【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長　殿
【提出日】	2025年12月1日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　佐野　径
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【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
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ｉＦｒｅｅ　８資産バランス
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	10兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

ｉＦｒｅｅ ８資産バランス

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

10兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

(5)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

(6)【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

(7)【申込期間】

2025年12月2日から2026年6月1日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8)【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ　https://www.daiwa-am.co.jp/

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社　証券保管振替機構

(12)【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型投信	国　内	株　式
追加型投信	海　外	債　券
	内　外	不動産投信
		その他資産（　　）
		資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

（注1）商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行なわれないファンド
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
投資対象地域	国内	目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	海外	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	内外	目論見書等において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
投資対象資産	株式	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるもの
	債券	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるもの
	不動産投信（リート）	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるもの
	その他資産	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券、不動産投信（リート）以外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	資産複合	目論見書等において、株式、債券、不動産投信（リート）およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
独立区分	ＭＭＦ（マネー・マネージメント・ファンド）	「ＭＭＦ等の運営に関する規則」に定めるＭＭＦ
	ＭＲＦ（マネー・リザーブ・ファンド）	「ＭＭＦ等の運営に関する規則」に定めるＭＲＦ
	ＥＴＦ	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第１号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託
補足分類	インデックス型	目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	特殊型	目論見書等において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

（注2）属性区分の定義

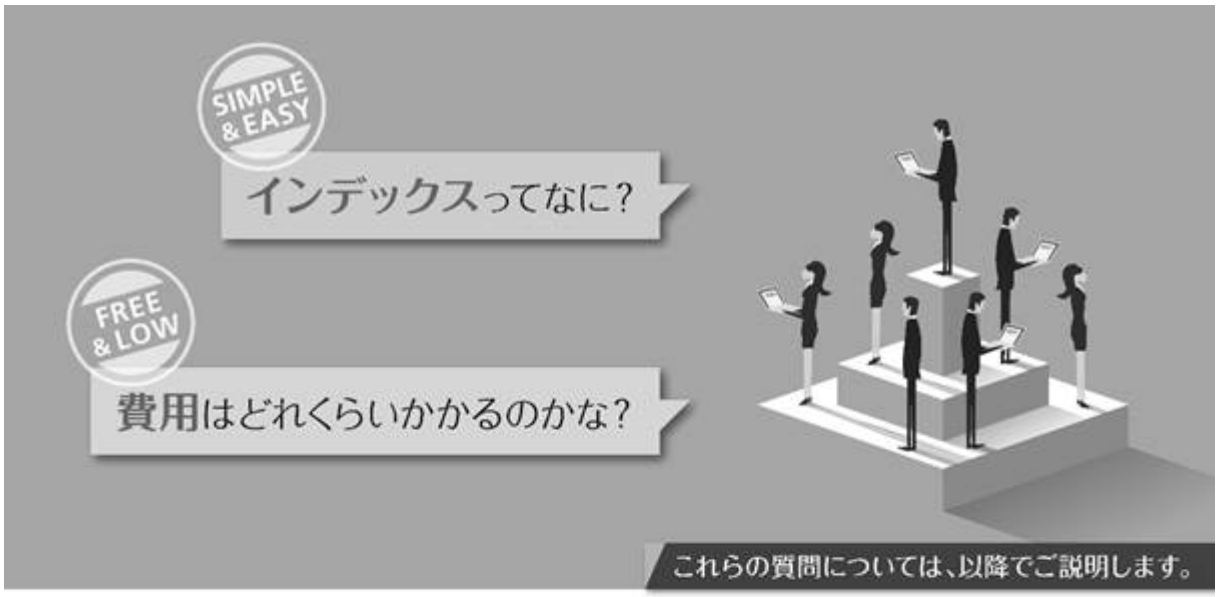
投資対象資産	株式	一般	大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
		大型株	目論見書等において、主として大型株に投資する旨の記載があるもの
		中小型株	目論見書等において、主として中小型株に投資する旨の記載があるもの
	債券	一般	公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのもの
		公債	目論見書等において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。）に主として投資する旨の記載があるもの
		社債	目論見書等において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるもの
		その他債券	目論見書等において、公債または社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

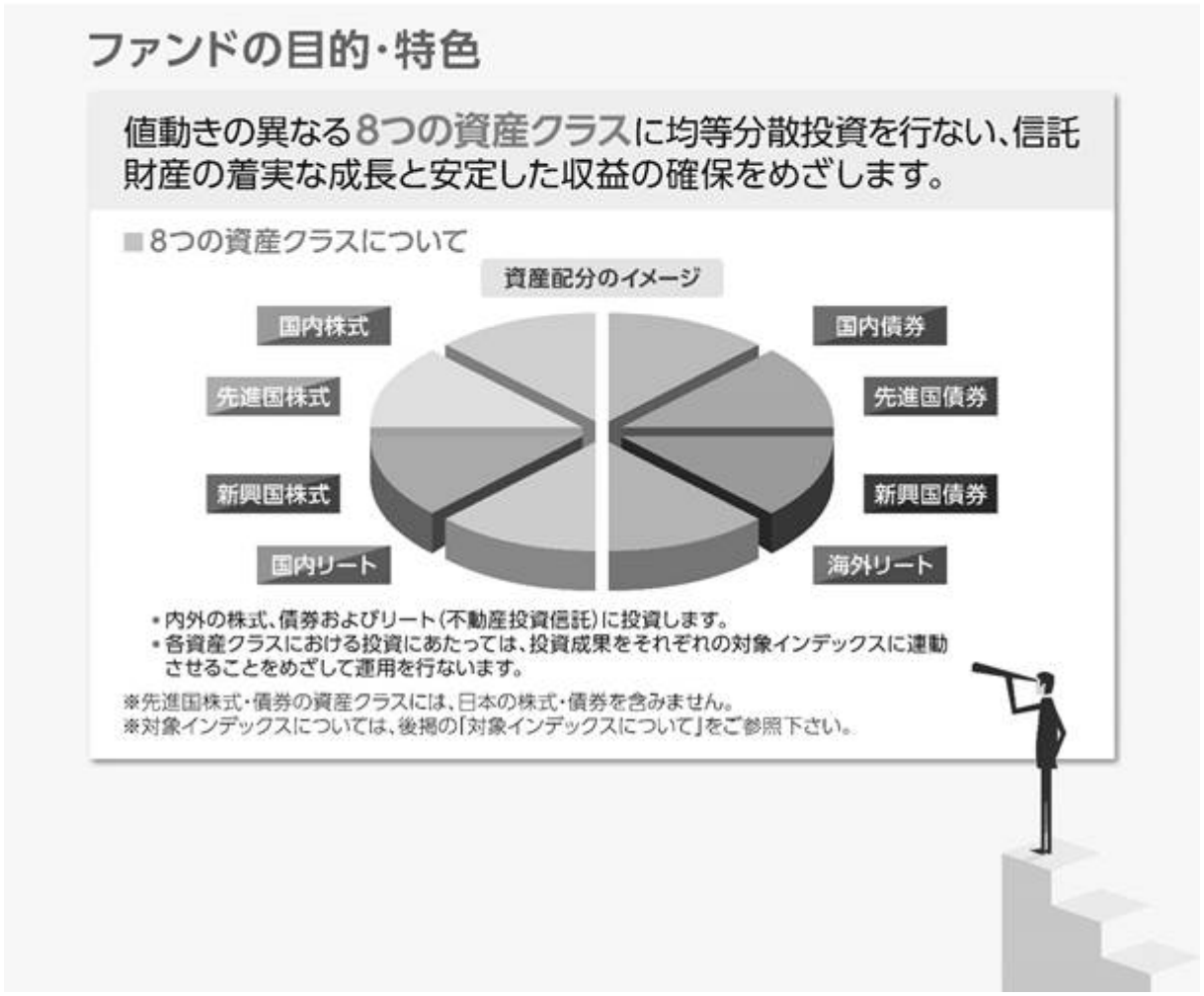
投資対象地域	グローバル	目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	日本	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	北米	目論見書等において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	欧州	目論見書等において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アジア	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	オセアニア	目論見書等において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中南米	目論見書等において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アフリカ	目論見書等において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中近東（中東）	目論見書等において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	エマージング	目論見書等において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるもの
投資形態	ファミリーファンド	目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの
	ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズ
為替ヘッジ	あり	目論見書等において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるもの
	なし	目論見書等において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの
対象インデックス	日経225	目論見書等において、日経225に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	ＴＯＰＩＸ	目論見書等において、ＴＯＰＩＸに連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	その他の指数	目論見書等において、上記以外の指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
特殊型	ブル・ベア型	目論見書等において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行なうとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）をめざす旨の記載があるもの
	条件付運用型	目論見書等において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるもの
	ロング・ショート型／絶対収益追求型	目論見書等において、ロング・ショート戦略により収益の追求をめざす旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求をめざす旨の記載があるもの
	その他型	目論見書等において、特殊型のうち上記に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

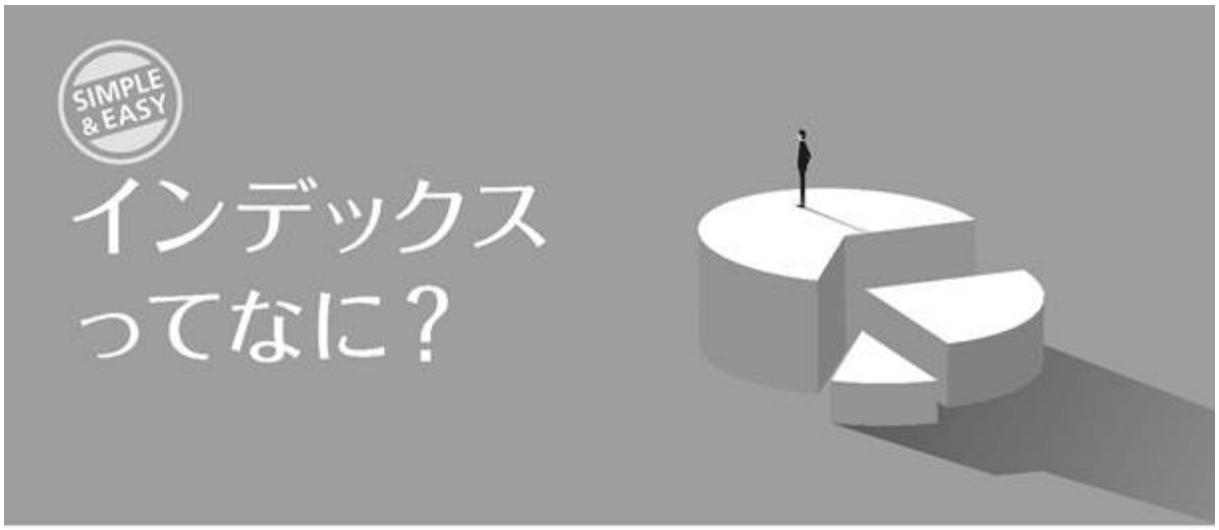
※商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、一般社団法人投資信託協会のホームページ（アドレスhttp://www.toushin.or.jp/）をご参照下さい。

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

＜ファンドの特色＞







「インデックス」とは

いうなれば「市場のモノサシ」です。
マーケット（市場）を構成する個々の価格データからマーケット全体の動向がわかるように情報会社等が計算したもので、「○○指数」「○○インデックス」などと呼ばれます。
インデックスの動きを確認することにより、マーケットのおおよその動きを読み取ることができます。

インデックス	マーケット
↗	☀
↘	☂

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

当ファンドの各資産クラスにおける対象インデックスは以下のとおりです。

■対象インデックスについて

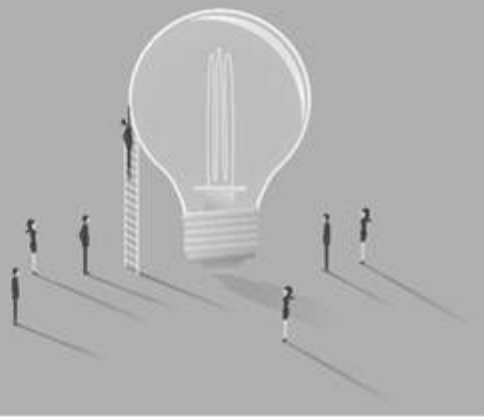
資産クラス	対象インデックス
国内株式	東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
先進国株式	MSCIコクサイ指数（配当込み、円ベース）
新興国株式	FTSE RAFI エマージング インデックス（円換算）
国内債券	NOMURA－BPI総合指数

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

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

FREE & LOW

費用はどれくらいかかるのかな？



ファンドへの投資にかかる主な費用は

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

当ファンドは、費用を低く抑えたファンドです。

※上記は主な費用であり、他にも費用・税金がかかります。

－Aさんの場合－

運用管理費用っていくらくらい？

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

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

※上記の運用管理費用は簡便に計算した概算値です。

■インデックスの概要について

●東証株価指数(TOPIX)

TOPIXは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。
配当込みTOPIXの指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社(以下「ＪＰＸ」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有します。
ＪＰＸは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、ＪＰＸにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもＪＰＸは責任を負いません。

●MSCIコクサイ指数

MSCIコクサイ指数は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。なお、MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)は、MSCIコクサイ指数(配当込み、米ドルベース)をもとに、MSCI Inc.の承諾を得て委託会社が計算したものです。
本ファンドは、ＭＳＣＩ Inc.([ＭＳＣＩ])によって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、ＭＳＣＩは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。
[https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html]

●FTSE RAFI エマージング インデックス

FTSE社(FTSE International Limited)による基準をクリアーした新興国の上場株式の中から、4つのファンダメンタル指標(株主資本、キャッシュフロー、売上、配当)に着目し、銘柄の選定およびウェイト付けを行なう指数です。なお、FTSE RAFI エマージング インデックス(円換算)は、FTSE RAFI エマージング インデックス(米ドルベース)をもとに、FTSE International Limitedの承諾を得て委託会社が計算したものです。

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

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

●NOMURA－BPI総合指数

NOMURA－BPIは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表わすために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。
NOMURA－BPIの知的財産権およびその他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当ファンドの設定の可否、運用成果等ならびに当ファンドおよび同指数に関連して行なわれる当社のサービス提供等の行為に関して一切責任を負いません。

●FTSE世界国債インデックス

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

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

JPモルガン社が算出し公表している債券指数で、新興国の政府が現地通貨建てで発行する債券で構成されています。米ドルベースの指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。外国人投資家に対して著しい不利益を与えうる制度等がある国は除外されています。国別構成比率に、1か国当たりの上限を設けており、分散が図られています。
JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P.Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P.Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016,J.P.Morgan Chase & Co. All rights reserved.

●東証REIT指数(配当込み)

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

●S&P先進国REIT指数

S&P先進国REIT指数は、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS&Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。
S&P先進国REIT指数(除く日本)(「当インデックス」)はS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社(「SPDJI」)の商品であり、これの使用ライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。S&P®、S&P 500®、US 500、The 500、iBoxx®、iTraxx®およびCDX®は、S&P Global, Inc.またはその関連会社(「S&P」)の商標です。Dow Jones®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC(「Dow Jones」)の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJIに付与されており、大和アセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスのいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。

ファンドの仕組みなど

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

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

分配方針

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

［分配方針］

①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。

②原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

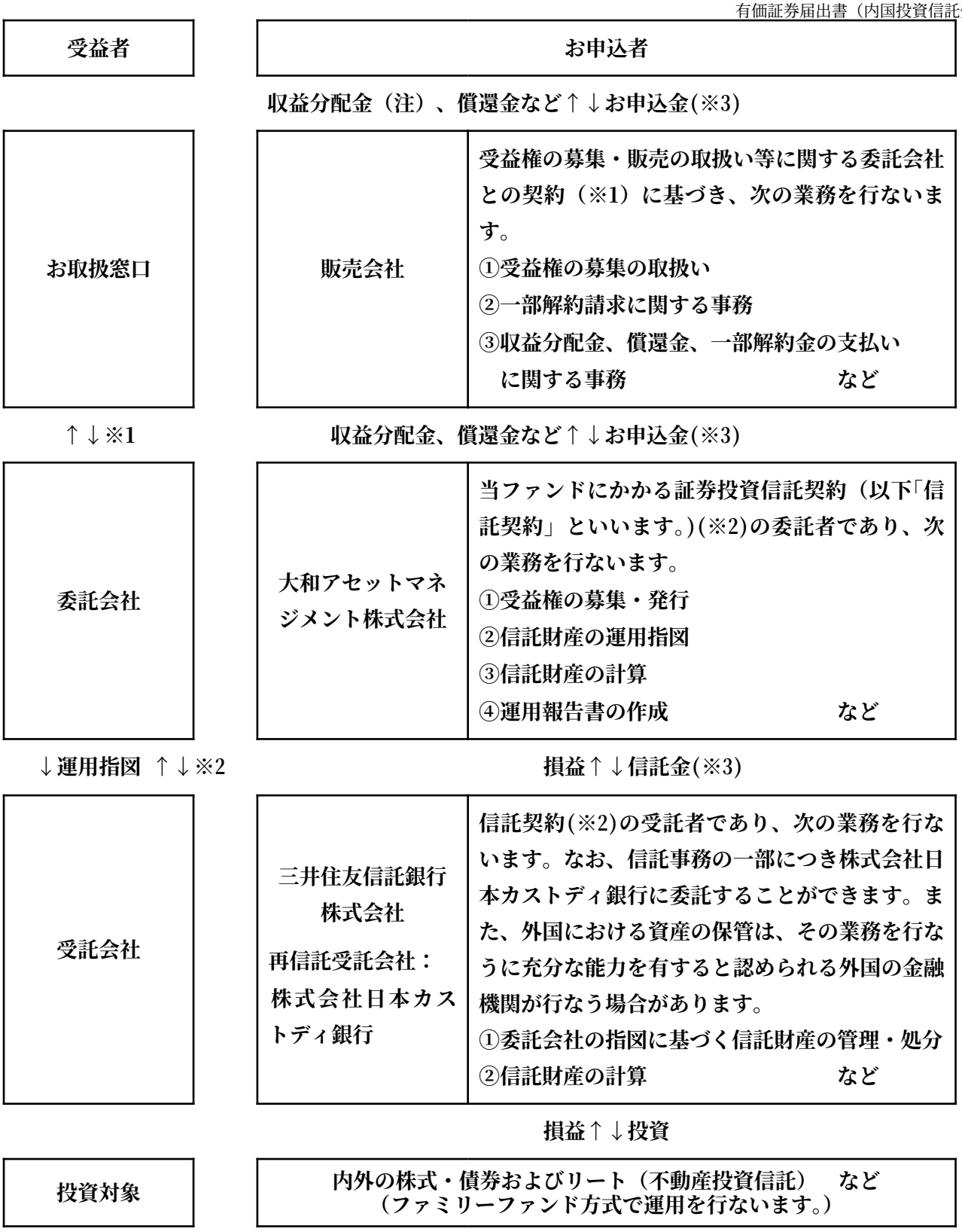
主な投資制限

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

(2)【ファンドの沿革】

2016年9月8日　　信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】



（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（2025年9月末日現在）＞

・資本金の額　414億2,454万1,896円

・沿革

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

・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

①　主要投資対象

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

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

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

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

② 投資態度

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

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

ロ．各資産クラスの配分比率については、均等とすることを目標とします。

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

ニ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

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

(2)【投資対象】

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

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

イ．有価証券

ロ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券

2．外国株式インデックスマザーファンドの受益証券

3．ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの受益証券

4．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券

5．外国債券インデックスマザーファンドの受益証券

6．ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券

7．ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの受益証券

8．ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの受益証券

9．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

10．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前9．の証券の性質を有するもの

11．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

1．預金

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

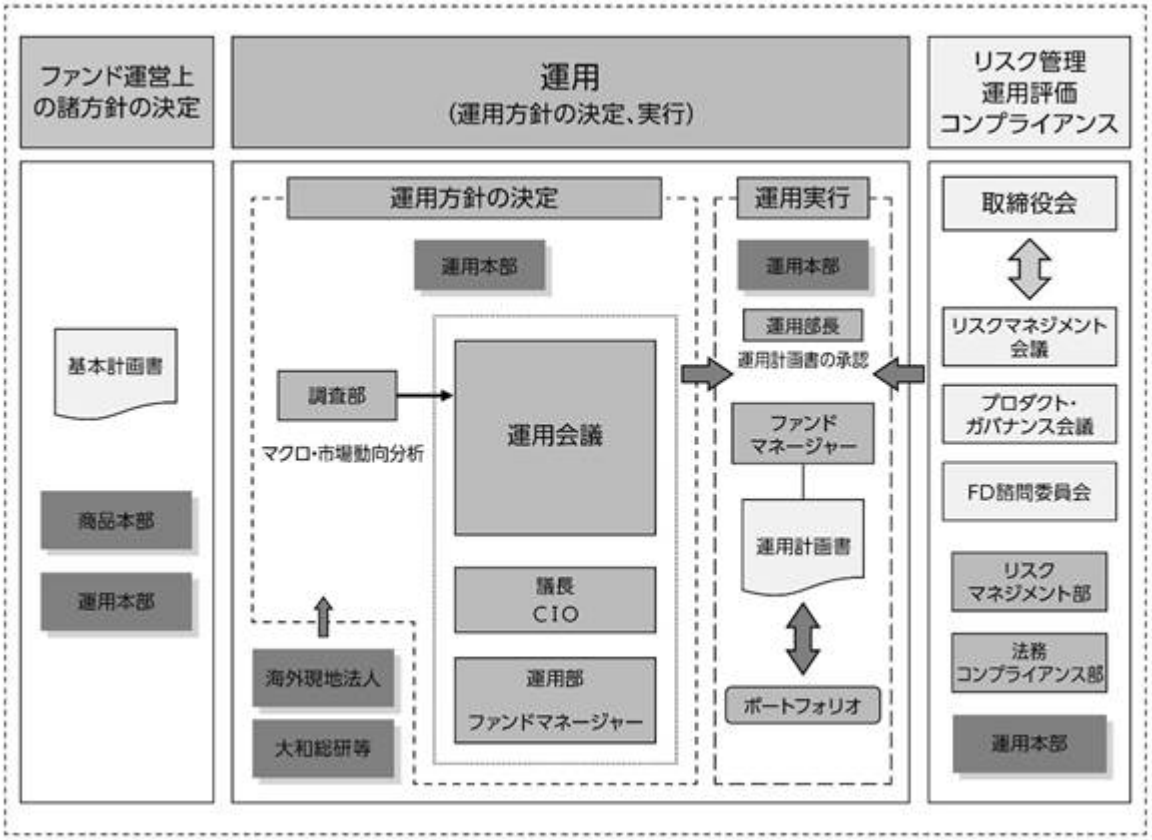
3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

(3)【運用体制】

①　運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を商品担当役員の決裁により決定します。

ロ．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

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

③ 職務権限

ファンド運用の意思決定機能を担う運用本部において、各職位の主たる職務権限は、社内規則によって、次のように定められています。

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

・基本的な運用方針の決定

・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

CIOおよびDeputy-CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④　リスクマネジメント会議、プロダクト・ガバナンス会議およびFD諮問委員会

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

イ．リスクマネジメント会議

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

ロ．プロダクト・ガバナンス会議

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

ハ．FD諮問委員会

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

⑤　受託会社に対する管理体制

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

※　上記の運用体制は2025年9月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

①　分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。

②　原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

③　留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

①　株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

②　外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

③　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

④　外国為替予約取引（信託約款）

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

⑤　信用リスク集中回避（信託約款）

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

⑥　資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜参考＞マザーファンドの概要

1．トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

①　投資対象

東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。

②　投資態度

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

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

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

ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

(2) 投資対象

①　委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）で市場性のあるものに投資することを指図します。

1．株券または新株引受権証書

2．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

②　委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

(3) 主な投資制限

①　株式

株式への投資には、制限を設けません。

②　先物取引等

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

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

③　スワップ取引

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

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

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

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

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

2．外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

外国の株式（預託証書を含みます。）を主要投資対象とします。

② 投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

① 委託会社は、信託金を、主として、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 外国通貨表示の株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

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

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

② 委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

(3) 主な投資制限

① 株式

株式への投資割合には、制限を設けません。

② 投資信託証券

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

③ 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

3. ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

次の有価証券を主要投資対象とします。

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

ロ．新興国の企業のＤＲ（預託証券）

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

② 投資態度

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

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

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

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

ニ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)④、⑤および⑥に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

①　株式

株式への投資割合には、制限を設けません。

②　投資信託証券

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

③　外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

④　先物取引等

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

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

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

⑤　スワップ取引

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

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

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

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

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

⑥　金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

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

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

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

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

4．ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

(1) 投資方針

①　主要投資対象

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

②　投資態度

イ．主としてわが国の公社債等に投資しベンチマーク（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数）の動きに連動する投資成果をめざします。

ロ．運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

(2) 投資対象

① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)④、⑤および⑥に定めるものに限ります。）

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

1. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

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

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

(3) 主な投資制限

①　株式

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②　投資信託証券

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③　外貨建資産

外貨建資産への投資は、行ないません。

④　先物取引等

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

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

⑤　スワップ取引

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

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

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

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

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

⑥　金利先渡取引

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

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

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

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

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

5．外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

②　投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

①　委託会社は、信託金を、主として、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10．コマーシャル・ペーパー

11．外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの

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

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

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

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

17．外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

19．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

21．外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

②　委託会社は、信託金を、前①に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

①　株式

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

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

② 投資信託証券

投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③ 同一銘柄の株式

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

④ 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

6. ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

新興国通貨建ての債券を主要投資対象とします。

② 投資態度

イ．主として、新興国通貨建ての債券に投資し、投資成果をJPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイド（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)④、⑤および⑥に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. 転換社債の転換、新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. コマーシャル・ペーパー
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
9. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
10. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
11. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
12. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
13. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
14. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
15. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
16. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
17. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
18. 外国の者に対する権利で前17.の有価証券の性質を有するもの

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

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

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

(3) 主な投資制限

① 株式

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

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

② 投資信託証券

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

③ 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

④ 先物取引等

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

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

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

⑤ スワップ取引

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

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

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

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

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

⑥ 金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

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

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

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

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

7．ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

(1) 投資方針

①　主要投資対象

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

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

②　投資態度

イ．「東証REIT指数」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

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

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

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

(2) 投資対象

① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)⑤に定めるものに限ります。）

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

3. 投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

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

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

なお、前2.の証券および前3.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

(3) 主な投資制限

① 株式

株式への直接投資は、行ないません。

② 投資信託証券

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

③ 同一銘柄の投資信託証券

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

④ 外貨建資産

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

⑤ 先物取引

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

8. ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

(1) 投資方針

① 主要投資対象

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

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

② 投資態度

イ．主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券に投資し、ベンチマーク（Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース）をいいます。以下同じ。）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

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

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

ニ．保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)⑤に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

(3) 主な投資制限

①　株式への直接投資は、行ないません。

②　投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

③　同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、「投資態度」で定めた指数における時価の構成割合が30%を超える場合には、当該指数における構成割合の範囲で組入れることができるものとします。

④　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

⑤　先物取引

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

3【投資リスク】

(1)価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

①　株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

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

② 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

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

③ リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

・リートには資産規模が小さく、流動性が低いものもあります。このようなリートへの投資は、流動性の高い株式等に比べ、より制約を受けることが考えられます。

・金利の上昇局面においては、他の、より利回りの高い債券等との比較でリートに対する投資価値が相対的に低下し、価格が下落することも想定されます。

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

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

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

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

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

・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リートの価格や配当が影響を受けることが考えられます。

・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。

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

④　外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

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

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

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

⑤　その他

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

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

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

①　金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の

受渡しに関する障害等）が発生した場合には、お買付け、ご換金の申込みの受付けを中止すること、すでに受付けたお買付けの申込みを取消すことがあります。

② ご換金の申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

(3)その他の留意点

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

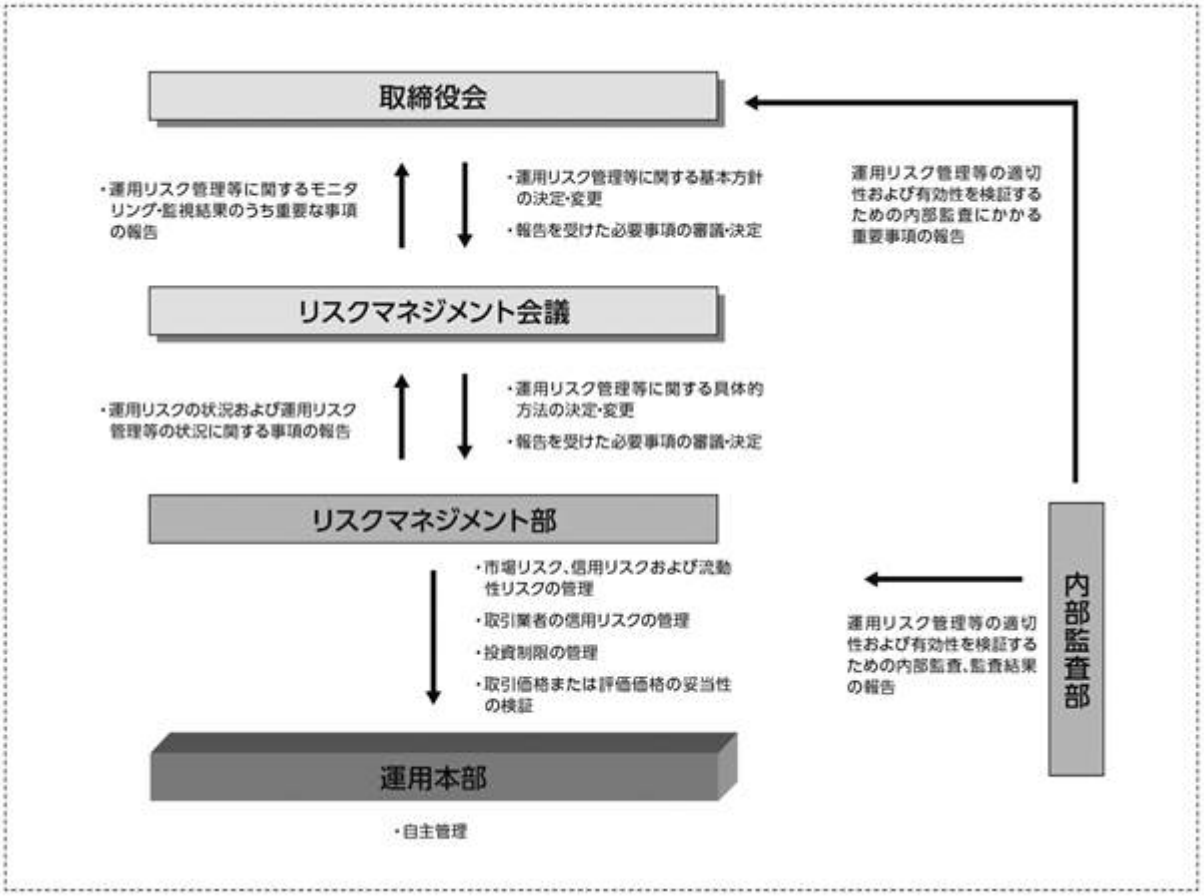
※ 流動性リスクに関する事項

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

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

(4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※ 流動性リスクに対する管理体制

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

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

参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

(2)【換金（解約）手数料】

① 換金手数料
ありません。

② 信託財産留保額
ありません。

(3)【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.242%（税抜0.22%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

② 信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

③ 信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分については、次のとおりです。

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

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

(4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

① 個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

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

当ファンドは、ＮＩＳＡの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」および「つみたて投資枠（特定累積投資勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

②　法人の投資者に対する課税

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

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

③　受益者が、確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、前②にかかわらず所得税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

＜注1＞個別元本について

①　投資者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。

②　投資者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

③　投資者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

④　個別元本について、詳しくは販売会社にお問合せ下さい。

＜注2＞収益分配金の課税について

①　追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（投資者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

②　投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

（※）外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

（※）上記は、2025年9月末日現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

（※）課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】（2025年9月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		102,606,279,309	99.00
	内 日本	102,606,279,309	99.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,031,337,727	1.00
純資産総額		103,637,617,036	100.00

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

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

(2)【投資資産】（2025年9月30日現在）

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	5,563,325,660	2.3397 13,016,513,063	2.3611 13,135,568,215	12.67
2	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	3,877,959,010	3.2419 12,571,955,963	3.3807 13,110,216,025	12.65
3	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,654,073,081	7.6457 12,646,546,558	7.8609 13,002,503,082	12.55
4	ダイワJ－REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	3,381,995,867	3.7100 12,547,264,333	3.7654 12,734,567,237	12.29
5	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	6,109,073,381	2.0613 12,592,654,880	2.0823 12,720,923,501	12.27
6	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	3,090,231,364	4.1087 12,696,925,509	4.1155 12,717,847,178	12.27

7	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	3,310,759,866	3.8151 12,631,065,597	3.8259 12,666,636,171	12.22
8	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	日本	親投資信託受益証券	10,930,857,405	1.1454 12,521,275,096	1.1452 12,518,017,900	12.08

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.00%
合計	99.00%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

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

第6計算期間末 (2022年9月7日)	45,579,049,607	45,579,049,607	1.5066	1.5066
第7計算期間末 (2023年9月7日)	60,624,212,803	60,624,212,803	1.6324	1.6324
第8計算期間末 (2024年9月9日)	76,283,161,440	76,283,161,440	1.7547	1.7547
2024年9月末日	79,925,821,039	－	1.8135	－
10月末日	83,274,905,219	－	1.8635	－
11月末日	83,010,731,036	－	1.8339	－
12月末日	85,632,832,803	－	1.8733	－
2025年1月末日	86,739,613,541	－	1.8697	－
2月末日	86,301,851,254	－	1.8380	－
3月末日	86,930,678,613	－	1.8270	－
4月末日	86,143,942,091	－	1.7883	－
5月末日	90,428,744,297	－	1.8479	－
6月末日	93,738,488,578	－	1.8947	－
7月末日	97,866,137,929	－	1.9562	－
8月末日	100,226,915,250	－	1.9798	－
第9計算期間末 (2025年9月8日)	101,431,793,489	101,431,793,489	2.0000	2.0000
9月末日	103,637,617,036	－	2.0269	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	11.8
第2計算期間	2.3
第3計算期間	5.8

第4計算期間	△1.4
第5計算期間	22.7
第6計算期間	2.8
第7計算期間	8.3
第8計算期間	7.5
第9計算期間	14.0

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	5,119,041,794	1,173,761,616
第2計算期間	5,936,562,291	1,810,640,911
第3計算期間	6,888,328,647	2,057,961,207
第4計算期間	9,224,765,978	3,298,328,374
第5計算期間	8,347,815,842	3,601,501,893
第6計算期間	9,073,700,420	2,405,303,826
第7計算期間	9,706,776,681	2,820,662,222
第8計算期間	10,741,153,643	4,406,740,422
第9計算期間	11,116,436,322	3,874,421,453

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

（参考）マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（2025年9月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		501,622,811,620	97.53
	内 日本	501,622,811,620	97.53
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		12,694,597,231	2.47
純資産総額		514,317,408,851	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)		12,626,820,000	2.46
	内 日本	12,626,820,000	2.46

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

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

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

(2) 投資資産（2025年9月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	ﾄﾖﾀ自動車	日本	株式	輸送用機器	6,014,300	2,922.94 17,579,476,454	2,849.50 17,137,747,850	3.33
2	三菱UFJﾌｨﾅﾝｼｬﾙG	日本	株式	銀行業	7,147,800	2,341.48 16,736,471,531	2,394.00 17,111,833,200	3.33
3	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	3,902,800	3,431.71 13,393,280,619	4,259.00 16,622,025,200	3.23
4	日 立	日本	株式	電気機器	2,906,800	3,863.05 11,229,133,970	3,930.00 11,423,724,000	2.22
5	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報･通信業	559,700	18,375.59 10,284,820,455	18,685.00 10,457,994,500	2.03
6	三井住友ﾌｨﾅﾝｼｬﾙG	日本	株式	銀行業	2,284,500	4,147.00 9,473,821,500	4,176.00 9,540,072,000	1.85
7	任 天 堂	日本	株式	その他製品	714,300	12,800.00 9,143,040,427	12,805.00 9,146,611,500	1.78
8	三菱商事	日本	株式	卸売業	2,212,200	3,570.94 7,899,642,657	3,531.00 7,811,278,200	1.52
9	三菱重工業	日本	株式	機械	1,998,200	3,698.22 7,389,797,980	3,879.00 7,751,017,800	1.51
10	みずほﾌｨﾅﾝｼｬﾙG	日本	株式	銀行業	1,488,900	4,844.07 7,212,345,960	4,988.00 7,426,633,200	1.44
11	ﾘｸﾙｰﾄﾎｰﾙﾃﾞｨﾝｸﾞｽ	日本	株式	サービス業	860,200	7,930.02 6,821,409,742	7,963.00 6,849,772,600	1.33
12	伊 藤 忠	日本	株式	卸売業	804,600	8,699.74 6,999,813,120	8,426.00 6,779,559,600	1.32
13	東京海上HD	日本	株式	保険業	1,063,700	6,325.76 6,728,715,719	6,269.00 6,668,335,300	1.30
14	三井物産	日本	株式	卸売業	1,720,900	3,723.98 6,408,599,524	3,680.00 6,332,912,000	1.23
15	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	239,400	25,610.74 6,131,213,254	26,360.00 6,310,584,000	1.23

16	キーエンス	日本	株式	電気機器	113,200	55,728.66 6,308,485,260	55,180.00 6,246,376,000	1.21
17	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	356,600	15,020.14 5,356,182,292	14,650.00 5,224,190,000	1.02
18	NTT	日本	株式	情報・通信業	33,751,800	157.99 5,332,696,599	154.70 5,221,403,460	1.02
19	信越化学	日本	株式	化学	1,007,800	4,632.14 4,668,275,830	4,853.00 4,890,853,400	0.95
20	HOYA	日本	株式	精密機器	217,800	20,499.76 4,464,849,294	20,475.00 4,459,455,000	0.87
21	三菱電機	日本	株式	電気機器	1,162,300	3,791.94 4,407,381,816	3,803.00 4,420,226,900	0.86
22	武田薬品	日本	株式	医薬品	1,009,700	4,477.78 4,521,219,020	4,315.00 4,356,855,500	0.85
23	本田技研	日本	株式	輸送用機器	2,680,600	1,630.93 4,371,877,889	1,531.00 4,103,998,600	0.80
24	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	18,227,200	228.88 4,171,885,032	217.70 3,968,061,440	0.77
25	日本電気	日本	株式	電気機器	808,100	4,684.90 3,785,868,598	4,739.00 3,829,585,900	0.74
26	KDDI	日本	株式	情報・通信業	1,594,600	2,469.41 3,937,730,476	2,360.50 3,764,053,300	0.73
27	富士通	日本	株式	電気機器	1,051,500	3,664.81 3,853,554,087	3,484.00 3,663,426,000	0.71
28	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	80,800	45,719.59 3,694,143,218	45,040.00 3,639,232,000	0.71
29	丸紅	日本	株式	卸売業	983,700	3,616.00 3,557,067,370	3,698.00 3,637,722,600	0.71
30	第一三共	日本	株式	医薬品	1,041,900	3,542.76 3,691,203,860	3,315.00 3,453,898,500	0.67

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.53%
合計	97.53%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

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

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	日本	TOPIX　先物 0712月	買建	402	12,612,061,150	12,626,820,000	2.46%

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

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

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

(1) 投資状況（2025年9月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資証券		244,365,627,250	95.80
	内 日本	244,365,627,250	95.80
コール･ローン、その他の資産（負債控除後）		10,711,531,123	4.20
純資産総額		255,077,158,373	100.00

その他の資産の投資状況

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

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

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

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

(2) 投資資産（2025年9月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	129,585	143,899.13 18,647,169,483	139,500.00 18,077,107,500	7.09
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	112,188	131,298.13 14,730,075,568	124,500.00 13,967,406,000	5.48
3	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	113,426	116,599.20 13,225,381,211	113,700.00 12,896,536,200	5.06
4	野村不動産マスターF	日本	投資証券	69,607	164,998.36 11,485,041,197	160,400.00 11,164,962,800	4.38
5	KDX不動産投資法人	日本	投資証券	63,695	171,798.60 10,942,712,411	168,500.00 10,732,607,500	4.21
6	GLP投資法人	日本	投資証券	71,874	136,599.80 9,817,974,435	136,500.00 9,810,801,000	3.85
7	日本プロロジスリート	日本	投資証券	112,447	86,000.39 9,670,486,100	86,400.00 9,715,420,800	3.81
8	オリックス不動産投資	日本	投資証券	87,047	101,300.40 8,817,896,053	100,200.00 8,722,109,400	3.42
9	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	68,769	129,098.59 8,877,981,262	126,000.00 8,664,894,000	3.40
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	48,295	182,598.92 8,818,615,051	179,400.00 8,664,123,000	3.40
11	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	120,579	67,400.16 8,127,044,611	67,400.00 8,127,024,600	3.19
12	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	44,979	168,001.47 7,556,538,213	166,100.00 7,471,011,900	2.93
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	80,376	88,999.64 7,153,435,647	89,200.00 7,169,539,200	2.81
14	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	59,073	106,199.65 6,273,532,033	103,100.00 6,090,426,300	2.39
15	産業ファンド	日本	投資証券	39,994	130,004.74 5,199,409,881	135,800.00 5,431,185,200	2.13
16	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	65,248	81,598.96 5,324,169,503	79,600.00 5,193,740,800	2.04
17	三井不ロジパーク	日本	投資証券	48,234	109,898.38 5,300,838,706	106,300.00 5,127,274,200	2.01
18	三井不動産アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	37,712	129,902.92 4,898,898,922	132,000.00 4,977,984,000	1.95

