284.940	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,526,144.320	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	1,773,160.290	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,546,061.600	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	1,835,000.000	1,387,351.750	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,461,190.990	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,381,225.120	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,551,387.200	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	496,062.250	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,543,140.900	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	2,150,398.800	

1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,172,357.420	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	1,922,717.070	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	4,963,140.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	1,794,017.400	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	4,913,842.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	730,230.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,386,801.600	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	1,748,478.900	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	5,951,872.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,489,960.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,440,272.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,450,000.000	1,736,192.500	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,047,955.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	1,770,650.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,402,665.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,099,264.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,710,288.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	5,923,724.500	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,519,296.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,619,891.000	

3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,226,600.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	2,805,402.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	2,886,480.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,075,160.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	1,841,765.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,438,636.500	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	2,896,440.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,241,988.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,386,696.200	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,414,925.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,465,000.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,414,775.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,412,500.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,477,408.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,401,051.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	2,885,610.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,500,000.000	1,433,955.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,030,090.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,387,400.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	3,482,089.000	

2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,377,925.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,361,700.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	3,363,252.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,502,512.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,649,388.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,816,340.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,609,348.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,323,925.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,038,475.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	2,907,660.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,562,644.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,301,450.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	965,430.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,753,430.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	2,850,000.000	2,453,878.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	2,926,485.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,832,380.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	2,887,170.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,295,350.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,406,625.000	

1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,700,000.000	1,625,353.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,199,200.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	5,910,125.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	3,208,626.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	268,950.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	4,942,496.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,500,000.000	2,349,450.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,404,992.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,337,184.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,524,446.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,092,008.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	2,699,480.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	2,927,900.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,041,360.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,789,940.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	6,500,000.000	6,024,525.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,032,400.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,140,274.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,227,120.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,297,900.000	



1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,700,000.000	3,340,955.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	5,000,000.000	2,902,500.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,014,025.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	4,000,000.000	3,671,840.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,416,320.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,221,680.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	7,728,966.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,658,640.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,423,480.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	3,639,156.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,086,061.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,662,369.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,289,450.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,277,200.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	5,000,000.000	4,560,400.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,004,670.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	3,373,561.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	8,554,757.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,542,850.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,349,200.000	

1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,097,018.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,725,770.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,489,360.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,649,280.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	7,154,880.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,091,625.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,222,760.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	4,137,088.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	2,660,114.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	6,000,000.000	5,209,920.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	3,987,984.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,331,050.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,539,900.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,164,295.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	6,900,000.000	4,061,409.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	5,700,000.000	3,627,252.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,390,820.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,267,850.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,283,850.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,495,500.000	

1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,299,500.000	
0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,153,465.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241115	4,500,000.000	4,305,960.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	10,000,000.000	7,950,000.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,600,000.000	3,755,004.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	2,652,400.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,180,340.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	7,000,000.000	6,331,850.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,623,560.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	4,855,648.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241215	2,200,000.000	2,103,068.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	4,000,000.000	3,436,920.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,618,640.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250115	1,000,000.000	954,700.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	10,400,000.000	8,558,992.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250215	3,700,000.000	3,538,162.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,759,103.000	
2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	3,900,000.000	2,441,283.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	1,762,450.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,391,750.000	

1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	5,000,000.000	4,592,750.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250315	5,000,000.000	4,785,900.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,699,880.000	
2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,683,300.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250415	3,000,000.000	2,900,430.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	9,300,000.000	8,257,656.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250515	3,000,000.000	2,901,360.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	3,612,500.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,214,115.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,767,770.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,828,310.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	6,000,000.000	5,492,520.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,875,000.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250615	4,000,000.000	3,869,840.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,754,120.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,872,590.000	
3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250715	3,000,000.000	2,905,830.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	3,823,317.300	
3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250815	4,500,000.000	4,362,525.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	9,500,000.000	8,324,470.000	

3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	5,200,000.000	3,858,348.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	2,000,000.000	1,645,840.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,047,217.600	
3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,378,250.000	
3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,257,590.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250915	2,300,000.000	2,242,362.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,419,625.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	3,500,000.000	3,450,370.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251015	3,400,000.000	3,358,928.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241031	1,000,000.000	991,450.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031	3,000,000.000	2,956,860.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	9,700,000.000	9,451,001.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251115	1,500,000.000	1,489,125.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	3,700,000.000	3,331,998.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	2,922,420.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241130	3,000,000.000	2,976,240.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	2,500,000.000	2,417,750.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	3,000,000.000	2,929,440.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20421115	2,500,000.000	2,250,725.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251215	3,500,000.000	3,441,410.000	

3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260115	1,500,000.000	1,471,020.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	5,000,000.000	4,833,350.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271231	1,500,000.000	1,464,510.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241231	3,000,000.000	2,968,050.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250131	1,000,000.000	987,590.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	5,000,000.000	4,732,000.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260215	3,500,000.000	3,441,410.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	8,000,000.000	7,420,000.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	2,500,000.000	2,207,225.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	4,500,000.000	3,783,600.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131	3,700,000.000	3,559,141.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250228	4,500,000.000	4,469,580.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300228	1,000,000.000	972,890.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280229	3,000,000.000	2,942,460.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260315	2,500,000.000	2,492,475.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250331	3,000,000.000	2,949,990.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,800,000.000	1,714,068.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280331	3,700,000.000	3,575,162.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260415	2,000,000.000	1,955,220.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	3,000,000.000	2,835,510.000	