19	ＡＰＩ投資法人	日本	投資証券	33,726	138,098.10 4,657,496,733	134,600.00 4,539,519,600	1.78
20	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	43,305	98,001.12 4,243,938,867	97,800.00 4,235,229,000	1.66
21	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	28,318	142,101.72 4,024,036,518	143,500.00 4,063,633,000	1.59
22	森ヒルズリート	日本	投資証券	25,283	141,401.75 3,575,060,640	143,000.00 3,615,469,000	1.42
23	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	11,075	325,005.11 3,599,431,695	325,000.00 3,599,375,000	1.41
24	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	32,262	110,001.10 3,548,855,771	107,400.00 3,464,938,800	1.36
25	イオンリート投資	日本	投資証券	26,525	134,597.47 3,570,197,910	129,700.00 3,440,292,500	1.35
26	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	38,390	90,500.24 3,474,304,473	89,300.00 3,428,227,000	1.34
27	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	19,302	168,601.20 3,254,340,424	169,500.00 3,271,689,000	1.28
28	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	8,924	376,496.56 3,359,855,337	365,000.00 3,257,260,000	1.28
29	森トラストリート投資法人	日本	投資証券	42,104	76,400.24 3,216,755,919	75,800.00 3,191,483,200	1.25
30	NTT都市開発リート投資法人	日本	投資証券	21,995	137,500.80 3,024,330,174	136,000.00 2,991,320,000	1.17

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	95.80%
合計	95.80%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
不動産投信指数先物取引	日本	TREIT　先物 0712月	買建	5,600	10,866,800,000	10,710,000,000	4.20%

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

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

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

(1) 投資状況（2025年9月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		94,467,755,130	84.65
	内 日本	94,467,755,130	84.65
地方債証券		5,056,833,974	4.53
	内 日本	5,056,833,974	4.53
特殊債券		4,502,923,006	4.03
	内 日本	4,502,923,006	4.03
社債券		7,162,768,100	6.42
	内 日本	7,162,768,100	6.42
コール･ローン、その他の資産（負債控除後）		408,221,312	0.37
純資産総額		111,598,501,522	100.00

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

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

(2) 投資資産（2025年9月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率 (%)
1	158 5年国債	日本	国債証券	2,050,000,000	98.18 2,012,690,900	97.89 2,006,806,500	0.100000 2028/03/20	1.80
2	154 5年国債	日本	国債証券	1,900,000,000	98.55 1,872,561,600	98.39 1,869,486,000	0.100000 2027/09/20	1.68

3	156 5年国債	日本	国債証券	1,870,000,000	98.63 1,844,447,600	98.38 1,839,706,000	0.200000 2027/12/20	1.65
4	163 5年国債	日本	国債証券	1,810,000,000	98.89 1,789,949,000	98.18 1,777,130,400	0.400000 2028/09/20	1.59
5	169 5年国債	日本	国債証券	1,800,000,000	98.54 1,773,833,000	98.01 1,764,234,000	0.500000 2029/03/20	1.58
6	153 5年国債	日本	国債証券	1,520,000,000	98.47 1,496,758,500	98.46 1,496,728,800	0.005000 2027/06/20	1.34
7	360 10年国債	日本	国債証券	1,530,000,000	96.13 1,470,899,200	94.55 1,446,645,600	0.100000 2030/09/20	1.30
8	150 5年国債	日本	国債証券	1,450,000,000	98.79 1,432,556,500	99.00 1,435,558,000	0.005000 2026/12/20	1.29
9	362 10年国債	日本	国債証券	1,530,000,000	95.89 1,467,234,400	93.80 1,435,201,200	0.100000 2031/03/20	1.29
10	366 10年国債	日本	国債証券	1,500,000,000	95.22 1,428,418,900	92.83 1,392,450,000	0.200000 2032/03/20	1.25
11	369 10年国債	日本	国債証券	1,370,000,000	96.75 1,325,521,400	93.63 1,282,840,600	0.500000 2032/12/20	1.15
12	358 10年国債	日本	国債証券	1,280,000,000	96.48 1,235,030,200	95.23 1,219,020,800	0.100000 2030/03/20	1.09
13	368 10年国債	日本	国債証券	1,300,000,000	94.05 1,222,673,000	91.99 1,195,987,000	0.200000 2032/09/20	1.07
14	361 10年国債	日本	国債証券	1,250,000,000	95.96 1,199,582,900	94.18 1,177,250,000	0.100000 2030/12/20	1.05
15	373 10年国債	日本	国債証券	1,260,000,000	96.76 1,219,190,600	92.97 1,171,447,200	0.600000 2033/12/20	1.05
16	164 5年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	98.05 1,176,612,000	97.30 1,167,684,000	0.200000 2028/12/20	1.05
17	370 10年国債	日本	国債証券	1,250,000,000	96.55 1,206,950,000	93.28 1,166,075,000	0.500000 2033/03/20	1.04
18	178 5年国債	日本	国債証券	1,175,000,000	99.89 1,173,785,450	99.13 1,164,789,250	1.000000 2030/03/20	1.04
19	367 10年国債	日本	国債証券	1,250,000,000	95.10 1,188,852,500	92.43 1,155,400,000	0.200000 2032/06/20	1.04
20	372 10年国債	日本	国債証券	1,180,000,000	98.21 1,158,951,500	94.81 1,118,805,200	0.800000 2033/09/20	1.00
21	371 10年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	95.52 1,146,252,900	92.19 1,106,388,000	0.400000 2033/06/20	0.99
22	374 10年国債	日本	国債証券	1,170,000,000	98.17 1,148,625,800	94.17 1,101,847,500	0.800000 2034/03/20	0.99

23	365 10年国債	日本	国債証券	1,180,000,000	94.79 1,118,574,600	92.61 1,092,857,000	0.100000 2031/12/20	0.98
24	359 10年国債	日本	国債証券	1,060,000,000	96.43 1,022,191,400	94.87 1,005,685,600	0.100000 2030/06/20	0.90
25	377 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	98.12 981,208,900	96.59 965,920,000	1.200000 2034/12/20	0.87
26	378 10年国債	日本	国債証券	950,000,000	99.54 945,685,550	98.11 932,073,500	1.400000 2035/03/20	0.84
27	364 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	95.25 952,588,500	93.01 930,170,000	0.100000 2031/09/20	0.83
28	174 5年国債	日本	国債証券	920,000,000	98.93 910,161,800	98.25 903,936,800	0.700000 2029/09/20	0.81
29	376 10年国債	日本	国債証券	858,000,000	97.02 832,439,880	94.32 809,299,920	0.900000 2034/09/20	0.73
30	17 40年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	89.84 943,387,200	76.67 805,098,000	2.200000 2064/03/20	0.72

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（2025年9月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		46,948,093,587	84.53
	内 中国	19,473,090,835	35.06
	内 台湾	8,303,533,642	14.95
	内 タイ	1,202,271,077	2.16
	内 マレーシア	239,426,354	0.43
	内 インドネシア	499,813,371	0.90
	内 インド	5,546,163,731	9.99
	内 サウジアラビア	981,333,358	1.77
	内 トルコ	786,980,179	1.42
	内 カナダ	35,557,755	0.06
	内 メキシコ	1,278,953,835	2.30
	内 チリ	141,615,174	0.25
	内 ブラジル	6,470,359,764	11.65
	内 南アフリカ	1,988,994,512	3.58
投資証券		5,052,250,988	9.10
	内 アメリカ	5,052,250,988	9.10
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,541,301,433	6.38
純資産総額		55,541,646,008	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）		3,026,655,960	5.45
	内 アメリカ	3,026,655,960	5.45
為替予約取引（買建）		14,875,200	0.03
	内 日本	14,875,200	0.03

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

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

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

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

(2) 投資資産（2025年9月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	アメリカ	投資証券	―	1,335,500	3,564.78 4,760,781,541	3,783.04 5,052,250,988	9.10
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技術	428,000	5,303.58 2,269,935,878	6,354.53 2,719,738,840	4.90
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	中国	株式	一般消費財･サービス	534,800	2,010.56 1,075,249,092	3,317.14 1,774,007,542	3.19
4	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	株式	コミュニケーション･サービス	102,500	9,503.78 974,137,860	12,625.80 1,294,144,500	2.33
5	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	株式	金融	8,592,000	157.05 1,349,436,322	143.09 1,229,449,901	2.21
6	VALE SA	ブラジル	株式	素材	755,090	1,543.37 1,165,387,361	1,601.53 1,209,300,508	2.18
7	IND & COMM BK OF CHINA-H	中国	株式	金融	10,101,000	117.26 1,184,512,957	109.61 1,107,220,105	1.99
8	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	999,902	786.98 786,906,976	1,072.93 1,072,832,802	1.93
9	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	株式	金融	879,500	957.45 842,082,992	1,023.45 900,128,673	1.62
10	BANK OF CHINA LTD-H	中国	株式	金融	8,967,000	87.61 785,647,292	80.91 725,608,743	1.31
11	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	ブラジル	株式	エネルギー	783,300	898.06 703,454,756	889.39 696,665,498	1.25
12	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	ブラジル	株式	金融	584,519	1,054.91 616,620,480	1,087.35 635,578,332	1.14
13	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	株式	エネルギー	260,907	2,581.13 673,436,711	2,320.03 605,312,589	1.09
14	BANCO BRADESCO SA-PREF	ブラジル	株式	金融	1,085,759	466.08 506,059,457	498.80 541,577,727	0.98
15	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	ブラジル	株式	エネルギー	539,700	982.78 530,408,231	959.57 517,883,655	0.93
16	BAIDU INC-CLASS A	中国	株式	コミュニケーション･サービス	203,300	1,643.26 334,076,181	2,515.59 511,420,464	0.92

17	HDFC BANK LIMITED	インド	株式	金融	315,618	1,680.95 530,540,760	1,606.00 506,884,717	0.91
18	JD.COM INC - CL A	中国	株式	一般消費財･サービス	192,895	2,375.94 458,308,104	2,613.15 504,065,112	0.91
19	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国	株式	エネルギー	5,521,800	79.96 441,541,902	78.43 433,091,339	0.78
20	PETROCHINA CO LTD-H	中国	株式	エネルギー	2,884,000	130.27 375,713,965	139.26 401,644,298	0.72
21	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	中国	株式	金融	3,741,000	108.84 407,206,728	100.62 376,433,636	0.68
22	MEDIATEK INC	台湾	株式	情報技術	52,003	6,305.64 327,912,665	6,403.41 332,996,582	0.60
23	SIBANYE STILLWATER LTD	南アフリカ	株式	素材	734,423	301.18 221,195,576	427.29 313,814,101	0.57
24	DELTA ELECTRONICS INC	台湾	株式	情報技術	73,000	2,233.86 163,071,904	4,145.10 302,592,942	0.54
25	CHINA MERCHANTS BANK-H	中国	株式	金融	315,500	992.84 313,243,229	894.13 282,099,971	0.51
26	ICICI BANK LTD	インド	株式	金融	120,003	2,438.33 292,607,155	2,278.28 273,401,515	0.49
27	XIAOMI CORP-CLASS B	中国	株式	情報技術	259,000	1,099.97 284,893,525	1,024.41 265,322,579	0.48
28	AMERICA MOVIL L	メキシコ	株式	コミュニケーション･サービス	1,654,100	137.62 227,646,829	154.96 256,320,414	0.46
29	INFOSYS LTD	インド	株式	情報技術	98,020	2,772.78 271,788,190	2,436.64 238,839,649	0.43
30	UNITED MICROELECTRONICS CORP	台湾	株式	情報技術	1,073,000	213.85 229,465,744	219.23 235,235,169	0.42

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

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

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	アメリカ	MSCI EMER MKT INDEX (ICE) DEC 25	買建	300	3,018,147,468	3,026,655,960	5.45%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2025年10月	買建	100,000	14,668,220	14,875,200	0.03%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2025年9月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		778,726,675,903	94.80
	内 香港	4,186,190,370	0.51
	内 シンガポール	3,584,086,073	0.44
	内 イスラエル	2,242,706,943	0.27
	内 ノルウェー	1,282,399,741	0.16
	内 スウェーデン	7,674,488,806	0.93
	内 デンマーク	4,018,580,851	0.49
	内 イギリス	29,038,637,121	3.53
	内 アイルランド	881,156,448	0.11
	内 オランダ	9,852,031,890	1.20
	内 ベルギー	2,096,129,155	0.26
	内 フランス	21,480,347,038	2.61
	内 ドイツ	19,610,227,818	2.39
	内 スイス	17,799,888,819	2.17
	内 ポルトガル	425,484,583	0.05
	内 スペイン	7,164,244,295	0.87
	内 イタリア	6,409,993,053	0.78
	内 フィンランド	2,142,039,176	0.26
	内 オーストリア	441,789,562	0.05
	内 カナダ	25,677,179,122	3.13
	内 アメリカ	600,354,869,248	73.08
	内 オーストラリア	11,982,561,067	1.46
	内 ニュージーランド	381,644,724	0.05
投資証券		13,339,360,692	1.62
	内 香港	206,191,251	0.03
	内 シンガポール	203,989,647	0.02
	内 イギリス	170,146,641	0.02
	内 フランス	298,370,380	0.04
	内 アメリカ	11,376,564,362	1.38
	内 オーストラリア	1,084,098,411	0.13
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		29,409,179,199	3.58
純資産総額		821,475,215,794	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）	30,358,871,002	3.70

	内 イギリス	1,739,834,263	0.21
	内 ドイツ	5,754,413,302	0.70
	内 カナダ	2,874,356,602	0.35
	内 アメリカ	18,640,784,662	2.27
	内 オーストラリア	1,349,482,173	0.16
為替予約取引(買建)		14,166,808,430	1.72
	内 日本	14,166,808,430	1.72

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

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

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

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

(2) 投資資産（2025年9月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	1,723,100	20,753.42 35,760,378,545	27,073.82 46,650,913,027	5.68
2	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	1,054,800	35,150.41 37,076,784,140	37,879.53 39,955,337,104	4.86
3	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	498,700	63,532.75 31,683,829,906	76,613.64 38,207,226,258	4.65
4	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	674,100	31,091.65 20,958,940,354	33,076.66 22,296,982,977	2.71
5	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	153,200	86,844.68 13,304,619,811	110,677.39 16,955,776,454	2.06
6	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	315,220	25,347.56 7,990,080,466	48,817.75 15,388,331,785	1.87
7	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	410,600	25,332.82 10,401,688,640	36,334.16 14,918,807,738	1.82

8	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	204,550	51,030.40 10,438,294,957	65,985.10 13,497,253,187	1.64
9	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	346,540	25,529.49 8,846,994,143	36,380.31 12,607,234,984	1.53
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	196,070	37,488.28 7,350,352,604	46,999.92 9,215,275,726	1.12
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	95,650	72,173.30 6,903,384,860	74,328.34 7,109,505,721	0.87
12	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	56,885	118,628.62 6,748,189,928	108,162.80 6,152,841,379	0.75
13	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	120,750	47,625.37 5,750,773,914	50,643.02 6,115,144,762	0.74
14	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	30,090	134,993.81 4,061,966,125	179,610.32 5,404,474,553	0.66
15	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	304,009	17,496.22 5,319,025,583	17,005.07 5,169,695,420	0.63
16	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	60,500	80,266.56 4,856,129,578	84,584.68 5,117,373,334	0.62
17	ORACLE CORP	アメリカ	株式	情報技術	119,533	27,717.58 3,313,181,880	42,097.30 5,032,017,613	0.61
18	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需品	309,600	13,833.78 4,282,983,264	15,346.55 4,751,292,004	0.58
19	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	169,800	23,222.74 3,943,226,747	27,039.58 4,591,321,635	0.56
20	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	31,360	145,056.91 4,548,987,130	136,503.60 4,280,753,072	0.52
21	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	アメリカ	株式	情報技術	160,100	11,732.04 1,878,304,620	26,628.67 4,263,251,156	0.52
22	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	70,250	63,334.29 4,449,242,250	60,564.38 4,254,647,976	0.52
23	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	124,672	27,450.79 3,422,358,895	33,224.06 4,142,110,108	0.50
24	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	504,601	7,041.72 3,553,334,519	7,804.28 3,938,052,336	0.48

25	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	27,134	114,763.05 3,113,981,934	144,024.98 3,907,973,943	0.48
26	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	165,467	26,512.55 4,386,970,349	22,857.54 3,782,169,630	0.46
27	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	64,066	88,161.82 5,648,180,438	51,390.39 3,292,377,264	0.40
28	GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財・サービス	75,306	27,800.21 2,093,530,157	43,715.63 3,292,049,564	0.40
29	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	138,318	23,643.93 3,270,393,712	23,240.16 3,214,533,557	0.39
30	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	227,122	11,366.24 2,581,541,346	12,602.69 2,862,348,612	0.35

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

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

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 EMINI DEC 25	買建	373	18,556,166,228	18,640,784,662	2.27%
	イギリス	FTSE 100 INDEX DEC 25	買建	93	1,731,809,034	1,739,834,263	0.21%
	オーストラリア	SPI 200 DEC 25	買建	62	1,352,561,205	1,349,482,173	0.16%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX DEC 25	買建	76	2,829,805,708	2,874,356,602	0.35%
	ドイツ	SWISS MKT IX DEC 25	買建	75	1,694,896,748	1,682,876,700	0.20%
		EURO STOXX 50 DEC 25	買建	422	4,017,556,805	4,071,536,602	0.50%
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2025年10月	買建	4,000,000	794,981,810	798,870,800	0.10%
		カナダ・ドル買/円売 2025年10月	買建	14,700,000	1,573,514,490	1,570,925,790	0.19%
		スイス・フラン買/円売 2025年10月	買建	5,700,000	1,050,899,130	1,063,270,590	0.13%
		ユーロ買/円売 2025年10月	買建	8,900,000	1,537,367,110	1,552,284,600	0.19%
		豪ドル買/円売 2025年10月	買建	5,500,000	529,028,190	538,035,850	0.07%
		米ドル買/円売 2025年10月	買建	58,100,000	8,592,243,070	8,643,420,800	1.05%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（2025年9月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券		749,891,588	1.40
	内 アメリカ	749,891,588	1.40
投資証券		51,471,497,626	96.02
	内 ガーンジィ	70,574,896	0.13
	内 韓国	111,489,646	0.21
	内 香港	509,390,414	0.95
	内 シンガポール	1,794,702,794	3.35
	内 イスラエル	89,723,649	0.17
	内 イギリス	2,023,119,529	3.77
	内 アイルランド	18,041,350	0.03
	内 オランダ	77,627,783	0.14
	内 ベルギー	499,824,158	0.93
	内 フランス	1,035,072,548	1.93
	内 ドイツ	14,700,594	0.03
	内 スペイン	247,265,075	0.46
	内 イタリア	6,729,830	0.01
	内 カナダ	662,481,752	1.24
	内 アメリカ	40,063,553,211	74.74
	内 オーストラリア	4,180,810,796	7.80
	内 ニュージーランド	66,389,601	0.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,381,044,352	2.58
純資産総額		53,602,433,566	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引（買建）		1,458,380,306	2.72
	内 ドイツ	393,185,592	0.73
	内 アメリカ	1,065,194,714	1.99
為替予約取引（買建）		278,567,398	0.52
	内 日本	278,567,398	0.52

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

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

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

(2) 投資資産（2025年9月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

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

19	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	26,591	18,769.74 499,108,711	19,221.89 511,129,458	0.95
20	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	49,499	8,567.15 424,071,327	10,135.75 501,709,509	0.94
21	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	153,067	3,734.80 571,686,014	3,226.22 493,829,286	0.92
22	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	1,221,353	359.94 439,733,792	401.34 490,188,805	0.91
23	LINK REIT	香港	投資証券	606,674	657.21 398,722,218	768.64 466,315,966	0.87
24	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	アメリカ	投資証券	63,968	7,574.41 484,525,613	6,978.00 446,369,062	0.83
25	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	157,073	3,216.10 505,174,590	2,830.20 444,549,387	0.83
26	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	35,185	15,935.07 560,679,230	12,568.44 442,220,899	0.83
27	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	アメリカ	投資証券	66,679	5,960.55 397,447,388	6,185.96 412,473,894	0.77
28	REGENCY CENTERS CORP	アメリカ	投資証券	36,933	11,181.18 412,958,310	10,752.11 397,107,812	0.74
29	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	302,927	1,542.51 467,279,659	1,302.28 394,498,124	0.74
30	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	43,802	10,429.49 456,839,063	8,859.84 388,079,097	0.72

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
不動産投信指数先物取引	アメリカ	DOW JONES US REAL ESTATE DEC 25	買建	194	1,073,660,239	1,065,194,714	1.99%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE DEC 25	買建	360	396,475,538	393,185,592	0.73%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2025年10月	買建	664,600	98,619,522	98,920,978	0.18%
		ユーロ買/円売 2025年10月	買建	1,030,000	177,112,929	179,646,420	0.34%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（2025年9月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		60,674,649,632	97.94
	内 中国	6,043,863,632	9.76
	内 タイ	5,249,537,404	8.47
	内 マレーシア	5,942,897,966	9.59
	内 インドネシア	6,136,906,848	9.91
	内 インド	6,050,207,825	9.77
	内 ポーランド	4,645,974,628	7.50
	内 ハンガリー	1,355,511,052	2.19
	内 セルビア	174,961,679	0.28
	内 ルーマニア	1,958,179,425	3.16
	内 トルコ	716,402,423	1.16
	内 チェコ	2,934,326,744	4.74
	内 メキシコ	6,135,157,640	9.90
	内 ドミニカ共和国	164,252,579	0.27
	内 コロンビア	2,253,400,773	3.64
	内 ペルー	1,132,311,288	1.83

	内 チリ	1,002,295,585	1.62
	内 ブラジル	4,181,328,623	6.75
	内 ウルグアイ	101,115,676	0.16
	内 南アフリカ	4,496,017,842	7.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,274,927,530	2.06
純資産総額		61,949,577,162	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引（買建）		291,205,371	0.47
	内 日本	291,205,371	0.47
為替予約取引（売建）		72,035,460	△0.12
	内 日本	72,035,460	△0.12

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

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

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

(2) 投資資産（2025年9月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	30,000,000	87.35 732,717,490	90.38 758,174,796	－ 2026/07/01	1.22
2	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	80,000,000	95.75 620,512,690	97.44 631,461,821	7.750000 2031/05/29	1.02
3	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	75,000,000	82.01 530,215,469	86.48 559,125,525	8.750000 2048/02/28	0.90
4	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	71,000,000	91.36 525,460,311	94.50 543,536,596	7.750000 2034/11/23	0.88
5	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	65,000,000	99.92 526,148,628	101.26 533,165,492	8.500000 2029/05/31	0.86
6	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	60,000,000	94.82 490,430,855	98.34 508,629,996	8.875000 2035/02/28	0.82
7	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	19,000,000	94.83 503,780,111	95.74 508,624,968	10.000000 2027/01/01	0.82
8	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	58,500,000	99.06 499,555,075	100.46 506,624,940	8.000000 2030/01/31	0.82

9	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	27,000,000	64.98 490,592,925	66.69 503,488,491	－ 2029/01/01	0.81
10	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	59,000,000	96.69 491,762,342	98.78 502,385,495	8.250000 2032/03/31	0.81
11	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	60,000,000	99.93 485,698,363	101.27 492,201,365	8.500000 2029/03/01	0.79
12	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	60,500,000	98.83 484,384,438	99.91 489,672,339	7.500000 2027/06/03	0.79
13	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	20,000,000	87.43 488,939,371	87.38 488,674,044	10.000000 2031/01/01	0.79
14	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	67,000,000	83.50 453,192,894	87.07 472,595,642	7.750000 2042/11/13	0.76
15	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	18,000,000	91.40 460,023,180	91.80 462,046,344	10.000000 2029/01/01	0.75
16	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	65,000,000	83.05 437,307,303	87.07 458,456,718	8.000000 2053/07/31	0.74
17	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	55,000,000	88.37 418,962,170	92.16 436,968,488	8.500000 2037/01/31	0.71
18	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	48,500,000	103.82 434,061,177	103.49 432,673,185	10.500000 2026/12/21	0.70
19	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	10,000,000	105.37 430,448,705	104.69 427,695,415	6.000000 2033/10/25	0.69
20	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	55,400,000	91.71 411,595,677	94.29 423,173,741	7.500000 2033/05/26	0.68
21	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	9,400,000	108.71 417,435,529	107.92 414,417,367	7.500000 2028/07/25	0.67
22	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	10,850,000	93.10 412,640,147	92.96 412,041,797	2.750000 2029/10/25	0.67
23	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	49,400,000	87.71 373,510,771	91.70 390,501,309	9.000000 2040/01/31	0.63
24	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	9,000,000	101.33 372,572,833	100.75 370,425,757	5.000000 2030/01/25	0.60
25	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	9,000,000	100.65 370,066,277	100.25 368,569,125	4.750000 2029/07/25	0.59
26	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	47,700,000	82.57 339,522,818	87.06 358,000,978	8.750000 2044/01/31	0.58
27	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	9,000,000	98.04 360,449,942	97.20 357,359,476	5.000000 2034/10/25	0.58
28	INDONESIA TREASURY BOND	インドネシア	国債証券	36,300,000,000	99.73 325,834,245	102.89 336,144,897	6.375000 2032/04/15	0.54

29	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	15,000,000	77.74 326,069,899	80.06 335,793,201	－ 2027/07/01	0.54
30	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	40,000,000	100.63 326,062,933	101.52 328,957,244	8.500000 2028/03/02	0.53

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.94%
合計	97.94%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2025年10月	買建	300,000	44,752,710	44,659,200	0.07%
		南アフリカ・ランド買/円売 2025年10月	買建	4,000,000	33,293,840	34,433,200	0.06%
		インド・ルピー買/円売 2025年10月	買建	30,000,000	50,241,000	50,700,000	0.08%
		インドネシア・ルピア買/円売 2025年10月	買建	11,000,000,000	97,933,000	99,000,000	0.16%
		マレーシア・リンギット買/円売 2025年10月	買建	959,000	33,805,613	33,845,411	0.05%
		ポーランド・ズロチ買/円売 2025年10月	買建	700,000	28,192,766	28,567,560	0.05%
		ルーマニア・レイ売/円買 2025年10月	売建	2,100,000	71,996,400	72,035,460	△0.12%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2025年9月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		347,463,236,502	97.88
	内 ユーロ	104,799,040,709	29.52
	内 中国	39,145,901,737	11.03
	内 シンガポール	1,342,264,172	0.38
	内 マレーシア	1,794,455,733	0.51
	内 イスラエル	1,256,234,867	0.35
	内 ノルウェー	531,607,724	0.15
	内 スウェーデン	570,801,907	0.16
	内 デンマーク	753,768,263	0.21
	内 イギリス	19,594,907,492	5.52
	内 ポーランド	2,220,997,840	0.63
	内 カナダ	6,861,719,741	1.93
	内 アメリカ	160,506,615,629	45.21
	内 メキシコ	2,841,042,924	0.80
	内 オーストラリア	4,335,239,294	1.22
	内 ニュージーランド	908,638,470	0.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		7,542,182,521	2.12
純資産総額		355,005,419,023	100.00

その他の資産の投資状況

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

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

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

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

(2) 投資資産（2025年9月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	85,000,000	100.98 1,791,559,599	100.63 1,785,332,438	1.850000 2027/05/15	0.50
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	11,500,000	96.37 1,650,101,482	98.10 1,679,606,841	2.875000 2028/05/15	0.47
3	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	73,000,000	101.70 1,549,695,281	101.64 1,548,704,904	2.050000 2029/04/15	0.44
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,500,000	97.46 1,523,533,704	98.53 1,540,276,004	3.875000 2034/08/15	0.43
5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	102.31 1,523,280,608	103.45 1,540,178,488	4.500000 2033/11/15	0.43
6	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,200,000	98.12 1,490,170,610	99.80 1,515,629,962	4.000000 2034/02/15	0.43
7	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	98.66 1,468,868,176	101.20 1,506,710,264	4.250000 2034/11/15	0.42
8	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	99.06 1,401,066,349	100.98 1,428,277,302	4.250000 2035/05/15	0.40
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	84.02 1,338,531,694	87.38 1,392,009,241	1.125000 2031/02/15	0.39
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,600,000	102.84 1,316,811,197	104.00 1,331,582,720	4.625000 2035/02/15	0.38
11	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,000,000	97.76 1,309,945,989	99.23 1,329,629,414	3.875000 2033/08/15	0.37
12	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	83.24 1,276,578,110	86.50 1,326,584,371	1.250000 2031/08/15	0.37
13	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	90.78 1,283,998,438	92.98 1,315,128,502	2.750000 2032/08/15	0.37
14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,500,000	101.38 1,282,968,933	102.36 1,295,408,602	4.375000 2034/05/15	0.36
15	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	83.41 1,241,837,856	86.56 1,288,735,056	1.375000 2031/11/15	0.36
16	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,500,000	99.16 1,254,947,460	101.06 1,278,919,397	4.000000 2029/01/31	0.36
17	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	60,000,000	101.85 1,275,563,059	101.11 1,266,308,414	2.390000 2026/11/15	0.36
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	83.18 1,213,659,933	86.69 1,264,900,856	0.875000 2030/11/15	0.36

19	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,300,000	99.59 1,230,699,398	101.09 1,249,185,530	4.000000 2029/07/31	0.35
20	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	58,000,000	102.85 1,245,113,733	102.64 1,242,619,946	2.370000 2029/01/15	0.35
21	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	100.43 1,196,199,335	100.37 1,195,482,579	3.875000 2027/07/31	0.34
22	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	95.37 1,135,990,131	97.12 1,156,833,331	3.500000 2033/02/15	0.33
23	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,500,000	99.85 1,114,930,956	101.15 1,129,507,896	4.000000 2030/02/28	0.32
24	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	50,000,000	103.99 1,085,333,564	104.30 1,088,495,672	2.540000 2030/12/25	0.31
25	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	52,000,000	100.41 1,089,875,373	100.18 1,087,330,179	1.790000 2032/03/25	0.31
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	85.94 1,023,663,148	89.05 1,060,668,761	1.625000 2031/05/15	0.30
27	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	100.19 1,044,170,009	101.13 1,054,019,780	4.000000 2030/03/31	0.30
28	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	99.50 1,037,013,254	100.37 1,046,068,100	4.000000 2027/01/15	0.29
29	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	99.04 1,032,238,636	100.18 1,044,067,152	3.750000 2027/08/15	0.29
30	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,900,000	85.84 1,009,672,161	88.73 1,043,670,238	1.875000 2032/02/15	0.29

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.88%
合計	97.88%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
為替予約取引	日本	デンマーク・クローネ買/円売 2025年10月	買建	418,000	9,611,032	9,770,332	0.00%
		スウェーデン・クローネ買/円売 2025年10月	買建	639,000	9,894,403	10,080,864	0.00%
		米ドル買/円売 2025年10月	買建	6,449,000	953,437,667	959,694,336	0.27%
		ユーロ買/円売 2025年10月	買建	3,029,000	526,537,308	528,379,238	0.15%
		ニュージーランド・ドル買/円売 2025年10月	買建	827,000	71,461,483	71,100,498	0.02%
		メキシコ・ペソ買/円売 2025年10月	買建	11,942,000	93,335,089	96,590,478	0.03%
		カナダ・ドル買/円売 2025年10月	買建	358,000	38,225,163	38,267,023	0.01%
		イスラエル・シュケル買/円売 2025年10月	買建	793,000	34,665,836	35,781,746	0.01%
		英ポンド買/円売 2025年10月	買建	445,000	88,885,704	88,907,004	0.03%
		マレーシア・リンギット買/円売 2025年10月	買建	1,330,000	46,935,700	46,938,892	0.01%
		ノルウェー・クローネ買/円売 2025年10月	買建	198,000	2,882,721	2,946,636	0.00%
		シンガポール・ドル買/円売 2025年10月	買建	282,000	32,239,227	32,516,856	0.01%
		豪ドル買/円売 2025年10月	買建	151,000	14,772,571	14,779,985	0.00%
		ポーランド・ズロチ買/円売 2025年10月	買建	1,188,000	47,660,302	48,489,883	0.01%
		オフショア人民元買/円売 2025年10月	買建	23,310,000	481,780,420	486,329,383	0.14%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●iFree 8資産バランス

2025年9月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	20,269円
純資産総額	1,036億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	2.4%
3カ月間	7.0%
6カ月間	10.9%
1年間	11.8%
3年間	41.3%
5年間	72.3%
設定来	102.7%

※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 17年9月	第2期 18年9月	第3期 19年9月	第4期 20年9月	第5期 21年9月	第6期 22年9月	第7期 23年9月	第8期 24年9月	第9期 25年9月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円			

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

主要な資産の状況

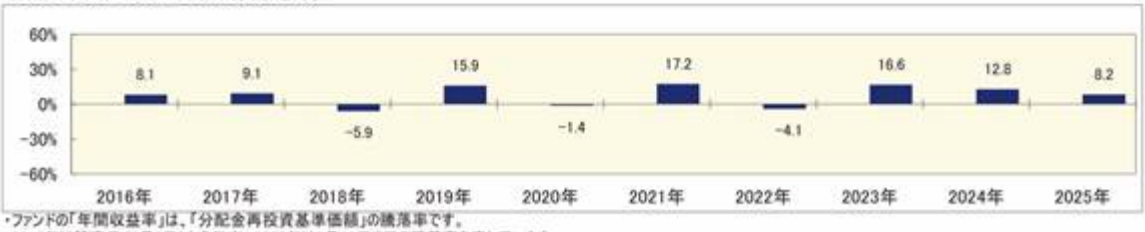
※比率は、純資産総額に対するものです。

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

※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Inc.が提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2016年は設定日（9月8日）から年末、2025年は9月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

（参考情報）ファンドの総経費率

	総経費率（①＋②）	運用管理費用の比率 ①	その他費用の比率 ②
iFree 8資産バランス	0.28%	0.24%	0.04%

※対象期間は2024年9月10日～2025年9月8日です。
※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。）を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した値（年率）です。
※詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧下さい。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

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

2【換金（解約）手続等】

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

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の解約請求には制限があります。

＜一部解約＞

受益者は、自己に帰属する受益権について、最低単位を1口単位として販売会社が定める単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

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

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要
- マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

無期限とします。ただし、(5)①により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

毎年9月8日から翌年9月7日までとします。

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

(5)【その他】

①　信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

2. 委託会社は、前1. の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

3. 前2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

5. 前2. から前4. までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2. から前4. までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。

6. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。

7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

8. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

②　信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本②の1. から7. までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。

2. 委託会社は、前1. の事項（前1. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1. の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当

する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

3. 前2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

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

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

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

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

③ 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

④ 運用報告書

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

2. 委託会社は、運用報告書（全体版）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

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

⑤ 公告

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

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

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

⑥ 関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

＜収益分配金および償還金にかかる請求権＞

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

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

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

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

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

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

＜換金請求権＞

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

第３ 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(2024年9月10日から2025年9月8日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ｉＦｒｅｅ ８資産バランス

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

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

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期 自　2023年9月8日 至　2024年9月9日	第9期 自　2024年9月10日 至　2025年9月8日
営業収益		
受取利息	468,025	3,874,453
有価証券売買等損益	4,811,259,364	11,932,875,409
営業収益合計	4,811,727,389	11,936,749,862
営業費用		
支払利息	56,726	-
受託者報酬	15,285,162	19,247,898
委託者報酬	152,852,589	192,479,637
その他費用	2,210,929	2,192,546
営業費用合計	170,405,406	213,920,081
営業利益又は営業損失（△）	4,641,321,983	11,722,829,781
経常利益又は経常損失（△）	4,641,321,983	11,722,829,781
当期純利益又は当期純損失（△）	4,641,321,983	11,722,829,781
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	334,562,436	376,139,349
期首剰余金又は期首欠損金（△）	23,485,381,199	32,809,916,615
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,825,989,829	9,520,904,409
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,825,989,829	9,520,904,409
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,808,213,960	2,960,977,661
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,808,213,960	2,960,977,661
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	32,809,916,615	50,716,533,795

(3)【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	第9期 自2024年9月10日 至2025年9月8日
1．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2024年9月7日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2024年9月9日としており、2025年9月7日が休日のため、当計算期間末日を2025年9月8日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

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

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第8期 自2023年9月8日 至2024年9月9日	第9期 自2024年9月10日 至2025年9月8日

※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（397,360円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（4,306,140,465円）、投資信託約款に規定される収益調整金（19,003,862,942円）及び分配準備積立金（9,499,515,848円）より分配対象額は32,809,916,615円（1万口当たり7,547.15円）であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,810,277円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（11,342,880,155円）、投資信託約款に規定される収益調整金（26,654,319,797円）及び分配準備積立金（12,715,523,566円）より分配対象額は50,716,533,795円（1万口当たり10,000.25円）であり、分配を行っておりません。

〔金融商品に関する注記〕

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	第9期 自2024年9月10日 至2025年9月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第8期 2024年9月9日現在	第9期 2025年9月8日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	4,736,207,037	11,853,427,097
合計	4,736,207,037	11,853,427,097

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

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

(関連当事者との取引に関する注記)

第9期 自2024年9月10日 至2025年9月8日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第8期 2024年9月9日現在	第9期 2025年9月8日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7547円 (17,547円)	2.0000円 (20,000円)

(4)【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	3,884,372,488	12,592,747,168	
	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	6,027,006,055	12,422,864,880	
	トピックス・インデックス・マザーファンド	5,578,054,919	13,050,975,093	
	外国株式インデックスマザーファンド	1,654,770,220	12,651,876,671	
	外国債券インデックスマザーファンド	3,253,312,085	12,412,361,597	
	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	3,382,075,391	12,547,499,700	
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	3,063,070,087	12,585,542,373	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	10,620,795,370	12,166,121,096	
親投資信託受益証券 合計			100,429,988,578	
合計			100,429,988,578	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

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

元本等合計	35,279,562,242	52,941,583,388
純資産合計	35,279,562,242	52,941,583,388
負債純資産合計	35,329,931,879	52,983,029,549

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2024年9月10日 至2025年9月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の１口当たり純資産額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引

	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3.　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年9月9日現在	2025年9月8日現在
1.　※1 期首	2023年9月8日	2024年9月10日
期首元本額	13,502,028,807円	14,193,724,013円
期中追加設定元本額	2,907,302,409円	2,745,247,640円
期中一部解約元本額	2,215,607,203円	608,360,393円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
新興国株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	119,662,376円	133,681,504円

	ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	476,159,782円	476,414,216円
	ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	350,897,362円	371,156,061円
	Ｄ－Ｉ's 新興国株式インデックス	123,581,490円	105,107,616円
	ｉＦｒｅｅ 新興国株式インデックス	7,328,195,695円	9,168,248,570円
	ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	3,680,542,853円	3,884,372,488円
	ダイワ新興国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	8,958,674円	7,398,917円
	新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド（為替ヘッジなし／適格機関投資家専用）	654,366円	-円
	ＤＣダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド	1,697,409,720円	1,833,401,247円
	ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式	304,589,361円	256,234,459円
	ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド	103,072,334円	94,596,182円
計		14,193,724,013円	16,330,611,260円
2.	期末日における受益権の総数	14,193,724,013口	16,330,611,260口

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年9月10日 至2025年9月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

II　金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年9月9日現在 当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	2025年9月8日現在 当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	△1,049,019,484	1,645,592,520
投資証券	△121,652,687	143,272,436
合計	△1,170,672,171	1,788,864,956

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．株式関連

種類	2024年9月9日現在				2025年9月8日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	1,475,213,668	-	1,436,845,112	△38,368,556	2,698,100,769	-	2,849,510,475	151,409,706
合計	1,475,213,668	-	1,436,845,112	△38,368,556	2,698,100,769	-	2,849,510,475	151,409,706

（注）　1．　時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．　株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4．　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2．通貨関連