3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280430	2,000,000.000	1,922,060.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260515	1,000,000.000	974,580.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	7,800,000.000	7,152,834.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	4,400,000.000	3,702,160.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	2,500,000.000	2,205,075.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250430	4,000,000.000	3,932,320.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250531	3,600,000.000	3,557,520.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280531	3,700,000.000	3,574,533.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531	1,500,000.000	1,437,585.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260615	3,000,000.000	2,958,030.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250630	2,500,000.000	2,484,600.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	3,000,000.000	2,874,420.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630	3,500,000.000	3,432,905.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260715	2,000,000.000	1,990,420.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250731	4,000,000.000	3,984,200.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	3,500,000.000	3,450,825.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815	7,000,000.000	6,681,710.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260815	6,000,000.000	5,952,180.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815	3,500,000.000	3,225,740.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430815	1,300,000.000	1,229,605.000	

	4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	3,000,000.000	2,915,970.000	
	5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250831	3,900,000.000	3,901,794.000	
	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300831	3,100,000.000	3,034,590.000	
	4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	3,000,000.000	2,991,090.000	
	4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260915	3,000,000.000	2,997,420.000	
	5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250930	1,000,000.000	1,001,050.000	
	4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930	1,500,000.000	1,512,885.000	
	4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	4,200,000.000	4,230,492.000	
	4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261015	1,000,000.000	999,370.000	
	5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251031	1,000,000.000	1,001,770.000	
	4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	2,000,000.000	2,037,340.000	
アメリカ・ドル 小計			888,304,328.350 (133,201,234,036)	
イギリス・ポンド	2% United Kingdom Gilt 20250907	921,000.000	882,133.800	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,282,000.000	826,364.380	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,367,094.050	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	989,560.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,059,080.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	969,798.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,410,000.000	1,276,966.500	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,345,005.000	



1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,040,000.000	490,661.600	
1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	708,842.200	
1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	445,833.500	
0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,500,000.000	1,258,860.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20250607	1,900,000.000	1,792,783.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	718,522.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,300,000.000	1,020,240.000	
0.5% United Kingdom Gilt 20611022	1,700,000.000	511,955.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,373,760.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,361,552.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	440,165.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,700,000.000	1,135,362.000	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	1,883,000.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20460131	2,000,000.000	982,260.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20261022	3,500,000.000	3,137,225.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,800,000.000	879,300.000	
0.25% UNITED KINGDOM GILT 20250131	1,100,000.000	1,044,186.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	2,100,000.000	1,336,104.000	
0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	2,700,000.000	2,259,414.000	
0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	2,300,000.000	1,707,359.000	

1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	1,300,000.000	664,690.000	
1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	3,600,000.000	2,842,452.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	820,000.000	305,056.400	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	2,000,000.000	1,993,800.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	1,000,000.000	929,220.000	
3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	1,100,000.000	1,029,006.000	
3.5% UNITED KINGDOM GILT 20251022	400,000.000	392,460.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	2,500,000.000	2,172,000.000	
4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	800,000.000	735,280.000	
4.5% UNITED KINGDOM GILT 20280607	700,000.000	711,361.000	
4.625% UNITED KINGDOM GILT 20340131	1,000,000.000	1,036,400.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,034,229.690	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	2,240,000.000	2,279,043.200	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,478,771.200	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,362,000.000	1,359,548.400	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	1,406,774.760	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	1,635,717.440	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,305,964.300	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,240,402.240	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	2,111,090.880	

	4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,600,000.000	1,676,144.000	
	4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,281,383.160	
	4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	1,412,467.260	
	4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,600,092.000	
	4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	1,083,226.320	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,532,922.850	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,359,505.440	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,866,000.000	1,547,660.400	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	1,155,175.560	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,524,000.000	1,305,763.200	
	イギリス・ボンド 小計		73,820,993.730 (13,781,641,320)	
イスラエル・ シュケル	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	1,916,118.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,600,000.000	1,751,776.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,215,314.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,693,404.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,027,376.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,109,052.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	1,986,168.000	
	0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	1,600,000.000	1,524,496.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,171,555.000	

	0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	185,236.000	
	0.4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20241031	900,000.000	871,677.000	
	1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	300,000.000	237,819.000	
	2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129	600,000.000	403,050.000	
	3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290228	3,000,000.000	2,962,920.000	
イスラエル・シケル 小計			20,055,961.000 (808,826,824)	
オーストラリア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,030,729.220	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,293,652.220	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,798,000.000	1,773,637.100	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	2,258,000.000	2,266,738.460	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,748,000.000	1,754,310.280	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,019,185.230	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,100,154.180	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	666,737.280	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,589,603.840	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,088,566.240	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	933,891.840	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,406,535.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,753,244.000	
2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,584,578.500		

	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,060,014.000	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,320,620.800	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	2,700,000.000	2,099,412.000	
	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,305,584.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,598,760.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	749,056.000	
	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,600,000.000	1,481,104.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	1,933,600.000	
	0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,085,844.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,600,000.000	1,282,944.000	
	3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,300,000.000	1,147,562.000	
	3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	1,200,000.000	1,127,676.000	
	3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221	1,100,000.000	1,005,224.000	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20540621	900,000.000	894,186.000	
	オーストラリア・ドル 小計		41,353,150.190 (4,034,826,864)	
オフショア・人 民元	3.22% China Government Bond 20251206	5,200,000.000	5,311,748.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,186,050.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,211,250.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,133,050.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,282,600.000	

3.13% China Government Bond 20291121	8,000,000.000	8,274,560.000	
2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,175,110.000	
2.68% China Government Bond 20300521	11,500,000.000	11,521,965.000	
3.02% China Government Bond 20251022	18,000,000.000	18,276,660.000	
3.28% China Government Bond 20271203	9,000,000.000	9,322,110.000	
3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	13,092,125.000	
3.03% China Government Bond 20260311	7,000,000.000	7,124,740.000	
3.81% China Government Bond 20500914	7,300,000.000	8,348,280.000	
3.01% China Government Bond 20280513	7,000,000.000	7,166,180.000	
3.72% China Government Bond 20510412	14,000,000.000	15,774,220.000	
3.02% China Government Bond 20310527	15,800,000.000	16,254,092.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,538,250.000	
2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,048,500.000	
3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,768,840.000	
3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,286,700.000	
3.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20250607	17,000,000.000	17,430,950.000	
3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,738,185.000	
4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	4,500,000.000	5,330,115.000	
3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	6,300,000.000	7,232,274.000	
3.77% CHINA GOVERNMENT BOND 20250308	11,000,000.000	11,259,380.000	

3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	12,000,000.000	12,771,000.000	
2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,599,990.000	
3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	11,500,000.000	12,622,400.000	
2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	6,000,000.000	6,097,860.000	
2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	17,000,000.000	16,979,430.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	7,200,000.000	7,238,520.000	
2.26% CHINA GOVERNMENT BOND 20250224	10,000,000.000	9,990,100.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	15,191,850.000	
3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	5,809,815.000	
2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	5,037,300.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	4,000,000.000	4,031,960.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	4,000,000.000	4,006,760.000	
2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20250825	25,000,000.000	24,941,000.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	32,000,000.000	31,796,800.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	9,503,990.000	
2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	17,200,000.000	17,178,844.000	
3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	14,000,000.000	14,210,560.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	5,500,000.000	5,561,325.000	
2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20251125	18,000,000.000	17,969,040.000	
2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	19,000,000.000	19,176,510.000	

2.29% CHINA GOVERNMENT BOND 20241225	5,000,000.000	5,000,400.000	
2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	20,000,000.000	20,149,200.000	
2.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20260215	18,000,000.000	18,037,800.000	
2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	15,000,000.000	15,318,000.000	
2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20250315	23,000,000.000	23,002,530.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	15,000,000.000	15,144,300.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	25,000,000.000	25,150,500.000	
3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	23,000,000.000	24,056,390.000	
2.3% CHINA GOVERNMENT BOND 20260515	7,000,000.000	6,994,960.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	40,000,000.000	39,998,400.000	
2% CHINA GOVERNMENT BOND 20250615	9,000,000.000	8,953,650.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	33,000,000.000	32,973,270.000	
2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	35,000,000.000	34,863,150.000	
2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	40,000,000.000	39,588,400.000	
2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	30,000,000.000	29,835,300.000	
2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925	25,000,000.000	24,968,500.000	
2.22% CHINA GOVERNMENT BOND 20250925	30,000,000.000	29,943,900.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	20,000,000.000	19,949,600.000	
2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	20,000,000.000	20,054,200.000	
オフショア・人民元 小計		907,785,438.000 (18,843,991,679)	



カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	605,000.000	509,652.000	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,081,093.570	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,298,735.900	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,147,881.240	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	955,061.910	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	948,237.920	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,163,216.740	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,116,545.720	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	907,119.660	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,122,472.800	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	602,478.500	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,710,229.200	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,131,830.600	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	2,955,718.500	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	700,000.000	670,320.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,694,636.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,602,500.000	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	1,917,657.000	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	275,478.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	2,905,844.000	

1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	2,650,000.000	1,796,408.500	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	2,200,000.000	2,013,440.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,100,000.000	1,779,225.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250401	200,000.000	191,594.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,313,280.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	92,278.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	400,000.000	383,272.000	
3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20251001	1,000,000.000	973,340.000	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	2,270,000.000	2,060,637.900	
3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241101	360,000.000	353,826.000	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	200,000.000	196,998.000	
3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250201	300,000.000	296,373.000	
3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260401	600,000.000	582,606.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	600,000.000	554,970.000	
3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250501	300,000.000	296,151.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201	400,000.000	341,156.000	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280901	1,200,000.000	1,170,348.000	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250801	500,000.000	491,275.000	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20331201	1,000,000.000	964,570.000	
4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20251101	2,000,000.000	2,001,100.000	

	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290301	300,000.000	302,970.000	
カナダ・ドル 小計			45,872,527.660 (5,011,573,646)	
シンガポール・ ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	782,267.600	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	803,984.200	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	388,436.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	587,749.360	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	622,687.500	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	515,249.200	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	661,168.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	438,300.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	693,000.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	542,575.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	324,229.500	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	432,000.000	
	0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	750,000.000	710,355.000	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	545,400.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	500,000.000	403,545.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	189,500.000	
2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	233,760.000		
3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	620,000.000	644,800.000		

	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	100,000.000	99,800.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20280801	400,000.000	398,724.000	
シンガポール・ドル 小計			10,017,530.360 (1,117,655,862)	
スウェーデン・ クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	3,655,000.000	3,979,600.550	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	7,502,416.950	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	6,800,178.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,642,465.000	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,202,089.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	5,746,240.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,165,200.000	
	1.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20331111	2,000,000.000	1,844,880.000	
スウェーデン・クローナ 小計			37,883,069.500 (539,833,740)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	16,289,885.700	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	5,873,799.050	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,690,368.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	8,590,000.000	7,574,747.900	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	1,710,450.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	403,625.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20241115	1,000,000.000	967,940.000	
	2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20331115	2,000,000.000	1,901,000.000	