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

（注）　1.　時価の算定方法

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

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

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

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

・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

2.　換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2024年9月9日現在	2025年9月8日現在
１口当たり純資産額	2.4856円	3.2419円
（1万口当たり純資産額）	(24,856円)	(32,419円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF	29,000	0.000	0.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	42,000	17.140	719,880.000	
	CANADIAN SOLAR INC	18,500	11.170	206,645.000	
	IQIYI INC-ADR	126,000	2.710	341,460.000	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	17,700	24.490	433,473.000	
	PINDUODUO INC-ADR	8,700	124.680	1,084,716.000	
	KE HOLDINGS INC-ADR	14,300	18.990	271,557.000	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	13,400	29.210	391,414.000	
	SBERBANK ROSSII	698,708	0.000	0.000	
	JINKOSOLAR HOLDING ADR REP LTD	14,900	25.480	379,652.000	
	BANK VTB	76,486	0.000	0.000	
	NK LUKOIL	23,088	0.000	0.000	
	MOBILNYE TELESISTEMY	70,700	0.000	0.000	
	NK ROSNEFT	97,499	0.000	0.000	
	MAGNIT	4,678	0.000	0.000	
	SURGUTNEFTEGAZ	360,750	0.000	0.000	
	TATNEFT	57,648	0.000	0.000	
	GAZPROM	853,478	0.000	0.000	
	GMK NORILSKIY NIKEL	182,900	0.000	0.000	
	NOVATEK	26,980	0.000	0.000	
	QFIN HOLDINGS ADR INC	4,900	28.770	140,973.000	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	7,290	0.000	0.000	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	3	0.000	0.000	
	SEVERSTAL - GDR REG S	13,460	0.000	0.000	
	TATNEFT PJSC - PREF	21,009	0.000	0.000	
	SISTEMA PJSFC	319,200	0.000	0.000	
	INTER RAO UES PJSC	2,726,100	0.000	0.000	
	ALROSA PJSC	180,310	0.000	0.000	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	56,619	0.000	0.000	
	AEROFLOT PJSC	164,910	0.000	0.000	
アメリカ・ドル 小計				3,969,770.000 (589,391,753)	
インド・ルピー	BHARTI AIRTEL PARTLY PAID LTD	3,608	1,436.950	5,184,515.600	
	JIO FINANCIAL SERVICES LTD	129,991	309.400	40,219,215.400	
	TATA STEEL LTD	617,810	167.680	103,594,380.800	

AXIS BANK LTD	91,997	1,055.900	97,139,632.300	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	3,155	14,895.000	46,993,725.000	
TATA POWER CO LTD	44,549	385.800	17,187,004.200	
FEDERAL BANK LTD	92,910	190.520	17,701,213.200	
BANK OF BARODA	110,407	234.260	25,863,943.820	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	18,566	2,633.400	48,891,704.400	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	107,210	383.600	41,125,756.000	
STATE BANK OF INDIA	116,609	806.600	94,056,819.400	
NTPC LTD	261,836	328.700	86,065,493.200	
POWER FINANCE CORPORATION	157,365	394.400	62,064,756.000	
JSW STEEL LTD	28,598	1,073.100	30,688,513.800	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	241,479	285.350	68,906,032.650	
INDIAN OIL CORP LTD	309,597	139.650	43,235,221.050	
BAJAJ FINSERV LTD	11,345	2,014.400	22,853,368.000	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	172,724	312.500	53,976,250.000	
PUNJAB NATIONAL BANK	216,474	103.750	22,459,177.500	
STEEL AUTHORITY OF INDIA	240,861	129.260	31,133,692.860	
JINDAL STEEL LTD	28,454	1,034.850	29,445,621.900	
CANARA BANK	224,158	107.140	24,016,288.120	
UNION BANK OF INDIA	165,991	127.340	21,137,293.940	
ULTRATECH CEMENT LTD	1,986	12,601.000	25,025,586.000	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	20,038	1,945.500	38,983,929.000	
OIL INDIA LTD	48,136	396.400	19,081,110.400	
SHRIRAM FINANCE LTD	53,268	592.500	31,561,290.000	
TECH MAHINDRA LTD	20,866	1,477.900	30,837,861.400	
YES BANK LTD	1,124,842	20.440	22,991,770.480	
REC LTD	86,270	366.150	31,587,760.500	
COAL INDIA LTD	138,787	392.650	54,494,715.550	
INDUSIND BANK LTD	38,319	757.050	29,009,398.950	
BAJAJ FINANCE LTD	38,240	937.600	35,853,824.000	
INDUS TOWERS LTD	73,058	337.400	24,649,769.200	
GAIL INDIA LTD	224,065	173.970	38,980,588.050	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	88,756	743.800	66,016,712.800	
GRASIM INDUSTRIES LTD	11,637	2,804.000	32,630,148.000	
WIPRO LTD	62,662	243.670	15,268,849.540	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	28,443	3,048.300	86,702,796.900	
INFOSYS LTD	98,020	1,444.600	141,599,692.000	
LARSEN & TOUBRO LTD	20,484	3,553.600	72,791,942.400	
TATA MOTORS LTD	127,732	691.700	88,352,224.400	

	DR. REDDY'S LABORATORIES	18,695	1,268.100	23,707,129.500	
	HDFC BANK LIMITED	315,618	963.400	304,066,381.200	
	ICICI BANK LTD	120,003	1,402.800	168,340,208.400	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	260,907	1,375.000	358,747,125.000	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	270,203	234.130	63,262,628.390	
	ITC LTD	106,344	407.350	43,319,228.400	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	22,275	3,561.300	79,327,957.500	
	HERO MOTOCORP LTD	6,689	5,363.000	35,873,107.000	
	BHARTI AIRTEL LTD	45,726	1,895.300	86,664,487.800	
	UPL LTD	34,005	688.850	23,424,344.250	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	18,283	1,593.600	29,135,788.800	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	33,331	1,419.000	47,296,689.000	
	VEDANTA LTD	162,367	445.500	72,334,498.500	
インド・ルピー 小計				3,255,859,162.450 (5,502,401,985)	
インドネシア・ルピア	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	640,200	5,500.000	3,521,100,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	2,800,500	3,150.000	8,821,575,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	1,052,500	4,370.000	4,599,425,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,440,600	8,000.000	11,524,800,000.000	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	2,282,200	4,680.000	10,680,696,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	4,417,300	4,000.000	17,669,200,000.000	
インドネシア・ルピア 小計				56,816,796,000.000 (517,032,844)	
オフショア・人民元	CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	667,200	2.400	1,601,280.000	
	INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	304,500	21.750	6,622,875.000	
	BANK OF BEIJING CO LTD -A	261,100	6.060	1,582,266.000	
	PING AN INSURANCE GROUP CO-A	108,853	57.900	6,302,588.700	
	IND & COMM BK OF CHINA-A	730,100	7.440	5,431,944.000	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	30,900	18.330	566,397.000	
	GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	8,900	26.070	232,023.000	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	42,000	12.900	541,800.000	
	KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	2,100	1,483.000	3,114,300.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	51,200	23.770	1,217,024.000	
	BANK OF JIANGSU CO LTD-A	162,700	10.660	1,734,382.000	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	337,200	7.740	2,609,928.000	
	SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	586,300	13.690	8,026,447.000	
	CITIC SECURITIES CO-A	47,300	29.830	1,410,959.000	

CHINA MERCHANTS BANK-A	122,800	42.760	5,250,928.000	
PING AN BANK CO LTD-A	267,300	11.720	3,132,756.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	1,258,600	5.490	6,909,714.000	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	25,700	26.460	680,022.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	281,300	4.110	1,156,143.000	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	108,000	19.020	2,054,160.000	
XIAMEN C & D INC-A	163,900	10.400	1,704,560.000	
BBMG CORPORATION-A	353,100	1.600	564,960.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	25,300	17.210	435,413.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	50,900	6.470	329,323.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	301,100	5.750	1,731,325.000	
CHINA COAL ENERGY CO-A	43,400	11.150	483,910.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	171,690	15.120	2,595,952.800	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	382,500	3.430	1,311,975.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	110,300	7.700	849,310.000	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	32,700	29.390	961,053.000	
YANKUANG ENERGY GROUP LTD A	57,250	12.990	743,677.500	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	59,000	9.050	533,950.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	807,300	7.300	5,893,290.000	
BANK OF CHINA LTD-A	331,700	5.520	1,830,984.000	
PETROCHINA CO LTD-A	310,500	8.900	2,763,450.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	732,600	5.690	4,168,494.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	60,600	28.070	1,701,042.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	510,900	7.260	3,709,134.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	41,400	38.160	1,579,824.000	
CHINA VANKE CO LTD -A	347,000	6.590	2,286,730.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	66,300	38.040	2,522,052.000	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	287,400	7.810	2,244,594.000	
CHINA MINSHENG BANKING-A	812,700	4.470	3,632,769.000	
PICC HOLDING CO-A	73,000	8.390	612,470.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	792,000	3.710	2,938,320.000	
CRRC CORP LTD-A	136,700	7.490	1,023,883.000	
CHINA UNITED NETWORK-A	283,100	5.390	1,525,909.000	
CGN POWER CO LTD-A	51,100	3.670	187,537.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,700	20.420	647,314.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	534,600	5.550	2,967,030.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	226,500	6.970	1,578,705.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	13,000	63.330	823,290.000	
HUAXIA BANK CO LTD-A	281,800	7.340	2,068,412.000	

	BYD CO LTD -A	5,700	107.260	611,382.000	
	WEICHAI POWER CO LTD-A	44,900	14.890	668,561.000	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	59,400	25.270	1,501,038.000	
	HUANENG POWER INTL INC-A	64,000	7.550	483,200.000	
	POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	223,100	6.200	1,383,220.000	
	CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	285,400	3.080	879,032.000	
オフショア・人民元 小計				124,655,012.000 (2,595,678,850)	
サウジアラビア・リアル	SAUDI ARABIAN MINING	35,154	53.300	1,873,708.200	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS	6,538	115.000	751,870.000	
	SAUDI AWWAL BANK	28,600	30.280	866,008.000	
	ALMARAI	14,314	48.100	688,503.400	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	28,386	60.000	1,703,160.000	
	SAUDI TELECOM CO	52,816	41.820	2,208,765.120	
	AL RAJHI BANK	47,565	93.650	4,454,462.250	
	RIYAD BANK	40,995	26.180	1,073,249.100	
	ETIHAD ETISALAT CO	12,917	61.900	799,562.300	
	ALINMA BANK	49,136	24.820	1,219,555.520	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	72,605	34.980	2,539,722.900	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	196,147	23.470	4,603,570.090	
サウジアラビア・リアル 小計				22,782,136.880 (903,539,549)	
タイ・バーツ	SCB X PUBLIC COMPANY LIMITED NON-V	179,800	126.500	22,744,700.000	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	99,600	219.000	21,812,400.000	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	203,500	170.000	34,595,000.000	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	3,719,100	1.910	7,103,481.000	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	359,100	22.100	7,936,110.000	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	49,900	293.000	14,620,700.000	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	673,400	25.250	17,003,350.000	
	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	1,505,600	4.980	7,497,888.000	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	481,000	21.000	10,101,000.000	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	163,600	112.000	18,323,200.000	
	BANGCHAK CORP PCL-NVDR	195,600	30.750	6,014,700.000	
	PTT PCL-NVDR	686,000	31.500	21,609,000.000	
	THAI OIL PCL-NVDR	376,600	33.750	12,710,250.000	
	CP ALL PCL-NVDR	401,200	47.500	19,057,000.000	
	BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	65,000	152.000	9,880,000.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	523,600	22.500	11,781,000.000	

	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	534,900	27.750	14,843,475.000	
タイ・バーツ 小計				257,633,254.000 (1,192,841,967)	
チリ・ペソ	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	15,853	44,160.000	700,068,480.000	
	BANCO DE CHILE	1,689,366	146.980	248,303,014.680	
チリ・ペソ 小計				948,371,494.680 (145,690,725)	
トルコ・リラ	AKBANK T.A.S.	332,664	62.450	20,774,866.800	
	TURKIYE IS BANKASI-C	821,090	13.690	11,240,722.100	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	99,505	90.050	8,960,425.250	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	172,197	167.500	28,842,997.500	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	663,979	27.340	18,153,185.860	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	188,702	85.800	16,190,631.600	
	YAPI VE KREDI BANKASI	451,111	30.300	13,668,663.300	
	KOC HOLDING AS	262,937	168.000	44,173,416.000	
	TURK HAVA YOLLARI AO	82,811	319.500	26,458,114.500	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	198,548	37.680	7,481,288.640	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	27,035	515.000	13,923,025.000	
トルコ・リラ 小計				209,867,336.550 (756,256,947)	
ブラジル・レアル	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	84,100	11.400	958,740.000	
	ENERGISA SA-UNITS	48,400	50.030	2,421,452.000	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	58,300	46.270	2,697,541.000	
	VIBRA ENERGIA SA	193,700	24.950	4,832,815.000	
	TIM SA	72,900	22.950	1,673,055.000	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	339,700	10.500	3,566,850.000	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	60,160	41.380	2,489,420.800	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	783,300	30.590	23,961,147.000	
	USINAS SIDER MINAS GER-PF A	149,400	4.520	675,288.000	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	1,085,759	17.240	18,718,485.160	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	584,519	38.360	22,422,148.840	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	295,700	7.790	2,303,503.000	
	VALE SA	755,090	56.220	42,451,159.800	
	GERDAU SA-PREF	322,292	17.440	5,620,772.480	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	539,700	32.900	17,756,130.000	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	154,374	11.140	1,719,726.360	
	ITAUSA SA	324,429	11.150	3,617,383.350	
	BRASKEM SA-PREF A	89,500	9.400	841,300.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	21,700	48.040	1,042,468.000	

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

	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	136,700	159.530	21,807,751.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	30,100	189.540	5,705,154.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	95,900	127.020	12,181,218.000	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	321,800	57.050	18,358,690.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	138,300	175.630	24,289,629.000	
メキシコ・ペソ 小計				152,079,179.060 (1,205,896,642)	
香港・ドル	TRIP.COM GROUP LTD	12,800	572.000	7,321,600.000	
	XPENG CLASS A INC	20,000	77.900	1,558,000.000	
	LI AUTO CLASS A INC	26,800	93.150	2,496,420.000	
	JD LOGISTICS INC	119,800	13.090	1,568,182.000	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	15,650	348.000	5,446,200.000	
	NIO CLASS A INC	44,880	47.840	2,147,059.200	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	1,364,000	3.810	5,196,840.000	
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	312,000	18.680	5,828,160.000	
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	25,000	42.240	1,056,000.000	
	CHINA RESOURCES BEER HOLDING	64,000	27.280	1,745,920.000	
	TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	134,000	11.300	1,514,200.000	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	301,000	24.560	7,392,560.000	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	5,521,800	4.130	22,805,034.000	
	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	674,000	8.780	5,917,720.000	
	TENCENT HOLDINGS LTD	102,500	605.500	62,063,750.000	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	222,000	18.750	4,162,500.000	
	PETROCHINA CO LTD-H	2,884,000	7.690	22,177,960.000	
	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	114,500	16.190	1,853,755.000	
	HUANENG POWER INTL INC-H	648,000	5.890	3,816,720.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	236,500	23.980	5,671,270.000	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	8,592,000	7.670	65,900,640.000	
	CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	1,677,000	7.040	11,806,080.000	
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	167,000	9.360	1,563,120.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	82,200	18.560	1,525,632.000	
	POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,586,000	5.750	9,119,500.000	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	304,000	36.240	11,016,960.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	683,120	11.190	7,644,112.800	
	SINOPHARM GROUP CO-H	124,400	18.560	2,308,864.000	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	259,000	31.320	8,111,880.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LTD	517,500	9.390	4,859,325.000	
	SINO BIOPHARMACEUTICAL	476,500	8.910	4,245,615.000	

CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	54,200	20.520	1,112,184.000	
BYD CO LTD-H	55,500	105.600	5,860,800.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,741,000	5.480	20,500,680.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	80,000	45.920	3,673,600.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	874,000	6.670	5,829,580.000	
CITIC LTD	260,000	11.310	2,940,600.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	2,843,000	1.410	4,008,630.000	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	340,000	24.960	8,486,400.000	
IND & COMM BK OF CHINA-H	10,101,000	5.770	58,282,770.000	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	120,500	36.940	4,451,270.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	354,000	6.520	2,308,080.000	
CHINA TOWER CORP LTD-H	351,000	11.080	3,889,080.000	
XIAOMI CORP-CLASS B	259,000	53.650	13,895,350.000	
MEITUAN-CLASS B	75,690	103.000	7,796,070.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	534,800	131.800	70,486,640.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-H	502,000	2.740	1,375,480.000	
CHINA FEIHE LTD	313,000	4.390	1,374,070.000	
CHINA ENERGY ENGINEERING C-H	930,000	1.200	1,116,000.000	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	472,000	7.360	3,473,920.000	
JD.COM INC - CL A	192,895	122.100	23,552,479.500	
NETEASE INC	51,600	210.000	10,836,000.000	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	19,600	143.500	2,812,600.000	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	50,400	37.660	1,898,064.000	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	991,000	2.310	2,289,210.000	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	152,200	25.740	3,917,628.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	65,000	72.950	4,741,750.000	
BAIDU INC-CLASS A	203,300	97.000	19,720,100.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	394,000	13.850	5,456,900.000	
CRRC CORP LTD - H	424,000	6.000	2,544,000.000	
CGN POWER CO LTD-H	1,331,000	2.880	3,833,280.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	879,500	55.450	48,768,275.000	
CHINA COAL ENERGY CO-H	324,000	9.390	3,042,360.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	3,070,000	1.590	4,881,300.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	470,050	13.680	6,430,284.000	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	1,881,580	4.350	8,184,873.000	
BBMG CORP-H	1,454,000	0.810	1,177,740.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	38,800	94.550	3,668,540.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	1,019,400	5.220	5,321,268.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	266,000	15.020	3,995,320.000	

	PICC PROPERTY & CASUALTY-H	458,000	18.120	8,298,960.000	
	LI NING CO LTD	163,500	18.850	3,081,975.000	
	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	108,500	19.280	2,091,880.000	
	WEICHAI POWER CO LTD-H	219,000	15.150	3,317,850.000	
	SUNNY OPTICAL TECH	19,700	79.800	1,572,060.000	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	474,000	6.940	3,289,560.000	
	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	277,600	32.140	8,922,064.000	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	129,600	12.070	1,564,272.000	
	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	380,000	22.580	8,580,400.000	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	69,800	63.950	4,463,710.000	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	192,000	7.240	1,390,080.000	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	254,000	28.240	7,172,960.000	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	430,000	5.120	2,201,600.000	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,187,100	6.790	8,060,409.000	
	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	326,000	5.980	1,949,480.000	
	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	2,497,000	1.470	3,670,590.000	
	CHINA MERCHANTS BANK-H	315,500	47.400	14,954,700.000	
	BANK OF CHINA LTD-H	8,967,000	4.330	38,827,110.000	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	255,000	12.650	3,225,750.000	
	CITIC SECURITIES CO LTD-H	111,500	28.100	3,133,150.000	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	601,000	3.580	2,151,580.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	184,000	10.960	2,016,640.000	
	BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-B	75,100	2.920	219,292.000	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	372,500	10.310	3,840,475.000	
香港・ドル 小計				825,771,301.500 (15,722,685,581)	
台湾・ドル	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTUR	330,000	16.050	5,296,500.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	45,000	129.500	5,827,500.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	18,000	370.500	6,669,000.000	
	SINO-AMERICAN SILICON PRODUC	71,000	103.500	7,348,500.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	230,000	156.000	35,880,000.000	
	WIWYNN CORP	3,000	3,025.000	9,075,000.000	
	THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	148,000	41.300	6,112,400.000	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	108,112	78.100	8,443,547.200	
	FORMOSA PLASTICS CORP	453,600	37.800	17,146,080.000	
	NAN YA PLASTICS CORP	309,140	38.450	11,886,433.000	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	242,000	28.550	6,909,100.000	
	WALSIN LIHWA CORP	265,000	23.300	6,174,500.000	

CHINA STEEL CORP	477,686	19.550	9,338,761.300	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	132,616	130.500	17,306,388.000	
DELTA ELECTRONICS INC	73,000	726.000	52,998,000.000	
YAGEO CORPORATION	114,312	135.000	15,432,120.000	
ACER INC	173,000	33.400	5,778,200.000	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	83,000	68.700	5,702,100.000	
INVENTEC CORP	340,000	41.700	14,178,000.000	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	24,000	539.000	12,936,000.000	
QUANTA COMPUTER INC	145,000	258.500	37,482,500.000	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	38,000	137.500	5,225,000.000	
NANYA TECHNOLOGY CORP	150,000	53.000	7,950,000.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	130,400	134.500	17,538,800.000	
MEDIATEK INC	52,003	1,435.000	74,624,305.000	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	68,000	187.500	12,750,000.000	
EVERGREEN MARINE CORP LTD	194,800	186.500	36,330,200.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	368,000	57.900	21,307,200.000	
WAN HAI LINES LTD	97,000	82.200	7,973,400.000	
EVA AIRWAYS CORP	158,000	39.550	6,248,900.000	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	333,300	29.150	9,715,695.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	296,735	87.000	25,815,945.000	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	385,838	64.600	24,925,134.800	
KGI FINANCIAL HOLDING CO LTD	677,710	15.250	10,335,077.500	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	253,947	34.300	8,710,382.100	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	258,940	33.800	8,752,172.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	300,718	41.250	12,404,617.500	
TS FINANCIAL HOLDING LTD	1,507,792	17.100	25,783,243.200	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	346,270	24.300	8,414,361.000	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	825,028	41.850	34,527,421.800	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	225,275	29.200	6,578,030.000	
LARGAN PRECISION CO LTD	5,000	2,405.000	12,025,000.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	37,000	438.500	16,224,500.000	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	76,000	134.000	10,184,000.000	
TAIWAN MOBILE CO LTD	60,000	106.000	6,360,000.000	
WISTRON CORP	294,110	115.500	33,969,705.000	
INNOLUX CORP	869,029	13.500	11,731,891.500	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	81,000	84.400	6,836,400.000	
PEGATRON CORP	95,000	70.200	6,669,000.000	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	98,000	174.000	17,052,000.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	140,311	116.500	16,346,231.500	

	POU CHEN	187,000	28.550	5,338,850.000	
	COMPAL ELECTRONICS	223,000	28.100	6,266,300.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	428,000	1,180.000	505,040,000.000	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	999,902	205.000	204,979,910.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	49,760	645.000	32,095,200.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,073,000	41.200	44,207,600.000	
台湾・ドル 小計				1,599,157,102.400 (7,765,506,889)	
南アフリカ・ランド	AngloGold Ashanti Plc	16,392	1,041.500	17,072,268.000	
	PEPKOR HOLDINGS SHS LTD	151,181	25.000	3,779,525.000	
	GOLD FIELDS LTD	34,981	605.810	21,191,839.610	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,220	3,423.800	7,600,836.000	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	25,275	278.330	7,034,790.750	
	NEDBANK GROUP LTD	16,557	212.510	3,518,528.070	
	BID CORP LTD	16,110	444.000	7,152,840.000	
	STANDARD BANK GROUP LTD	46,415	241.480	11,208,294.200	
	SASOL LTD	97,599	125.540	12,252,578.460	
	DISCOVERY LTD	16,908	222.240	3,757,633.920	
	SANLAM LTD	51,532	83.770	4,316,835.640	
	FIRSTRAND LTD	233,444	73.600	17,181,478.400	
	ABSA GROUP LTD	40,814	185.950	7,589,363.300	
	NASPERS LTD-N SHS	3,390	5,724.150	19,404,868.500	
	MTN GROUP LTD	117,184	139.560	16,354,199.040	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	74,648	184.000	13,735,232.000	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	19,352	103.930	2,011,253.360	
	VALTERRA PLATINUM LTD	8,899	945.900	8,417,564.100	
	SIBANYE STILLWATER LTD	734,423	37.810	27,768,533.630	
南アフリカ・ランド 小計				211,348,461.980 (1,781,667,534)	
合計				45,168,130,497 [45,168,130,497]	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	1,235,500	30,393,300.000	
	アメリカ・ドル 小計			30,393,300.000 (4,512,493,251)	

投資証券 合計		4,512,493,251 [4,512,493,251]	
合計		4,512,493,251 [4,512,493,251]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

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

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

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

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2024年9月10日 至2025年9月8日

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年9月9日現在	2025年9月8日現在
1．　※1 期首	2023年9月8日	2024年9月10日
期首元本額	22,164,970,341円	26,125,724,702円
期中追加設定元本額	4,942,482,106円	4,311,100,956円
期中一部解約元本額	981,727,745円	994,254,249円
期末元本額の内訳		

ファンド名		
新興国債券インデックスファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	597,816,178円	705,777,853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）	475,166,876円	481,643,241円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	553,350,187円	496,890,718円
Ｄ－Ｉ's 新興国債券インデックス	79,021,792円	60,883,251円
ｉＦｒｅｅ 新興国債券インデックス	9,353,736,063円	11,399,235,861円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	5,163,331,504円	6,027,006,055円
ダイワ新興国債券インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	5,542,444円	9,751,796円
ＤＣダイワ新興国債券インデックスファンド	9,734,438,864円	10,103,756,216円
スタイル9（8資産分散・保守型）	50,457円	93,077円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	1,083,643円	2,581,576円
スタイル9（8資産分散・積極型）	1,286,308円	6,542,652円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券	121,925,339円	107,149,870円
ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド	38,975,047円	41,259,243円
計	26,125,724,702円	29,442,571,409円
2. 期末日における受益権の総数	26,125,724,702口	29,442,571,409口

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年9月10日 至2025年9月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2．　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3．　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II　金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年9月9日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2025年9月8日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	927,023,685	330,645,924
合計	927,023,685	330,645,924

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	2024年9月9日現在				2025年9月8日現在			
	契約額等 (円)	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	44,055,000	-	44,044,000	11,000	-	-	-	-
南アフリカ・ランド	44,055,000	-	44,044,000	11,000	-	-	-	-
買建	162,537,050	-	162,762,569	225,519	96,791,526	-	97,473,030	681,504
アメリカ・ドル	86,775,600	-	87,169,644	394,044	-	-	-	-
オフショア・人民元	14,071,400	-	14,063,350	△8,050	35,304,920	-	35,397,740	92,820
トルコ・リラ	20,795,000	-	20,942,000	147,000	-	-	-	-
ポーランド・ズロチ	28,021,450	-	27,710,375	△311,075	28,192,766	-	28,510,090	317,324
メキシコ・ペソ	12,873,600	-	12,877,200	3,600	-	-	-	-
南アフリカ・ランド	-	-	-	-	33,293,840	-	33,565,200	271,360
合計	206,592,050	-	206,806,569	236,519	96,791,526	-	97,473,030	681,504

（注）　1.　時価の算定方法

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

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

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

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

・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2024年9月9日現在	2025年9月8日現在
1口当たり純資産額	1.8122円	2.0612円
（1万口当たり純資産額）	(18,122円)	(20,612円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	インド・ルピー	5.85% India Government Bond 20301201	90,000,000.000	87,965,100.000	
		7.26% INDIA GOVERNMENT BOND 20320822	130,000,000.000	135,205,200.000	
		7.18% INDIA GOVERNMENT BOND 20330814	160,000,000.000	166,028,800.000	
		7.26% INDIA GOVERNMENT BOND 20290114	100,000,000.000	103,586,000.000	
		7.72% INDIA GOVERNMENT BOND 20490615	66,000,000.000	70,888,620.000	

		6.45% INDIA GOVERNMENT BOND 20291007	100,000,000.000	100,620,000.000	
		7.16% INDIA GOVERNMENT BOND 20500920	90,000,000.000	90,055,800.000	
		5.79% INDIA GOVERNMENT BOND 20300511	90,000,000.000	88,390,800.000	
		5.77% INDIA GOVERNMENT BOND 20300803	100,000,000.000	97,981,000.000	
		6.67% INDIA GOVERNMENT BOND 20501217	130,000,000.000	121,654,000.000	
		6.1% INDIA GOVERNMENT BOND 20310712	140,000,000.000	138,418,000.000	
		6.99% INDIA GOVERNMENT BOND 20511215	130,000,000.000	127,530,000.000	
		6.54% INDIA GOVERNMENT BOND 20320117	130,000,000.000	130,055,900.000	
		7.1% INDIA GOVERNMENT BOND 20290418	120,000,000.000	123,574,800.000	
		7.54% INDIA GOVERNMENT BOND 20360523	140,000,000.000	148,190,000.000	
		7.38% INDIA GOVERNMENT BOND 20270620	65,000,000.000	66,852,500.000	
		7.36% INDIA GOVERNMENT BOND 20520912	130,000,000.000	132,264,600.000	
		7.41% INDIA GOVERNMENT BOND 20361219	125,000,000.000	131,628,750.000	
		7.26% INDIA GOVERNMENT BOND 20330206	120,000,000.000	124,572,000.000	
		7.06% INDIA GOVERNMENT BOND 20280410	91,000,000.000	93,487,030.000	
		7.17% INDIA GOVERNMENT BOND 20300417	80,000,000.000	82,812,800.000	
		7.3% INDIA GOVERNMENT BOND 20530619	160,000,000.000	162,966,400.000	
		7.18% INDIA GOVERNMENT BOND 20370724	150,000,000.000	155,790,000.000	
		7.37% INDIA GOVERNMENT BOND 20281023	60,000,000.000	62,222,400.000	
		7.32% INDIA GOVERNMENT BOND 20301113	50,000,000.000	52,365,500.000	

	7.37% INDIA GOVERNMENT BOND 20540123	8,000,000.000	8,185,440.000	
	7.1% INDIA GOVERNMENT BOND 20340408	142,000,000.000	147,026,800.000	
	7.04% INDIA GOVERNMENT BOND 20290603	70,000,000.000	71,945,300.000	
	7.02% INDIA GOVERNMENT BOND 20310618	50,000,000.000	51,425,500.000	
	6.79% INDIA GOVERNMENT BOND 20341007	160,000,000.000	162,712,000.000	
	6.75% INDIA GOVERNMENT BOND 20291223	80,000,000.000	81,602,400.000	
	6.79% INDIA GOVERNMENT BOND 20311230	50,000,000.000	50,765,000.000	
	6.79% INDIA GOVERNMENT BOND 20341202	10,000,000.000	10,164,700.000	
	6.33% INDIA GOVERNMENT BOND 20350505	100,000,000.000	99,430,000.000	
	6.28% INDIA GOVERNMENT BOND 20320714	10,000,000.000	9,906,700.000	
	6.01% INDIA GOVERNMENT BOND 20300721	30,000,000.000	29,812,500.000	
インド・ルピー 小計			3,518,082,340.000 (5,945,559,155)	
インドネシア・ルピア	8.25% Indonesia Treasury Bond 20360515	15,250,000,000.000	17,349,010,000.000	
	8.75% Indonesia Treasury Bond 20310515	12,000,000,000.000	13,613,880,000.000	
	7.5% Indonesia Treasury Bond 20320815	10,000,000,000.000	10,724,400,000.000	
	7.5% Indonesia Treasury Bond 20380515	10,000,000,000.000	10,701,600,000.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20390415	12,000,000,000.000	13,733,040,000.000	
	8.25% Indonesia Treasury Bond 20290515	17,000,000,000.000	18,492,600,000.000	
	7% Indonesia Treasury Bond 20300915	30,000,000,000.000	31,535,100,000.000	
	7.5% Indonesia Treasury Bond 20350615	22,000,000,000.000	23,699,060,000.000	

7.5% Indonesia Treasury Bond 20400415	19,000,000,000.000	20,297,320,000.000	
5.5% Indonesia Treasury Bond 20260415	20,600,000,000.000	20,638,110,000.000	
6.5% Indonesia Treasury Bond 20310215	28,000,000,000.000	28,846,440,000.000	
6.25% Indonesia Treasury Bond 20360615	7,300,000,000.000	7,225,394,000.000	
6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20320415	36,300,000,000.000	36,906,210,000.000	
5.125% INDONESIA TREASURY BOND 20270415	20,000,000,000.000	19,952,200,000.000	
7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20420615	17,000,000,000.000	17,486,200,000.000	
6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20370715	2,700,000,000.000	2,675,970,000.000	
7% INDONESIA TREASURY BOND 20330215	24,000,000,000.000	25,049,280,000.000	
6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20280815	16,100,000,000.000	16,484,951,000.000	
7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20430615	18,000,000,000.000	18,530,100,000.000	
7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20380615	20,000,000,000.000	20,768,400,000.000	
6.625% INDONESIA TREASURY BOND 20340215	23,500,000,000.000	23,902,320,000.000	
6.875% INDONESIA TREASURY BOND 20290415	26,000,000,000.000	27,073,800,000.000	
6.75% INDONESIA TREASURY BOND 20350715	31,000,000,000.000	31,842,580,000.000	
6.5% INDONESIA TREASURY BOND 20300715	26,000,000,000.000	26,855,920,000.000	
7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20400815	8,000,000,000.000	8,305,040,000.000	
7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20450815	7,000,000,000.000	7,207,130,000.000	
6.5% INDONESIA TREASURY BOND 20360415	7,000,000,000.000	7,075,740,000.000	
10.5% Indonesia Treasury Bond 20300815	5,000,000,000.000	6,000,600,000.000	

	9.5% Indonesia Treasury Bond 20310715	5,100,000,000.000	5,959,248,000.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20260915	22,024,000,000.000	22,731,190,640.000	
	8.25% Indonesia Treasury Bond 20320615	6,500,000,000.000	7,218,900,000.000	
	7% Indonesia Treasury Bond 20270515	20,000,000,000.000	20,559,600,000.000	
	6.125% Indonesia Treasury Bond 20280515	20,000,000,000.000	20,316,800,000.000	
	6.625% Indonesia Treasury Bond 20330515	17,000,000,000.000	17,311,100,000.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20340315	26,920,000,000.000	30,433,867,600.000	
	9% Indonesia Treasury Bond 20290315	17,000,000,000.000	18,832,600,000.000	
インドネシア・ルピア 小計			656,335,701,240.000 (5,972,654,881)	
ウルグアイ・ペソ	8.5% Uruguay Government International Bond 20280315	2,800,000.000	2,837,968.000	
	8.25% Uruguay Government International Bond 20310521	12,000,000.000	12,138,000.000	
	9.75% URUGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 20330720	11,000,000.000	12,072,500.000	
ウルグアイ・ペソ 小計			27,048,468.000 (100,357,930)	
オフショア・人民元	3.25% China Government Bond 20281122	4,800,000.000	5,089,872.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,900,000.000	6,312,941.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	2,000,000.000	2,032,500.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	4,200,000.000	4,301,766.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	5,700,000.000	6,094,953.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	4,800,000.000	4,926,816.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	4,000,000.000	4,195,560.000	

		3.28% China Government Bond 20271203	3,700,000.000	3,867,018.000	
		3.27% China Government Bond 20301119	5,500,000.000	5,997,475.000	
		3.81% China Government Bond 20500914	5,500,000.000	7,292,615.000	
		3.01% China Government Bond 20280513	3,000,000.000	3,130,170.000	
		3.72% China Government Bond 20510412	2,000,000.000	2,648,720.000	
		3.02% China Government Bond 20310527	7,000,000.000	7,549,220.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,560,030.000	
		2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	1,800,000.000	1,880,550.000	
		3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	2,000,000.000	2,573,140.000	
		2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	3,500,000.000	3,755,850.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	2,800,000.000	2,837,016.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	3,000,000.000	3,193,020.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	3,500,000.000	3,657,010.000	
		2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	2,200,000.000	2,237,730.000	
		3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	2,000,000.000	2,493,700.000	
		2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	2,500,000.000	2,666,100.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	3,600,000.000	3,762,576.000	
		2.5% CHINA GOVERNMENT BOND 20270725	3,700,000.000	3,767,451.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	3,000,000.000	3,182,160.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	1,600,000.000	1,692,448.000	

		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	3,300,000.000	3,435,993.000	
		2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	3,200,000.000	3,263,808.000	
		3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	1,200,000.000	1,454,520.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	3,700,000.000	3,969,841.000	
		2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	3,000,000.000	3,152,520.000	
		2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	3,200,000.000	3,289,728.000	
		2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	2,500,000.000	2,706,125.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	3,700,000.000	3,899,726.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	3,300,000.000	3,399,693.000	
		3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	2,200,000.000	2,703,382.000	
		2.3% CHINA GOVERNMENT BOND 20260515	1,000,000.000	1,006,580.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	3,200,000.000	3,414,528.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	3,000,000.000	3,139,680.000	
		2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	3,000,000.000	3,080,940.000	
		2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	3,000,000.000	3,165,180.000	
		2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	4,500,000.000	4,533,435.000	
		2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925	1,200,000.000	1,236,252.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	4,700,000.000	4,923,955.000	
		3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	2,800,000.000	3,367,224.000	
		2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	4,000,000.000	4,130,760.000	

		2.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20261115	3,000,000.000	3,035,790.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	2,400,000.000	2,564,280.000	
		2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225	4,500,000.000	4,703,220.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20290115	2,200,000.000	2,262,436.000	
		2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20270225	4,000,000.000	4,036,160.000	
		2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225	5,500,000.000	5,743,265.000	
		2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325	900,000.000	929,583.000	
		2.05% CHINA GOVERNMENT BOND 20290415	2,200,000.000	2,240,282.000	
		1.85% CHINA GOVERNMENT BOND 20270515	3,300,000.000	3,323,991.000	
		2.49% CHINA GOVERNMENT BOND 20440525	1,700,000.000	1,808,800.000	
		2.27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525	3,900,000.000	4,049,916.000	
		2.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20310625	2,700,000.000	2,766,555.000	
		1.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20290715	3,000,000.000	3,039,360.000	
		2.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20540520	2,300,000.000	2,537,912.000	
		2.47% CHINA GOVERNMENT BOND 20540725	2,500,000.000	2,703,850.000	
		1.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20270815	3,000,000.000	3,012,180.000	
		2.11% CHINA GOVERNMENT BOND 20340825	4,700,000.000	4,823,563.000	
		2.33% CHINA GOVERNMENT BOND 20440815	500,000.000	519,740.000	
		1.87% CHINA GOVERNMENT BOND 20310915	1,000,000.000	1,010,900.000	
		2.17% CHINA GOVERNMENT BOND 20340829	3,300,000.000	3,402,069.000	

		2.25% CHINA GOVERNMENT BOND 20390829	1,000,000.000	1,030,210.000	
		2.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20540925	2,100,000.000	2,150,484.000	
		1.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20291015	500,000.000	503,455.000	
		1.42% CHINA GOVERNMENT BOND 20271115	1,500,000.000	1,499,940.000	
		2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20341125	2,000,000.000	2,043,200.000	
		1.49% CHINA GOVERNMENT BOND 20311225	2,500,000.000	2,467,950.000	
		1.43% CHINA GOVERNMENT BOND 20300125	5,200,000.000	5,166,616.000	
		1.92% CHINA GOVERNMENT BOND 20550115	2,200,000.000	2,125,552.000	
		1.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20350215	6,000,000.000	5,908,200.000	
		1.45% CHINA GOVERNMENT BOND 20280225	4,300,000.000	4,303,526.000	
		1.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20320325	4,000,000.000	4,024,080.000	
		1.65% CHINA GOVERNMENT BOND 20350515	2,000,000.000	1,977,060.000	
		1.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20280525	3,800,000.000	3,803,078.000	
		1.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20350525	5,000,000.000	4,953,900.000	
		1.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20550425	4,300,000.000	4,177,149.000	
		1.98% CHINA GOVERNMENT BOND 20450425	2,000,000.000	1,970,860.000	
		1.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	500,000.000	495,185.000	
		1.45% CHINA GOVERNMENT BOND 20300425	2,000,000.000	1,986,240.000	
		1.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20300725	1,500,000.000	1,495,530.000	
		1.42% CHINA GOVERNMENT BOND 20280815	2,000,000.000	1,996,320.000	

	1.83% CHINA GOVERNMENT BOND 20350825	2,000,000.000	2,002,040.000	
	2.15% CHINA GOVERNMENT BOND 20550825	150,000.000	151,771.500	
	1.9% CHINA GOVERNMENT BOND 20550715	3,000,000.000	2,883,480.000	
オフショア・人民元 小計			286,601,955.500 (5,967,883,859)	
コロンビア・ペソ	6% Colombian TES 20280428	7,300,000,000.000	6,665,703,000.000	
	7.5% Colombian TES 20260826	5,000,000,000.000	4,929,850,000.000	
	7.75% Colombian TES 20300918	4,000,000,000.000	3,518,520,000.000	
	7% Colombian TES 20320630	5,300,000,000.000	4,190,127,000.000	
	7.25% Colombian TES 20341018	4,500,000,000.000	3,421,170,000.000	
	5.75% Colombian TES 20271103	3,500,000,000.000	3,267,005,000.000	
	7.25% Colombian TES 20501026	8,000,000,000.000	5,049,520,000.000	
	6.25% Colombian TES 20360709	3,750,000,000.000	2,560,237,500.000	
	7% COLOMBIAN TES 20310326	4,500,000,000.000	3,729,285,000.000	
	9.25% COLOMBIAN TES 20420528	9,300,000,000.000	7,471,527,000.000	
	13.25% COLOMBIAN TES 20330209	5,200,000,000.000	5,538,572,000.000	
	11.5% COLOMBIAN TES 20460725	6,000,000,000.000	5,639,580,000.000	
	11% COLOMBIAN TES 20290822	1,000,000,000.000	1,007,370,000.000	
コロンビア・ペソ 小計			56,988,466,500.000 (2,135,756,760)	
セルビア・ディナール	5.875% Serbia Treasury Bonds 20280208	25,000,000.000	25,912,500.000	
	4.5% Serbia Treasury Bonds 20320820	35,000,000.000	34,212,500.000	
	7% SERBIA TREASURY BONDS 20311026	29,000,000.000	32,407,500.000	
	5.25% SERBIA TREASURY BONDS 20350727	25,000,000.000	25,037,500.000	

セルビア・ディナール 小計			117,570,000.000 (174,529,255)	
タイ・バーツ	4.875% Thailand Government Bond 20290622	48,050,000.000	54,771,234.000	
	3.65% Thailand Government Bond 20310620	39,200,000.000	44,744,448.000	
	3.4% Thailand Government Bond 20360617	34,600,000.000	41,736,942.000	
	2.125% Thailand Government Bond 20261217	40,000,000.000	40,529,600.000	
	3.775% Thailand Government Bond 20320625	40,000,000.000	46,782,800.000	
	2.875% Thailand Government Bond 20460617	34,900,000.000	41,392,796.000	
	2.875% Thailand Government Bond 20281217	39,000,000.000	41,217,540.000	
	3.3% Thailand Government Bond 20380617	40,000,000.000	48,754,400.000	
	1.6% Thailand Government Bond 20291217	38,500,000.000	39,307,730.000	
	1.6% Thailand Government Bond 20350617	20,500,000.000	21,173,220.000	
	1.585% Thailand Government Bond 20351217	40,900,000.000	42,215,344.000	
	2% Thailand Government Bond 20311217	60,000,000.000	63,134,400.000	
	2% Thailand Government Bond 20420617	29,000,000.000	30,835,410.000	
	1% THAILAND GOVERNMENT BOND 20270617	61,000,000.000	60,912,160.000	
	2.65% THAILAND GOVERNMENT BOND 20280617	50,000,000.000	52,137,000.000	
	3.39% THAILAND GOVERNMENT BOND 20370617	48,500,000.000	59,407,165.000	
	2.35% THAILAND GOVERNMENT BOND 20260617	17,000,000.000	17,148,920.000	
	3.45% THAILAND GOVERNMENT BOND 20430617	49,500,000.000	62,909,055.000	
	3.35% THAILAND GOVERNMENT BOND 20330617	37,000,000.000	42,905,570.000	

	2.25% THAILAND GOVERNMENT BOND 20270317	50,000,000.000	50,871,000.000	
	2.4% THAILAND GOVERNMENT BOND 20290317	37,000,000.000	38,676,100.000	
	2.8% THAILAND GOVERNMENT BOND 20340617	40,000,000.000	45,240,000.000	
	2.4% THAILAND GOVERNMENT BOND 20271117	28,700,000.000	29,505,322.000	
	2.5% THAILAND GOVERNMENT BOND 20291117	44,000,000.000	46,537,920.000	
	2.98% THAILAND GOVERNMENT BOND 20450617	20,000,000.000	24,207,200.000	
	2.05% THAILAND GOVERNMENT BOND 20280417	20,000,000.000	20,501,200.000	
	2.41% THAILAND GOVERNMENT BOND 20350317	16,000,000.000	17,712,640.000	
	2.7% THAILAND GOVERNMENT BOND 20400617	7,000,000.000	8,197,350.000	
	1.66% THAILAND GOVERNMENT BOND 20300317	10,000,000.000	10,250,800.000	
タイ・バーツ 小計			1,143,715,266.000 (5,295,401,681)	
チェコ・コルナ	2.5% Czech Republic Government Bond 20280825	26,600,000.000	25,757,046.000	
	1% Czech Republic Government Bond 20260626	25,000,000.000	24,587,500.000	
	0.95% Czech Republic Government Bond 20300515	27,500,000.000	24,105,675.000	
	0.25% Czech Republic Government Bond 20270210	27,000,000.000	25,849,800.000	
	2.75% Czech Republic Government Bond 20290723	21,800,000.000	21,020,868.000	
	2% Czech Republic Government Bond 20331013	29,500,000.000	24,993,875.000	
	1.2% Czech Republic Government Bond 20310313	23,000,000.000	19,891,550.000	
	0.05% Czech Republic Government Bond 20291129	15,500,000.000	13,264,745.000	
	4.2% Czech Republic Government Bond 20361204	15,300,000.000	14,951,925.000	

	1.75% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20320623	29,500,000.000	25,477,970.000	
	1.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20400424	16,500,000.000	11,030,250.000	
	3.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20350530	25,000,000.000	23,365,000.000	
	5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20300930	26,000,000.000	27,272,180.000	
	5.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20281212	20,500,000.000	21,682,645.000	
	1.95% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20370730	14,000,000.000	10,736,460.000	
	4.9% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20340414	26,000,000.000	27,145,820.000	
	5.75% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20290329	12,000,000.000	12,830,520.000	
	6.2% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20310616	8,000,000.000	8,904,480.000	
	4.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20321111	20,000,000.000	20,407,600.000	
	3% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20330303	11,000,000.000	10,166,420.000	
	3.6% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20360603	10,000,000.000	9,293,300.000	
	4.25% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20341024	4,000,000.000	3,973,960.000	
チェコ・コルナ 小計			406,709,589.000 (2,899,839,370)	
チリ・ペソ	5% BONOS TESORERIA PESOS 20350301	970,000,000.000	927,814,700.000	
	6% BONOS TESORERIA PESOS 20430101	630,000,000.000	655,678,800.000	
	4.7% BONOS TESORERIA PESOS 20300901	800,000,000.000	779,368,000.000	
	5% BONOS TESORERIA PESOS 20281001	720,000,000.000	718,466,400.000	
	7% BONOS TESORERIA PESOS 20340501	220,000,000.000	241,716,200.000	
	6% BONOS TESORERIA PESOS 20330401	850,000,000.000	875,304,500.000	

	6.2% BONOS TESORERIA PESOS 20401001	350,000,000.000	370,370,000.000	
	5.8% BONOS TESORERIA PESOS 20291001	1,000,000,000.000	1,021,460,000.000	
	5.8% BONOS TESORERIA PESOS 20341001	440,000,000.000	447,735,200.000	
	5.3% BONOS TESORERIA PESOS 20371101	150,000,000.000	145,560,000.000	
	BONOS TESORERIA PESOS 20290401	400,000,000.000	336,672,000.000	
チリ・ペソ 小計			6,520,145,800.000 (1,001,637,838)	
ドミニカ・ペソ	13.625% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20330203	11,400,000.000	13,724,232.000	
	11.25% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20350915	12,500,000.000	13,780,375.000	
	10.75% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20360601	20,000,000.000	21,385,000.000	
	10.5% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20370315	18,000,000.000	19,080,000.000	
ドミニカ・ペソ 小計			67,969,607.000 (159,008,098)	
トルコ・リラ	11% Turkey Government Bond 20270224	2,970,000.000	2,139,914.700	
	10.5% Turkey Government Bond 20270811	20,000,000.000	13,175,200.000	
	12.4% Turkey Government Bond 20280308	15,000,000.000	9,535,050.000	
	11.7% Turkey Government Bond 20301113	13,900,000.000	7,110,684.000	
	16.9% TURKEY GOVERNMENT BOND 20260902	8,500,000.000	7,088,320.000	
	17.8% TURKEY GOVERNMENT BOND 20330713	11,500,000.000	7,398,755.000	
	17.3% TURKEY GOVERNMENT BOND 20280719	23,000,000.000	15,926,350.000	
	26.2% TURKEY GOVERNMENT BOND 20331005	52,000,000.000	46,384,000.000	
	31.08% TURKEY GOVERNMENT BOND 20281108	39,500,000.000	36,548,560.000	

	30% TURKEY GOVERNMENT BOND 20290912	40,000,000.000	36,180,000.000	
	27.7% TURKEY GOVERNMENT BOND 20340927	12,000,000.000	11,007,000.000	
トルコ・リラ 小計			192,493,833.700 (693,651,530)	
ハンガリー・フォリント	3% Hungary Government Bond 20271027	270,000,000.000	252,865,800.000	
	2.75% Hungary Government Bond 20261222	170,000,000.000	163,203,400.000	
	6.75% Hungary Government Bond 20281022	373,000,000.000	376,584,530.000	
	3% Hungary Government Bond 20300821	300,000,000.000	256,599,000.000	
	3.25% Hungary Government Bond 20311022	332,000,000.000	275,666,240.000	
	3% Hungary Government Bond 20381027	100,000,000.000	64,810,000.000	
	1.5% Hungary Government Bond 20260422	224,000,000.000	218,267,840.000	
	2% Hungary Government Bond 20290523	300,000,000.000	257,178,000.000	
	2.25% Hungary Government Bond 20330420	315,000,000.000	229,707,450.000	
	1.5% Hungary Government Bond 20260826	100,000,000.000	95,989,000.000	
	3% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20410425	130,000,000.000	78,183,300.000	
	2.25% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20340622	75,000,000.000	52,043,250.000	
	4.5% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20280323	100,000,000.000	95,689,000.000	
	4.75% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20321124	235,000,000.000	206,727,150.000	
	9.5% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20261021	190,000,000.000	196,579,700.000	
	7% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20351024	170,000,000.000	168,607,700.000	
ハンガリー・フォリント 小計			2,988,701,360.000 (1,315,028,598)	

ブラジル・レアル	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20270101	19,000,000.000	18,180,150.000	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20290101	18,000,000.000	16,549,920.000	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20310101	19,000,000.000	16,580,160.000	
	10% BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F 20330101	9,000,000.000	7,535,250.000	
	10% BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F 20350101	12,000,000.000	9,722,040.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20260701	30,000,000.000	26,897,700.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20270701	15,000,000.000	11,943,600.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20300101	10,000,000.000	5,830,300.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20280101	9,200,000.000	6,906,164.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20280701	4,000,000.000	2,830,720.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20290101	27,000,000.000	17,926,380.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20320101	8,700,000.000	3,870,021.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20290701	3,000,000.000	1,866,090.000	
ブラジル・レアル 小計			146,638,495.000 (4,020,739,550)	
ペルー・ソル	6.35% Peru Government Bond 20280812	1,270,000.000	1,349,933.800	
	6.15% Peru Government Bond 20320812	3,350,000.000	3,557,901.000	
	5.94% Peru Government Bond 20290212	2,300,000.000	2,421,463.000	
	5.4% Peru Government Bond 20340812	2,850,000.000	2,764,528.500	
	5.35% Peru Government Bond 20400812	2,100,000.000	1,860,348.000	
	7.3% PERU GOVERNMENT BOND 20330812	2,500,000.000	2,793,425.000	

	7.6% PERU GOVERNMENT BOND 20390812	1,800,000.000	1,967,328.000	
	6.85% PERU GOVERNMENT BOND 20350812	1,300,000.000	1,371,825.000	
	8.2% Peru Government Bond 20260812	175,000.000	181,616.750	
	6.9% Peru Government Bond 20370812	4,465,000.000	4,660,299.100	
	6.95% Peru Government Bond 20310812	3,370,000.000	3,735,982.000	
ペルー・ソル 小計			26,664,650.150 (1,123,371,045)	
ポーランド・ズロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,900,000.000	4,854,381.000	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	7,100,000.000	6,882,101.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	10,850,000.000	10,091,368.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	9,400,000.000	7,904,742.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	6,300,000.000	6,053,985.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	9,400,000.000	7,692,772.000	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	6,150,000.000	6,107,196.000	
	7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	9,400,000.000	10,165,724.000	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	10,000,000.000	10,521,000.000	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725	9,000,000.000	9,035,640.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20341025	9,000,000.000	8,792,820.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300125	9,000,000.000	9,083,610.000	
	4.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300725	7,500,000.000	7,390,275.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20280125	800,000.000	720,032.000	

	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20351025	1,500,000.000	1,455,975.000	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	6,950,000.000	6,687,359.500	
ポーランド・ズロチ 小計			113,438,980.500 (4,637,385,523)	
マレーシア・リンギット	4.07% Malaysia Government Investment Issue 20260930	4,650,000.000	4,708,497.000	
	4.258% Malaysia Government Investment Issue 20270726	1,800,000.000	1,842,282.000	
	4.369% Malaysia Government Investment Issue 20281031	4,400,000.000	4,567,728.000	
	4.13% Malaysia Government Investment Issue 20290709	5,000,000.000	5,180,050.000	
	3.465% Malaysia Government Investment Issue 20301015	5,100,000.000	5,172,369.000	
	3.422% Malaysia Government Investment Issue 20270930	4,250,000.000	4,286,337.500	
	3.447% Malaysia Government Investment Issue 20360715	3,700,000.000	3,683,276.000	
	4.417% MALAYSIA T-BILL 20410930	3,300,000.000	3,596,670.000	
	3.804% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20311008	4,000,000.000	4,117,960.000	
	3.635% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20300830	1,000,000.000	1,022,200.000	
	3.612% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20350430	1,500,000.000	1,521,705.000	
	3.974% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20400716	2,000,000.000	2,080,000.000	
	3.775% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20450531	800,000.000	799,632.000	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	6,000,000.000	6,052,740.000	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	3,850,000.000	3,910,868.500	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	3,100,000.000	3,313,590.000	
	3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	3,700,000.000	3,745,991.000	

		3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	3,820,000.000	3,892,847.400	
		4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	4,300,000.000	4,792,737.000	
		4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	4,200,000.000	4,577,664.000	
		4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	4,450,000.000	5,037,489.000	
		3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	3,100,000.000	3,128,830.000	
		3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	5,000,000.000	5,136,600.000	
		4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	2,750,000.000	3,196,490.000	
		3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	5,000,000.000	5,165,050.000	
		3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	4,400,000.000	4,473,084.000	
		4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	5,000,000.000	5,163,450.000	
		2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	5,400,000.000	5,232,222.000	
		3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	4,000,000.000	4,063,600.000	
		4.193% MALAYSIAN GOVERNMENT 20321007	4,000,000.000	4,209,560.000	
		4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	4,100,000.000	4,602,783.000	
		4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	1,500,000.000	1,570,665.000	
		3.599% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280731	5,000,000.000	5,074,050.000	
		4.291% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430814	5,000,000.000	5,358,800.000	
		4.662% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380331	1,400,000.000	1,554,448.000	
		4.245% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300930	3,600,000.000	3,781,764.000	
		4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	4,100,000.000	4,475,396.000	

	3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	3,000,000.000	3,036,540.000	
	4.467% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390915	4,900,000.000	5,355,945.000	
	4.054% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390418	4,000,000.000	4,187,320.000	
	4.18% MALAYSIAN GOVERNMENT 20440516	2,500,000.000	2,643,375.000	
	4.119% MALAYSIAN GOVERNMENT 20341130	5,000,000.000	5,272,700.000	
	3.336% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300515	2,000,000.000	2,018,620.000	
	3.476% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350702	500,000.000	502,925.000	
	3.917% MALAYSIAN GOVERNMENT 20550715	550,000.000	553,069.000	
マレーシア・リンギット 小計			167,659,919.400 (5,894,403,020)	
メキシコ・ペソ	8% Mexican Bonos 20471107	40,000,000.000	34,754,400.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	40,000,000.000	38,809,600.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	65,000,000.000	55,941,600.000	
	7.5% MEXICAN BONOS 20330526	55,400,000.000	52,048,854.000	
	7% MEXICAN BONOS 20260903	30,000,000.000	29,807,100.000	
	8% MEXICAN BONOS 20350524	6,000,000.000	5,690,520.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20290301	60,000,000.000	60,729,000.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20280302	40,000,000.000	40,542,800.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20300228	34,300,000.000	34,651,575.000	
	8% MEXICAN BONOS 20360221	20,000,000.000	18,851,800.000	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	60,500,000.000	60,315,475.000	
	10% Mexican Bonos 20361120	16,890,000.000	18,299,808.300	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	59,500,000.000	60,218,760.000	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	35,000,000.000	33,408,900.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	80,000,000.000	77,949,600.000	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	65,000,000.000	56,072,900.000	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	71,000,000.000	66,817,390.000	
メキシコ・ペソ 小計			744,910,082.300 (5,906,690,007)	

ルーマニア・レイ	5.8% Romania Government Bond 20270726	2,800,000.000	2,728,600.000	
	5% Romania Government Bond 20290212	2,600,000.000	2,410,122.000	
	4.85% Romania Government Bond 20260422	2,500,000.000	2,469,300.000	
	3.65% Romania Government Bond 20310924	2,500,000.000	2,048,325.000	
	4.15% Romania Government Bond 20280126	2,600,000.000	2,423,564.000	
	3.25% Romania Government Bond 20260624	2,000,000.000	1,945,560.000	
	4.15% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20301024	2,500,000.000	2,152,825.000	
	4.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20341011	2,700,000.000	2,220,777.000	
	2.5% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20271025	2,300,000.000	2,089,113.000	
	4.85% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20290725	2,300,000.000	2,100,498.000	
	6.7% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20320225	3,000,000.000	2,876,520.000	
	4.25% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20360428	2,300,000.000	1,774,818.000	
	8.25% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20320929	2,500,000.000	2,596,575.000	
	8.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20281030	2,700,000.000	2,793,717.000	
	8% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20300429	3,500,000.000	3,561,285.000	
	7.9% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20380224	2,600,000.000	2,695,732.000	
	7.2% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20261028	2,400,000.000	2,406,480.000	
	7.2% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20331030	2,700,000.000	2,648,889.000	
	7.35% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20310428	2,500,000.000	2,477,900.000	
	7.2% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20270531	3,000,000.000	2,997,420.000	

		7.1% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20340731	2,700,000.000	2,628,450.000	
		6.3% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20290425	2,000,000.000	1,925,840.000	
		6.3% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20280426	500,000.000	486,945.000	
		6.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20350425	500,000.000	473,425.000	
		6.85% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20300729	1,000,000.000	974,050.000	
		7.65% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20310727	700,000.000	704,760.000	
	ルーマニア・レイ 小計			56,611,490.000 (1,939,509,647)	
	南アフリカ・ランド	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	48,500,000.000	50,237,755.000	
		6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	17,720,000.000	13,655,386.400	
		6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	16,280,000.000	11,375,650.000	
		7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	38,000,000.000	35,730,260.000	
		8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	75,000,000.000	62,079,000.000	
		8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	55,000,000.000	49,209,050.000	
		8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	58,500,000.000	58,391,190.000	
		8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	47,700,000.000	39,869,091.000	
		8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	59,000,000.000	57,514,380.000	
		8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	60,000,000.000	57,579,000.000	
		9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	49,400,000.000	43,820,764.000	
		11.625% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20530331	15,000,000.000	16,192,500.000	
		10.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20380331	8,000,000.000	8,416,480.000	

		10% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20330331	5,000,000.000	5,251,700.000	
	南アフリカ・ランド 小計			509,322,206.400 (4,293,586,200)	
国債証券 合計				59,476,993,947 [59,476,993,947]	
合計				59,476,993,947 [59,476,993,947]	

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
インド・ルピー	国債証券	36銘柄	100%	9.9%
インドネシア・ルピア	国債証券	36銘柄	100%	10.0%
ウルグアイ・ペソ	国債証券	3銘柄	100%	0.2%
オフショア・人民元	国債証券	90銘柄	100%	10.0%
コロンビア・ペソ	国債証券	13銘柄	100%	3.6%
セルビア・ディナール	国債証券	4銘柄	100%	0.3%
タイ・バーツ	国債証券	29銘柄	100%	8.9%
チェコ・コルナ	国債証券	22銘柄	100%	4.9%
チリ・ペソ	国債証券	11銘柄	100%	1.7%
ドミニカ・ペソ	国債証券	4銘柄	100%	0.3%
トルコ・リラ	国債証券	11銘柄	100%	1.2%
ハンガリー・フォリント	国債証券	16銘柄	100%	2.2%
ブラジル・レアル	国債証券	13銘柄	100%	6.8%
ペルー・ソル	国債証券	11銘柄	100%	1.9%
ポーランド・ズロチ	国債証券	16銘柄	100%	7.8%
マレーシア・リンギット	国債証券	45銘柄	100%	9.9%
メキシコ・ペソ	国債証券	17銘柄	100%	9.9%
ルーマニア・レイ	国債証券	26銘柄	100%	3.3%
南アフリカ・ランド	国債証券	14銘柄	100%	7.2%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

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

期末剰余金又は期末欠損金（△）	166,279,960,902	290,603,053,337
元本等合計	356,011,042,239	507,512,339,385
純資産合計	356,011,042,239	507,512,339,385
負債純資産合計	379,771,723,899	519,967,809,282

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	2024年9月9日現在	2025年9月8日現在
1. ※1 期首	2023年9月8日	2024年9月10日
期首元本額	161,837,366,239円	189,731,081,337円
期中追加設定元本額	45,131,685,403円	55,360,566,250円
期中一部解約元本額	17,237,970,305円	28,182,361,539円
期末元本額の内訳		
ファンド名		

トピックス・インデックスファンド	2,796,289,328円	2,780,907,612円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	3,855,336,127円	3,539,447,475円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドＶＡ２	906,394円	900,080円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	9,102,808円	8,390,437円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	139,731,414円	93,321,668円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	11,345,216円	9,421,930円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	326,312,724円	223,926,031円
国内株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,210,358,757円	1,500,239,796円
日本株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	806,501,924円	932,945,619円
アセット・アロケーションファンド（リスク判断付き）2023-07（適格機関投資家専用）	1,139,715,535円	320,911,436円
Ｄ－Ｉ's ＴＯＰＩＸインデックス	12,940,316円	9,985,752円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	244,560,257円	238,704,010円
ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	8,736,405,174円	11,215,469,502円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	4,923,229,766円	5,578,054,919円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	1,164,622,244円	1,262,782,851円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	4,217,861円	5,440,436円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	71,512,201,743円	71,239,078,609円
ダイワ・ライフ・バランス３０	2,976,357,767円	2,780,924,299円
ダイワ・ライフ・バランス５０	5,065,079,023円	5,194,963,513円
ダイワ・ライフ・バランス７０	6,061,926,904円	6,291,386,823円
年金ダイワ日本株式インデックス	7,869,642,736円	10,600,746,704円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	48,273,526円	39,453,807円

ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	75,818,829円	76,542,379円
ダイワつみたてインデックス日本株式	6,239,751,271円	7,583,670,623円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	12,225,840円	12,171,768円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	13,614,963円	14,345,245円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	34,614,877円	290,582,027円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	20,766,034,706円	31,248,891,497円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	46,891,177円	39,002,619円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	19,720,730円	17,507,099円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	3,083,043,311円	2,355,819,558円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	302,012,383円	243,904,985円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	40,356,490円	30,851,624円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	57,882,863円	42,157,846円
ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	252,298,401円	211,295,033円
ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	14,290,905,074円	18,950,681,597円
ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	12,373,133,432円	19,560,355,816円
ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	3,448,211,798円	3,283,801,344円
スタイル9（4資産分散・保守型）	550,348円	1,459,735円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	4,363,232円	10,249,166円
スタイル9（4資産分散・積極型）	6,118,317円	15,700,988円
スタイル9（6資産分散・保守型）	273,622円	639,450円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	7,841,413円	18,514,343円

	スタイル9（6資産分散・積極型）	9,101,329円	21,913,104円
	スタイル9（8資産分散・保守型）	435,270円	1,013,262円
	スタイル9（8資産分散・バランス型）	6,346,993円	16,907,278円
	スタイル9（8資産分散・積極型）	19,070,869円	45,343,238円
	ダイワ国内株式インデックス（投資一任専用）	-円	20,832,657円
	ダイワ・インデックスセレクトＴＯＰＩＸ	1,027,576,483円	887,745,098円
	ダイワライフスタイル２５	94,085,020円	81,844,944円
	ダイワライフスタイル５０	430,730,614円	407,368,951円
	ダイワライフスタイル７５	380,782,713円	365,658,040円
	ＤＣ・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）	7,772,231,425円	7,185,111,425円
	計	189,731,081,337円	216,909,286,048円
2.	期末日における受益権の総数	189,731,081,337口	216,909,286,048口
3.	※2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式　14,570,847,450円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式　11,661,423,930円
4.	※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式　679,700,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式　998,390,000円
5.	※4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年9月10日 至2025年9月8日

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

II　金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年9月9日現在	2025年9月8日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	15,818,431,709	79,377,736,323
合計	15,818,431,709	79,377,736,323

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種類	2024年9月9日現在				2025年9月8日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	4,603,565,000	-	4,394,500,000	△209,065,000	6,020,067,500	-	6,216,210,000	196,142,500
合計	4,603,565,000	-	4,394,500,000	△209,065,000	6,020,067,500	-	6,216,210,000	196,142,500

（注）　1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

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

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

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

西松建設	17,700	5,316.00	94,093,200	
三井住友建設	87,800	598.00	52,504,400	
大豊建設	15,300	860.00	13,158,000	
奥 村 組	19,600	4,910.00	96,236,000	
東鉄工業	12,200	4,435.00	54,107,000	
淺沼組	44,400	907.00	40,270,800	
戸田建設	136,400	1,064.50	145,197,800	
熊 谷 組	18,300	4,825.00	88,297,500	
矢作建設	15,100	2,278.00	34,397,800	貸付株式数 100株
ピーエス・コンストラクション	8,000	1,888.00	15,104,000	
日本ハウスHLDGS	23,700	318.00	7,536,600	貸付株式数 9,100株
大東建託	37,900	16,340.00	619,286,000	
新日本建設	15,600	1,923.00	29,998,800	
東亜道路	19,200	1,711.00	32,851,200	
日本道路	5,500	2,513.00	13,821,500	
東亜建設	33,500	2,226.00	74,571,000	
日本国土開発	34,000	532.00	18,088,000	
若築建設	3,300	5,900.00	19,470,000	貸付株式数 500株
東洋建設	31,900	1,744.00	55,633,600	
五洋建設	145,100	1,074.00	155,837,400	
世紀東急	15,800	1,599.00	25,264,200	貸付株式数 3,000株
福 田 組	3,800	6,670.00	25,346,000	
住友林業	287,600	1,796.00	516,529,600	
大和ハウス	334,500	5,507.00	1,842,091,500	
ライト工業	21,100	3,310.00	69,841,000	
積水ハウス	336,300	3,463.00	1,164,606,900	
日特建設	10,600	1,327.00	14,066,200	
北陸電気工事	7,600	1,475.00	11,210,000	
ユアテック	20,500	2,717.00	55,698,500	
日本リーテック	8,700	2,016.00	17,539,200	貸付株式数 2,900株
四電工	13,900	1,399.00	19,446,100	
中電工	17,200	3,880.00	66,736,000	
関 電 工	60,700	4,039.00	245,167,300	
きんでん	76,100	5,243.00	398,992,300	
東京エネシス	11,800	1,656.00	19,540,800	貸付株式数 4,600株
トーエネック	18,400	1,441.00	26,514,400	
住友電設	9,000	6,640.00	59,760,000	貸付株式数 300株
日本電設工業	20,800	2,732.00	56,825,600	
エクシオグループ	114,600	2,197.50	251,833,500	

新日本空調	14,400	3,150.00	45,360,000	貸付株式数 3,400株
九電工	24,000	7,191.00	172,584,000	
三機工業	23,100	5,200.00	120,120,000	
日揮ホールディングス	109,700	1,492.00	163,672,400	
中外炉工業	3,600	4,045.00	14,562,000	
太平電業	7,300	6,280.00	45,844,000	
高砂熱学	26,700	8,835.00	235,894,500	
朝日工業社	10,300	3,165.00	32,599,500	
明星工業	18,600	1,690.00	31,434,000	
大 氣 社	28,400	2,951.00	83,808,400	
ダイダン	19,400	6,200.00	120,280,000	
日比谷総合設備	9,000	4,555.00	40,995,000	貸付株式数 1,800株
ニップン	39,400	2,371.00	93,417,400	貸付株式数 3,400株
日清製粉Ｇ本社	110,600	1,861.00	205,826,600	
日東富士製粉	2,000	7,160.00	14,320,000	
昭和産業	9,400	3,060.00	28,764,000	
中部飼料	15,400	1,760.00	27,104,000	
フィード・ワン	16,300	1,150.00	18,745,000	
日本甜菜糖	5,800	2,821.00	16,361,800	貸付株式数 2,200株
DM三井製糖	10,600	3,330.00	35,298,000	
ウェルネオシュガー	6,200	2,575.00	15,965,000	
ＬＩＦＵＬＬ	34,100	228.00	7,774,800	
ＭＩＸＩ	21,100	3,310.00	69,841,000	
ジェイエイシーリクルートメント	42,000	1,100.00	46,200,000	
日本M&Aセンターホールデ	170,900	795.90	136,019,310	
メンバーズ	4,500	1,230.00	5,535,000	貸付株式数 1,700株
ＵＴグループ	15,200	2,766.00	42,043,200	
アイティメディア	6,200	1,704.00	10,564,800	貸付株式数 500株
ケアネット	19,800	1,127.00	22,314,600	
E・Jホールディングス	7,600	1,781.00	13,535,600	
オープンアップグループ	38,800	1,820.00	70,616,000	
コシダカホールディングス	31,900	1,404.00	44,787,600	貸付株式数 12,300株
パソナグループ	13,600	2,185.00	29,716,000	
リンクアンドモチベーション	27,600	559.00	15,428,400	貸付株式数 8,800株
エス・エム・エス	44,400	1,625.00	72,150,000	
パーソルホールディングス	1,059,300	290.00	307,197,000	
クックパッド	22,700	170.00	3,859,000	貸付株式数 12,100株
森永製菓	43,700	2,723.00	118,995,100	

中 村 屋	2,800	3,145.00	8,806,000		
江崎グリコ	31,800	5,100.00	162,180,000		
ｍｅｉｔｏ	4,900	2,185.00	10,706,500	貸付株式数	1,900株
井村屋グループ	6,100	2,567.00	15,658,700		
不 二 家	7,600	2,590.00	19,684,000	貸付株式数	3,000株
山崎製パン	74,500	3,379.00	251,735,500		
モロゾフ	10,800	1,560.00	16,848,000	貸付株式数	4,200株
亀田製菓	7,100	4,255.00	30,210,500	貸付株式数	2,700株
寿スピリッツ	65,800	1,845.50	121,433,900	貸付株式数	25,800株
カルビー	50,900	2,754.00	140,178,600		
森永乳業	41,400	3,558.00	147,301,200		
六甲バター	9,100	1,289.00	11,729,900	貸付株式数	3,400株
ヤクルト	154,300	2,458.00	379,269,400	貸付株式数	60,600株
明治ホールディングス	143,100	3,209.00	459,207,900		
雪印メグミルク	29,900	3,030.00	90,597,000		
プリマハム	14,900	2,429.00	36,192,100	貸付株式数	5,800株
日本ハム	46,100	5,793.00	267,057,300		
丸大食品	11,200	2,047.00	22,926,400	貸付株式数	3,900株
Ｓ Ｆｏｏｄｓ	12,300	2,779.00	34,181,700		
柿安本店	4,700	2,741.00	12,882,700	貸付株式数	1,800株
伊藤ハム米久HLDGS	17,000	5,840.00	99,280,000		
学情	5,300	1,920.00	10,176,000	貸付株式数	2,200株
スタジオアリス	5,800	2,094.00	12,145,200	貸付株式数	2,200株 (300株)
クロスキャット	6,500	1,149.00	7,468,500	貸付株式数	100株
システナ	162,000	492.00	79,704,000		
ＮＪＳ	2,500	6,340.00	15,850,000	貸付株式数	1,100株
デジタルアーツ	7,200	7,990.00	57,528,000	貸付株式数	2,800株
日鉄ソリューションズ	38,700	3,533.00	136,727,100	貸付株式数	15,200株
ＡＬＳＯＫ	194,100	1,170.50	227,194,050		
キューブシステム	6,000	1,201.00	7,206,000	貸付株式数	2,300株
いちご	94,200	443.00	41,730,600		
日本駐車場開発	132,500	298.00	39,485,000	貸付株式数	52,000株
コア	5,000	2,060.00	10,300,000		
カカクコム	83,800	2,703.50	226,553,300		
セントケア・ホールディング	7,400	821.00	6,075,400	貸付株式数	2,800株
ルネサンス	9,000	1,210.00	10,890,000	貸付株式数	3,400株
ディップ	20,300	2,397.00	48,659,100	貸付株式数	8,000株

SBSホールディングス	10,100	3,765.00	38,026,500	貸付株式数	3,800株
デジタルホールディングス	5,900	2,012.00	11,870,800	貸付株式数	2,300株
新日本科学	12,300	1,741.00	21,414,300	貸付株式数	4,100株
エムスリー	229,600	2,416.00	554,713,600		
ワールドホールディングス	5,300	2,585.00	13,700,500	貸付株式数	400株
ディー・エヌ・エー	46,500	2,338.00	108,717,000	貸付株式数	18,200株
博報堂ＤＹHLDGS	131,700	1,204.50	158,632,650		
ぐるなび	21,600	242.00	5,227,200	貸付株式数	8,500株
タカミヤ	15,700	374.00	5,871,800	貸付株式数	6,200株
ファンコミュニケーションズ	16,800	534.00	8,971,200	貸付株式数	1,800株
ライク	6,100	1,496.00	9,125,600	貸付株式数	2,300株 (2,000株)
エスプール	30,000	329.00	9,870,000		
WDBホールディングス	5,900	1,805.00	10,649,500	貸付株式数	1,800株
手間いらず	1,600	3,020.00	4,832,000	貸付株式数	500株
アドウェイズ	12,400	303.00	3,757,200	貸付株式数	4,800株
バリューコマース	10,200	823.00	8,394,600	貸付株式数	1,700株
インフォマート	109,700	360.00	39,492,000	貸付株式数	42,500株
サッポロホールディングス	33,300	7,378.00	245,687,400		
アサヒグループホールディン	835,700	1,879.50	1,570,698,150		
キリンＨＤ	463,600	2,252.00	1,044,027,200		
シマダヤ	3,200	1,754.00	5,612,800	貸付株式数	1,200株
宝ホールディングス	75,000	1,755.00	131,625,000		
オエノンホールディングス	33,300	600.00	19,980,000	貸付株式数	12,000株
養 命 酒	3,600	3,975.00	14,310,000	貸付株式数	1,400株
飛島ホールディングス	11,400	2,252.00	25,672,800		
コカ・コーラボトラーズJHD	77,500	2,702.50	209,443,750		
ライフドリンク カンパニー	24,300	2,534.00	61,576,200	貸付株式数	9,500株
サントリー食品インター	78,400	4,680.00	366,912,000		
ダイドーグループHD	12,600	2,591.00	32,646,600	貸付株式数	3,900株
伊 藤 園	36,000	3,594.00	129,384,000	貸付株式数	14,000株
キーコーヒー	12,500	2,001.00	25,012,500	貸付株式数	4,800株
日清オイリオグループ	15,700	5,370.00	84,309,000		
不二製油	22,200	3,677.00	81,629,400		
Ｊ－オイルミルズ	12,700	2,094.00	26,593,800		
インターメスティック	5,200	3,035.00	15,782,000	貸付株式数	3,400株
サンエー	20,300	2,864.00	58,139,200	貸付株式数	7,800株
カワチ薬品	9,400	2,864.00	26,921,600		

エービーシー・マート	52,300	3,150.00	164,745,000		
ハードオフコーポレーション	4,700	1,826.00	8,582,200		
高千穂交易	9,500	1,942.00	18,449,000	貸付株式数	3,600株
アスクル	28,000	1,563.00	43,764,000		
ゲオホールディングス	13,400	1,680.00	22,512,000		
アンドエスティHD	16,500	3,190.00	52,635,000	貸付株式数	6,300株
リガク・ホールディングス	67,900	911.00	61,856,900	貸付株式数	30,000株
伊藤忠食品	2,700	10,430.00	28,161,000	貸付株式数	1,000株
くら寿司	14,000	3,945.00	55,230,000	貸付株式数	5,600株
キャンドゥ	4,300	3,605.00	15,501,500	貸付株式数	1,700株
パルグループHLDGS	27,400	5,620.00	153,988,000		
エディオン	52,100	2,111.00	109,983,100	貸付株式数	20,100株
あらた	18,300	3,175.00	58,102,500		
サーラコーポレーション	25,100	1,024.00	25,702,400		
トーメンデバイス	1,700	6,340.00	10,778,000	貸付株式数	600株
ハローズ	4,800	5,080.00	24,384,000		
JPホールディングス	29,700	632.00	18,770,400	貸付株式数	11,300株
フジオフードG本社	19,500	1,166.00	22,737,000	貸付株式数	7,600株 (100株)
あみやき亭	8,700	1,561.00	13,580,700	貸付株式数	3,400株
東京エレクトロンデバイス	11,900	2,910.00	34,629,000	貸付株式数	4,600株
円谷フィールズホールディ	19,400	2,288.00	44,387,200	貸付株式数	7,700株
双日	133,100	4,026.00	535,860,600		
アルフレッサホールディングス	105,100	2,281.00	239,733,100		
大黒天物産	4,300	7,700.00	33,110,000	貸付株式数	1,700株
ハニーズホールディングス	10,600	1,562.00	16,557,200	貸付株式数	4,100株
キッコーマン	368,800	1,332.50	491,426,000		
味 の 素	510,000	4,293.00	2,189,430,000		
ブルドックソース	5,900	2,163.00	12,761,700	貸付株式数	2,200株
キユーピー	59,800	4,245.00	253,851,000		
ハウス食品G本社	37,500	2,949.50	110,606,250		
カ ゴ メ	59,500	2,984.50	177,577,750	貸付株式数	23,300株
アリアケジャパン	11,100	6,230.00	69,153,000		
エバラ食品工業	2,800	2,570.00	7,196,000		
キオクシアホールディングス	68,400	3,150.00	215,460,000	貸付株式数	27,300株
ニチレイ	86,900	1,717.50	149,250,750		
横浜冷凍	30,100	1,219.00	36,691,900		

東洋水産	51,600	10,645.00	549,282,000		
イートアンドHLDGS	5,800	2,093.00	12,139,400	貸付株式数	2,200株
ヨシムラ・フード・HLDGS	6,100	911.00	5,557,100	貸付株式数	2,300株
日清食品ＨＤ	138,400	2,867.00	396,792,800	貸付株式数	54,300株
フジッコ	11,400	1,663.00	18,958,200	貸付株式数	600株
ロックフィールド	12,500	1,501.00	18,762,500	貸付株式数	4,800株
日本たばこ産業	676,200	4,783.00	3,234,264,600		
ケンコーマヨネーズ	7,000	1,915.00	13,405,000		
わらべや日洋HD	7,400	2,798.00	20,705,200		
なとり	7,000	2,009.00	14,063,000		
ファーマフーズ	14,700	971.00	14,273,700	貸付株式数	5,300株
北の達人コーポ	47,700	149.00	7,107,300	貸付株式数	18,700株 (1,300株)
ユーグレナ	75,100	460.00	34,546,000	貸付株式数	29,100株
紀文食品	9,600	1,206.00	11,577,600	貸付株式数	3,700株
ピックルスホールディングス	6,500	1,045.00	6,792,500		
スター・マイカ・HLDGS	11,700	1,150.00	13,455,000	貸付株式数	4,600株
SREホールディングス	4,100	3,370.00	13,817,000	貸付株式数	1,200株
片倉工業	11,900	2,880.00	34,272,000		
グ ン ゼ	16,100	3,845.00	61,904,500		
ヒューリック	324,600	1,622.00	526,501,200		
ラサ商事	6,300	1,712.00	10,785,600	貸付株式数	900株
アルペン	11,500	2,436.00	28,014,000	貸付株式数	4,400株
ラクーンホールディングス	8,500	696.00	5,916,000	貸付株式数	3,200株
クオールホールディングス	14,800	2,099.00	31,065,200		
アルコニックス	17,100	2,180.00	37,278,000		
神戸物産	104,100	4,102.00	427,018,200	貸付株式数	34,600株
ソリトンシステムズ	5,800	1,405.00	8,149,000		
ジンズホールディングス	8,100	9,610.00	77,841,000	貸付株式数	3,100株
ビックカメラ	63,600	1,657.50	105,417,000	貸付株式数	18,300株
DCMホールディングス	61,900	1,525.00	94,397,500		
ペッパーフードサービス	41,500	186.00	7,719,000	貸付株式数	16,300株
ＭｏｎｏｔａＲＯ	169,500	2,519.00	426,970,500		
あい ホールディングス	21,500	2,690.00	57,835,000		
Ｊ．フロント リテイリング	137,200	2,479.00	340,118,800		
ドトール・日レスＨＤ	21,200	2,647.00	56,116,400		
マツキヨココカラ&カンパニー	208,100	3,260.00	678,406,000		
ブロンコビリー	7,000	4,000.00	28,000,000	貸付株式数	2,700株