デンマーク・クローネ 小計			39,411,815.650 (864,301,118)	
ニュージーランド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	600,000.000	595,728.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	1,500,000.000	1,345,470.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	380,460.500	
	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	600,000.000	551,112.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	530,000.000	420,565.600	
	1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	214,140.500	
	0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	1,100,000.000	903,628.000	
	0.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20260515	500,000.000	450,020.000	
	2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	440,000.000	353,782.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	249,185.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20250415	640,000.000	619,648.000	
	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20340515	200,000.000	189,170.000	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20300515	500,000.000	492,455.000	
ニュージーランド・ドル 小計			6,765,364.600 (608,612,200)	
ノルウェー・クローネ	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,236,764.650	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,120,309.200	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,176,236.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,261,475.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,475,780.000	

	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,158,768.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	2,940,000.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	1,700,000.000	1,513,459.000	
	3.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20421006	3,500,000.000	3,554,285.000	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20330815	1,500,000.000	1,420,125.000	
	ノルウェー・クローネ 小計		33,857,201.850 (469,599,389)	
ポーランド・ズ ロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,088,205.540	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	2,890,342.600	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,244,099.200	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	2,000,000.000	1,879,200.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,321,100.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	1,912,020.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,800,000.000	1,360,512.000	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	500,000.000	477,395.000	
	7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	1,000,000.000	1,089,420.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20251025	1,500,000.000	1,363,800.000	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	2,000,000.000	2,079,380.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	843,349.790	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,301,461.500	
3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	4,445,098.020		

ポーランド・ズロチ 小計			32,295,383.650 (1,203,474,554)	
マレーシア・リンギット	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,363,294.430	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,220,231.300	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,542,432.920	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,324,960.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	737,579.000	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,420,335.910	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,886,735.540	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,411,215.000	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,751,121.810	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,244,143.800	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	977,727.600	
	3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,562,787.500	
	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,201,602.500	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,085,135.000	
	3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,208,232.000	
	4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,276,992.000	
	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	2,000,000.000	2,183,940.000	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	656,441.500		
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,313,672.900		

	4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,297,356.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,277,341.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,645,875.000	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,517,765.000	
	2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,652,796.000	
	3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	1,400,000.000	1,360,968.000	
	4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	1,900,000.000	2,014,361.000	
	4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	515,705.000	
	4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	700,000.000	712,894.000	
	3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	1,000,000.000	995,280.000	
	マレーシア・リングット 小計		42,358,921.710 (1,356,150,530)	
メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	37,290,000.000	34,252,729.500	
	8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	18,264,537.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	6,216,700.000	
	5% MEXICAN BONOS 20250306	1,000,000.000	939,560.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	14,000,000.000	11,936,260.000	
	7.5% MEXICAN BONOS 20330526	10,000,000.000	8,814,700.000	
	7% MEXICAN BONOS 20260903	3,000,000.000	2,809,470.000	
	8% MEXICAN BONOS 20350524	5,000,000.000	4,519,000.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20290301	10,000,000.000	9,679,800.000	
	10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	23,729,083.140	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	26,275,376.640	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,258,066.720	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	28,520,300.400	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	17,357,728.860	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	44,515,000.000	40,660,446.150	



	7.75% Mexican Bonos 20421113	29,654,000.000	25,039,244.520	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	7,056,734.640	
メキシコ・ペソ 小計			275,329,737.570 (2,396,580,168)	
ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	310,772.280	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	268,244.550	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	766,476.100	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	248,972.400	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	732,568.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	386,523.300	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	446,435.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	436,655.000	
	0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	211,156.500	
	0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	242,552.000	
	Finland Government Bond 20300915	500,000.000	409,585.000	
	0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	172,188.000	
	0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	480,258.000	
	FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	184,352.000	
	0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	267,898.500	
	1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	800,000.000	703,936.000	
	1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	256,813.200	

2.75% FINLAND GOVERNMENT BOND 20380415	400,000.000	372,028.000	
3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20330915	300,000.000	296,745.000	
2.875% FINLAND GOVERNMENT BOND 20290415	1,000,000.000	998,270.000	
1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,326,112.050	
0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,057,629.280	
1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	547,043.840	
1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	132,024.000	
0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,181,158.400	
2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	369,100.800	
0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,098,588.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,130,393.600	
Austria Government Bond 20300220	980,000.000	814,713.200	
0.75% Austria Government Bond 20510320	1,200,000.000	645,456.000	
Austria Government Bond 20401020	400,000.000	228,900.000	
0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	145,554.500	
Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	965,256.000	
Austria Government Bond 20250420	480,000.000	458,817.600	
0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	409,272.000	
0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	123,336.000	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	300,000.000	260,238.000	

0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	1,500,000.000	1,262,610.000	
1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	300,000.000	221,478.000	
2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	300,000.000	292,677.000	
2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	300,000.000	294,186.000	
3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20531020	300,000.000	284,358.000	
2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20290523	1,000,000.000	999,950.000	
3.45% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20301020	800,000.000	820,440.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,637,462.220	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,532,966.620	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	867,274.340	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,463,000.000	1,393,141.750	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	842,237.760	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	516,283.200	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,024,122.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	424,171.400	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	472,176.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,362,515.600	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	551,804.500	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,350,105.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	466,354.000	

0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,015,320.600	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	522,123.200	
Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,074,756.000	
Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,259,840.000	
0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	202,417.600	
0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	1,400,000.000	1,111,236.000	
1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	473,632.000	
2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	400,000.000	363,716.000	
3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	1,500,000.000	1,477,020.000	
3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	600,000.000	551,022.000	
3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20430622	700,000.000	680,001.000	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,319,783.640	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,419,818.500	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,041,684.500	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,365,275.340	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,638,915.760	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	2,753,576.050	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,271,000.000	3,716,739.170	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	1,563,367.500	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,182,166.760	

3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,974,000.000	2,088,946.020	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	2,664,370.800	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	2,538,566.820	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,122,058.740	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,061,251.940	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	4,168,000.000	3,958,224.560	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,249,123.800	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	4,200,000.000	3,893,946.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,062,070.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	3,470,000.000	2,530,566.900	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,748,247.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,696,191.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	4,700,000.000	4,196,207.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,610,270.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,850,000.000	1,382,050.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,504,667.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,100,000.000	1,550,157.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,810,360.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,529,118.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,020,756.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	900,000.000	754,335.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	1,400,000.000	1,001,084.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,770,880.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	536,272.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	3,600,000.000	2,979,432.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	579,432.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	3,800,000.000	3,100,686.000	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	1,600,000.000	1,261,136.000	
1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,528,172.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,700,000.000	1,360,748.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	200,000.000	195,658.000	
2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,600,000.000	1,568,080.000	
2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,700,000.000	1,666,901.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,000,000.000	802,130.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330815	900,000.000	901,215.000	
2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,488,660.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	2,100,000.000	963,564.000	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20241212	1,500,000.000	1,481,550.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250313	1,500,000.000	1,485,855.000	
2.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250612	1,000,000.000	994,430.000	

3.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250918	100,000.000	100,074.000	
3.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20251212	300,000.000	300,855.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,297,784.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,175,800.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	94,714.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,059,970.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	2,800,000.000	2,592,100.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	100,000.000	91,588.000	
1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,863,890.000	
1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	410,688.700	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	100,000.000	98,586.000	
2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20281019	100,000.000	99,426.000	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,189,620.500	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,750,603.640	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	3,227,000.000	3,896,699.310	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,036,950.260	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	1,880,635.680	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,538,280.800	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,581,679.640	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	1,843,542.900	

3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	3,690,554.120	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,899,000.000	5,873,929.250	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	3,088,000.000	2,946,816.640	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	4,967,913.330	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	1,899,000.000	1,866,337.200	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,356,580.240	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	4,901,091.810	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,629,964.800	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	4,387,000.000	4,128,693.440	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	3,296,053.090	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	863,795.860	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	3,743,941.500	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	2,062,759.100	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,189,336.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	1,897,684.500	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	4,923,720.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	3,276,525.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,468,959.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,850,000.000	1,841,185.500	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	5,350,000.000	4,713,831.500	



FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	4,330,000.000	4,148,529.700	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,541,566.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,382,313.100	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	2,806,890.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,386,418.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	5,000,000.000	4,083,150.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	1,480,000.000	516,016.800	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	1,500,000.000	840,840.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,632,620.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	3,100,000.000	2,824,751.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,600,000.000	1,267,812.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	3,600,000.000	2,793,708.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250225	2,100,000.000	2,015,685.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	2,200,000.000	1,657,062.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	4,300,000.000	3,938,499.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	4,800,000.000	4,404,288.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	851,500.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	1,100,000.000	968,352.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260924	2,200,000.000	2,172,742.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20330525	2,200,000.000	2,181,960.000	

2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290225	600,000.000	595,638.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20331125	700,000.000	720,993.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,259,335.350	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	1,936,975.950	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	1,891,301.230	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,426,822.600	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	1,842,059.970	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,710,064.710	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,938,000.000	1,822,301.400	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,048,376.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,234,386.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,045,752.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	610,533.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,168,566.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	733,584.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,250,000.000	553,812.500	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,052,935.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	586,467.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	782,973.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	100,000.000	93,900.000	

0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	600,000.000	493,476.000	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	900,000.000	720,018.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715	900,000.000	869,454.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300115	1,300,000.000	1,279,902.000	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20440115	600,000.000	618,012.000	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,224,896.100	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,648,207.120	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,794,154.840	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,211,606.280	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,411,693.640	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,720,764.500	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	2,891,000.000	2,808,519.770	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,170,743.700	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,278,558.420	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	1,827,384.440	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,000,021.800	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	638,425.040	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,291,380.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,444,632.100	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,650,000.000	1,360,540.500	

2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,563,056.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,566,704.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,075,815.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	1,971,753.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,261,624.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,450,065.500	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,522,193.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,152,067.800	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	650,000.000	567,138.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	2,900,000.000	2,789,075.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,026,878.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,031,975.000	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,634,152.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,251,198.000	
0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,166,159.500	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,035,105.500	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,078,770.000	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	1,500,000.000	1,460,625.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,655,340.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,806,483.000	

0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	1,998,304.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,593,393.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	999,105.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,900,000.000	1,532,141.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	668,736.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	455,658.000	
0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,647,851.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,399,230.000	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	2,200,000.000	1,278,332.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	1,013,914.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	250,985.200	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	694,016.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,502,596.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	3,100,000.000	2,824,782.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,700,000.000	1,321,155.000	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	900,000.000	761,490.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241215	300,000.000	288,861.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	485,656.000	
1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	277,311.000	
1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250815	500,000.000	480,500.000	

2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	761,232.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,600,000.000	1,405,664.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	300,000.000	258,348.000	
2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	200,000.000	193,112.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	500,000.000	483,550.000	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260115	3,300,000.000	3,302,178.000	
4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	2,800,000.000	2,846,956.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	300,000.000	300,129.000	
3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,500,000.000	1,487,220.000	
4.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20430901	100,000.000	96,330.000	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	500,000.000	476,865.000	
3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250328	400,000.000	398,748.000	
3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260415	500,000.000	503,650.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311030	900,000.000	899,226.000	
3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	1,200,000.000	1,185,648.000	
4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	2,100,000.000	2,117,010.000	
3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280801	700,000.000	703,948.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260915	400,000.000	403,508.000	
3.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250929	300,000.000	300,291.000	
4.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340301	400,000.000	396,716.000	