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

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

RS TECHNOLOGIES	7,800	3,685.00	28,743,000		
AND DOホールディングス	6,700	1,118.00	7,490,600	貸付株式数	2,400株
ケイアイスター不動産	6,000	5,560.00	33,360,000	貸付株式数	2,300株
ジェイ・エス・ビー	4,600	3,815.00	17,549,000	貸付株式数	1,000株
ロードスターキャピタル	6,300	3,140.00	19,782,000		
アズーム	1,000	9,580.00	9,580,000	貸付株式数	300株
霞ヶ関キャピタル	9,200	9,130.00	83,996,000	貸付株式数	1,800株
JMホールディングス	8,600	2,826.00	24,303,600	貸付株式数	3,200株
コメダホールディングス	31,300	3,045.00	95,308,500		
アレンザホールディングス	8,900	1,042.00	9,273,800	貸付株式数	3,400株 (1,200株)
串カツ田中HLDGS	3,600	2,810.00	10,116,000	貸付株式数	1,400株
バロックジャパン	14,000	760.00	10,640,000	貸付株式数	5,300株
クスリのアオキHLDGS	31,100	3,996.00	124,275,600	貸付株式数	12,200株
力の源HD	9,000	1,550.00	13,950,000	貸付株式数	3,600株
FOOD&LIFE COMPAN	68,700	8,161.00	560,660,700		
アセンテック	4,500	1,784.00	8,028,000		
セーレン	21,900	3,175.00	69,532,500		
小松マテーレ	16,400	837.00	13,726,800		
ワコールホールディングス	22,200	5,824.00	129,292,800		
ホギメディカル	15,200	5,380.00	81,776,000	貸付株式数	6,000株
ＴＳＩホールディングス	34,500	1,144.00	39,468,000	貸付株式数	200株
ワールド	17,400	3,085.00	53,679,000	貸付株式数	6,800株
ＴＩＳ	119,800	4,999.00	598,880,200		
グリーホールディングス	38,000	452.00	17,176,000		
GMOペパボ	1,400	1,730.00	2,422,000	貸付株式数	500株
コーエーテクモＨＤ	85,200	1,912.50	162,945,000	貸付株式数	12,300株
三菱総合研究所	5,400	4,855.00	26,217,000		
ファインデックス	7,900	846.00	6,683,400		
ブレインパッド	8,500	1,264.00	10,744,000	貸付株式数	3,400株
ＫＬａｂ	30,600	177.00	5,416,200	貸付株式数	12,000株
ポールトゥウィンホールディン	16,100	375.00	6,037,500	貸付株式数	100株
ネクソン	278,400	3,406.00	948,230,400		
アイスタイル	38,800	581.00	22,542,800	貸付株式数	15,500株
エムアップホールディングス	13,900	2,232.00	31,024,800		
エイチームホールディングス	8,800	1,109.00	9,759,200	貸付株式数	3,400株
セルシス	15,300	1,842.00	28,182,600	貸付株式数	6,000株

エニグモ	12,600	302.00	3,805,200	貸付株式数	4,800株 (4,700株)
コロプラ	38,500	530.00	20,405,000		
ブロードリーフ	41,400	720.00	29,808,000		
デジタルハーツHLDGS	8,100	954.00	7,727,400		
メディアドゥ	5,100	1,926.00	9,822,600	貸付株式数	1,900株
じげん	27,900	535.00	14,926,500	貸付株式数	11,100株
ブイキューブ	14,200	157.00	2,229,400	貸付株式数	6,000株
フィックスターズ	15,600	1,813.00	28,282,800	貸付株式数	6,100株
CARTA HOLDINGS	6,400	2,096.00	13,414,400		
北里コーポレーション	8,900	1,525.00	13,572,500	貸付株式数	3,400株
オプティム	11,700	587.00	6,867,900	貸付株式数	4,400株
セレス	5,100	2,450.00	12,495,000	貸付株式数	1,900株
ＳＨＩＦＴ	101,800	1,422.00	144,759,600		
特種東海製紙	5,500	4,360.00	23,980,000	貸付株式数	2,000株
セック	1,900	4,470.00	8,493,000	貸付株式数	700株
テクマトリックス	24,500	2,064.00	50,568,000		
プロシップ	5,000	3,215.00	16,075,000	貸付株式数	1,900株
ガンホー・オンライン・エンター	26,300	2,829.00	74,402,700	貸付株式数	9,000株
GMOペイメントゲートウェイ	22,700	8,393.00	190,521,100		
システムリサーチ	7,800	2,143.00	16,715,400	貸付株式数	3,000株
インターネットイニシアティブ	61,900	2,755.00	170,534,500		
さくらインターネット	17,700	2,970.00	52,569,000	貸付株式数	7,000株
GMOグローバルサインHD	3,500	2,197.00	7,689,500	貸付株式数	1,300株
SRAホールディングス	6,400	4,825.00	30,880,000		
朝日ネット	12,200	694.00	8,466,800		
ｅＢＡＳＥ	16,000	507.00	8,112,000	貸付株式数	1,500株
アバントグループ	15,900	1,511.00	24,024,900	貸付株式数	1,000株
アドソル日進	9,100	1,339.00	12,184,900		
フリービット	5,900	1,583.00	9,339,700		
コムチュア	15,000	1,701.00	25,515,000		
アステリア	8,900	1,668.00	14,845,200	貸付株式数	3,400株
アイル	6,300	3,025.00	19,057,500		
王子ホールディングス	428,700	835.70	358,264,590		
日本製紙	59,000	1,253.00	73,927,000		
北越コーポレーション	63,600	1,049.00	66,716,400	貸付株式数	18,800株
大王製紙	57,100	901.00	51,447,100	貸付株式数	22,200株

マークラインズ	6,700	2,128.00	14,257,600		
メディカル・データ・ビジ	11,800	597.00	7,044,600	貸付株式数	4,700株
ｇｕｍｉ	20,900	611.00	12,769,900	貸付株式数	8,300株
テラスカイ	4,400	2,138.00	9,407,200	貸付株式数	1,700株
デジタル・インフォメーション	6,600	2,390.00	15,774,000		
ネオジャパン	3,000	2,019.00	6,057,000		
ＰＲ ＴＩＭＥＳ	2,300	2,903.00	6,676,900	貸付株式数	800株
ラクス	53,400	2,719.50	145,221,300		
ダブルスタンダード	4,000	1,780.00	7,120,000		
オープンドア	7,900	479.00	3,784,100	貸付株式数	3,100株
アカツキ	5,500	2,890.00	15,895,000		
UBICOMホールディングス	3,600	1,108.00	3,988,800		
カナミックネットワーク	14,200	519.00	7,369,800		
レンゴー	103,100	957.70	98,738,870		
トーモク	6,500	3,415.00	22,197,500	貸付株式数	2,500株
ザ・パック	22,700	1,134.00	25,741,800	貸付株式数	4,800株
チェンジホールディングス	28,100	1,112.00	31,247,200		
オークネット	10,500	1,910.00	20,055,000		
オロ	4,700	2,779.00	13,061,300	貸付株式数	1,600株
ユーザーローカル	5,500	2,072.00	11,396,000	貸付株式数	300株
PKSHA TECHNOLOGY	13,500	3,690.00	49,815,000	貸付株式数	5,400株
マネーフォワード	25,800	6,291.00	162,307,800	貸付株式数	10,800株
レゾナック・ホールディング	109,400	4,173.00	456,526,200	貸付株式数	1,000株
住友化学	910,500	477.90	435,127,950		
住友精化	5,300	4,700.00	24,910,000		
日産化学	57,800	5,365.00	310,097,000		
ラサ工業	4,000	4,510.00	18,040,000		
クレハ	21,100	4,000.00	84,400,000	貸付株式数	8,200株
多木化学	4,400	3,720.00	16,368,000	貸付株式数	1,100株
テイカ	8,100	1,358.00	10,999,800		
石原産業	18,800	2,512.00	47,225,600		
日本曹達	24,000	3,495.00	83,880,000	貸付株式数	1,200株
東ソー	151,100	2,374.00	358,711,400		
トクヤマ	36,600	3,495.00	127,917,000		
セントラル硝子	14,300	3,420.00	48,906,000		
東亞合成	47,800	1,567.00	74,902,600		
大阪ソーダ	39,500	1,797.00	70,981,500		
関東電化	24,300	869.00	21,116,700		

GMOフィナンシャルゲート	1,900	6,170.00	11,723,000	貸付株式数	700株
SUN ASTERISK	9,900	468.00	4,633,200	貸付株式数	3,100株
デンカ	41,200	2,382.50	98,159,000		
イビデン	65,500	7,267.00	475,988,500		
信越化学	1,006,800	4,437.00	4,467,171,600		
日本カーバイド	6,000	2,222.00	13,332,000		
プラスアルファ・コンサルティン	14,400	2,452.00	35,308,800		
電算システムＨＤ	5,000	3,515.00	17,575,000	貸付株式数	1,900株
堺 化 学	7,900	2,973.00	23,486,700		
第一稀元素化学工	12,400	707.00	8,766,800	貸付株式数	4,200株
エア・ウォーター	106,800	2,645.00	282,486,000		
日本酸素HLDGS	109,800	5,442.00	597,531,600	貸付株式数	10,900株
日本化学工業	4,100	2,900.00	11,890,000		
日本パーカライジング	50,400	1,434.00	72,273,600		
高圧ガス	16,400	1,091.00	17,892,400	貸付株式数	5,900株
四国化成ホールディンク	12,800	2,184.00	27,955,200	貸付株式数	3,800株
戸田工業	2,600	1,404.00	3,650,400	貸付株式数	1,000株
ステラ ケミファ	6,000	4,260.00	25,560,000		
保土谷化学	7,100	1,773.00	12,588,300		
日本触媒	72,500	1,922.00	139,345,000		
大日精化	7,700	4,110.00	31,647,000		
カネカ	27,900	4,400.00	122,760,000		
協和キリン	133,300	2,601.00	346,713,300		
APPIER GROUP	43,300	1,617.00	70,016,100	貸付株式数	17,000株
三菱瓦斯化学	89,500	2,719.50	243,395,250		
三井化学	101,900	3,838.00	391,092,200		
東京応化工業	54,000	4,776.00	257,904,000		
大阪有機化学	9,500	3,025.00	28,737,500		
三菱ケミカルグループ	827,600	885.70	733,005,320		
ＫＨネオケム	18,800	2,830.00	53,204,000	貸付株式数	100株
ビジョナル	13,600	11,320.00	153,952,000		
ダイセル	124,100	1,408.00	174,732,800		
住友ベークライト	35,700	5,106.00	182,284,200		
積水化学	223,400	2,901.00	648,083,400		
日本ゼオン	81,900	1,731.50	141,809,850		
アイカ工業	28,600	3,862.00	110,453,200		
ＵＢＥ	58,400	2,432.00	142,028,800		
積水樹脂	14,800	2,212.00	32,737,600		
旭有機材	7,500	4,590.00	34,425,000	貸付株式数	100株

ニチバン	7,000	1,992.00	13,944,000	貸付株式数	2,800株
リケンテクノス	19,500	1,231.00	24,004,500		
大倉工業	5,800	5,320.00	30,856,000		
積水化成品	15,900	373.00	5,930,700		
群栄化学	2,700	3,450.00	9,315,000		
ダイキョーニシカワ	25,000	779.00	19,475,000		
森六	6,100	2,527.00	15,414,700		
恵和	7,300	1,145.00	8,358,500	貸付株式数	1,400株
日本化薬	74,400	1,456.50	108,363,600		
カーリット	11,200	1,382.00	15,478,400		
CLホールディングス	3,000	988.00	2,964,000	貸付株式数	1,000株
プレステージ・インター	53,700	686.00	36,838,200		
ハイマックス	3,500	1,223.00	4,280,500		
アミューズ	7,100	2,020.00	14,342,000		
野村総合研究所	245,700	5,727.00	1,407,123,900		
ドリームインキュベータ	2,800	2,673.00	7,484,400	貸付株式数	1,100株
クイック	8,000	2,466.00	19,728,000		
日本システム技術	10,500	2,133.00	22,396,500	貸付株式数	3,100株
電通グループ	112,300	3,100.00	348,130,000		
インテージホールディングス	8,500	1,824.00	15,504,000		
テイクアンドギヴニーズ	5,600	876.00	4,905,600	貸付株式数	800株
東邦システムサイエンス	5,300	1,243.00	6,587,900	貸付株式数	2,000株
ぴあ	4,000	3,525.00	14,100,000	貸付株式数	800株
イオンファンタジー	5,000	3,635.00	18,175,000	貸付株式数	1,900株
ソースネクスト	58,800	178.00	10,466,400	貸付株式数	23,100株
シーティーエス	16,000	915.00	14,640,000		
メディカルシステムネットワーク	11,700	490.00	5,733,000		
日本精化	7,500	2,698.00	20,235,000		
扶桑化学工業	10,500	4,780.00	50,190,000		
トリケミカル	12,400	2,589.00	32,103,600	貸付株式数	4,900株
シンプレクスＨＤ	22,400	4,365.00	97,776,000		
ＨＥＲＯＺ	4,500	1,127.00	5,071,500	貸付株式数	1,800株 (300株)
ラクスル	22,600	1,361.00	30,758,600	貸付株式数	8,000株
メルカリ	62,500	2,327.00	145,437,500	貸付株式数	25,000株
ＩＰＳ	3,300	3,105.00	10,246,500	貸付株式数	1,100株
システムサポートホールディン	4,000	2,841.00	11,364,000		

ＡＤＥＫＡ	39,500	3,410.00	134,695,000		
日油	130,000	2,703.50	351,455,000		
ハリマ化成グループ	8,800	910.00	8,008,000	貸付株式数	3,400株
ボードルア	3,100	2,928.00	9,076,800		
イーソル	7,600	549.00	4,172,400	貸付株式数	2,900株
ウイングアーク1ST	11,800	3,325.00	39,235,000		
ヒト・コミュニケーションズHD	4,500	1,122.00	5,049,000	貸付株式数	1,700株
サーバーワークス	2,000	2,050.00	4,100,000		
Ｓａｎｓａｎ	32,100	1,917.00	61,535,700		
ギフティ	8,800	1,214.00	10,683,200		
花 王	275,700	6,888.00	1,899,021,600		
第一工業製薬	4,100	5,840.00	23,944,000	貸付株式数	1,500株
石原ケミカル	4,800	1,951.00	9,364,800	貸付株式数	1,800株
三洋化成	7,000	4,300.00	30,100,000	貸付株式数	1,800株
メドレー	13,800	2,462.00	33,975,600	貸付株式数	5,400株
ベース	4,800	3,590.00	17,232,000	貸付株式数	1,000株
ＪＭＤＣ	13,800	4,417.00	60,954,600		
武田薬品	1,008,600	4,650.00	4,689,990,000		
アステラス製薬	994,300	1,724.00	1,714,173,200		
住友ファーマ	100,900	1,793.00	180,913,700		
塩野義製薬	376,000	2,693.50	1,012,756,000		
日本新薬	29,700	3,380.00	100,386,000		
中外製薬	354,800	6,678.00	2,369,354,400		
科研製薬	18,700	3,930.00	73,491,000		
エーザイ	147,900	5,322.00	787,123,800		
理研ビタミン	8,800	2,999.00	26,391,200		
ロート製薬	119,800	2,587.50	309,982,500		
小野薬品	231,900	1,776.50	411,970,350		
久光製薬	22,200	4,340.00	96,348,000		
持田製薬	13,800	3,290.00	45,402,000		
参天製薬	202,400	1,641.00	332,138,400		
扶桑薬品	4,400	2,207.00	9,710,800	貸付株式数	800株
ツムラ	38,900	3,812.00	148,286,800		
テ ル モ	750,900	2,657.50	1,995,516,750		
ＨＵグループＨＤ	34,000	3,887.00	132,158,000		
キッセイ薬品工業	17,700	4,540.00	80,358,000		
生化学工業	21,600	677.00	14,623,200	貸付株式数	8,400株
栄研化学	17,900	2,485.00	44,481,500	貸付株式数	7,000株
ＪＣＲファーマ	38,400	660.00	25,344,000	貸付株式数	14,800株

東和薬品	15,200	3,050.00	46,360,000	貸付株式数	3,500株
富士製薬工業	8,400	1,590.00	13,356,000	貸付株式数	3,300株
ゼリア新薬工業	18,000	2,124.00	38,232,000	貸付株式数	7,000株
ネクセラファーマ	49,700	1,035.00	51,439,500	貸付株式数	19,500株
第一三共	1,040,900	3,704.00	3,855,493,600		
杏林製薬	22,800	1,572.00	35,841,600	貸付株式数	2,000株
大幸薬品	23,500	319.00	7,496,500	貸付株式数	9,800株
ダイト	15,300	1,240.00	18,972,000		
大塚ホールディングス	252,400	8,477.00	2,139,594,800		
ペプチドリーム	54,900	1,715.00	94,153,500		
大日本塗料	12,600	1,319.00	16,619,400		
日本ペイントHOLD	601,100	1,041.00	625,745,100		
関西ペイント	90,300	2,518.50	227,420,550	貸付株式数	16,800株
中国塗料	25,600	3,565.00	91,264,000		
藤倉化成	14,300	615.00	8,794,500		
太陽ホールディングス	19,700	7,740.00	152,478,000		
ＤＩＣ	40,200	3,685.00	148,137,000		
サカタインクス	25,200	2,307.00	58,136,400		
ARTIENCE	21,300	3,185.00	67,840,500		
アルプス技研	9,600	2,923.00	28,060,800		
サニックスホールディングス	16,500	241.00	3,976,500	貸付株式数	2,200株
日本空調サービス	12,500	1,280.00	16,000,000	貸付株式数	4,900株
オリエンタルランド	684,900	3,655.00	2,503,309,500	貸付株式数	171,900株
フォーカスシステムズ	7,600	1,624.00	12,342,400	貸付株式数	2,700株
ダスキン	24,300	3,965.00	96,349,500	貸付株式数	7,000株
パーク２４	79,500	2,023.00	160,828,500		
明光ネットワークジャパン	15,300	742.00	11,352,600	貸付株式数	5,800株
ファルコホールディングス	4,600	2,521.00	11,596,600		
クレスコ	17,800	1,682.00	29,939,600		
フジ・メディア・HD	108,900	3,383.00	368,408,700	貸付株式数	43,500株
ラウンドワン	109,800	1,349.00	148,120,200		
リゾートトラスト	91,700	1,854.00	170,011,800		
オービック	210,500	5,301.00	1,115,860,500		
ジャストシステム	16,300	4,770.00	77,751,000		
ＴＤＣソフト	19,100	1,390.00	26,549,000	貸付株式数	4,600株
ＬＩＮＥヤフー	1,815,000	479.30	869,929,500		
ビー・エム・エル	14,300	3,735.00	53,410,500		
トレンドマイクロ	65,500	7,940.00	520,070,000		
IDホールディングス	7,300	2,275.00	16,607,500		

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

資 生 堂	219,800	2,426.50	533,344,700	
ライオン	130,100	1,635.00	212,713,500	
高砂香料	7,700	8,140.00	62,678,000	
マンダム	22,400	1,487.00	33,308,800	
ミルボン	18,200	2,528.00	46,009,600	
コーセー	25,600	5,834.00	149,350,400	貸付株式数 1,800株
コタ	11,500	1,403.00	16,134,500	貸付株式数 4,500株
ポーラ・オルビスHD	58,100	1,308.00	75,994,800	貸付株式数 18,400株
ノエビアホールディングス	10,100	4,630.00	46,763,000	貸付株式数 3,900株
新日本製薬	6,500	2,381.00	15,476,500	貸付株式数 2,200株
Ｉ－ｎｅ	3,000	1,616.00	4,848,000	貸付株式数 1,200株
アクシージア	7,100	466.00	3,308,600	貸付株式数 2,700株
エステー	7,800	1,581.00	12,331,800	
コ ニ シ	35,700	1,315.00	46,945,500	
長谷川香料	21,700	2,986.00	64,796,200	
小林製薬	29,700	5,454.00	161,983,800	
荒川化学工業	10,500	1,157.00	12,148,500	
メック	8,500	3,240.00	27,540,000	
日本高純度化学	2,800	3,110.00	8,708,000	
タカラバイオ	35,600	927.00	33,001,200	貸付株式数 3,700株
ＪＣＵ	12,300	4,620.00	56,826,000	
ＯＡＴアグリオ	4,200	2,510.00	10,542,000	
デクセリアルズ	96,900	1,979.50	191,813,550	
アース製薬	10,300	5,250.00	54,075,000	
北興化学	8,400	1,626.00	13,658,400	
大成ラミックグループ	3,300	2,632.00	8,685,600	
クミアイ化学	50,700	845.00	42,841,500	
日本農薬	17,300	1,039.00	17,974,700	
ニチレキグループ	12,100	2,806.00	33,952,600	貸付株式数 4,700株
ユシロ	5,900	2,376.00	14,018,400	
ＪＸ金属	294,300	1,570.00	462,051,000	
富士石油	29,700	344.00	10,216,800	貸付株式数 11,600株
出光興産	490,200	1,014.00	497,062,800	
ENEOSホールディングス	1,716,000	900.80	1,545,772,800	
コスモエネルギーHLDGS	37,300	7,297.00	272,178,100	
ＡＮＹＣＯＬＯＲ	15,500	4,750.00	73,625,000	
テスホールディングス	26,900	374.00	10,060,600	貸付株式数 10,300株
インフロニアＨＤ	116,200	1,523.50	177,030,700	貸付株式数 45,600株
横浜ゴム	63,300	5,855.00	370,621,500	
TOYO TIRE	71,600	3,949.00	282,748,400	

ブリヂストン	331,800	6,996.00	2,321,272,800	
住友ゴム	122,300	1,821.00	222,708,300	
藤倉コンポジット	10,900	1,966.00	21,429,400	
オカモト	6,000	5,150.00	30,900,000	
アキレス	6,200	1,146.00	7,105,200	
フ コ ク	6,700	1,932.00	12,944,400	貸付株式数 2,200株
ニッタ	11,100	4,175.00	46,342,500	
住友理工	22,000	2,258.00	49,676,000	
三ツ星ベルト	15,800	3,815.00	60,277,000	貸付株式数 6,100株
バンドー化学	16,800	2,057.00	34,557,600	
ＡＧＣ	110,300	4,800.00	529,440,000	
日本板硝子	58,000	531.00	30,798,000	
有沢製作所	17,000	1,676.00	28,492,000	
日本電気硝子	37,800	4,835.00	182,763,000	
オハラ	4,300	1,263.00	5,430,900	貸付株式数 1,600株
住友大阪セメント	19,700	4,057.00	79,922,900	
太平洋セメント	69,900	4,189.00	292,811,100	
日本ヒユーム	9,900	4,080.00	40,392,000	貸付株式数 3,900株
日本コンクリート	22,000	361.00	7,942,000	貸付株式数 8,400株
三谷セキサン	4,000	8,870.00	35,480,000	
アジアパイルＨＤ	16,100	1,319.00	21,235,900	
東海カーボン	114,100	1,041.00	118,778,100	
日本カーボン	6,500	4,255.00	27,657,500	貸付株式数 2,500株
東洋炭素	9,800	4,090.00	40,082,000	貸付株式数 3,800株
ノリタケ	12,300	4,745.00	58,363,500	
ＴＯＴＯ	82,300	4,130.00	339,899,000	
日本碍子	125,900	2,416.50	304,237,350	
日本特殊陶業	92,600	5,574.00	516,152,400	
ＭＡＲＵＷＡ	4,700	40,340.00	189,598,000	
品川リフラクトリーズ	14,000	1,944.00	27,216,000	
黒崎播磨	7,700	4,115.00	31,685,500	
ヨータイ	5,800	1,749.00	10,144,200	
フジミインコーポレーテッド	30,500	2,123.00	64,751,500	
ニチアス	28,700	5,812.00	166,804,400	貸付株式数 100株
日本製鉄	590,500	3,443.00	2,033,091,500	
神戸製鋼所	234,500	1,912.50	448,481,250	
中山製鋼所	24,000	699.00	16,776,000	
合同製鐵	6,500	4,325.00	28,112,500	貸付株式数 2,200株
ＪＦＥホールディングス	351,300	1,975.00	693,817,500	

東京製鐵	32,600	1,662.00	54,181,200		
共英製鋼	11,400	2,396.00	27,314,400		
大和工業	22,000	10,190.00	224,180,000	貸付株式数	7,200株
東京鐵鋼	5,100	6,190.00	31,569,000	貸付株式数	1,000株
大阪製鐵	5,400	2,770.00	14,958,000	貸付株式数	2,000株
淀川製鋼所	53,800	1,436.00	77,256,800		
中部鋼鈑	9,500	2,291.00	21,764,500	貸付株式数	3,700株
丸一鋼管	35,500	3,920.00	139,160,000		
モリ工業	14,800	950.00	14,060,000	貸付株式数	4,300株
大同特殊鋼	73,500	1,345.00	98,857,500		
日本冶金工	7,900	4,530.00	35,787,000		
愛知製鋼	25,800	2,975.00	76,755,000	貸付株式数	6,200株
大平洋金属	10,800	2,106.00	22,744,800		
新日本電工	63,900	345.00	22,045,500		
栗本鉄工所	5,400	8,120.00	43,848,000		
日本製鋼所	34,600	8,923.00	308,735,800		
三菱製鋼	8,600	1,805.00	15,523,000		
日本精線	9,300	1,148.00	10,676,400		
エンビプロＨＤ	11,500	490.00	5,635,000	貸付株式数	4,600株
大紀アルミニウム	16,600	1,164.00	19,322,400		
日本軽金属ＨＤ	34,100	2,157.00	73,553,700		
三井金属	29,100	10,675.00	310,642,500		
東邦亜鉛	9,200	656.00	6,035,200	貸付株式数	3,600株
三菱マテリアル	83,400	2,600.00	216,840,000		
住友鉱山	147,500	4,264.00	628,940,000		
DOWAホールディングス	31,400	5,512.00	173,076,800		
古河機金	13,900	2,945.00	40,935,500		
大阪チタニウム	20,200	2,779.00	56,135,800	貸付株式数	8,000株
東邦チタニウム	24,100	1,758.00	42,367,800	貸付株式数	9,600株
ＵＡＣＪ	15,700	6,350.00	99,695,000		
ＣＫサンエツ	2,800	4,150.00	11,620,000	貸付株式数	300株
古河電工	38,800	8,880.00	344,544,000		
住友電工	402,700	4,236.00	1,705,837,200		
フジクラ	125,000	13,555.00	1,694,375,000		
ＳＷＣＣ	15,600	8,080.00	126,048,000		
平河ヒューテック	7,800	1,972.00	15,381,600		
いよぎんホールディンク	145,700	2,022.00	294,605,400		
しずおかフィナンシャルク	245,200	1,949.00	477,894,800		
ちゅうぎんフィナンシャ	93,700	2,124.50	199,065,650		
楽天銀行	51,600	7,774.00	401,138,400	貸付株式数	10,000株

京都フィナンシャルG	140,100	2,907.50	407,340,750	
リョービ	13,800	2,904.00	40,075,200	
AREホールディングス	47,200	2,173.00	102,565,600	
東洋製罐グループHD	69,000	3,583.00	247,227,000	貸付株式数　22,000株
ホッカンホールディングス	6,300	2,277.00	14,345,100	
コロナ	6,500	951.00	6,181,500	
横河ブリッジHLDGS	20,100	2,823.00	56,742,300	
三和ホールディングス	113,100	4,822.00	545,368,200	
文化シヤッター	30,500	2,403.00	73,291,500	
三協立山	14,700	659.00	9,687,300	
アルインコ	8,900	1,092.00	9,718,800	貸付株式数　1,100株
ＬＩＸＩＬ	170,000	1,983.00	337,110,000	
ノーリツ	20,500	2,072.00	42,476,000	貸付株式数　6,300株
長府製作所	11,600	1,899.00	22,028,400	
リンナイ	60,800	3,726.00	226,540,800	
ユニプレス	19,000	1,274.00	24,206,000	
日東精工	15,200	646.00	9,819,200	
岡 部	20,800	957.00	19,905,600	貸付株式数　8,200株
ジーテクト	13,000	2,045.00	26,585,000	
東 プ レ	20,600	2,253.00	46,411,800	
高周波熱錬	16,000	1,262.00	20,192,000	貸付株式数　2,600株
東京製綱	6,900	1,539.00	10,619,100	
サンコール	13,000	858.00	11,154,000	貸付株式数　5,200株
パイオラックス	15,700	1,869.00	29,343,300	貸付株式数　300株
エイチワン	12,000	1,517.00	18,204,000	
日本発条	97,700	1,994.00	194,813,800	
中央発條	7,600	3,355.00	25,498,000	貸付株式数　2,900株
三浦工業	53,000	2,960.00	156,880,000	
タ ク マ	37,400	2,291.00	85,683,400	
テクノプロ・ホールディング	70,700	4,827.00	341,268,900	
アイ・アールジャパンHD	6,000	783.00	4,698,000	貸付株式数　500株
ＫｅｅＰｅｒ技研	7,200	3,410.00	24,552,000	貸付株式数　2,800株
Ｇｕｎｏｓｙ	9,200	744.00	6,844,800	貸付株式数　3,600株
イー・ガーディアン	3,500	2,060.00	7,210,000	
ジャパンマテリアル	35,600	1,518.00	54,040,800	
ベクトル	15,900	1,149.00	18,269,100	
チャームケアコーポレーション	9,700	1,048.00	10,165,600	貸付株式数　3,700株
キャリアリンク	4,300	2,400.00	10,320,000	

ＩＢＪ	8,900	843.00	7,502,700	貸付株式数	3,400株
アサンテ	5,700	1,701.00	9,695,700	貸付株式数	2,200株
バリューＨＲ	10,400	1,559.00	16,213,600	貸付株式数	3,800株 (700株)
M&Aキャピタルパートナー	9,400	3,170.00	29,798,000	貸付株式数	2,100株
ライドオンエクスプレスHD	4,600	1,008.00	4,636,800		
シグマクシス・ホールディンク	33,900	945.00	32,035,500		
ウィルグループ	9,800	970.00	9,506,000	貸付株式数	3,700株
メドピア	8,900	697.00	6,203,300		
リクルートホールディングス	859,300	8,454.00	7,264,522,200	※	
エラン	10,200	826.00	8,425,200	貸付株式数	4,000株
ツ ガ ミ	24,300	2,258.00	54,869,400		
オークマ	20,000	3,515.00	70,300,000		
芝浦機械	14,700	4,220.00	62,034,000	貸付株式数	5,700株
アマダ	152,600	1,902.50	290,321,500		
アイダエンジニア	25,600	930.00	23,808,000		
ＦＵＪＩ	49,600	2,778.50	137,813,600		
牧野フライス	12,600	11,560.00	145,656,000		
オーエスジー	41,900	2,052.00	85,978,800		
旭ダイヤモンド	28,500	848.00	24,168,000		
DMG森精機	78,200	3,056.00	238,979,200	貸付株式数	24,200株
ソディツク	27,800	884.00	24,575,200		
ディスコ	55,000	37,730.00	2,075,150,000		
日東工器	4,000	1,832.00	7,328,000	貸付株式数	1,500株
日進工具	9,500	815.00	7,742,500		
冨士ダイス	8,500	859.00	7,301,500	貸付株式数	3,300株
日本郵政	1,153,400	1,548.50	1,786,039,900		
ベルシステム24HLDGS	12,600	1,320.00	16,632,000		
鎌倉新書	9,900	628.00	6,217,200		
エアトリ	9,500	999.00	9,490,500	貸付株式数	1,100株
アトラエ	9,000	820.00	7,380,000		
ストライク	5,700	4,570.00	26,049,000		
ソラスト	32,000	490.00	15,680,000		
セラク	3,500	1,744.00	6,104,000		
インソース	25,200	981.00	24,721,200		
豊田自動織機	96,400	16,595.00	1,599,758,000		
リケンＮＰＲ	14,300	3,050.00	43,615,000	貸付株式数	1,300株
島精機製作所	18,200	1,078.00	19,619,600	貸付株式数	7,100株

オプトラン	18,700	1,655.00	30,948,500	貸付株式数	7,300株
イワキポンプ	7,600	2,483.00	18,870,800	貸付株式数	3,000株
フリュー	10,800	1,120.00	12,096,000		
ヤマシンフィルタ	24,100	690.00	16,629,000	貸付株式数	8,600株
日阪製作所	12,100	1,392.00	16,843,200		
やまびこ	18,600	2,472.00	45,979,200		
野村マイクロ・サイエンス	18,900	3,350.00	63,315,000	貸付株式数	6,900株 (100株)
平田機工	16,400	1,850.00	30,340,000	貸付株式数	6,400株
ＰＥＧＡＳＵＳ	12,600	670.00	8,442,000		
マルマエ	4,400	1,726.00	7,594,400	貸付株式数	1,800株
タツモ	7,500	2,053.00	15,397,500	貸付株式数	3,100株
ナブテスコ	66,500	3,223.00	214,329,500		
三井海洋開発	28,900	7,880.00	227,732,000		
レオン自動機	12,000	1,411.00	16,932,000		
ＳＭＣ	32,400	44,230.00	1,433,052,000		
ホソカワミクロン	8,600	5,630.00	48,418,000	貸付株式数	3,400株
ユニオンツール	5,000	8,680.00	43,400,000	貸付株式数	1,900株
瑞 光	9,700	1,002.00	9,719,400	貸付株式数	3,800株
オイレス工業	15,500	2,296.00	35,588,000		
日精エーエスビー	4,500	7,220.00	32,490,000		
サトー	14,200	2,326.00	33,029,200		
技研製作所	10,700	1,480.00	15,836,000	貸付株式数	4,000株
日本エアーテック	5,300	1,253.00	6,640,900		
日精樹脂工業	7,500	889.00	6,667,500	貸付株式数	2,700株
ワイエイシイホールディングス	11,500	845.00	9,717,500	貸付株式数	4,500株
小松製作所	562,700	5,205.00	2,928,853,500		
住友重機械	67,500	3,502.00	236,385,000		
日立建機	45,500	4,924.00	224,042,000		
日 工	16,900	806.00	13,621,400		
巴工業	13,400	1,722.00	23,074,800		
井関農機	10,700	2,383.00	25,498,100	貸付株式数	4,100株
ＴＯＷＡ	34,900	1,821.00	63,552,900	貸付株式数	13,900株
北川鉄工所	4,500	1,680.00	7,560,000		
ローツェ	59,600	1,698.00	101,200,800	貸付株式数	23,400株
クボタ	583,700	1,856.00	1,083,347,200		
荏原実業	6,000	4,410.00	26,460,000		
東洋エンジニア	16,300	1,695.00	27,628,500	貸付株式数	6,300株
三菱化工機	12,000	2,916.00	34,992,000		

月島ホールディングス	14,900	3,445.00	51,330,500		
帝国電機製作所	7,100	3,230.00	22,933,000	貸付株式数	2,700株
新東工業	25,400	1,016.00	25,806,400	貸付株式数	9,800株
渋谷工業	10,700	3,420.00	36,594,000		
アイチ コーポレーション	18,900	1,369.00	25,874,100		
小森コーポレーション	27,100	1,565.00	42,411,500		
鶴見製作所	8,100	3,940.00	31,914,000		
酒井重工業	4,500	2,173.00	9,778,500		
荏原製作所	234,400	3,155.00	739,532,000		
酉島製作所	9,800	2,074.00	20,325,200		
ＡＩＲＭＡＮ	11,500	2,063.00	23,724,500	貸付株式数	4,500株
ダイキン工業	148,700	18,665.00	2,775,485,500		
オルガノ	17,600	11,820.00	208,032,000	貸付株式数	600株
トーヨーカネツ	4,100	4,500.00	18,450,000		
栗田工業	63,800	5,181.00	330,547,800		
椿本チエイン	49,400	2,202.00	108,778,800		
日 機 装	26,300	1,527.00	40,160,100		
木村化工機	8,700	1,047.00	9,108,900		
レイズネクスト	16,000	1,925.00	30,800,000	貸付株式数	6,200株
アネスト岩田	19,400	1,606.00	31,156,400		
ダイフク	192,600	4,815.00	927,369,000		
サムコ	3,100	2,921.00	9,055,100	貸付株式数	1,100株
タダノ	60,200	1,092.00	65,738,400		
フジテック	36,700	5,632.00	206,694,400		
ＣＫＤ	31,600	2,464.00	77,862,400		
平和	38,000	2,217.00	84,246,000	貸付株式数	14,900株
理想科学工業	18,300	1,214.00	22,216,200	貸付株式数	7,100株
ＳＡＮＫＹＯ	131,900	3,005.00	396,359,500		
日本金銭機械	13,800	1,012.00	13,965,600	貸付株式数	1,900株
マースグループHLDGS	7,700	3,235.00	24,909,500		
ガリレイ	16,800	3,650.00	61,320,000		
ダイコク電機	5,000	2,682.00	13,410,000	貸付株式数	1,900株
竹内製作所	20,700	5,320.00	110,124,000	貸付株式数	4,900株
ア マ ノ	32,400	4,340.00	140,616,000		
ＪＵＫＩ	17,700	454.00	8,035,800		
ジャノメ	9,200	1,200.00	11,040,000		
ブラザー工業	152,500	2,659.00	405,497,500		
マックス	13,800	5,760.00	79,488,000	貸付株式数	4,200株
モリタホールディングス	17,800	2,320.00	41,296,000		
グローリー	29,900	3,853.00	115,204,700		

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

オープングループ	18,500	405.00	7,492,500	貸付株式数	7,200株
三桜工業	15,700	899.00	14,114,300	貸付株式数	3,800株
マキタ	142,000	5,139.00	729,738,000		
東芝テック	17,100	2,987.00	51,077,700		
芝浦メカトロニクス	8,300	10,380.00	86,154,000		
マブチモーター	55,100	2,557.00	140,890,700		
ニデック	504,000	2,536.50	1,278,396,000		
ユーエムシーエレクトロニクス	7,100	305.00	2,165,500	貸付株式数	2,800株
トレックス・セミコンダクター	5,400	1,634.00	8,823,600	貸付株式数	900株
東光高岳	6,200	3,175.00	19,685,000		
ダブル・スコープ	35,000	254.00	8,890,000	貸付株式数	13,700株
宮越ホールディングス	5,100	969.00	4,941,900	貸付株式数	2,000株
ダイヘン	10,700	7,920.00	84,744,000		
ヤーマン	22,200	812.00	18,026,400	貸付株式数	8,700株 (200株)
ＪＶＣケンウッド	90,100	1,216.00	109,561,600		
ミマキエンジニアリング	9,500	1,819.00	17,280,500	貸付株式数	3,700株
大崎電気	24,500	1,306.00	31,997,000	貸付株式数	3,500株
オムロン	104,600	3,949.00	413,065,400		
日東工業	15,400	3,575.00	55,055,000		
ＩＤＥＣ	15,900	2,457.00	39,066,300		
ジーエス・ユアサ コーポ	50,900	3,427.00	174,434,300		
ＢＵＦＦＡＬＯ	2,200	3,675.00	8,085,000	貸付株式数	800株
テクノメディカ	2,200	2,047.00	4,503,400	貸付株式数	800株
ダイヤモンドエレクトリクHD	4,600	578.00	2,658,800	貸付株式数	1,800株
日本電気	807,200	4,458.00	3,598,497,600		
富 士 通	1,050,400	3,646.00	3,829,758,400		
沖 電 気	55,300	1,686.00	93,235,800		
電気興業	4,600	2,086.00	9,595,600		
サンケン電気	11,700	7,760.00	90,792,000	貸付株式数	4,600株
アイホン	6,900	2,850.00	19,665,000		
ルネサスエレクトロニクス	1,106,900	1,702.00	1,883,943,800		
セイコーエプソン	142,100	1,997.00	283,773,700		
ワコム	74,200	770.00	57,134,000		
アルバック	25,000	6,330.00	158,250,000		
アクセル	5,600	1,200.00	6,720,000		
ＥＩＺＯ	14,900	2,284.00	34,031,600		