4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,504,020.000	
4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290201	600,000.000	609,870.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	3,254,000.000	3,507,031.040	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,226,549.480	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,022,610.800	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,427,561.240	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,610,507.600	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	2,126,066.600	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,154,747.300	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,329,400.360	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,114,173.800	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,526,041.500	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	1,819,272.980	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,277,040.940	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	1,892,295.200	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,202,661.440	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	1,742,762.040	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,035,003.970	

4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	832,720.200	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	652,214.190	
3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	730,663.110	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,060,569.080	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	933,092.560	
2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	727,204.100	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,023,824.410	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	455,928.000	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	736,536.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	646,087.500	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	674,812.500	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	867,017.500	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	396,162.000	
0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	259,500.500	
0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	456,610.000	
0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	666,320.000	
IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	637,824.000	
0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	253,296.000	
0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	79,819.000	
3% IRISH TREASURY 20431018	200,000.000	191,980.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	919,314.000	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,492,656.950	



4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	910,175.000	
3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	366,118.220	
3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	698,540.910	
2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	717,384.660	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	675,184.090	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	387,187.260	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	367,101.790	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,006,651.960	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	1,993,650.050	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	1,891,205.280	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,149,409.440	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	2,654,234.940	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,605,012.480	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	1,302,170.500	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,494,712.800	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,798,901.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,581,422.500	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	1,922,695.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,227,968.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	2,200,000.000	1,714,240.000	

1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,681,514.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,462,960.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	2,250,000.000	1,858,005.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,407,440.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	2,560,000.000	2,156,313.600	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	2,500,000.000	2,400,625.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	696,962.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,205,528.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,099,688.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	854,334.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	466,390.000	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,737,736.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	286,091.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	2,500,000.000	2,194,850.000	
0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	1,900,000.000	1,296,370.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,523,591.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	363,300.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	900,000.000	814,617.000	
0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,686,132.000	
1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	600,000.000	370,992.000	

SPANISH GOVERNMENT BOND 20250531	100,000.000	95,032.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	1,100,000.000	963,017.000	
2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,700,000.000	1,580,711.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,000,000.000	912,130.000	
3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	1,500,000.000	1,454,100.000	
2.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260531	2,300,000.000	2,276,862.000	
3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730	800,000.000	791,072.000	
3.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20331031	1,500,000.000	1,495,410.000	
3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290531	600,000.000	608,220.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,556,054.160	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,825,528.120	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,858,000.000	2,056,508.720	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,144,355.050	
4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,789,000.000	2,848,935.610	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,098,895.100	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	1,928,733.600	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	1,493,005.650	
2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,080,161.090	
ユーロ 小計		562,077,572.530 (91,922,166,212)	
国債証券 合計		276,160,468,142 [276,160,468,142]	

合計		276,160,468,142	
		[276,160,468,142]	

- (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 275銘柄	100%	48.2%
イギリス・ポンド	国債証券 58銘柄	100%	5.0%
イスラエル・シケル	国債証券 14銘柄	100%	0.3%
オーストラリア・ドル	国債証券 28銘柄	100%	1.5%
オフショア・人民元	国債証券 64銘柄	100%	6.8%
カナダ・ドル	国債証券 41銘柄	100%	1.8%
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%	0.2%
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	100%	0.3%
ニュージーランド・ドル	国債証券 13銘柄	100%	0.2%
ノルウェー・クローネ	国債証券 10銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	100%	0.4%
マレーシア・リングgit	国債証券 29銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 17銘柄	100%	0.9%
ユーロ	国債証券 375銘柄	100%	33.3%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ラップ専用)

## 【純資産額計算書】

2023年11月30日

資産総額	11,308,916円
負債総額	220円
純資産総額( - )	11,308,696円
発行済数量	13,963,427口
1単位当たり純資産額( / )	0.8099円

(参考) 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド

## 純資産額計算書

2023年11月30日

資産総額	130,687,568,689円
負債総額	871,874,585円
純資産総額( - )	129,815,694,104円
発行済数量	153,736,520,659口
1単位当たり純資産額( / )	0.8444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)

## 純資産額計算書

2023年11月30日

資産総額	3,762,117,230円
負債総額	1,946,892円
純資産総額( - )	3,760,170,338円
発行済数量	3,446,457,082口
1単位当たり純資産額( / )	1.0910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11月30日

資産総額	283,408,201,506円
------	------------------

負債総額	72,907,356円
純資産総額( - )	283,335,294,150円
発行済数量	82,595,678,754口
1単位当たり純資産額( / )	3.4304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。



## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

2023年11月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 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11月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	89	290,714
追加型株式投資信託	773	25,324,802
株式投資信託 合計	862	25,615,516
単位型公社債投資信託	101	169,041
追加型公社債投資信託	14	1,527,194
公社債投資信託 合計	115	1,696,235
総合計	977	27,311,751

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

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

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

## (1)【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	3,168	1,982
有価証券	486	346
前払費用	332	393
未収委託者報酬	13,811	12,525
未収収益	52	47
関係会社短期貸付金	24,900	22,100
その他	45	59
流動資産計	42,799	37,455
固定資産		
有形固定資産	1	196
建物	4	3
器具備品	198	193
無形固定資産	1,770	1,482
ソフトウェア	1,738	1,351
ソフトウェア仮勘定	31	131
投資その他の資産	16,617	13,824

投資有価証券	10,755	8,260
関係会社株式	3,705	3,475
出資金	177	177
長期差入保証金	1,067	1,066
繰延税金資産	885	824
その他	26	20
固定資産計	18,591	15,503
資産合計	61,390	52,959