ジャパンディスプレイ	61,700	19.00	1,172,300	
日本信号	26,000	1,225.00	31,850,000	
京三製作所	26,600	540.00	14,364,000	
能美防災	15,400	3,895.00	59,983,000	
ホーチキ	6,700	3,870.00	25,929,000	
エレコム	27,300	1,856.00	50,668,800	
パナソニック ホールディンク	1,348,600	1,543.00	2,080,889,800	
シャープ	164,900	872.00	143,792,800	貸付株式数　64,800株
アンリツ	80,400	1,716.00	137,966,400	
ソニーグループ	3,898,900	4,184.00	16,312,997,600	
ＴＤＫ	985,900	2,081.00	2,051,657,900	
帝国通信工業	5,000	2,457.00	12,285,000	貸付株式数　1,900株
タムラ製作所	45,500	504.00	22,932,000	貸付株式数　17,800株
アルプスアルパイン	92,700	1,850.00	171,495,000	
日本電波工業	10,800	935.00	10,098,000	
鈴木	6,100	2,119.00	12,925,900	
メイコー	11,300	9,910.00	111,983,000	貸付株式数　2,200株
日本トリム	2,600	4,660.00	12,116,000	
フオスター電機	11,600	2,323.00	26,946,800	
ＳＭＫ	2,700	2,273.00	6,137,100	貸付株式数　1,000株
ヨコオ	10,100	1,472.00	14,867,200	
ホシデン	28,000	2,320.00	64,960,000	
ヒロセ電機	16,600	19,335.00	320,961,000	
日本航空電子	29,700	2,546.00	75,616,200	
ＴＯＡ	11,500	1,154.00	13,271,000	
マクセル	21,800	2,153.00	46,935,400	
古野電気	13,500	5,780.00	78,030,000	貸付株式数　5,200株
スミダコーポレーション	19,600	1,066.00	20,893,600	
アイコム	4,400	2,971.00	13,072,400	
リオン	4,700	2,663.00	12,516,100	
横河電機	124,900	4,390.00	548,311,000	
新電元工業	4,400	3,115.00	13,706,000	
アズビル	297,500	1,469.50	437,176,250	
日本光電工業	101,200	1,728.50	174,924,200	
チノー	4,700	2,620.00	12,314,000	貸付株式数　1,800株
日本電子材料	6,900	2,890.00	19,941,000	貸付株式数　2,700株
堀場製作所	21,400	11,730.00	251,022,000	
アドバンテスト	356,200	11,940.00	4,253,028,000	
エスペック	10,100	3,345.00	33,784,500	

キーエンス	113,100	55,890.00	6,321,159,000	
日置電機	5,900	6,090.00	35,931,000	
シスメックス	292,700	1,962.00	574,277,400	
日本マイクロニクス	18,600	4,575.00	85,095,000	貸付株式数　7,300株
メガチップス	8,700	6,090.00	52,983,000	
OBARA GROUP	6,200	4,325.00	26,815,000	貸付株式数　1,800株
デンソー	1,107,300	2,204.50	2,441,042,850	
コーセル	13,900	1,240.00	17,236,000	
イリソ電子工業	11,400	3,045.00	34,713,000	
オプテックスグループ	19,100	1,971.00	37,646,100	
千代田インテグレ	3,400	3,180.00	10,812,000	
レーザーテック	43,800	16,000.00	700,800,000	貸付株式数　17,500株
スタンレー電気	64,200	2,976.00	191,059,200	
ウシオ電機	43,000	2,232.00	95,976,000	貸付株式数　1,500株
日本セラミック	9,200	3,400.00	31,280,000	
古河電池	8,300	1,395.00	11,578,500	貸付株式数　2,400株
山一電機	9,200	3,305.00	30,406,000	
図 研	10,300	5,080.00	52,324,000	
日本電子	26,100	4,965.00	129,586,500	
カ シ オ	90,400	1,280.00	115,712,000	
ファナック	539,800	4,175.00	2,253,665,000	
日本シイエムケイ	33,100	358.00	11,849,800	貸付株式数　12,400株
エンプラス	3,300	5,290.00	17,457,000	貸付株式数　1,200株
大真空	12,200	593.00	7,234,600	貸付株式数　4,800株
ロ ー ム	204,800	2,109.00	431,923,200	貸付株式数　80,400株
浜松ホトニクス	188,900	1,568.00	296,195,200	
三井ハイテック	50,000	868.00	43,400,000	貸付株式数　19,300株
京 セ ラ	702,300	2,042.00	1,434,096,600	
太陽誘電	49,500	3,097.00	153,301,500	貸付株式数　19,400株
村田製作所	995,600	2,524.50	2,513,392,200	
双葉電子工業	21,500	661.00	14,211,500	貸付株式数　8,400株
日東電工	358,500	3,495.00	1,252,957,500	
東海理化電機	30,200	2,777.00	83,865,400	
ニチコン	26,600	1,394.00	37,080,400	
日本ケミコン	13,900	1,439.00	20,002,100	
ＫＯＡ	17,400	1,188.00	20,671,200	
三井Ｅ＆Ｓ	61,000	4,230.00	258,030,000	貸付株式数　24,400株
カナデビア	93,500	1,041.00	97,333,500	
三菱重工業	1,996,200	3,727.00	7,439,837,400	
川崎重工業	85,200	9,082.00	773,786,400	貸付株式数　34,000株

ＩＨＩ	91,500	15,855.00	1,450,732,500		
名村造船所	32,300	3,275.00	105,782,500	貸付株式数	1,700株
マネジメントソリューションズ	6,400	1,519.00	9,721,600	貸付株式数	2,500株
プロレド・パートナーズ	2,800	797.00	2,231,600	貸付株式数	1,000株
フロンティア・マネジメント	4,500	701.00	3,154,500	貸付株式数	1,700株
アンビスホールディングス	24,900	612.00	15,238,800		
カーブスホールディングス	31,700	838.00	26,564,600		
フォーラムエンジニアリング	13,500	1,333.00	17,995,500		
FAST FITNESS JAP	4,000	1,884.00	7,536,000		
MACBEE PLANET	4,300	2,493.00	10,719,900	貸付株式数	1,700株
日本車輌	4,300	2,850.00	12,255,000		
三菱ロジスネクスト	18,100	1,839.00	33,285,900	貸付株式数	6,900株
フルサト・マルカHD	10,600	2,338.00	24,782,800	貸付株式数	4,100株
ヤマエグループHD	12,900	2,839.00	36,623,100	貸付株式数	3,200株
ＦＰＧ	35,400	2,480.00	87,792,000		
ライフネット生命保険	20,400	2,107.00	42,982,800		
全国保証	58,200	3,465.00	201,663,000		
めぶきフィナンシャルG	542,300	910.50	493,764,150		
ジャパンインベストメントA	18,100	1,930.00	34,933,000	貸付株式数	800株
東京きらぼしFG	14,300	7,190.00	102,817,000		
九州フィナンシャルG	195,800	879.00	172,108,200		
かんぽ生命保険	125,700	4,194.00	527,185,800		
ゆうちょ銀行	906,800	1,888.50	1,712,491,800		
富山第一銀行	35,300	1,273.00	44,936,900	貸付株式数	13,600株
コンコルディア・フィナンシャル	580,500	1,120.50	650,450,250		
ジェイリース	8,400	1,687.00	14,170,800		
西日本フィナンシャルHD	68,100	2,482.00	169,024,200		
ＳＢＩアルヒ	11,300	839.00	9,480,700	貸付株式数	4,300株
プレミアグループ	18,800	2,237.00	42,055,600		
日産自動車	1,412,800	353.20	499,000,960	貸付株式数	565,100株
いすゞ自動車	331,700	2,001.00	663,731,700		
トヨタ自動車	6,008,200	2,970.00	17,844,354,000	※	
日野自動車	170,000	390.80	66,436,000		
三菱自動車工業	432,100	423.90	183,167,190	貸付株式数	169,700株
武蔵精密工業	27,700	3,165.00	87,670,500	貸付株式数	10,800株
日産車体	17,200	1,224.00	21,052,800		

新明和工業	32,500	1,797.00	58,402,500	
極東開発工業	15,300	2,773.00	42,426,900	
トピー工業	9,200	3,060.00	28,152,000	
ティラド	2,500	6,810.00	17,025,000	
タチエス	20,900	2,070.00	43,263,000	
ＮＯＫ	43,900	2,697.50	118,420,250	
フタバ産業	34,100	990.00	33,759,000	
カヤバ	19,200	4,000.00	76,800,000	
市光工業	24,500	458.00	11,221,000	
大同メタル工業	22,100	944.00	20,862,400	貸付株式数　8,600株
プレス工業	42,300	674.00	28,510,200	
太平洋工業	25,400	2,446.00	62,128,400	
アイシン	224,600	2,659.50	597,323,700	
マ ツ ダ	347,100	1,176.00	408,189,600	
本田技研	2,677,900	1,694.00	4,536,362,600	貸付株式数　753,900株
スズキ	913,400	2,054.00	1,876,123,600	
SUBARU	340,800	3,120.00	1,063,296,000	
ヤマハ発動機	559,400	1,133.50	634,079,900	
小糸製作所	117,100	2,230.50	261,191,550	
エクセディ	18,500	5,490.00	101,565,000	
ミツバ	21,200	997.00	21,136,400	
豊田合成	32,400	3,816.00	123,638,400	
愛三工業	21,400	2,002.00	42,842,800	貸付株式数　2,600株
ヨ ロ ズ	11,700	1,003.00	11,735,100	貸付株式数　4,500株
エフ・シー・シー	19,800	3,245.00	64,251,000	
シマノ	48,200	16,920.00	815,544,000	
テイ・エス テック	41,900	1,936.00	81,118,400	
３３ＦＧ	10,000	3,540.00	35,400,000	
第四北越フィナンシャルG	35,000	4,075.00	142,625,000	
ひろぎんHLDGS	154,900	1,418.00	219,648,200	貸付株式数　11,900株
おきなわＦＧ	8,800	3,655.00	32,164,000	
ダイレクトマケティングミクス	11,900	300.00	3,570,000	
ポピンズ	1,700	1,458.00	2,478,600	
LITALICO	10,600	1,318.00	13,970,800	貸付株式数　500株
十六ＦＧ	15,600	5,510.00	85,956,000	
北國ＦＨＤ	10,700	6,310.00	67,517,000	
ネットプロＨＤ	37,800	846.00	31,978,800	貸付株式数　14,400株
プロクレアホールディングス	12,700	1,714.00	21,767,800	

ＦＰパートナー	4,900	2,195.00	10,755,500	貸付株式数	1,900株
あいちフィナンシャルグル	20,800	3,090.00	64,272,000	貸付株式数	2,600株
小 野 建	12,700	1,459.00	18,529,300	貸付株式数	4,900株
ノ ジ マ	39,000	3,605.00	140,595,000		
佐鳥電機	7,600	1,917.00	14,569,200		
カッパ・クリエイト	18,800	1,640.00	30,832,000	貸付株式数	7,500株
伯東	6,300	4,075.00	25,672,500	貸付株式数	2,400株
コンドーテック	9,200	1,695.00	15,594,000	貸付株式数	3,000株
ナガイレーベン	15,100	2,056.00	31,045,600	貸付株式数	5,800株
良品計画	261,000	3,066.00	800,226,000		
松田産業	9,100	4,050.00	36,855,000		
第一興商	46,300	1,722.00	79,728,600	貸付株式数	7,200株
メディパルHD	129,700	2,707.50	351,162,750		
アドヴァングループ	9,600	943.00	9,052,800	貸付株式数	3,600株
ＳＰＫ	4,800	2,406.00	11,548,800		
萩原電気HLDGS	5,100	3,645.00	18,589,500		
アルビス	3,900	3,125.00	12,187,500		
アズワン	35,000	2,585.50	90,492,500		
スズデン	6,800	1,718.00	11,682,400	貸付株式数	2,600株
シモジマ	8,000	1,311.00	10,488,000		
ドウシシャ	11,100	2,824.00	31,346,400		
高速	7,100	2,947.00	20,923,700	貸付株式数	2,700株
G-7ホールディングス	13,000	1,353.00	17,589,000		
たけびし	5,100	2,102.00	10,720,200	貸付株式数	1,500株
イオン北海道	29,500	926.00	27,317,000	貸付株式数	11,500株
コ ジ マ	19,800	1,125.00	22,275,000	貸付株式数	7,600株
コーナン商事	13,200	4,090.00	53,988,000		
エコス	4,400	2,770.00	12,188,000	貸付株式数	1,700株
ワタミ	14,400	999.00	14,385,600	貸付株式数	5,400株
リックス	2,700	3,435.00	9,274,500		
システムソフト	38,900	62.00	2,411,800	貸付株式数	15,500株
パンパシフィックHD	241,700	5,522.00	1,334,667,400		
丸文	10,700	1,223.00	13,086,100	貸付株式数	4,100株
西松屋チェーン	26,500	2,204.00	58,406,000	貸付株式数	5,600株
ゼンショーホールディングス	67,900	9,300.00	631,470,000		
ハピネット	9,100	6,690.00	60,879,000		
幸楽苑	10,400	1,063.00	11,055,200	貸付株式数	3,500株
橋本総業HLDGS	4,700	1,296.00	6,091,200	貸付株式数	1,000株

日本ライフライン	30,100	1,536.00	46,233,600		
サイゼリヤ	15,500	5,260.00	81,530,000		
タカショー	9,700	446.00	4,326,200	貸付株式数	3,500株
ＶＴホールディングス	46,600	496.00	23,113,600	貸付株式数	9,700株
アルゴグラフィックス	10,400	4,790.00	49,816,000		
魚力	4,200	2,614.00	10,978,800	貸付株式数	1,600株
ＩＤＯＭ	40,700	1,027.00	41,798,900		
日本エム・ディ・エム	9,000	516.00	4,644,000		
フジ・コーポレーション	4,600	2,817.00	12,958,200		
ユナイテッドアローズ	12,800	2,226.00	28,492,800		
進和	7,000	3,360.00	23,520,000	貸付株式数	2,300株
ダイトロン	4,900	4,220.00	20,678,000		
ハイデイ日高	19,300	3,760.00	72,568,000	貸付株式数	4,300株
シークス	19,200	1,355.00	26,016,000		
コロワイド	67,500	1,924.00	129,870,000	貸付株式数	27,000株
オーハシテクニカ	5,600	2,327.00	13,031,200	貸付株式数	1,200株
壱番屋	47,200	930.00	43,896,000	貸付株式数	18,300株
白銅	3,400	2,318.00	7,881,200	貸付株式数	1,000株
スギホールディングス	64,200	3,862.00	247,940,400		
薬王堂ホールディングス	5,800	2,280.00	13,224,000		
ダブルエー	3,200	1,300.00	4,160,000	貸付株式数	1,200株
島津製作所	162,700	3,642.00	592,553,400		
ＪＭＳ	10,400	451.00	4,690,400		
長野計器	7,400	2,095.00	15,503,000	貸付株式数	2,900株
ブイ・テクノロジー	5,500	3,055.00	16,802,500		
スター精密	18,400	1,692.00	31,132,800		
東京計器	7,900	4,205.00	33,219,500	貸付株式数	3,100株
愛知時計	5,400	2,904.00	15,681,600		
インターアクション	6,800	1,402.00	9,533,600		
東京精密	23,200	8,435.00	195,692,000		
マニー	45,200	1,310.00	59,212,000		
ニコン	169,200	1,701.50	287,893,800		
トプコン	63,000	3,294.00	207,522,000		
オリンパス	625,900	1,875.50	1,173,875,450		
理研計器	16,000	3,090.00	49,440,000		
SCREENホールディングス	47,200	11,215.00	529,348,000		
キヤノン電子	12,500	2,683.00	33,537,500		
タムロン	57,700	1,044.00	60,238,800		
ＨＯＹＡ	217,500	20,755.00	4,514,212,500		
ノーリツ鋼機	32,200	1,770.00	56,994,000		

A&Dホロンホールディングス	14,100	2,010.00	28,341,000	
朝日インテック	137,800	2,707.00	373,024,600	
キヤノン	507,300	4,477.00	2,271,182,100	
リ コ ー	289,000	1,391.00	401,999,000	
シチズン時計	104,000	1,067.00	110,968,000	
メニコン	42,200	1,235.00	52,117,000	
パラマウントベッドHD	24,300	2,723.00	66,168,900	
トランザクション	12,400	1,191.00	14,768,400	貸付株式数 5,400株
ニホンフラッシュ	9,500	815.00	7,742,500	
前田工繊	23,000	1,855.00	42,665,000	
アートネイチャー	11,600	811.00	9,407,600	貸付株式数 4,500株
フルヤ金属	9,700	2,725.00	26,432,500	貸付株式数 3,800株
バンダイナムコHLDGS	302,200	5,000.00	1,511,000,000	
ＳＨＯＥＩ	29,500	1,870.00	55,165,000	貸付株式数 200株
フランスベッドHLDGS	14,700	1,296.00	19,051,200	貸付株式数 5,700株
マーベラス	21,000	571.00	11,991,000	貸付株式数 8,200株
パイロットコーポレーション	17,300	4,598.00	79,545,400	
萩原工業	7,600	1,681.00	12,775,600	貸付株式数 2,900株
エイベックス	21,300	1,304.00	27,775,200	
フジシールインターナショナル	25,400	2,925.00	74,295,000	
タカラトミー	47,500	3,321.00	157,747,500	
広済堂ホールディングス	42,700	434.00	18,531,800	貸付株式数 16,800株
レック	14,500	1,216.00	17,632,000	
三光合成	14,300	916.00	13,098,800	
プロネクサス	11,700	1,146.00	13,408,200	貸付株式数 4,600株
TOPPANホールディングス	137,000	3,936.00	539,232,000	
大日本印刷	221,700	2,621.00	581,075,700	
共同印刷	12,700	1,578.00	20,040,600	
ＮＩＳＳＨＡ	21,500	1,429.00	30,723,500	
ＺＡＣＲＯＳ	9,000	4,205.00	37,845,000	
TAKARA & COMPANY	6,100	4,020.00	24,522,000	貸付株式数 2,000株
前澤化成工業	8,000	2,279.00	18,232,000	貸付株式数 3,000株
未来工業	5,400	3,925.00	21,195,000	貸付株式数 1,200株
アシックス	434,600	4,114.00	1,787,944,400	
ツ ツ ミ	2,600	2,269.00	5,899,400	
ジェイ エス ピー	9,300	2,001.00	18,609,300	貸付株式数 3,400株
ニ チ ハ	14,200	2,926.00	41,549,200	貸付株式数 4,300株
ローランド	9,000	3,420.00	30,780,000	

エフピコ	25,000	2,659.00	66,475,000	
小松ウオール工業	7,500	2,674.00	20,055,000	
ヤマハ	191,300	1,022.00	195,508,600	
河合楽器	3,400	2,601.00	8,843,400	
クリナップ	11,100	777.00	8,624,700	
ピジョン	66,800	1,866.00	124,648,800	
キングジム	10,000	848.00	8,480,000	貸付株式数 3,800株 (200株)
象印マホービン	30,700	1,688.00	51,821,600	貸付株式数 4,700株
リンテック	21,400	3,580.00	76,612,000	
信越ポリマー	24,400	1,886.00	46,018,400	
イトーキ	24,800	2,385.00	59,148,000	
任 天 堂	713,600	13,790.00	9,840,544,000	
三菱鉛筆	15,500	2,136.00	33,108,000	貸付株式数 6,000株
松 風	11,300	1,992.00	22,509,600	
タカラスタンダード	25,600	2,705.00	69,248,000	
コ ク ヨ	234,800	928.20	217,941,360	
ナカバヤシ	12,200	588.00	7,173,600	
ニ フ コ	42,400	4,457.00	188,976,800	
立川ブラインド	5,900	1,845.00	10,885,500	貸付株式数 1,800株
グローブライド	11,200	2,422.00	27,126,400	貸付株式数 4,300株
オカムラ	34,000	2,430.00	82,620,000	
バルカー	8,700	3,845.00	33,451,500	貸付株式数 3,400株
伊 藤 忠	803,800	8,726.00	7,013,958,800	
丸 紅	982,700	3,543.00	3,481,706,100	
スクロール	17,500	1,159.00	20,282,500	
ヨンドシーホールディングス	11,300	1,745.00	19,718,500	貸付株式数 4,400株
三陽商会	5,900	3,380.00	19,942,000	
長瀬産業	51,100	3,329.00	170,111,900	
蝶 理	6,400	3,970.00	25,408,000	貸付株式数 1,600株
豊田通商	359,100	4,054.00	1,455,791,400	
オンワードホールディングス	73,400	691.00	50,719,400	
三共生興	15,600	688.00	10,732,800	
兼 松	50,000	3,170.00	158,500,000	
美 津 濃	33,700	2,638.00	88,900,600	貸付株式数 13,200株
ルックホールディングス	3,600	2,700.00	9,720,000	貸付株式数 1,300株
三井物産	1,719,100	3,720.00	6,395,052,000	
日本紙パルプ	57,100	720.00	41,112,000	

東京エレクトロン	239,200	20,600.00	4,927,520,000	
カメイ	11,200	2,924.00	32,748,800	
スターゼン	24,800	1,225.00	30,380,000	
セイコーグループ	17,500	6,900.00	120,750,000	
山 善	40,300	1,403.00	56,540,900	貸付株式数 16,100株
椿本興業	6,600	2,973.00	19,621,800	貸付株式数 2,500株
住友商事	716,600	4,370.00	3,131,542,000	
ＢＩＰＲＯＧＹ	38,300	6,344.00	242,975,200	
内田洋行	4,400	11,360.00	49,984,000	
三菱商事	2,210,100	3,497.00	7,728,719,700	※
第一実業	11,100	2,765.00	30,691,500	
キヤノンマーケティングJPN	28,200	5,873.00	165,618,600	
西華産業	5,700	5,980.00	34,086,000	
佐藤商事	8,300	1,750.00	14,525,000	
東京産業	12,100	948.00	11,470,800	
ユアサ商事	10,300	5,100.00	52,530,000	
神鋼商事	7,900	2,333.00	18,430,700	
阪和興業	19,700	6,520.00	128,444,000	
正栄食品	8,000	4,185.00	33,480,000	貸付株式数 2,500株 (1,100株)
カナデン	8,600	2,043.00	17,569,800	
ＲＹＯＤＥＮ	9,100	3,195.00	29,074,500	
ニプロ	94,200	1,565.00	147,423,000	
岩谷産業	118,800	1,669.50	198,336,600	
極東貿易	6,900	1,799.00	12,413,100	
アステナホールディングス	22,600	520.00	11,752,000	
三愛オブリ	27,900	2,119.00	59,120,100	貸付株式数 4,200株
稲畑産業	32,400	3,555.00	115,182,000	
ＧＳＩクレオス	6,400	2,427.00	15,532,800	貸付株式数 2,500株
明和産業	17,000	840.00	14,280,000	
ゴールドウイン	20,100	7,577.00	152,297,700	
ユニ・チャーム	708,500	993.20	703,682,200	
ワ キ タ	17,600	1,880.00	33,088,000	貸付株式数 6,800株
東邦ホールディングス	30,900	5,660.00	174,894,000	貸付株式数 12,000株
サンゲツ	30,000	3,175.00	95,250,000	
ミツウロコグループ	14,500	2,201.00	31,914,500	貸付株式数 5,300株
シナネンホールディングス	3,000	6,550.00	19,650,000	貸付株式数 1,100株
伊藤忠エネクス	29,600	1,973.00	58,400,800	
サンリオ	97,200	7,627.00	741,344,400	貸付株式数 38,800株
サンワ テクノス	5,400	2,650.00	14,310,000	貸付株式数 2,100株

新光商事	16,100	1,020.00	16,422,000	貸付株式数	3,100株
トーホー	5,100	3,585.00	18,283,500		
三信電気	4,800	2,805.00	13,464,000		
東陽テクニカ	11,000	1,594.00	17,534,000		
モスフード サービス	17,600	4,010.00	70,576,000	貸付株式数	6,900株
加賀電子	24,300	3,590.00	87,237,000		
都築電気	6,400	3,170.00	20,288,000	貸付株式数	2,400株
ソーダニツカ	11,600	1,117.00	12,957,200	貸付株式数	4,200株
立花エレテック	7,100	3,025.00	21,477,500		
木曽路	18,100	2,544.00	46,046,400	貸付株式数	7,100株 (200株)
SRSホールディングス	19,700	1,280.00	25,216,000	貸付株式数	7,600株
千 趣 会	24,200	247.00	5,977,400	貸付株式数	8,700株 (400株)
リテールパートナーズ	17,700	1,472.00	26,054,400	貸付株式数	6,800株
上新電機	11,800	2,575.00	30,385,000	貸付株式数	4,600株
日本瓦斯	57,200	2,889.00	165,250,800		
ロイヤルホールディングス	23,200	2,733.00	63,405,600	貸付株式数	8,100株
チヨダ	10,500	1,289.00	13,534,500		
ライフコーポレーション	22,900	2,513.00	57,547,700		
リンガーハット	15,400	2,271.00	34,973,400	貸付株式数	6,100株
ＭｒＭａｘＨＤ	15,100	866.00	13,076,600		
AOKIホールディングス	25,600	1,812.00	46,387,200		
オークワ	17,700	971.00	17,186,700	貸付株式数	4,700株
コメリ	16,100	3,345.00	53,854,500		
青山商事	25,600	2,566.00	65,689,600	貸付株式数	10,200株
しまむら	28,100	11,235.00	315,703,500		
高 島 屋	160,100	1,406.00	225,100,600		
松 屋	20,300	1,397.00	28,359,100		
エイチ・ツー・オーリテイリング	58,200	2,248.50	130,862,700		
近鉄百貨店	6,800	2,031.00	13,810,800	貸付株式数	2,500株
丸井グループ	69,900	3,289.00	229,901,100		
クレディセゾン	70,500	3,881.00	273,610,500		
アクシアル リテイリング	32,600	1,162.00	37,881,200		
イオン	1,458,000	1,797.00	2,620,026,000		
イ ズ ミ	18,200	3,242.00	59,004,400		
フオーバル	4,700	1,399.00	6,575,300	貸付株式数	1,000株
平 和 堂	19,600	2,885.00	56,546,000		
フ ジ	22,000	2,019.00	44,418,000	貸付株式数	8,400株

ヤオコー	14,200	9,082.00	128,964,400	
ゼビオホールディングス	16,200	1,163.00	18,840,600	貸付株式数 6,300株
ケーズホールディングス	74,000	1,579.50	116,883,000	
ＰＡＬＴＡＣ	18,600	4,690.00	87,234,000	
三谷産業	20,900	428.00	8,945,200	
あおぞら銀行	76,800	2,279.50	175,065,600	貸付株式数 30,700株
三菱UFJフィナンシャルG	7,140,700	2,285.50	16,320,069,850	
りそなホールディングス	1,365,200	1,476.00	2,015,035,200	
三井住友トラストグルー	391,900	4,259.00	1,669,102,100	
三井住友フィナンシャルG	2,298,500	4,090.00	9,400,865,000	
千葉銀行	340,500	1,522.00	518,241,000	
群馬銀行	188,700	1,587.00	299,466,900	
武蔵野銀行	16,900	3,885.00	65,656,500	
千葉興業銀行	26,300	1,557.00	40,949,100	貸付株式数 8,400株
筑波銀行	48,800	299.00	14,591,200	
七十七銀行	35,600	5,694.00	202,706,400	
秋田銀行	7,500	3,560.00	26,700,000	
山形銀行	12,300	1,640.00	20,172,000	貸付株式数 4,800株
岩手銀行	7,000	3,810.00	26,670,000	貸付株式数 1,300株
東邦銀行	128,100	419.00	53,673,900	貸付株式数 12,800株
ふくおかフィナンシャルG	96,900	4,466.00	432,755,400	
スルガ銀行	63,000	1,525.00	96,075,000	
八十二銀行	250,400	1,451.00	363,330,400	
山梨中央銀行	12,500	3,105.00	38,812,500	
大垣共立銀行	21,200	3,190.00	67,628,000	
福井銀行	10,000	2,005.00	20,050,000	貸付株式数 3,800株
清水銀行	4,400	1,968.00	8,659,200	
滋賀銀行	16,800	6,640.00	111,552,000	
南都銀行	16,800	4,970.00	83,496,000	
百五銀行	104,700	865.00	90,565,500	
紀陽銀行	39,800	2,980.00	118,604,000	
ほくほくフィナンシャルG	62,600	3,752.00	234,875,200	
山陰合同銀行	69,700	1,366.00	95,210,200	
百十四銀行	10,900	5,020.00	54,718,000	
四国銀行	16,100	1,450.00	23,345,000	
阿波銀行	15,200	3,490.00	53,048,000	
大分銀行	6,500	4,885.00	31,752,500	
宮崎銀行	7,100	4,385.00	31,133,500	貸付株式数 2,700株
佐賀銀行	6,400	2,952.00	18,892,800	
琉球銀行	25,500	1,372.00	34,986,000	貸付株式数 3,000株

セブン銀行	398,800	287.60	114,694,880	貸付株式数　156,600株
みずほフィナンシャルG	1,487,400	4,891.00	7,274,873,400	
山口フィナンシャルG	109,100	1,782.50	194,470,750	
芙蓉総合リース	30,700	4,460.00	136,922,000	
みずほリース	83,600	1,307.00	109,265,200	
東京センチュリー	83,200	1,910.00	158,912,000	
SBIホールディングス	179,300	6,643.00	1,191,089,900	
日本証券金融	40,900	1,892.00	77,382,800	
アイフル	184,300	490.00	90,307,000	
名古屋銀行	7,000	10,530.00	73,710,000	
北洋銀行	143,800	720.00	103,536,000	
愛媛銀行	16,200	1,225.00	19,845,000	貸付株式数　6,400株
京葉銀行	50,000	1,220.00	61,000,000	
栃木銀行	51,000	483.00	24,633,000	
北日本銀行	3,800	3,860.00	14,668,000	
東和銀行	20,400	968.00	19,747,200	貸付株式数　7,900株
リコーリース	10,600	5,830.00	61,798,000	貸付株式数　4,100株
イオンフィナンシャルサービス	63,900	1,546.00	98,789,400	貸付株式数　25,500株
ア コ ム	264,900	478.40	126,728,160	
ジャックス	13,300	4,435.00	58,985,500	貸付株式数　2,000株
オ リ コ	36,300	1,043.00	37,860,900	貸付株式数　5,300株
オリックス	639,000	3,903.00	2,494,017,000	
三菱HCキャピタル	558,000	1,226.00	684,108,000	
ジャフコ グループ	33,200	2,614.00	86,784,800	貸付株式数　1,900株
トモニホールディングス	106,300	656.00	69,732,800	
大和証券G本社	796,000	1,207.00	960,772,000	
野村ホールディングス	1,871,900	1,083.50	2,028,203,650	
岡三証券グループ	88,000	691.00	60,808,000	貸付株式数　32,800株
丸三証券	37,000	977.00	36,149,000	貸付株式数　13,500株
東洋証券	28,100	547.00	15,370,700	
東海東京ＨＤ	132,200	592.00	78,262,400	
水戸証券	30,500	556.00	16,958,000	
いちよし証券	22,400	816.00	18,278,400	貸付株式数　8,400株
松井証券	76,700	802.00	61,513,400	
SOMPOホールディングス	513,300	4,801.00	2,464,353,300	
日本取引所グループ	662,200	1,541.50	1,020,781,300	
マネックスG	107,200	806.00	86,403,200	
極東証券	13,900	1,619.00	22,504,100	貸付株式数　5,300株
岩井コスモホールディング	12,700	2,716.00	34,493,200	

アイザワ証券グループ	13,400	1,445.00	19,363,000	貸付株式数	4,200株
フィデアホール	11,500	1,612.00	18,538,000		
池田泉州ＨＤ	154,400	645.00	99,588,000		
アニコム ホールディングス	34,800	906.00	31,528,800	貸付株式数	13,600株
ＭＳ＆ＡＤ	815,800	3,506.00	2,860,194,800		
スパークス・グループ	12,300	1,608.00	19,778,400		
第一生命HLDGS	2,033,100	1,239.50	2,520,027,450		
東京海上ＨＤ	1,062,600	6,514.00	6,921,776,400		
イー・ギャランティ	18,200	1,486.00	27,045,200	貸付株式数	6,900株
NECキャピタルソリューション	5,500	3,905.00	21,477,500		
T&Dホールディングス	298,900	3,937.00	1,176,769,300		
アドバンスクリエイト	8,600	335.00	2,881,000	貸付株式数	3,400株
三井不動産	1,528,700	1,634.00	2,497,895,800		
三菱地所	634,400	3,355.00	2,128,412,000		
平和不動産	36,100	2,358.00	85,123,800	貸付株式数	9,900株
東京建物	106,100	2,867.50	304,241,750		
京阪神ビルディング	18,600	1,628.00	30,280,800	貸付株式数	6,200株
住友不動産	181,100	6,374.00	1,154,331,400		
テーオーシー	19,800	819.00	16,216,200		
スターツコーポレーション	18,300	4,995.00	91,408,500		
フジ住宅	14,000	814.00	11,396,000		
空港施設	15,700	1,091.00	17,128,700	貸付株式数	6,100株
明和地所	8,900	1,110.00	9,879,000	貸付株式数	2,200株
ゴールドクレスト	7,600	3,440.00	26,144,000	貸付株式数	1,200株
リログループ	64,700	1,760.00	113,872,000		
エスリード	5,200	5,350.00	27,820,000		
日神グループHLDGS	17,900	585.00	10,471,500	貸付株式数	6,800株
エスコン	29,200	1,047.00	30,572,400	貸付株式数	11,400株
MIRARTHホールディング	65,200	402.00	26,210,400	貸付株式数	25,600株
ランド	718,300	10.00	7,183,000	貸付株式数	278,200株
カチタス	29,900	2,786.00	83,301,400	貸付株式数	11,200株
東祥	9,700	719.00	6,974,300		
トーセイ	16,500	3,335.00	55,027,500		
サンフロンティア不動産	18,500	2,344.00	43,364,000		
グランディハウス	10,400	576.00	5,990,400	貸付株式数	1,300株
東武鉄道	119,100	2,780.00	331,098,000		
相鉄ホールディングス	37,300	2,662.50	99,311,250		
東急	316,900	1,911.00	605,595,900		
京浜急行	139,900	1,595.00	223,140,500	貸付株式数	34,100株

小田急電鉄	186,900	1,755.00	328,009,500	
京王電鉄	55,700	3,905.00	217,508,500	
京成電鉄	196,800	1,430.50	281,522,400	
富士急行	13,900	2,358.00	32,776,200	貸付株式数　5,500株
東日本旅客鉄道	623,300	3,795.00	2,365,423,500	
西日本旅客鉄道	278,700	3,372.00	939,776,400	
東海旅客鉄道	435,300	4,156.00	1,809,106,800	
東京地下鉄	252,000	1,746.00	439,992,000	貸付株式数　100,800株
西武ホールディングス	123,000	5,478.00	673,794,000	
鴻池運輸	19,300	3,390.00	65,427,000	
西日本鉄道	32,700	2,323.50	75,978,450	
ハマキョウレックス	38,600	1,558.00	60,138,800	
サカイ引越センター	14,300	2,989.00	42,742,700	貸付株式数　5,600株
近鉄グループHLDGS	120,900	3,079.00	372,251,100	
阪急阪神HLDGS	149,700	4,416.00	661,075,200	
南海電鉄	50,300	2,760.00	138,828,000	貸付株式数　1,700株
京阪ホールディングス	58,700	3,466.00	203,454,200	
神戸電鉄	3,100	2,590.00	8,029,000	貸付株式数　1,200株
名古屋鉄道	124,700	1,753.50	218,661,450	貸付株式数　49,000株
山陽電鉄	8,500	2,112.00	17,952,000	貸付株式数　3,200株
ヤマトホールディングス	137,100	2,506.50	343,641,150	
山 九	25,800	8,179.00	211,018,200	
日 新	2,600	8,060.00	20,956,000	
丸全昭和運輸	7,000	7,330.00	51,310,000	貸付株式数　700株
センコーグループHLDGS	74,300	2,092.00	155,435,600	
ニッコンホールディングス	64,100	3,253.00	208,517,300	貸付株式数　24,700株
福山通運	12,100	3,745.00	45,314,500	
セイノーホールディングス	55,500	2,313.50	128,399,250	貸付株式数　20,700株
神奈川中央交通	3,200	3,690.00	11,808,000	
AZ-COM丸和ホールディ	35,000	1,101.00	38,535,000	貸付株式数　14,000株
日本郵船	220,200	5,544.00	1,220,788,800	
商船三井	214,700	4,861.00	1,043,656,700	
川崎汽船	243,100	2,341.00	569,097,100	
NSユナイテッド海運	7,100	5,360.00	38,056,000	
飯野海運	41,400	1,237.00	51,211,800	貸付株式数　14,100株
九州旅客鉄道	86,400	4,168.00	360,115,200	
SGホールディングス	189,500	1,618.50	306,705,750	
NIPPON EXPRESS	121,300	3,453.00	418,848,900	
日本航空	258,700	3,152.00	815,422,400	
ANAホールディングス	307,000	2,966.50	910,715,500	

ビーウィズ	3,000	1,507.00	4,521,000	貸付株式数	1,200株
サンウェルズ	6,000	740.00	4,440,000	貸付株式数	2,300株
TREホールディングス	26,700	1,603.00	42,800,100		
人・夢・技術グループ	4,800	1,834.00	8,803,200		
シルバーライフ	3,200	791.00	2,531,200	貸付株式数	500株
GENKY DRUGSTORES	10,500	4,860.00	51,030,000	貸付株式数	1,900株
コーア商事HLDGS	10,700	780.00	8,346,000	貸付株式数	4,100株
KPPグループホールディン	22,700	837.00	18,999,900		
ブックオフＧＨＤ	8,700	1,586.00	13,798,200	貸付株式数	3,400株
ギフトホールディングス	6,800	3,035.00	20,638,000	貸付株式数	2,600株
三菱倉庫	112,100	1,238.50	138,835,850		
三井倉庫HOLD	34,800	4,280.00	148,944,000		
住友倉庫	32,900	3,155.00	103,799,500		
渋沢倉庫	5,100	4,580.00	23,358,000	貸付株式数	2,000株
ヤマタネ	9,600	2,893.00	27,772,800	貸付株式数	3,700株
乾汽船	14,300	1,659.00	23,723,700	貸付株式数	5,700株
日本トランスシティ	22,700	1,181.00	26,808,700		
中央倉庫	6,700	1,447.00	9,694,900	貸付株式数	2,300株
安田倉庫	7,700	2,116.00	16,293,200	貸付株式数	900株
ＮＩＳＳＯＨＤ	10,100	653.00	6,595,300	貸付株式数	3,700株
大栄環境	25,300	3,495.00	88,423,500	貸付株式数	4,600株
GENOVA	5,300	688.00	3,646,400	貸付株式数	2,100株
日本管財ホールディンク	12,200	2,809.00	34,269,800	貸付株式数	4,800株
上 組	49,500	4,545.00	224,977,500		
キユーソー流通システム	6,400	3,450.00	22,080,000	貸付株式数	2,500株
エーアイテイー	7,100	2,109.00	14,973,900		
日本コンセプト	4,000	3,040.00	12,160,000		
TBSホールディングス	56,000	5,523.00	309,288,000		
日本テレビHLDS	100,400	4,038.00	405,415,200	貸付株式数	36,100株
朝日放送グループHD	14,100	777.00	10,955,700	貸付株式数	5,400株
テレビ朝日ＨＤ	27,500	3,255.00	89,512,500		
スカパーJSATHD	88,100	1,346.00	118,582,600		
テレビ東京ＨＤ	7,000	4,715.00	33,005,000	貸付株式数	2,200株
ビジョン	23,700	1,253.00	29,696,100	貸付株式数	800株
U-NEXT HOLDINGS	38,100	2,058.00	78,409,800	貸付株式数	1,500株
日本通信	91,100	146.00	13,300,600	貸付株式数	20,200株
ＮＴＴ	33,717,900	158.80	5,354,402,520		
ＫＤＤＩ	1,593,000	2,513.50	4,004,005,500		
ソフトバンク	18,188,000	227.40	4,135,951,200		

光通信	13,100	39,200.00	513,520,000		
エムティーアイ	7,600	834.00	6,338,400	貸付株式数	3,000株
GMOインターネットグループ	36,600	3,880.00	142,008,000		
ファイバーゲート	4,300	707.00	3,040,100	貸付株式数	1,700株
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	58,000	3,295.00	191,110,000		
学研ホールディングス	20,700	1,050.00	21,735,000		
ゼンリン	19,400	1,125.00	21,825,000	貸付株式数	7,400株
東京電力ＨＤ	950,900	761.50	724,110,350	貸付株式数	373,400株
中部電力	416,500	2,086.00	868,819,000		
関西電力	551,300	2,116.00	1,166,550,800		
中国電力	196,400	883.90	173,597,960		
北陸電力	115,600	931.40	107,669,840	貸付株式数	1,900株
東北電力	297,600	1,145.00	340,752,000		
四国電力	105,300	1,389.00	146,261,700		
九州電力	260,500	1,564.50	407,552,250	貸付株式数	27,300株
北海道電力	118,300	1,191.50	140,954,450	貸付株式数	46,400株
沖縄電力	28,900	1,018.00	29,420,200	貸付株式数	2,100株
電源開発	85,100	2,868.00	244,066,800		
エフオン	8,100	437.00	3,539,700		
イーレックス	22,000	739.00	16,258,000	貸付株式数	8,600株
レノバ	30,800	953.00	29,352,400	貸付株式数	12,100株
東京瓦斯	203,900	5,715.00	1,165,288,500		
大阪瓦斯	218,600	4,327.00	945,882,200		
東邦瓦斯	41,500	4,477.00	185,795,500		
北海道瓦斯	33,700	675.00	22,747,500	貸付株式数	5,000株
広島ガス	23,900	386.00	9,225,400		
西部ガスHLDGS	11,800	1,999.00	23,588,200		
静岡ガス	25,800	1,147.00	29,592,600		
メタウォーター	15,000	3,060.00	45,900,000		
M&A総研ホールディング	15,000	1,350.00	20,250,000	貸付株式数	5,800株
アイネット	6,500	1,721.00	11,186,500	貸付株式数	2,400株
松 竹	6,500	12,420.00	80,730,000	貸付株式数	2,200株
東 宝	66,900	9,259.00	619,427,100	貸付株式数	2,600株
エイチ・アイ・エス	33,800	1,477.00	49,922,600	貸付株式数	14,200株
東 映	18,700	5,240.00	97,988,000		
ラックランド	5,300	1,293.00	6,852,900	貸付株式数	1,800株
共立メンテナンス	36,500	3,390.00	123,735,000	貸付株式数	14,100株 (1,300株)
イチネンホールディングス	11,000	1,857.00	20,427,000		

建設技術研究所	12,000	2,950.00	35,400,000	貸付株式数	4,700株
スペース	8,400	1,371.00	11,516,400		
アインホールディングス	12,000	6,196.00	74,352,000		
燦ホールディングス	9,700	1,464.00	14,200,800		
ピー・シー・エー	7,400	1,962.00	14,518,800		
スバル興業	4,500	3,635.00	16,357,500	貸付株式数	1,500株
タナベコンサルティンググル	9,700	721.00	6,993,700	貸付株式数	3,800株
ビジネスＢ太田昭和	4,800	2,936.00	14,092,800	貸付株式数	900株
ナ ガ ワ	3,100	6,760.00	20,956,000	貸付株式数	900株
東京都競馬	8,500	5,250.00	44,625,000	貸付株式数	2,700株
カナモト	16,400	3,520.00	57,728,000		
ＤＴＳ	19,300	5,140.00	99,202,000		
スクウェア・エニックス・HD	57,000	10,015.00	570,855,000		
シーイーシー	13,700	2,318.00	31,756,600		
カプコン	225,300	4,011.00	903,678,300		
ニシオホールディングス	9,600	4,320.00	41,472,000		
アイ・エス・ビー	5,300	1,677.00	8,888,100	貸付株式数	1,200株
日本空港ビルデング	39,400	4,970.00	195,818,000		
トランス・コスモス	14,800	3,670.00	54,316,000		
乃村工藝社	50,700	1,071.00	54,299,700		
ＳＣＳＫ	92,600	4,790.00	443,554,000		
藤田観光	4,600	10,550.00	48,530,000	貸付株式数	2,000株
KNT-CTホールディングス	6,900	1,542.00	10,639,800	貸付株式数	900株
トーカイ	10,300	2,241.00	23,082,300		
セコム	236,700	5,551.00	1,313,921,700		
ＮＳＷ	5,000	2,612.00	13,060,000		
セントラル警備保障	6,300	2,525.00	15,907,500		
アイネス	8,800	1,958.00	17,230,400		
丹青社	24,600	1,461.00	35,940,600		
メイテックグループホールデ	42,900	3,330.00	142,857,000		
ＴＫＣ	17,700	4,375.00	77,437,500		
応用地質	10,500	2,962.00	31,101,000		
船井総研ホールディン	23,200	2,574.00	59,716,800		
ＮＳＤ	43,600	3,243.00	141,394,800		
コナミグループ	42,500	21,835.00	927,987,500		
学 究 社	4,600	2,350.00	10,810,000		
ナック	11,800	552.00	6,513,600	貸付株式数	4,500株

福井コンピュータHLDS	7,900	3,350.00	26,465,000	貸付株式数 3,000株
ダイセキ	28,000	3,665.00	102,620,000	貸付株式数 5,400株
ステップ	4,200	2,402.00	10,088,400	
泉州電業	7,600	4,325.00	32,870,000	
GENKI GLOBAL DIN	6,800	3,545.00	24,106,000	貸付株式数 2,600株
トラスコ中山	25,100	2,455.00	61,620,500	
ヤマダホールディングス	367,800	489.90	180,185,220	貸付株式数 144,400株
オートバックスセブン	41,600	1,610.00	66,976,000	
モリト	9,500	1,563.00	14,848,500	
アークランズ	35,600	1,858.00	66,144,800	貸付株式数 13,900株
ニトリホールディングス	43,500	14,230.00	619,005,000	
グルメ杵屋	9,700	1,013.00	9,826,100	貸付株式数 3,700株
ケーユーホールディングス	7,000	1,203.00	8,421,000	
吉野家ホールディングス	46,800	3,078.00	144,050,400	貸付株式数 18,700株 (4,400株)
加藤産業	14,800	5,820.00	86,136,000	
イノテック	8,100	1,555.00	12,595,500	
イエローハット	37,700	1,730.00	65,221,000	
松屋フーズHLDGS	5,600	6,520.00	36,512,000	
JBCCホールディングス	30,000	1,382.00	41,460,000	
JKホールディングス	9,200	1,315.00	12,098,000	
サガミホールディングス	19,200	1,885.00	36,192,000	貸付株式数 7,500株
日 伝	6,700	2,839.00	19,021,300	貸付株式数 2,600株
ミロク情報サービス	9,600	1,868.00	17,932,800	貸付株式数 3,700株
杉本商事	10,600	1,881.00	19,938,600	貸付株式数 4,100株
因幡電機産業	33,600	4,231.00	142,161,600	
王将フードサービス	21,900	3,895.00	85,300,500	貸付株式数 8,600株
ミニストップ	9,900	1,999.00	19,790,100	貸付株式数 3,700株 (1,200株)
アークス	20,100	3,120.00	62,712,000	
バローホールディングス	22,800	2,956.00	67,396,800	
東 テ ク	12,000	3,265.00	39,180,000	
ミスミグループ本社	180,700	2,352.50	425,096,750	
ベ ル ク	6,000	7,500.00	45,000,000	
大 庄	8,100	1,219.00	9,873,900	貸付株式数 3,000株 (300株)
ファーストリテイリング	80,700	49,180.00	3,968,826,000	
ソフトバンクグループ	559,200	15,865.00	8,871,708,000	
スズケン	36,600	6,074.00	222,308,400	
サンドラッグ	40,400	4,663.00	188,385,200	

サックスバーホールディング	11,400	814.00	9,279,600	貸付株式数　4,400株
ジェコス	7,100	1,435.00	10,188,500	
ベルーナ	28,800	1,039.00	29,923,200	貸付株式数　11,500株
合計			501,745,134,810	

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

リクルートホールディングス　35,000株
日 立　80,000株
トヨタ自動車　60,000株
三菱商事　60,000株

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年9月9日現在 金　額（円）	2025年9月8日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	2,406,309,279	1,766,114,327
コール・ローン	17,582,607,405	9,900,584,511
株式	523,045,340,869	757,500,641,996
投資証券	11,493,815,458	13,309,446,858
派生商品評価勘定	84,815,852	617,190,846
未収入金	5,497,286	5,217,441

未収配当金	717,628,521	996,828,909
差入委託証拠金	10,197,038,669	11,670,067,668
流動資産合計	565,533,053,339	795,766,092,556
資産合計	565,533,053,339	795,766,092,556
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	949,726,919	16,395,215
未払解約金	222,732,100	233,739,600
流動負債合計	1,172,459,019	250,134,815
負債合計	1,172,459,019	250,134,815
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	93,061,760,460	104,047,824,431
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	471,298,833,860	691,468,133,310
元本等合計	564,360,594,320	795,515,957,741
純資産合計	564,360,594,320	795,515,957,741
負債純資産合計	565,533,053,339	795,766,092,556

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2024年9月10日 至2025年9月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)投資証券

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

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

（貸借対照表に関する注記）

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

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	5,609,050,842円	7,198,599,110円
ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	566,472,797円	623,922,392円
Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	16,325,240円	16,032,487円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	49,059,003円	46,323,427円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	9,171,696,796円	11,398,215,544円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,497,529,348円	1,654,770,220円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	353,932,925円	376,810,408円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	19,363,392円	28,366,515円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	50,556,549,718円	51,206,730,357円
ダイワ・ライフ・バランス３０	460,963,110円	416,840,512円
ダイワ・ライフ・バランス５０	1,034,239,767円	1,041,465,511円
ダイワ・ライフ・バランス７０	1,027,431,638円	1,026,598,684円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,242,109,512円	1,001,937,576円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	10,009,386円	8,336,933円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	11,822,069円	12,817,010円
ダイワつみたてインデックス外国株式	2,670,717,096円	3,302,481,265円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	1,865,562円	1,847,918円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	2,794,350円	2,909,261円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	5,889,309円	49,014,860円
ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	14,825,536円	26,974,602円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	42,895,445円	35,348,939円

ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	30,065,390円	26,443,512円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	701,581,123円	533,143,468円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	39,452,864円	31,278,177円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	123,320,896円	101,775,161円
スタイル9（4資産分散・保守型）	221,681円	583,729円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	1,758,388円	4,162,742円
スタイル9（4資産分散・積極型）	2,513,560円	6,468,033円
スタイル9（6資産分散・保守型）	109,963円	234,282円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	3,149,074円	7,549,429円
スタイル9（6資産分散・積極型）	3,708,744円	8,901,409円
スタイル9（8資産分散・保守型）	155,698円	327,040円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	2,264,732円	6,033,151円
スタイル9（8資産分散・積極型）	7,098,499円	16,898,996円
全世界株式インデックス・ファンド（オール・カントリー）	-円	735,360,420円
ダイワ・インデックスセレクト外国株式	1,260,299,293円	1,067,249,741円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	429,563,603円	397,969,549円
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	4,486,545,620円	6,583,036,742円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,226,456,468円	3,382,181,383円
ダイワライフスタイル２５	7,236,293円	6,079,272円
ダイワライフスタイル５０	33,086,936円	30,353,563円
ダイワライフスタイル７５	28,903,662円	27,233,403円
ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	78,106,048円	-円

ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	75,686,081円	62,203,629円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	74,388,492円	61,446,762円
計	93,061,760,460円	104,047,824,431円
2. 期末日における受益権の総数	93,061,760,460口	104,047,824,431口

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年9月10日 至2025年9月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年9月8日現在

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年9月9日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2025年9月8日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	63,172,648,855	55,681,365,221
投資証券	1,573,922,346	△689,918,293
合計	64,746,571,201	54,991,446,928

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．株式関連

種類	2024年9月9日現在				2025年9月8日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買建	30,336,842,208	-	29,698,800,021	△638,042,187	23,843,762,547	-	24,398,105,268	554,342,721
合計	30,336,842,208	-	29,698,800,021	△638,042,187	23,843,762,547	-	24,398,105,268	554,342,721

（注）　1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2．通貨関連

種類	2024年9月9日現在				2025年9月8日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	17,336,313,480	-	17,109,444,600	△226,868,880	9,651,828,570	-	9,698,281,480	46,452,910
アメリカ・ドル	10,837,406,950	-	10,733,910,500	△103,496,450	5,057,889,070	-	5,076,273,090	18,384,020
イギリス・ポンド	1,158,743,640	-	1,139,211,600	△19,532,040	614,974,180	-	619,134,170	4,159,990
オーストラリア・ドル	754,949,600	-	730,976,400	△23,973,200	529,028,190	-	533,822,850	4,794,660
カナダ・ドル	1,796,310,930	-	1,752,035,410	△44,275,520	1,391,779,060	-	1,392,131,000	351,940
スイス・フラン	1,336,818,600	-	1,317,464,460	△19,354,140	938,822,340	-	948,338,370	9,516,030
ユーロ	1,452,083,760	-	1,435,846,230	△16,237,530	1,119,335,730	-	1,128,582,000	9,246,270
合計	17,336,313,480	-	17,109,444,600	△226,868,880	9,651,828,570	-	9,698,281,480	46,452,910

（注）　1．時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

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

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	8,300	251.020	2,083,466.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	47,100	194.460	9,159,066.000	
	FIRST SOLAR INC	7,200	205.140	1,477,008.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	12,200	167.900	2,048,380.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,800	102.450	901,560.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	26,900	75.610	2,033,909.000	
	ABBOTT LABORATORIES	122,766	132.940	16,320,512.040	
	HOWMET AEROSPACE INC	27,083	178.200	4,826,190.600	
	VERISK ANALYTICS INC	9,900	270.310	2,676,069.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	25,000	53.700	1,342,500.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	85,400	110.450	9,432,430.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,400	865.860	2,943,924.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	37,100	68.740	2,550,254.000	
	AFLAC INC	36,300	106.930	3,881,559.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	8,300	210.140	1,744,162.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	11,500	163.420	1,879,330.000	
	ADOBE INC	29,920	348.970	10,441,182.400	

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	11,600	84.480	979,968.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,700	167.800	1,292,060.000	
GARMIN LTD	11,600	237.390	2,753,724.000	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	15,700	289.860	4,550,802.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	45,400	214.250	9,726,950.000	
WR BERKLEY CORP	21,413	71.960	1,540,879.480	
AUTOZONE INC	1,220	4,219.410	5,147,680.200	
DOLLAR TREE INC	13,971	101.120	1,412,747.520	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	83,800	18.950	1,588,010.000	
DR HORTON INC	19,516	181.800	3,548,008.800	
AUTODESK INC	15,100	326.370	4,928,187.000	
MOODY'S CORP	11,500	499.030	5,738,845.000	
DEVON ENERGY CORP	42,700	34.760	1,484,252.000	
ATMOS ENERGY CORP	11,300	166.480	1,881,224.000	
ALLIANT ENERGY CORP	18,200	64.620	1,176,084.000	
CITIGROUP INC	129,773	95.400	12,380,344.200	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	28,700	295.970	8,494,339.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	37,700	108.110	4,075,747.000	
DOMINO'S PIZZA INC	2,330	463.830	1,080,723.900	
DAVITA INC	2,950	137.870	406,716.500	
DANAHER CORP	45,450	200.210	9,099,544.500	
FORTIVE CORP	24,000	47.870	1,148,880.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	40,500	174.270	7,057,935.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	33,900	62.940	2,133,666.000	
APPLE INC	1,054,800	239.690	252,825,012.000	
BOEING CO/THE	53,200	229.610	12,215,252.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,115	153.360	1,704,596.400	
BECTON DICKINSON AND CO	20,299	192.390	3,905,324.610	
LEIDOS HOLDINGS INC	8,700	179.000	1,557,300.000	
NISOURCE INC	33,300	40.330	1,342,989.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,400	126.130	1,059,492.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	50,471	103.690	5,233,337.990	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	297,504	44.380	13,203,227.520	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	95,650	499.770	47,803,000.500	
TRUIST FINANCIAL CORP	92,417	46.520	4,299,238.840	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	51,500	169.990	8,754,485.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	143,600	47.140	6,769,304.000	
JPMORGAN CHASE & CO	196,070	294.380	57,719,086.600	
T ROWE PRICE GROUP INC	15,600	108.160	1,687,296.000	

BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	12,912	28.910	373,285.920	
CADENCE DESIGN SYS INC	19,300	351.010	6,774,493.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,800	489.280	3,327,104.000	
DOLLAR GENERAL CORP	15,600	109.280	1,704,768.000	
SERVICENOW INC	14,700	913.800	13,432,860.000	
CATERPILLAR INC	33,200	423.080	14,046,256.000	
BROWN & BROWN INC	21,000	94.790	1,990,590.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	19,900	39.350	783,065.000	
CMS ENERGY CORP	21,200	71.550	1,516,860.000	
DELTA AIR LINES INC	11,600	61.180	709,688.000	
CORNING INC	57,400	71.190	4,086,306.000	
CISCO SYSTEMS INC	280,650	66.900	18,775,485.000	
MORGAN STANLEY	84,552	148.090	12,521,305.680	
DECKERS OUTDOOR CORP	10,600	120.400	1,276,240.000	
MSCI INC	5,500	555.150	3,053,325.000	
FAIR ISAAC CORP	1,800	1,531.990	2,757,582.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,300	578.050	1,329,515.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	15,700	88.800	1,394,160.000	
BROADCOM INC	315,220	334.890	105,564,025.800	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,100	400.520	1,241,612.000	
CNH INDUSTRIAL NV	61,700	11.460	707,082.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,000	221.240	884,960.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,200	452.000	4,158,400.000	
DTE ENERGY COMPANY	14,700	136.600	2,008,020.000	
CENTENE CORP	35,107	28.980	1,017,400.860	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,400	232.580	1,721,092.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	30,600	51.710	1,582,326.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	18,100	299.180	5,415,158.000	
GARTNER INC	5,450	245.910	1,340,209.500	
DOMINION ENERGY INC	60,241	58.190	3,505,423.790	
MONSTER BEVERAGE CORP	51,600	62.460	3,222,936.000	
DEERE & CO	18,200	473.260	8,613,332.000	
QUANTA SERVICES INC	10,500	372.500	3,911,250.000	
POOL CORP	2,600	333.090	866,034.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	17,284	87.780	1,517,189.520	
BURLINGTON STORES INC	4,500	291.200	1,310,400.000	
NASDAQ INC	30,400	93.480	2,841,792.000	
TARGA RESOURCES CORP	15,300	162.350	2,483,955.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,800	138.650	665,520.000	

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

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

GOLDMAN SACHS GROUP INC	21,650	738.210	15,982,246.500	
ALPHABET INC-CL A	410,600	235.000	96,491,000.000	
ALPHABET INC-CL C	346,540	235.170	81,495,811.800	
OWENS CORNING	6,000	155.590	933,540.000	
GENERAL MILLS INC	38,300	50.580	1,937,214.000	
FIRSTENERGY CORP	38,718	43.480	1,683,458.640	
GENUINE PARTS CO	9,850	139.500	1,374,075.000	
FIFTH THIRD BANCORP	47,100	45.620	2,148,702.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	13,250	272.390	3,609,167.500	
HALLIBURTON CO	60,700	22.100	1,341,470.000	
HOME DEPOT INC	70,250	418.950	29,431,237.500	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	102,800	17.630	1,812,364.000	
HERSHEY CO/THE	10,500	185.480	1,947,540.000	
HUMANA INC	8,600	307.920	2,648,112.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	17,900	226.740	4,058,646.000	
HP INC	66,300	29.340	1,945,242.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	92,600	23.520	2,177,952.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	26,500	91.290	2,419,185.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	62,603	27.290	1,708,435.870	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	65,600	248.530	16,303,568.000	
HUBBELL INC	3,800	436.040	1,656,952.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	35,400	48.690	1,723,626.000	
ZOETIS INC	31,500	153.320	4,829,580.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	15,799	413.830	6,538,100.170	
CHENIERE ENERGY INC	15,700	235.780	3,701,746.000	
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,000	144.950	434,850.000	
ALLEGION PLC	6,150	171.860	1,056,939.000	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	7,900	149.210	1,178,759.000	
WASTE CONNECTIONS INC	18,237	179.300	3,269,894.100	
JM SMUCKER CO/THE	7,600	112.510	855,076.000	
JOHNSON & JOHNSON	169,800	178.430	30,297,414.000	
ABBVIE INC	124,672	212.560	26,500,280.320	
HOLOGIC INC	15,800	66.760	1,054,808.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	23,500	129.890	3,052,415.000	
KROGER CO	44,400	67.750	3,008,100.000	
KLA CORP	9,400	905.090	8,507,846.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	14,900	463.900	6,912,110.000	
CORPAY INC	4,800	316.650	1,519,920.000	
LOWE'S COS INC	39,600	269.970	10,690,812.000	

ELI LILLY & CO	56,885	727.210	41,367,340.850	
LAM RESEARCH CORP	90,300	102.950	9,296,385.000	
LOEWS CORP	12,600	96.640	1,217,664.000	
MCDONALD'S CORP	50,450	314.380	15,860,471.000	
3M CO	37,990	155.300	5,899,847.000	
META PLATFORMS INC CLASS A	153,200	752.450	115,275,340.000	
S&P GLOBAL INC	22,239	538.060	11,965,916.340	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,300	622.640	2,677,352.000	
PHILLIPS 66	28,800	131.550	3,788,640.000	
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	11,800	172.430	2,034,674.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	17,900	70.910	1,269,289.000	
METLIFE INC	40,300	79.510	3,204,253.000	
MARVELL TECHNOLOGY INC	60,900	63.330	3,856,797.000	
ARISTA NETWORKS INC	75,300	142.850	10,756,605.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11,798	478.980	5,651,006.040	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,500	1,305.710	1,958,565.000	
BAKER HUGHES CO	69,923	45.580	3,187,090.340	
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,000	339.760	2,718,080.000	
MERCK & CO. INC.	177,121	84.710	15,003,919.910	
DUPONT DE NEMOURS INC	29,551	77.820	2,299,658.820	
MASCO CORP	14,900	76.070	1,133,443.000	
M & T BANK CORP	11,399	199.570	2,274,898.430	
MARSH & MCLENNAN COS	34,770	203.740	7,084,039.800	
HEICO CORP-CLASS A	5,420	252.340	1,367,682.800	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	16,502	264.700	4,368,079.400	
WORKDAY INC-CLASS A	15,300	231.080	3,535,524.000	
BLOCK INC CLASS A	39,212	74.940	2,938,547.280	
TRANSUNION	13,800	90.020	1,242,276.000	
VISTRA CORP	24,000	188.000	4,512,000.000	
NETAPP INC	14,300	118.750	1,698,125.000	
NIKE INC -CL B	83,200	73.910	6,149,312.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	15,900	277.750	4,416,225.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	38,100	65.920	2,511,552.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	13,605	165.500	2,251,627.500	
NORTHROP GRUMMAN CORP	9,700	580.800	5,633,760.000	
NEWMONT CORP	77,611	76.170	5,911,629.870	
MCKESSON CORP	8,900	687.400	6,117,860.000	
XYLEM INC	17,200	140.560	2,417,632.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	109,800	161.550	17,738,190.000	

NUCOR CORP	16,300	147.260	2,400,338.000	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	11,200	707.190	7,920,528.000	
GODADDY INC - CLASS A	10,100	145.240	1,466,924.000	
EVERGY INC	16,250	71.600	1,163,500.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	52,224	45.910	2,397,603.840	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,850	335.070	619,879.500	
OKTA INC	11,800	91.480	1,079,464.000	
WIX.COM LTD	4,110	153.100	629,241.000	
EQUITABLE HOLDINGS INC	21,300	53.370	1,136,781.000	
KKR & CO INC	44,000	135.530	5,963,320.000	
PAYCHEX INC	22,900	135.440	3,101,576.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	60,300	104.840	6,321,852.000	
ALTRIA GROUP INC	118,900	66.550	7,912,795.000	
P G & E CORP	155,100	15.090	2,340,459.000	
PFIZER INC	401,113	24.880	9,979,691.440	
CIGNA CORP	18,900	305.310	5,770,359.000	
DELL TECHNOLOGIES -C	22,901	124.830	2,858,731.830	
XCEL ENERGY INC	40,700	72.680	2,958,076.000	
STERIS PLC	7,000	245.300	1,717,100.000	
SEA LTD-ADR	28,000	191.620	5,365,360.000	
FOX CORP - CLASS B	9,833	55.970	550,353.010	
FOX CORP - CLASS A	15,099	61.500	928,588.500	
STRYKER CORP	24,280	392.310	9,525,286.800	
DOW INC	49,918	24.500	1,222,991.000	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	8,300	119.090	988,447.000	
ZOOM COMMUNICATIONS INC CLASS A	17,400	83.680	1,456,032.000	
PARKER HANNIFIN CORP	9,100	758.560	6,902,896.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	140,400	90.990	12,774,996.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	165,467	160.020	26,478,029.340	
EXELON CORP	71,222	43.430	3,093,171.460	
INGERSOLL-RAND INC	28,508	80.950	2,307,722.600	
NVR INC	200	8,502.000	1,700,400.000	
CONOCOPHILLIPS	89,103	92.950	8,282,123.850	
TWILIO INC - A	10,800	108.670	1,173,636.000	
DOCUSIGN INC	14,300	79.860	1,141,998.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,700	224.120	829,244.000	
PURE STORAGE INC - CLASS A	22,000	79.230	1,743,060.000	
PEPSICO INC	96,800	146.390	14,170,552.000	

CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,520	462.770	1,628,950.400	
MONGODB INC	5,800	324.740	1,883,492.000	
SNAP INC - A	74,900	7.310	547,519.000	
CORTEVA INC	48,168	72.300	3,482,546.400	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	25,000	105.710	2,642,750.000	
AMCOR PLC	161,800	8.300	1,342,940.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	17,600	417.630	7,350,288.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,800	143.600	1,981,680.000	
ACCENTURE PLC-CL A	44,000	254.950	11,217,800.000	
PENTAIR PLC	11,675	110.640	1,291,722.000	
QUALCOMM INC	76,300	159.840	12,195,792.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	15,900	79.980	1,271,682.000	
DATADOG INC - CLASS A	20,300	136.080	2,762,424.000	
PINTEREST INC- CLASS A	42,000	37.940	1,593,480.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,500	573.380	4,300,350.000	
REPUBLIC SERVICES INC	15,500	229.730	3,560,815.000	
BOOKING HOLDINGS INC	2,300	5,505.800	12,663,340.000	
ROSS STORES INC	23,100	150.950	3,486,945.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,430	220.250	1,416,207.500	
RESMED INC	10,400	277.050	2,881,320.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	7,930	183.490	1,455,075.700	
HUBSPOT INC	3,580	487.530	1,745,357.400	
REVVITY INC	8,400	86.640	727,776.000	
CARRIER GLOBAL CORP	54,487	65.510	3,569,443.370	
OTIS WORLDWIDE CORP	27,838	87.000	2,421,906.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	16,600	63.750	1,058,250.000	
DYNATRACE INC	21,300	50.000	1,065,000.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	31,400	52.070	1,634,998.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	63,485	27.030	1,715,999.550	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	26,800	36.070	966,676.000	
CHEVRON CORP	138,318	153.660	21,253,943.880	
ZSCALER INC	7,200	274.200	1,974,240.000	
EDISON INTERNATIONAL	27,200	54.450	1,481,040.000	
TESLA INC	204,550	350.840	71,764,322.000	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	22,400	225.580	5,052,992.000	
GEN DIGITAL INC	37,200	29.500	1,097,400.000	
SYNOPSYS INC	13,139	598.140	7,858,961.460	
CARVANA CO	8,600	368.880	3,172,368.000	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	22,000	214.430	4,717,460.000	

CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	6,305	261.500	1,648,757.500	
DOORDASH INC - A	25,350	246.850	6,257,647.500	
ROBLOX CORP -CLASS A	40,100	127.690	5,120,369.000	
AIRBNB INC-CLASS A	30,500	123.810	3,776,205.000	
CBRE GROUP INC - A	21,100	164.380	3,468,418.000	
SOUTHERN CO/THE	77,600	91.780	7,122,128.000	
SYSCO CORP	34,200	82.450	2,819,790.000	
TRAVELERS COS INC/THE	16,003	275.220	4,404,345.660	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,500	187.280	842,760.000	
STEEL DYNAMICS INC	9,950	134.630	1,339,568.500	
SCHLUMBERGER LTD	105,852	35.820	3,791,618.640	
AFFIRM HOLDINGS INC	19,600	87.350	1,712,060.000	
AT&T INC	507,691	29.590	15,022,576.690	
ON SEMICONDUCTOR CORP	29,300	49.105	1,438,776.500	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	16,800	372.430	6,256,824.000	
SEMPRA ENERGY	46,100	81.110	3,739,171.000	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	11,400	53.800	613,320.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	160,100	153.110	24,512,911.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	15,050	188.160	2,831,808.000	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	14,200	299.070	4,246,794.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	64,100	187.930	12,046,313.000	
SALESFORCE INC	67,466	250.760	16,917,774.160	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	28,309	131.550	3,724,048.950	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	46,434	106.230	4,932,683.820	
TERADYNE INC	11,400	120.200	1,370,280.000	
UNION PACIFIC CORP	42,180	220.310	9,292,675.800	
MARATHON PETROLEUM CORP	21,688	180.280	3,909,912.640	
RTX CORP	94,279	157.520	14,850,828.080	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	51,800	85.040	4,405,072.000	
IQVIA HOLDINGS INC	12,204	187.680	2,290,446.720	
AMEREN CORPORATION	19,500	100.630	1,962,285.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	64,066	315.390	20,205,775.740	
APPLOVIN CORP CLASS A	16,300	490.240	7,990,912.000	
TOAST INC CLASS A	31,700	41.220	1,306,674.000	
VERISIGN INC	6,000	280.090	1,680,540.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	54,400	14.210	773,024.000	

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

NETFLIX INC	30,090	1,243.820	37,426,543.800	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	26,700	492.600	13,152,420.000	
NRG ENERGY INC	13,850	147.660	2,045,091.000	
TEXTRON INC	12,800	81.450	1,042,560.000	
NEWS CORP - CLASS A	26,187	29.440	770,945.280	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,450	889.190	1,289,325.500	
OMNICOM GROUP	13,700	79.430	1,088,191.000	
JACOBS SOLUTIONS INC	8,520	145.420	1,238,978.400	
ORACLE CORP	119,533	232.800	27,827,282.400	
MASTERCARD INC - A	60,500	584.220	35,345,310.000	
ONEOK INC	44,100	72.630	3,202,983.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,600	518.440	3,940,144.000	
U HAUL NON VOTING SERIES N	6,900	53.570	369,633.000	
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	15,300	177.310	2,712,843.000	
EXPAND ENERGY CORP	16,000	95.510	1,528,160.000	
YUM! BRANDS INC	19,700	144.580	2,848,226.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	13,000	239.680	3,115,840.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	12,600	50.390	634,914.000	
BANK OF AMERICA CORP	504,601	49.770	25,113,991.770	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,400	549.030	1,866,702.000	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,600	57.770	785,672.000	
AMERICAN EXPRESS CO	39,600	326.220	12,918,312.000	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	32,335	75.730	2,448,729.550	
LINDE PLC	33,246	469.520	15,609,661.920	
ANALOG DEVICES INC	35,091	247.070	8,669,933.370	
ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	26,100	19.060	497,466.000	
MONDAYCOM LTD	3,000	185.730	557,190.000	
ADVANCED MICRO DEVICES	114,427	151.140	17,294,496.780	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	19,100	33.680	643,288.000	
NATERA INC	9,200	168.020	1,545,784.000	
LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER	15,000	100.750	1,511,250.000	
KENVUE INC	135,500	18.620	2,523,010.000	
VERALTO CORP	17,516	105.710	1,851,616.360	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	40,672	79.210	3,221,629.120	
BUNGE GLOBAL LTD	9,900	84.330	834,867.000	
VERTIV HOLDINGS CLASS A	25,600	124.000	3,174,400.000	
NUTANIX INC CLASS A	18,000	69.920	1,258,560.000	

ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	18,300	352.270	6,446,541.000	
AVERY DENNISON CORP	5,530	168.060	929,371.800	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	34,800	71.820	2,499,336.000	
EMERSON ELECTRIC CO	39,700	132.550	5,262,235.000	
AON PLC-CLASS A	14,500	370.540	5,372,830.000	
AMGEN INC	38,000	283.640	10,778,320.000	
SAMSARA INC CLASS A	20,100	42.090	846,009.000	
TAPESTRY INC	15,200	104.180	1,583,536.000	
EATON CORP PLC	27,636	349.030	9,645,793.080	
COOPER INC	14,100	68.090	960,069.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	10,600	148.430	1,573,358.000	
APPLIED MATERIALS INC	56,600	162.750	9,211,650.000	
CME GROUP INC	25,500	261.940	6,679,470.000	
ECOLAB INC	18,000	273.560	4,924,080.000	
EQUIFAX INC	8,800	249.670	2,197,096.000	
GILEAD SCIENCES INC	87,800	115.050	10,101,390.000	
KEURIG DR PEPPER INC	91,100	28.650	2,610,015.000	
HORMEL FOODS CORP	21,000	25.660	538,860.000	
STATE STREET CORP	20,013	112.950	2,260,468.350	
SOLVENTUM CORP	11,072	72.720	805,155.840	
GE VERNOVA	19,326	582.080	11,249,278.080	
SCHWAB (CHARLES) CORP	121,840	92.050	11,215,372.000	
CRH PUBLIC LIMITED PLC	47,700	112.360	5,359,572.000	
LABCORP HOLDINGS	6,000	278.670	1,672,020.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	36,200	24.420	884,004.000	
SMURFIT WESTROCK PLC	36,900	46.910	1,730,979.000	
FERGUSON ENTERPRISES LTD	14,000	238.340	3,336,760.000	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	12,500	295.280	3,691,000.000	
CROWN HOLDINGS INC	8,180	94.230	770,801.400	
REDDIT INC CLASS A	7,500	240.000	1,800,000.000	
TE CONNECTIVITY LTD	20,995	208.740	4,382,496.300	
BLACKROCK INC	10,400	1,099.150	11,431,160.000	
CARDINAL HEALTH INC	16,900	149.560	2,527,564.000	
APTIV HOLDINGS LTD	15,400	80.440	1,238,776.000	
FEDEX CORP	16,100	227.720	3,666,292.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	45,174	221.530	10,007,396.220	
ROCKET LAB INC	31,500	45.840	1,443,960.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	18,113	66.030	1,196,001.390	
INTEL CORP	307,700	24.490	7,535,573.000	

HARTFORD INSURANCE GROUP INC	20,050	131.670	2,639,983.500	
ILLINOIS TOOL WORKS	19,700	266.240	5,244,928.000	
ILLUMINA INC	11,200	98.930	1,108,016.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	25,300	466.860	11,811,558.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,350	193.090	1,226,121.500	
SNAP-ON INC	3,700	328.700	1,216,190.000	
DUKE ENERGY CORP	54,828	120.610	6,612,805.080	
TARGET CORP	32,100	93.170	2,990,757.000	
DOVER CORP	9,700	177.750	1,724,175.000	
WW GRAINGER INC	3,300	993.470	3,278,451.000	
JABIL INC	7,600	210.100	1,596,760.000	
CINTAS CORP	25,700	204.500	5,255,650.000	
CLOROX COMPANY	8,600	127.030	1,092,458.000	
ENTERGY CORP	31,600	87.750	2,772,900.000	
MICROSOFT CORP	498,700	495.000	246,856,500.000	
INCYTE CORP	11,700	86.640	1,013,688.000	
CVS HEALTH CORP	89,269	73.780	6,586,266.820	
MEDTRONIC PLC	90,398	92.900	8,397,974.200	
MICRON TECHNOLOGY INC	79,000	131.370	10,378,230.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	46,100	37.780	1,741,658.000	
KELLOGG CO	19,600	79.870	1,565,452.000	
KEYCORP	65,800	18.940	1,246,252.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	91,411	61.740	5,643,715.140	
CHUBB LTD	26,899	277.380	7,461,244.620	
ALLSTATE CORP	18,700	201.530	3,768,611.000	
EBAY INC	32,600	92.660	3,020,716.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	65,050	68.260	4,440,313.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	16,600	89.200	1,480,720.000	
TRIMBLE INC	16,900	80.740	1,364,506.000	
LENNAR CORP-A	16,100	141.880	2,284,268.000	
PROGRESSIVE CORP	41,400	243.860	10,095,804.000	
PACCAR INC	37,055	99.050	3,670,297.750	
BIOGEN INC	10,400	140.670	1,462,968.000	
IDEXX LABORATORIES INC	5,700	642.990	3,665,043.000	
STARBUCKS CORP	80,200	85.430	6,851,486.000	
PTC INC	8,500	213.900	1,818,150.000	
EVERSOURCE ENERGY	26,000	63.530	1,651,780.000	
INTUIT INC	19,680	672.820	13,241,097.600	
BEST BUY CO INC	14,250	76.170	1,085,422.500	

	BALL CORP	18,604	50.940	947,687.760	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	104,397	107.220	11,193,446.340	
	ELECTRONIC ARTS INC	16,900	168.620	2,849,678.000	
	VULCAN MATERIALS CO	9,400	294.810	2,771,214.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	18,200	396.120	7,209,384.000	
	CARNIVAL CORP	74,100	31.570	2,339,337.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	262,690	33.910	8,907,817.900	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,900	59.990	713,881.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	79,800	6.380	509,124.000	
アメリカ・ドル 小計				3,943,347,635.220 (585,468,823,402)	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	404,906	26.275	10,638,905.150	
	HALEON PLC	617,607	3.657	2,258,588.790	
	WISE PLC CLASS A	45,084	11.420	514,859.280	
	BP PLC	1,089,909	4.156	4,530,206.750	
	UNILEVER PLC	168,370	47.690	8,029,565.300	
	BARCLAYS PLC	971,758	3.610	3,508,532.250	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	580,819	10.755	6,246,708.340	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	141,556	3.422	484,404.630	
	PRUDENTIAL PLC	176,551	9.756	1,722,431.550	
	NATWEST GROUP PLC	556,996	5.060	2,818,399.760	
	BAE SYSTEMS PLC	207,134	17.770	3,680,771.180	
	AVIVA PLC	210,133	6.564	1,379,313.010	
	GSK	280,676	14.760	4,142,777.760	
	INFORMA PLC	89,236	8.902	794,378.870	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	86,323	6.160	531,749.680	
	AUTO TRADER GROUP PLC	59,528	8.038	478,486.060	
	DCC PLC	6,761	47.560	321,553.160	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,007	71.950	360,253.650	
	HALMA PLC	26,104	32.420	846,291.680	
	ENTAIN PLC	41,144	8.644	355,648.730	
	JD SPORTS FASHION PLC	172,738	0.944	163,168.310	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	47,535	6.700	318,484.500	
	M&G PLC	154,620	2.606	402,939.720	
	RELX PLC	126,136	34.820	4,392,055.520	
	DIAGEO PLC	153,010	20.340	3,112,223.400	
	RIO TINTO PLC	77,606	46.810	3,632,736.860	
	STANDARD CHARTERED PLC	135,683	13.660	1,853,429.780	

TESCO PLC	450,719	4.410	1,987,670.790	
FRESNILLO PLC	16,136	21.180	341,760.480	
SMITH & NEPHEW PLC	57,221	14.160	810,249.360	
GLENCORE PLC	693,869	2.869	1,990,710.160	
SMITHS GROUP PLC	22,378	23.560	527,225.680	
PEARSON PLC	40,375	10.455	422,120.620	
SAINSBURY (J) PLC	116,988	3.126	365,704.480	
NEXT PLC	8,027	122.000	979,294.000	
WHITBREAD PLC	11,775	31.030	365,378.250	
BUNZL PLC	22,170	25.880	573,759.600	
VODAFONE GROUP PLC	1,336,897	0.878	1,174,597.700	
KINGFISHER PLC	118,387	2.532	299,755.880	
WPP PLC	73,027	3.988	291,231.670	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	46,155	11.240	518,782.200	
SEVERN TRENT PLC	18,341	25.540	468,429.140	
RENTOKIL INITIAL PLC	173,687	3.771	654,973.670	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	46,689	57.100	2,665,941.900	
SCHRODERS PLC	50,139	3.678	184,411.240	
SSE PLC	76,086	16.515	1,256,560.290	
BARRATT REDROW PLC	92,981	3.679	342,077.090	
ASTRAZENECA PLC	106,621	120.900	12,890,478.900	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	397,269	2.349	933,184.880	
3I GROUP PLC	66,931	39.220	2,625,033.820	
ASHTEAD GROUP PLC	29,268	55.380	1,620,861.840	
SAGE GROUP PLC/THE	66,433	10.850	720,798.050	
NATIONAL GRID PLC	337,065	10.340	3,485,252.100	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,117,646	0.793	3,267,763.860	
IMPERIAL BRANDS PLC	52,954	31.440	1,664,873.760	
CENTRICA PLC	333,159	1.545	514,730.650	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	143,772	41.330	5,942,096.760	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	22,010	22.220	489,062.200	
HSBC HOLDINGS PLC	1,198,375	9.630	11,540,351.250	
ANGLO AMERICAN PLC	76,952	22.770	1,752,197.040	
MONDI PLC	29,910	10.120	302,689.200	
COMPASS GROUP PLC	116,715	25.570	2,984,402.550	
BT GROUP PLC	411,207	2.047	841,740.720	
COCA-COLA HBC AG-DI	14,786	37.800	558,910.800	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	10,046	90.880	912,980.480	
INTERTEK GROUP PLC	10,850	46.960	509,516.000	