(単位:百万円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	65	101
未払金	9,856	5,874
未払収益分配金	26	38
未払償還金	12	12
未払手数料	4,917	4,525
その他未払金	2	1,297
未払費用	4,246	3,987
未払法人税等	980	560
未払消費税等	1,016	327
賞与引当金	866	692
その他	2	2
流動負債計	17,033	11,545
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	2,399	2,276
役員退職慰労引当金	13	51
その他	1	0
固定負債計	2,415	2,329
負債合計	19,449	13,874
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495

利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,925	11,505
利益剰余金合計	14,299	11,879
株主資本合計	40,969	38,549
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	971	534
評価・換算差額等合計	971	534
純資産合計	41,941	39,084
負債・純資産合計	61,390	52,959

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	74,402	69,845
その他営業収益	545	559
営業収益計	74,948	70,405
営業費用		
支払手数料	31,234	29,405
広告宣伝費	650	662
調査費	9,104	9,638
調査費	1,252	1,469
委託調査費	7,851	8,169
委託計算費	1,729	1,783
営業雑経費	2,051	1,658
通信費	189	181
印刷費	468	468
協会費	46	51
諸会費	15	17
その他営業雑経費	1,331	939
営業費用計	44,768	43,147
一般管理費		
給料	5,948	5,788
役員報酬	306	317
給料・手当	4,281	4,369
賞与	493	409
賞与引当金繰入額	866	692

福利厚生費	867	874
交際費	46	66
旅費交通費	48	95
租税公課	527	476
不動産賃借料	1,300	1,300
退職給付費用	408	488
役員退職慰労引当金繰入額	10	38
固定資産減価償却費	606	625
諸経費	1,864	2,193
一般管理費計	11,628	11,946
営業利益	18,551	15,310

(単位:百万円)

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	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	14,298	40,969

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

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

## 注記事項

（重要な会計方針）

## 1．有価証券の評価基準及び評価方法

## （1）子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

## （2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2．固定資産の減価償却の方法

## （1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物 15～18年



器具備品 4～20年

## (2) 無形固定資産

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

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

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

## (2) 退職給付引当金

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

## (3) 役員退職慰労引当金

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

## 4. 収益及び費用の計上基準

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

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

## (重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

## (会計方針の変更に関する注記)

## (時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用)

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

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

## (貸借対照表関係)

## 1 有形固定資産の減価償却累計額

前事業年度	当事業年度
(2022年3月31日)	(2023年3月31日)

建物	37百万円	38百万円
器具備品	283百万円	296百万円

## 2 関係会社項目

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

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

## 3 保証債務

前事業年度(2022年3月31日)

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

当事業年度(2023年3月31日)

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自2021年4月1日至2022年3月31日)

### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

## 2. 配当に関する事項

### (1) 配当金支払額

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

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

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

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

## 1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

## 2．配当に関する事項

## （1）配当金支払額

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

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

2023年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

## （金融商品関係）

## 1．金融商品の状況に関する事項

## （1）金融商品に対する取組方針

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

## （2）金融商品の内容及びそのリスク

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

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。その他未払金は主にグループ通算制度における通算親法人へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド

運用に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。また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下3つのレベルに分類しております。

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

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

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

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

### 前事業年度（2022年3月31日）

#### （1）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券及び投資有価証券	66	-	-	66
資産合計	66	-	-	66

### 当事業年度（2023年3月31日）

#### （1）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

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

(単位：百万円)

区分	前事業年度	当事業年度
非上場株式等	666	666
子会社株式	1,677	1,448
関連会社株式	2,027	2,027

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（2022年3月31日）

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

当事業年度（2023年3月31日）

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

2. その他有価証券

前事業年度（2022年3月31日）

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	66	55	11
(2) その他	6,755	4,917	1,838
小計	6,822	4,972	1,850

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他	3,753	4,208	454
小計	3,753	4,208	454
合計	10,575	9,180	1,395

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

当事業年度(2023年3月31日)

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

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

### 3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

### 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、証券投資信託について331百万円の減損処理を行っております。

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

(退職給付関係)

#### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

### (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,452百万円	2,399百万円
勤務費用	152	150
退職給付の支払額	303	322
その他	98	48
退職給付債務の期末残高	2,399	2,276

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

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,399百万円	2,276百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,399	2,276
退職給付引当金	2,399	2,276
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,399	2,276

### (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	152百万円	150百万円
その他	67	153
確定給付制度に係る退職給付費用	219	303

(注) その他には、臨時に支払った割増退職金等を含んでおります。

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度189百万円、当事業年度184百万円であります。

### (税効果会計関係)

#### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位: 百万円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	734	697
賞与引当金	227	182
投資有価証券評価損	144	177
関係会社株式評価損	-	155
未払事業税	213	114
出資金評価損	94	94
システム関連費用	111	68
その他	437	309
繰延税金資産小計	1,963	1,799
評価性引当額	356	459
繰延税金資産合計	1,607	1,339
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	562	356
連結法人間取引(譲渡益)	159	159
繰延税金負債合計	722	515
繰延税金資産の純額	885	824

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

前事業年度(2022年3月31日)

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

当事業年度(2023年3月31日)

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

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

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

(収益認識関係)

(1) 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が69,845百万円、その他559百万円であります。

(2) 収益を理解するための基礎となる情報

(重要な会計方針)の4. 収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。



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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	(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。

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	(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)	17,100 0	関係会社短期貸付金 受取利息関係会社	22,100 0

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 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せん。

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

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

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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

## 2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社(東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

## (1株当たり情報)

前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,078.50円	1株当たり純資産額	14,983.42円
1株当たり当期純利益	4,883.43円	1株当たり当期純利益	3,955.35円

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

(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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

当期純利益(百万円)	12,738	10,317
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 中間財務諸表

### (1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

	当中間会計期間 (2023年9月30日)	
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金		2,879
有価証券		110
未収委託者報酬		14,148
関係会社短期貸付金		17,800
その他		629
流動資産合計		35,568
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	1	184
<b>無形固定資産</b>		
ソフトウェア		1,009
その他		203
無形固定資産合計		1,213
<b>投資その他の資産</b>		
投資有価証券		8,477
関係会社株式		3,475
繰延税金資産		628
その他		1,216
投資その他の資産合計		13,797
固定資産合計		15,196
資産合計		50,764

(単位:百万円)

当中間会計期間  
(2023年9月30日)

負債の部	
流動負債	
未払金	5,255
未払費用	4,567
未払法人税等	2,453
賞与引当金	727
その他	2 725
流動負債合計	13,864
固定負債	
退職給付引当金	2,228
役員退職慰労引当金	58
固定負債合計	2,287
負債合計	16,152
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174
資本剰余金	
資本準備金	11,495
資本剰余金合計	11,495
利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	6,594
利益剰余金合計	6,968
株主資本合計	33,638
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	973
評価・換算差額等合計	973
純資産合計	34,612
負債・純資産合計	50,764

## (2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間
	(自 2023年4月1日
	至 2023年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	36,557

その他営業収益		322
営業収益合計		36,879
営業費用		
支払手数料		15,250
その他営業費用		7,380
営業費用合計		22,631
一般管理費	1	6,087
営業利益		8,160
営業外収益	2	128
営業外費用	3	116
経常利益		8,172
特別利益		-
特別損失	4	258
税引前中間純利益		7,914
法人税、住民税及び事業税		2,505
法人税等調整額		2
中間純利益		5,405

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	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	11,505	11,879	38,549
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	10,316	10,316	10,316
中間純利益	-	-	-	5,405	5,405	5,405
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	-	-	-	-	-	-

当中間期変動額	-	-	-	4,910	4,910	4,910
合計						
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,594	6,594	33,638

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	534	534	39,084
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	10,316
中間純利益	-	-	5,405
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	438	438	438
当中間期変動額合計	438	438	4,472
当中間期末残高	973	973	34,612

## 注記事項

### （重要な会計方針）

#### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

##### （1）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

##### （2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

#### 2．固定資産の減価償却の方法

##### （1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

##### （2）無形固定資産

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



### 3. 引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

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

#### (2) 退職給付引当金

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

#### (3) 役員退職慰労引当金

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

### 4. 収益及び費用の計上基準

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

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

### 5. グループ通算制度の適用

当社は、株式会社大和証券グループ本社を通算親会社とするグループ通算制度を適用しております。

#### (中間貸借対照表関係)

#### 1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2023年9月30日現在)
有形固定資産	340百万円

#### 2 消費税等の取扱い

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

#### 3 保証債務

当中間会計期間（2023年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,299百万円に対して保証を行っております。

## （中間損益計算書関係）

## 1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
有形固定資産	10百万円
無形固定資産	230百万円

## 2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
投資有価証券売却益	35百万円
有価証券償還益	32百万円
雑収入	32百万円
受取配当金	25百万円

## 3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
有価証券償還損	103百万円

## 4 特別損失の項目

	当中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
ソフトウェア除却損	153百万円
投資有価証券評価損	104百万円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

## 1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

## 2．配当に関する事項

## 配当金支払額

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

(金融商品関係)

当中間会計期間(2023年9月30日)

## 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

- レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価
- レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
- レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

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

## (1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券及び投資有価証券	111	7,809	-	7,921
資産合計	111	7,809	-	7,921

## (2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

## (注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

## 有価証券及び投資有価証券

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

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

（単位：百万円）

区分	当中間会計期間
非上場株式	666
子会社株式	1,448
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2023年9月30日）

1．子会社株式及び関連会社株式

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

2．その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額（百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	111	55	56
（2）その他	5,511	3,839	1,672
小計	5,623	3,894	1,728
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,297	2,623	325
小計	2,297	2,623	325
合計	7,921	6,518	1,403

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

（収益認識関係）

（1）顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が36,557百万円、その他322百万円であります。

（2）収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の4．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

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

[関連情報]

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

## ( 1 株当たり情報 )

当中間会計期間 ( 自 2023年 4 月 1 日 至 2023年 9 月 30 日 )	
1 株当たり純資産額	13,268.89円
1 株当たり中間純利益	2,072.34円

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

( 注 2 ) 1 株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 ( 自 2023年 4 月 1 日 至 2023年 9 月 30 日 )	
中間純利益(百万円)	5,405
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,405
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

## ( 重要な後発事象 )

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

提出日前1年以内において、定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項に該当する事実はありません。

##### b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

## 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 (2023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)	

(注1) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

(注4) 全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。

(注5) 協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

(注6) 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(注7) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注8) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注9) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

(注10) 全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。

(注11) 労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

(注12) 農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行いません。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）を行いません。

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いません。

## 3【資本関係】

該当事項はありません。



## 第3【参考情報】

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

(提出年月日)	(書類名)
2023年2月14日	有価証券報告書、有価証券届出書
2023年8月14日	半期報告書、有価証券届出書

**独立監査人の監査報告書**

2023年5月26日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員	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		

**監査意見**

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

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

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

**財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

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

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2024年1月12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 秋山 範之指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ラップ専用）の2022年11月22日から2023年11月20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、ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ラップ専用）の2023年11月20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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2024年1月12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 秋山 範之指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている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）の2022年11月22日から2023年11月20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、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）の2023年11月20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



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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2023年11月27日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第65期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。