	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	32,667	92.700	3,028,230.900	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	11,467	17.200	197,232.400	
	ADMIRAL GROUP PLC	17,902	33.420	598,284.840	
	ANTOFAGASTA PLC	26,663	21.330	568,721.790	
	EXPERIAN PLC	63,182	39.210	2,477,366.220	
イギリス・ポンド 小計				144,166,258.880 (28,879,384,979)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	89,469	32.700	2,925,636.300	
	AZRIELI GROUP LTD	3,098	329.600	1,021,100.800	
	PHOENIX FINANCIAL LTD	16,493	118.300	1,951,121.900	
	NOVA MEASURING INSTRUMENTS	2,139	863.900	1,847,882.100	
	ICL GROUP LTD	56,522	20.300	1,147,396.600	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,030	1,622.700	3,294,081.000	
	BANK HAPOALIM BM	91,238	65.300	5,957,841.400	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	109,024	63.400	6,912,121.600	
	NICE LTD	4,617	468.800	2,164,449.600	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	11,384	219.800	2,502,203.200	
イスラエル・シュケル 小計				29,723,834.500 (1,321,316,587)	
オーストラリア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	144,638	5.920	856,256.960	
	TELSTRA GROUP LTD	261,489	4.830	1,262,991.870	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	198,174	33.290	6,597,212.460	
	SGH LTD	13,549	49.410	669,456.090	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	178,895	5.080	908,786.600	
	BHP GROUP LTD	337,031	41.610	14,023,859.910	
	SOUTH32 LTD	293,178	2.640	773,989.920	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	126,073	25.680	3,237,554.640	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	112,438	18.870	2,121,705.060	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	203,378	43.170	8,779,828.260	
	WESTPAC BANKING CORP	227,202	38.170	8,672,300.340	
	SANTOS LTD	215,611	7.800	1,681,765.800	
	RIO TINTO LTD	24,644	117.230	2,889,016.120	
	ORIGIN ENERGY LTD	114,371	12.420	1,420,487.820	
	XERO LTD	10,924	158.890	1,735,714.360	
	PRO MEDICUS LTD	3,817	298.230	1,138,343.910	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	15,927	43.960	700,150.920	
	COLES GROUP LTD	89,062	23.960	2,133,925.520	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,328	93.560	1,246,967.680	

	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	90,129	19.940	1,797,172.260	
	EVOLUTION MINING LTD	131,920	9.060	1,195,195.200	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	111,108	168.140	18,681,699.120	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	100,261	21.620	2,167,642.820	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	81,112	27.590	2,237,880.080	
	QANTAS AIRWAYS LTD	49,383	11.850	585,188.550	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	38,510	29.930	1,152,604.300	
	MACQUARIE GROUP LTD	24,037	221.790	5,331,166.230	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	37,261	69.690	2,596,719.090	
	CSL LTD	32,150	209.250	6,727,387.500	
	WESFARMERS LTD	75,351	92.560	6,974,488.560	
	COCHLEAR LTD	4,346	298.530	1,297,411.380	
	BLUESCOPE STEEL LTD	28,548	22.910	654,034.680	
	SUNCORP GROUP LTD	71,893	21.210	1,524,850.530	
	ASX LTD	12,589	61.470	773,845.830	
	COMPUTERSHARE LTD	34,210	37.460	1,281,506.600	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	157,027	8.690	1,364,564.630	
	SONIC HEALTHCARE LTD	31,257	22.940	717,035.580	
	BRAMBLES LTD	90,721	26.560	2,409,549.760	
	CARSALES.COM LTD	25,090	39.460	990,051.400	
	SIGMA HEALTHCARE LTD	304,204	3.040	924,780.160	
	REA GROUP LTD	3,510	241.620	848,086.200	
オーストラリア・ドル 小計				123,083,174.700 (11,977,223,730)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	49,700	76.240	3,789,128.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	26,881	80.660	2,168,221.460	
	BROOKFIELD RENEWABLE SUBORDINATE V	8,900	45.990	409,311.000	
	CELESTICA INC	7,600	336.260	2,555,576.000	
	BOMBARDIER INC CLASS B	6,500	155.010	1,007,565.000	
	ATKINSREALIS GROUP INC	12,200	94.710	1,155,462.000	
	IMPERIAL OIL LTD	11,700	120.900	1,414,530.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,400	4,599.690	6,439,566.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	20,387	87.360	1,781,008.320	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	29,700	144.440	4,289,868.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	11,750	278.330	3,270,377.500	
	BCE INC	4,830	34.230	165,330.900	

FRANCO-NEVADA CORP	12,600	268.650	3,384,990.000	
SUNCOR ENERGY INC	80,230	55.400	4,444,742.000	
METRO INC/CN	13,500	97.310	1,313,685.000	
NATIONAL BANK OF CANADA	25,700	145.910	3,749,887.000	
BANK OF NOVA SCOTIA	81,500	87.860	7,160,590.000	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	61,000	108.420	6,613,620.000	
TORONTO-DOMINION BANK	112,400	103.160	11,595,184.000	
GREAT-WEST LIFECO INC	18,100	54.180	980,658.000	
ROYAL BANK OF CANADA	92,250	200.220	18,470,295.000	
TOURMALINE OIL CORP	24,200	57.990	1,403,358.000	
TC ENERGY CORP	68,050	71.830	4,888,031.500	
PEMBINA PIPELINE CORP	38,029	52.570	1,999,184.530	
BARRICK MINING CORP	111,500	39.370	4,389,755.000	
CAE INC	19,600	36.860	722,456.000	
THOMSON REUTERS CORP	10,341	241.930	2,501,798.130	
EMPIRE CO LTD 'A'	8,100	52.490	425,169.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	9,550	80.430	768,106.500	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	26,100	36.740	958,914.000	
HYDRO ONE LTD	21,300	49.990	1,064,787.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	39,040	56.620	2,210,444.800	
STANTEC INC	7,400	149.870	1,109,038.000	
WSP GLOBAL INC	8,600	281.470	2,420,642.000	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,400	144.870	782,298.000	
EMERA INC	19,500	64.810	1,263,795.000	
TFI INTERNATIONAL INC	5,200	133.640	694,928.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	8,800	38.070	335,016.000	
WHITECAP RESOURCES INC	79,700	10.080	803,376.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	23,900	49.700	1,187,830.000	
IVANHOE MINES LTD-CL A	48,100	12.560	604,136.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	32,917	210.420	6,926,395.140	
ALAMOS GOLD INC-CLASS A	27,300	44.580	1,217,034.000	
KINROSS GOLD CORP	80,300	30.630	2,459,589.000	
BANK OF MONTREAL	47,000	174.720	8,211,840.000	
POWER CORP OF CANADA	36,500	57.960	2,115,540.000	
LUNDIN GOLD INC	7,100	93.800	665,980.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	79,900	203.340	16,246,866.000	
NUTRIEN LTD	31,919	78.160	2,494,789.040	
CAMECO CORP	28,500	105.130	2,996,205.000	
FIRSTSERVICE CORP	2,700	279.260	754,002.000	

	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	16,500	66.370	1,095,105.000	
	TELUS CORP	10,800	22.970	248,076.000	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	30,400	47.560	1,445,824.000	
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,400	169.970	577,898.000	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	136,900	42.060	5,758,014.000	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,300	2,376.850	3,089,905.000	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	17,300	63.550	1,099,415.000	
	WESTON (GEORGE) LTD	11,511	88.580	1,019,644.380	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	23,400	47.910	1,121,094.000	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	5,600	149.450	836,920.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	37,000	79.980	2,959,260.000	
	ENBRIDGE INC	142,700	66.870	9,542,349.000	
	BROOKFIELD CORP	89,525	92.160	8,250,624.000	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	111,700	42.480	4,745,016.000	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	60,220	106.170	6,393,557.400	
	IA FINANCIAL CORP INC	6,100	149.180	909,998.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,200	76.870	707,204.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	34,950	133.760	4,674,912.000	
	CGI INC - CLASS A	13,000	133.930	1,741,090.000	
	IGM FINANCIAL INC	5,200	49.970	259,844.000	
	TMX GROUP LTD	18,000	54.300	977,400.000	
	OPEN TEXT CORP	16,800	46.020	773,136.000	
	SAPUTO INC	15,900	34.670	551,253.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	45,800	24.580	1,125,764.000	
	FORTIS INC	32,900	68.180	2,243,122.000	
	RB GLOBAL INC	12,200	159.360	1,944,192.000	
	LUNDIN MINING CORP	44,700	16.560	740,232.000	
	CENOVUS ENERGY INC	88,200	22.110	1,950,102.000	
	DOLLARAMA INC	18,200	188.430	3,429,426.000	
	ALTAGAS LTD	19,300	41.460	800,178.000	
	KEYERA CORP	14,800	44.320	655,936.000	
	ARC RESOURCES LTD	37,900	25.600	970,240.000	
カナダ・ドル 小計				233,417,629.600 (25,043,377,479)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	170,900	2.770	473,393.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	92,100	35.840	3,300,864.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	155,340	50.810	7,892,825.400	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	110,575	6.570	726,477.750	

	KEPPEL CORP LTD	106,400	8.630	918,232.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	188,600	3.100	584,660.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	247,200	16.850	4,165,320.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	441,400	0.765	337,671.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	542,450	4.390	2,381,355.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	114,000	7.920	902,880.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	65,300	6.120	399,636.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	62,600	16.250	1,017,250.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	140,300	2.970	416,691.000	
シンガポール・ドル 小計				23,517,255.650	
				(2,716,478,200)	
スイス・フラン	SANDOZ GROUP AG	27,796	48.880	1,358,668.480	
	BELIMO N AG	719	831.500	597,848.500	
	GALDERMA GROUP N AG	8,767	144.700	1,268,584.900	
	AMRIZE AG	33,922	42.340	1,436,257.480	
	AVOLTA AG	5,644	44.680	252,173.920	
	UBS GROUP AG-REG	210,342	32.100	6,751,978.200	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,103	289.200	608,187.600	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	469	610.000	286,090.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	46,716	274.200	12,809,527.200	
	SIKA AG-REG	10,136	185.400	1,879,214.400	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	124,600.000	996,800.000	
	ABB LTD-REG	104,129	55.080	5,735,425.320	
	SWISS RE AG	19,845	140.950	2,797,152.750	
	NESTLE SA-REG	171,040	75.410	12,898,126.400	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,505	1,068.000	1,607,340.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,708	303.200	821,065.600	
	JULIUS BAER GROUP LTD	13,700	57.020	781,174.000	
	SGS SA-REG	11,038	85.380	942,424.440	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,571	291.000	457,161.000	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,428	198.700	482,443.600	
	VAT GROUP AG	1,798	276.300	496,787.400	
	BKW AG	1,374	163.400	224,511.600	
	ALCON INC	33,225	64.080	2,129,058.000	
	SIG GROUP N AG	19,984	12.830	256,394.720	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,920	148.100	284,352.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	9,729	575.400	5,598,066.600	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,724	200.800	546,979.200	
	NOVARTIS AG-REG	126,419	103.980	13,145,047.620	

	BARRY CALLEBAUT AG-REG	240	1,128.000	270,720.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	35,743	144.550	5,166,650.650	
	SWISSCOM AG-REG	1,721	587.500	1,011,087.500	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,896	93.050	176,422.800	
	GEBERIT AG-REG	2,258	598.200	1,350,735.600	
	GIVAUDAN-REG	616	3,504.000	2,158,464.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	7,421	94.940	704,549.740	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,374	239.500	808,073.000	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	10,112	85.260	862,149.120	
	LONZA GROUP AG-REG	4,655	577.400	2,687,797.000	
	HOLCIM LTD	33,922	66.860	2,268,024.920	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,905	834.000	1,588,770.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	3,215	163.800	526,617.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,248	112.500	590,400.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	63	12,650.000	796,950.000	
スイス・フラン 小計				98,416,252.260 (18,296,565,457)	
スウェーデン・クローナ	SAGAX CLASS B	16,042	202.400	3,246,900.800	
	ERICSSON LM-B SHS	203,867	75.380	15,367,494.460	
	VOLVO AB-B SHS	114,147	276.900	31,607,304.300	
	SKF AB-B SHARES	24,823	238.800	5,927,732.400	
	TELE2 AB-B SHS	39,841	166.850	6,647,470.850	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	109,995	175.600	19,315,122.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	106,045	119.250	12,645,866.250	
	SWEDBANK AB - A SHARES	61,784	265.200	16,385,116.800	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	41,131	145.550	5,986,617.050	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	44,003	127.050	5,590,581.150	
	SKANSKA AB-B SHS	24,765	230.700	5,713,285.500	
	SANDVIK AB	77,095	241.800	18,641,571.000	
	INVESTOR AB-B SHS	125,608	290.550	36,495,404.400	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	194,409	155.800	30,288,922.200	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,564	365.600	2,034,198.400	
	SECURITAS AB-B SHS	35,897	146.000	5,240,962.000	
	TELIA CO AB	172,199	35.800	6,164,724.200	
	ALFA LAVAL AB	21,118	433.700	9,158,876.600	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	113,926	139.750	15,921,158.500	
	ASSA ABLOY AB-B	73,157	342.100	25,027,009.700	
	TRELLEBORG AB-B SHS	14,805	369.800	5,474,889.000	

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

ニュージーランド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	95,450	5.750	548,837.500	
	INFRATIL LTD	67,924	12.080	820,521.920	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	123,213	7.630	940,115.190	
	CONTACT ENERGY LTD	61,127	9.190	561,757.130	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	42,791	37.890	1,621,350.990	
ニュージーランド・ドル 小計				4,492,582.730 (393,011,137)	
ノルウェー・クローネ	DNB BANK	64,709	263.200	17,031,408.800	
	NORSK HYDRO ASA	101,085	66.800	6,752,478.000	
	ORKLA ASA	51,165	113.300	5,796,994.500	
	TELENOR ASA	44,944	168.600	7,577,558.400	
	EQUINOR ASA	55,986	239.400	13,403,048.400	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,085	359.900	4,349,391.500	
	MOWI ASA	33,969	206.400	7,011,201.600	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	14,598	276.800	4,040,726.400	
	AKER BP ASA	23,066	244.200	5,632,717.200	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	32,101	298.650	9,586,963.650	
	SALMAR ASA	4,882	514.000	2,509,348.000	
ノルウェー・クローネ 小計				83,691,836.450 (1,237,802,261)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	75,818	24.300	1,842,377.400	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	32,730	38.210	1,250,613.300	
	EXOR NV	6,897	84.800	584,865.600	
	DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	7,728	44.060	340,495.680	
	DSM FIRMENICH AG	12,811	82.020	1,050,758.220	
	FERROVIAL	35,396	46.960	1,662,196.160	
	LOTUS BAKERIES NV	29	8,500.000	246,500.000	
	SYENSQO SA	5,019	74.620	374,517.780	
	CVC CAPITAL PARTNERS PLC	14,682	15.420	226,396.440	
	COVESTRO V AG	11,566	55.200	638,443.200	
	TELECOM ITALIA	716,514	0.001	931.460	
	HENSOLDT AG	4,637	90.400	419,184.800	
	BAYER AG-REG	67,682	28.155	1,905,586.710	
	EVONIK INDUSTRIES AG	17,696	16.100	284,905.600	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	127,506	29.870	3,808,604.220	
	COMMERZBANK AG	52,564	32.580	1,712,535.120	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	14,208	99.920	1,419,663.360	

SIEMENS AG-REG	52,361	226.000	11,833,586.000	
E.ON SE	154,667	15.175	2,347,071.720	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	19,293	88.440	1,706,272.920	
GEA GROUP AG	10,095	63.300	639,013.500	
CONTINENTAL AG	7,471	72.820	544,038.220	
BASF SE	61,487	43.810	2,693,745.470	
ALLIANZ SE-REG	26,604	351.400	9,348,645.600	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	11,012	74.080	815,768.960	
RHEINMETALL AG	3,166	1,744.500	5,523,087.000	
RWE AG	43,559	35.020	1,525,436.180	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	41,388	7.560	312,893.280	
BRENNTAG SE	8,367	51.800	433,410.600	
FRESENIUS SE & CO KGAA	29,101	46.820	1,362,508.820	
SAP SE	71,937	228.250	16,419,620.250	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	8,990	531.800	4,780,882.000	
ZALANDO SE	15,225	24.690	375,905.250	
HEIDELBERG MATERIALS AG	9,217	198.350	1,828,191.950	
RATIONAL AG	336	642.000	215,712.000	
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	4,270	84.450	360,601.500	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,807	193.200	349,112.400	
TALANX AG	4,411	110.800	488,738.800	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	10,397	36.150	375,851.550	
DELIVERY HERO SE	12,982	25.110	325,978.020	
NEMETSCHEK SE	3,964	114.900	455,463.600	
SCOUT24 AG	5,099	110.300	562,419.700	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	23,328	47.240	1,102,014.720	
KNORR-BREMSE AG	4,932	85.800	423,165.600	
SIEMENS ENERGY AG	46,809	87.580	4,099,532.220	
BEIERSDORF AG	6,764	97.320	658,272.480	
MERCK KGAA	8,906	109.550	975,652.300	
ADIDAS AG	11,782	175.700	2,070,097.400	
HENKEL AG & CO KGAA	7,071	67.750	479,060.250	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	240,464	31.650	7,610,685.600	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	15,174	41.990	637,156.260	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	49,751	52.920	2,632,822.920	
QIAGEN N.V.	14,661	40.390	592,157.790	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	89,970	31.575	2,840,802.750	
HANNOVER RUECK SE	4,130	244.400	1,009,372.000	
DHL GROUP	66,138	39.000	2,579,382.000	

DEUTSCHE BOERSE AG	12,972	245.800	3,188,517.600	
MTU AERO ENGINES AG	3,711	361.800	1,342,639.800	
SYMRISE AG	9,150	82.320	753,228.000	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,862	81.400	314,366.800	
VONOVIA SE	51,858	26.770	1,388,238.660	
LEG IMMOBILIEN SE	5,056	70.400	355,942.400	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	52,816	23.800	1,257,020.800	
NN GROUP NV	18,532	57.900	1,073,002.800	
ARCELORMITTAL	32,314	28.860	932,582.040	
HEINEKEN NV	19,843	66.800	1,325,512.400	
AEGON LTD	91,201	6.476	590,617.670	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	62,520	34.740	2,171,944.800	
AKZO NOBEL N.V.	11,768	60.360	710,316.480	
WOLTERS KLUWER	16,433	108.200	1,778,050.600	
ING GROEP NV	207,639	20.555	4,268,019.640	
KONINKLIJKE KPN NV	267,914	4.160	1,114,522.240	
ASML HOLDING NV	27,134	660.200	17,913,866.800	
ABN AMRO BANK NV-CVA	40,684	25.040	1,018,727.360	
IMCD NV	4,081	92.820	378,798.420	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	4,998	108.700	543,282.600	
ASR NEDERLAND NV	10,032	57.740	579,247.680	
ADYEN NV	1,738	1,386.400	2,409,563.200	
PROSUS NV	90,137	52.430	4,725,882.910	
JDE PEET'S NV	11,789	31.260	368,524.140	
INPOST SA	17,322	11.460	198,510.120	
ASM INTERNATIONAL NV	3,230	415.700	1,342,711.000	
RANDSTAD NV	7,252	38.500	279,202.000	
HEINEKEN HOLDING NV	8,748	59.050	516,569.400	
TOTALENERGIES SE	141,479	51.820	7,331,441.780	
MICHELIN (CGDE)	46,190	30.950	1,429,580.500	
AIR LIQUIDE SA	39,852	175.380	6,989,243.760	
KERING	5,128	237.350	1,217,130.800	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	37,777	218.300	8,246,719.100	
BOUYGUES SA	13,194	36.030	475,379.820	
BNP PARIBAS	70,114	76.520	5,365,123.280	
THALES SA	6,387	222.200	1,419,191.400	
DANONE	44,600	75.080	3,348,568.000	
CARREFOUR SA	40,771	12.300	501,483.300	
L'OREAL	16,565	402.650	6,669,897.250	

COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	30,941	91.460	2,829,863.860	
LEGRAND SA	18,065	131.050	2,367,418.250	
PERNOD RICARD SA	13,905	96.120	1,336,548.600	
REXEL SA	15,472	27.590	426,872.480	
SOCIETE GENERALE SA	49,624	53.040	2,632,056.960	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	17,125	496.250	8,498,281.250	
ACCOR SA	13,305	40.910	544,307.550	
CAPGEMINI SE	11,214	125.000	1,401,750.000	
PUBLICIS GROUPE	15,768	82.320	1,298,021.760	
BUREAU VERITAS SA	21,509	26.400	567,837.600	
EIFFAGE	4,659	107.850	502,473.150	
SODEXO SA	5,916	52.350	309,702.600	
IPSEN	2,605	120.000	312,600.000	
AMUNDI SA	4,253	62.500	265,812.500	
TELEPERFORMANCE	3,631	65.780	238,847.180	
EURONEXT NV	5,386	140.200	755,117.200	
EUROFINS SCIENTIFIC	8,015	63.840	511,677.600	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,010	173.750	349,237.500	
ESSILORLUXOTTICA	20,752	259.600	5,387,219.200	
DASSAULT AVIATION SA	1,353	269.200	364,227.600	
FDJ UNITED	7,358	27.920	205,435.360	
AXA SA	122,106	39.510	4,824,408.060	
EDENRED	16,373	23.810	389,841.130	
RENAULT SA	13,030	33.010	430,120.300	
HERMES INTERNATIONAL	2,181	2,039.000	4,447,059.000	
STMICROELECTRONICS NV	47,108	22.800	1,074,062.400	
DASSAULT SYSTEMES SE	46,315	26.800	1,241,242.000	
ORANGE	128,277	13.625	1,747,774.120	
ALSTOM	23,463	20.030	469,963.890	
SANOFI	76,104	79.500	6,050,268.000	
VINCI SA	34,069	115.550	3,936,672.950	
AIRBUS SE	40,938	183.840	7,526,041.920	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	43,379	28.420	1,232,831.180	
CREDIT AGRICOLE SA	72,959	15.690	1,144,726.710	
BIOMERIEUX	2,802	118.300	331,476.600	
ENGIE	125,827	17.640	2,219,588.280	
SAFRAN SA	24,810	278.200	6,902,142.000	
ARKEMA	3,939	57.350	225,901.650	
ADP	2,392	111.800	267,425.600	

GETLINK SE	20,861	15.680	327,100.480	
BOLLORE	46,528	4.860	226,126.080	
UCB SA	8,712	206.900	1,802,512.800	
KBC GROUP NV	15,821	99.500	1,574,189.500	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,611	75.700	424,752.700	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	68,096	51.320	3,494,686.720	
AGEAS	10,282	58.550	602,011.100	
D'IETEREN GROUP	1,502	159.400	239,418.800	
ELIA GROUP SA/NV	2,979	94.300	280,919.700	
SOFINA	1,064	252.600	268,766.400	
ARGENX SE	4,217	639.800	2,698,036.600	
PRYSMIAN SPA	19,400	76.480	1,483,712.000	
GENERALI	58,494	33.210	1,942,585.740	
MEDIOBANCA SPA	32,588	19.385	631,718.380	
TENARIS SA	25,755	14.965	385,423.570	
UNICREDIT SPA	96,579	64.920	6,269,908.680	
UNIPOL GRUPPO SPA	24,380	17.215	419,701.700	
TELECOM ITALIA SPA	795,819	0.433	344,748.790	
INTESA SANPAOLO	977,560	5.291	5,172,269.960	
POSTE ITALIANE SPA	31,033	19.725	612,125.920	
MONCLER SPA	16,093	47.050	757,175.650	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	7,934	54.050	428,832.700	
ENI SPA	140,264	14.626	2,051,501.260	
BPER BANCA	102,653	8.674	890,412.120	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	41,820	6.120	255,938.400	
BANCO BPM SPA	83,944	11.495	964,936.280	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	18,401	10.240	188,426.240	
NEXI SPA	38,461	5.256	202,151.010	
BANCA MEDIOLANUM SPA	15,600	16.980	264,888.000	
LEONARDO SPA	27,883	47.140	1,314,404.620	
ENEL SPA	560,314	7.841	4,393,422.070	
SNAM SPA	136,735	5.172	707,193.420	
TERNA SPA	96,930	8.536	827,394.480	
FINECOBANK SPA	42,133	18.475	778,407.170	
STELLANTIS NV	138,905	7.750	1,076,513.750	
FERRARI NV	8,686	418.400	3,634,222.400	
TELEFONICA SA	253,904	4.554	1,156,278.810	
ENDESA SA	21,525	25.740	554,053.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	397,039	15.605	6,195,793.590	

IBERDROLA SA	438,883	15.720	6,899,240.760	
BANCO DE SABADELL SA	344,594	3.219	1,109,248.080	
BANKINTER SA	47,200	12.515	590,708.000	
REPSOL SA	79,736	14.190	1,131,453.840	
GRIFOLS SA	20,213	12.300	248,619.900	
BANCO SANTANDER SA	1,024,367	8.089	8,286,104.660	
AMADEUS IT GROUP SA	31,033	68.560	2,127,622.480	
CAIXABANK SA	267,370	8.576	2,292,965.120	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	87,000	4.505	391,935.000	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	12,317	64.900	799,373.300	
AENA SME SA	51,671	24.410	1,261,289.110	
CELLNEX TELECOM SA	34,067	30.620	1,043,131.540	
ACCIONA SA	1,712	167.700	287,102.400	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	75,149	42.070	3,161,518.430	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	27,487	16.680	458,483.160	
UPM-KYMMENE OYJ	36,188	23.790	860,912.520	
NOKIA OYJ	356,483	3.882	1,383,867.000	
WARTSILA OYJ ABP	34,650	24.740	857,241.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	39,502	9.728	384,275.450	
ELISA OYJ	9,684	45.860	444,108.240	
SAMPO OYJ-A SHS	166,804	9.750	1,626,339.000	
FORTUM OYJ	30,379	14.740	447,786.460	
KESKO OYJ-B SHS	18,838	19.200	361,689.600	
KONE OYJ-B	23,414	55.680	1,303,691.520	
NESTE OYJ	28,715	16.775	481,694.120	
ORION OYJ-CLASS B	7,366	65.900	485,419.400	
METSO CORPORATION	45,854	11.565	530,301.510	
NORDEA BANK ABP	215,067	13.340	2,868,993.780	
VERBUND AG	4,639	61.900	287,154.100	
OMV AG	10,014	46.100	461,645.400	
ERSTE GROUP BANK AG	21,210	81.050	1,719,070.500	
RYANAIR HOLDINGS PLC	58,354	24.040	1,402,830.160	
AIB GROUP PLC	147,367	7.145	1,052,937.210	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	66,750	12.920	862,410.000	
KINGSPAN GROUP PLC	10,662	69.400	739,942.800	
JERONIMO MARTINS	19,184	21.900	420,129.600	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	216,179	3.749	810,455.070	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	606,730	0.710	431,263.680	
GALP ENERGIA SGPS SA	28,255	15.765	445,440.070	

	EDP RENOVAVEIS SA	21,782	10.000	217,820.000	
	KERRY GROUP PLC-A	11,282	78.850	889,585.700	
ユーロ 小計				390,211,186.730 (67,842,116,925)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	101,500	51.300	5,206,950.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	160,000	41.280	6,604,800.000	
	MTR CORP	114,000	26.400	3,009,600.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	106,000	92.150	9,767,900.000	
	SINO LAND CO	268,000	9.670	2,591,560.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	196,169	51.300	10,063,469.700	
	WHARF HOLDINGS LTD	77,000	23.060	1,775,620.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	26,000	67.400	1,752,400.000	
	CLP HOLDINGS LTD	120,000	64.600	7,752,000.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	106,507	26.520	2,824,565.640	
	HONG KONG & CHINA GAS	817,475	6.890	5,632,402.750	
	HANG SENG BANK LTD	55,000	114.000	6,270,000.000	
	WH GROUP LTD	609,000	8.340	5,079,060.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	88,000	435.600	38,332,800.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	140,669	36.980	5,201,939.620	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	45,000	52.950	2,382,750.000	
	AIA GROUP LTD	776,000	71.650	55,600,400.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	99,000	28.260	2,797,740.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	122,000	22.620	2,759,640.000	
	SANDS CHINA LTD	177,600	19.710	3,500,496.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	107,000	96.700	10,346,900.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	270,500	37.280	10,084,240.000	
香港・ドル 小計				199,337,233.710 (3,795,380,930)	
合計				757,500,641,996 [757,500,641,996]	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,137	1,980,871.170	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	23,107	4,211,250.750	
		BXP INC	10,500	806,715.000	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	7,600	1,502,824.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	25,600	1,710,336.000	
		EQUINIX INC	6,908	5,344,581.440	
		AMERICAN TOWER CORP	33,100	6,564,392.000	

		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	23,500	818,975.000	
		KIMCO REALTY CORP	47,800	1,087,928.000	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	19,400	939,542.000	
		INVITATION HOMES INC	41,100	1,243,275.000	
		VICI PROPERTIES INC	74,600	2,506,560.000	
		VENTAS INC	31,900	2,166,329.000	
		WEYERHAEUSER CO	51,214	1,339,246.100	
		CROWN CASTLE INTL CORP	30,800	2,961,420.000	
		IRON MOUNTAIN INC	20,900	1,926,562.000	
		SUN COMMUNITIES INC	9,100	1,181,362.000	
		PROLOGIS INC	65,554	7,450,212.100	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11,000	931,700.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,600	846,336.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,600	1,233,352.000	
		WELLTOWER INC	46,200	7,753,284.000	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	48,400	890,076.000	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	8,300	1,206,820.000	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	12,900	796,188.000	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	42,700	943,243.000	
		REALTY INCOME CORP	63,795	3,782,405.550	
		PUBLIC STORAGE	11,200	3,335,360.000	
		REGENCY CENTERS CORP	12,200	898,896.000	
		UDR INC	22,300	871,707.000	
		WP CAREY INC	15,500	1,055,860.000	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	23,800	3,885,112.000	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	15,000	2,209,200.000	
	アメリカ・ドル 小計			76,381,921.110 (11,340,423,827)	
	イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	48,766	263,092.570	
		SEGRO PLC	87,095	546,782.410	
	イギリス・ポンド 小計			809,874.980 (162,234,156)	
	オーストラリア・ドル	TRANSURBAN GROUP	206,386	2,965,766.820	
		APA GROUP	86,730	770,162.400	
		SCENTRE GROUP	345,787	1,403,895.220	

		STOCKLAND	156,047	970,612.340	
		GOODMAN GROUP	134,871	4,515,481.080	
		VICINITY CENTRES	252,023	645,178.880	
	オーストラリア・ドル 小計			11,271,096.740 (1,096,790,424)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	285,800	791,666.000	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	427,291	965,677.660	
	シンガポール・ドル 小計			1,757,343.660 (202,990,766)	
	ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	8,397	735,409.260	
		GECINA SA	3,108	260,295.000	
		KLEPIERRE	14,542	487,738.680	
		COVIVIO	3,853	216,731.250	
	ユーロ 小計			1,700,174.190 (295,592,285)	
	香港・ドル	LINK REIT	189,800	7,876,700.000	
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	277,000	3,227,050.000	
	香港・ドル 小計			11,103,750.000 (211,415,400)	
投資証券 合計				13,309,446,858 [13,309,446,858]	
合計				13,309,446,858 [13,309,446,858]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式 524銘柄 投資証券 33銘柄	98.1%	1.9%	77.4%
イギリス・ポンド	株式 71銘柄 投資証券 2銘柄	99.4%	0.6%	3.8%

イスラエル・シュケル	株式	10銘柄	100%	-%	0.2%
オーストラリア・ドル	株式 投資証券	41銘柄 6銘柄	91.6%	8.4%	1.7%
カナダ・ドル	株式	83銘柄	100%	-%	3.2%
シンガポール・ドル	株式 投資証券	13銘柄 2銘柄	93%	7.0%	0.4%
スイス・フラン	株式	43銘柄	100%	-%	2.4%
スウェーデン・クローナ	株式	40銘柄	100%	-%	0.8%
デンマーク・クローネ	株式	15銘柄	100%	-%	0.5%
ニュージーランド・ドル	株式	5銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式	11銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式 投資証券	214銘柄 4銘柄	99.6%	0.4%	8.8%
香港・ドル	株式 投資証券	22銘柄 2銘柄	94.7%	5.3%	0.5%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年9月9日現在 金　額（円）	2025年9月8日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	2,519,089,461	2,152,208,971
コール・ローン	999,645,481	1,122,549,170
国債証券	308,161,268,383	346,096,709,260
派生商品評価勘定	1,015	8,971,611
未収入金	-	153,721
未収利息	2,211,509,089	2,660,509,188
前払費用	149,220,358	141,199,896
流動資産合計	314,040,733,787	352,182,301,817

資産合計	314,040,733,787	352,182,301,817
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	19,406,553	74,650
未払金	455,507	-
未払解約金	126,946,817	203,406,421
流動負債合計	146,808,877	203,481,071
負債合計	146,808,877	203,481,071
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	88,440,035,633	92,254,082,920
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	225,453,889,277	259,724,737,826
元本等合計	313,893,924,910	351,978,820,746
純資産合計	313,893,924,910	351,978,820,746
負債純資産合計	314,040,733,787	352,182,301,817

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年9月9日現在	2025年9月8日現在
1.　※1 期首	2023年9月8日	2024年9月10日
期首元本額	81,490,428,967円	88,440,035,633円
期中追加設定元本額	13,845,307,021円	16,361,140,295円
期中一部解約元本額	6,895,700,355円	12,547,093,008円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックスＶＡ	334,284,052円	253,100,710円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	4,950,980円	4,660,760円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	31,902,746円	23,818,760円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	14,267,455円	12,354,424円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	178,441,285円	135,633,584円
外国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	796,100,609円	1,009,718,287円

外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	613,146,390円	678,351,579円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	969,436,086円	1,044,634,371円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	5,638,316,159円	7,624,731,897円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	1,128,937,747円	1,075,867,916円
Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス	1,826,625円	1,332,817円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	21,719,982円	27,644,639円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	2,039,529,754円	1,266,940,397円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	2,647,928,780円	3,253,312,085円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	623,529,591円	747,366,962円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	2,275,241円	3,773,606円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	51,775,310,181円	51,019,021,694円
ダイワ・ライフ・バランス３０	1,194,490,715円	1,255,361,290円
ダイワ・ライフ・バランス５０	918,786,615円	995,015,612円
ダイワ・ライフ・バランス７０	730,856,465円	813,112,694円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	721,177,932円	792,717,183円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	592,006,270円	648,836,524円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	241,749,041円	312,243,472円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	34,439,660円	35,152,531円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	21,631,919円	30,692,734円
ダイワつみたてインデックス外国債券	2,393,028,554円	2,801,867,546円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	4,983,279円	5,292,316円

ダイワつみたてインデックスバランス５０	2,478,881円	2,934,544円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	4,158,514円	39,465,904円
ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ラップ専用）	2,194,163,571円	3,073,514,089円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	90,046,824円	82,854,322円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	27,047,472円	26,563,761円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	2,512,298,728円	2,134,138,021円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	162,551,333円	144,025,583円
スタイル9（4資産分散・保守型）	147,695円	354,111円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	1,833,793円	4,393,184円
スタイル9（4資産分散・積極型）	1,674,011円	4,791,857円
スタイル9（6資産分散・保守型）	38,982円	140,946円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	1,220,989円	4,125,988円
スタイル9（6資産分散・積極型）	431,674円	1,973,561円
スタイル9（8資産分散・保守型）	61,560円	210,415円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	1,210,582円	2,706,852円
スタイル9（8資産分散・積極型）	1,348,851円	2,896,224円
ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	-円	4,772,355円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	135,760,414円	115,125,199円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	68,716,898円	67,426,427円

	ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	3,504,769,883円	4,415,656,622円
	ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,953,669,728円	6,153,353,537円
	ダイワライフスタイル２５	25,738,639円	23,808,345円
	ダイワライフスタイル５０	58,505,542円	58,465,895円
	ダイワライフスタイル７５	17,106,956円	17,828,788円
	計	88,440,035,633円	92,254,082,920円
2.	期末日における受益権の総数	88,440,035,633口	92,254,082,920口

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年9月10日 至2025年9月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年9月9日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2025年9月8日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	11,323,285,016	△1,323,582,924
合計	11,323,285,016	△1,323,582,924

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	2024年9月9日現在				2025年9月8日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	900,446,984	-	881,041,446	△19,405,538	896,416,225	-	905,313,186	8,896,961
アメリカ・ドル	92,558,185	-	91,327,710	△1,230,475	249,575,645	-	251,769,602	2,193,957
イギリス・ポンド	11,956,631	-	11,772,180	△184,451	-	-	-	-

イスラエル・シュケル	64,850,317	-	61,840,696	△3,009,621	34,665,836	-	35,126,965	461,129
オフショア・人民元	583,897,032	-	571,393,720	△12,503,312	299,343,202	-	302,461,965	3,118,763
シンガポール・ドル	13,368,888	-	13,113,204	△255,684	32,239,227	-	32,544,858	305,631
スウェーデン・クローナ	-	-	-	-	9,894,403	-	10,097,030	202,627
デンマーク・クローネ	1,917,798	-	1,883,240	△34,558	9,611,032	-	9,723,516	112,484
ニュージーランド・ドル	-	-	-	-	71,461,483	-	72,191,559	730,076
ノルウェー・クローネ	15,253,779	-	14,792,026	△461,753	2,882,721	-	2,919,173	36,452
ポーランド・ズロチ	52,778,680	-	51,779,991	△998,689	47,660,302	-	48,391,873	731,571
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	93,335,089	-	94,073,105	738,016
ユーロ	63,865,674	-	63,138,679	△726,995	45,747,285	-	46,013,540	266,255
合計	900,446,984	-	881,041,446	△19,405,538	896,416,225	-	905,313,186	8,896,961

（注）　1．時価の算定方法

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

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

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

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

・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

2．換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2024年9月9日現在	2025年9月8日現在
1口当たり純資産額	3.5492円	3.8153円

（1万口当たり純資産額）	(35,492円)	(38,153円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	748,349.500	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	776,280.060	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	795,324.600	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,593,111.230	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	976,000.000	1,013,009.920	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	911,482.110	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	553,967.720	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	531,585.750	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	960,611.260	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,104,835.180	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,069,370.400	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,201,675.200	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,028,775.900	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,178,000.000	1,165,843.040	

		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,016,964.740	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,426,927.840	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,286,917.500	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,339,351.650	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,377,208.450	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,205,196.500	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,342,204.770	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,094,333.460	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	4,056,640.500	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,257,382.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,136,907.500	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,794,140.520	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	2,796,662.100	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	1,837,523.000	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	4,307,000.000	3,726,545.610	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	1,327,000.000	1,103,785.330	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,539,187.680	
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,139,600.820	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,063,000.000	1,469,804.980	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	2,935,000.000	2,274,038.000	

		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,416,306.410	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	507,785.860	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	1,148,000.000	805,344.960	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	1,973,869.830	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	1,843,140.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	5,197,498.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	744,760.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,571,167.600	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	1,781,191.650	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,276,480.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,515,140.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,758,931.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,450,000.000	1,766,376.500	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,354,965.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	1,797,850.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	6,239,319.500	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,254,680.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	2,915,892.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	11,500,000.000	11,316,920.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	3,700,000.000	3,635,805.000	

		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,408,946.400	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,657,339.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,415,033.600	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,411,768.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	3,500,936.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,150,000.000	3,010,659.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,746,262.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,379,883.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	2,200,000.000	1,394,250.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,737,252.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,446,775.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,931,030.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,350,000.000	4,986,146.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	2,923,920.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,951,780.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,439,825.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,581,600.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	6,312,605.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20500215	4,400,000.000	2,610,740.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	1,300,000.000	1,253,954.000	

		0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,528,896.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,939,188.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,283,552.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	1,900,000.000	923,229.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	3,400,000.000	2,163,046.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,322,795.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,314,990.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,931,360.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,713,250.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,200,000.000	3,089,336.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	3,400,000.000	2,139,008.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,299,345.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,752,400.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	8,542,758.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,752,880.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,000,000.000	3,190,140.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	4,300,000.000	2,798,268.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,694,600.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,682,800.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,560,400.000	

		1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	3,340,875.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	9,402,197.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,721,050.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,296,486.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,781,480.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,000,000.000	7,166,240.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	1,500,000.000	1,415,730.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	4,086,592.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	2,810,062.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	6,000,000.000	5,651,340.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,701,450.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,963,575.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	3,900,000.000	2,264,496.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	5,700,000.000	3,855,822.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,658,950.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,666,400.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,858,800.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,675,550.000	
		0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,397,800.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	10,000,000.000	8,704,600.000	

		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,600,000.000	3,698,574.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	2,801,840.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,622,600.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	7,000,000.000	6,799,100.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	5,000,000.000	4,855,850.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	5,259,576.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	6,500,000.000	6,070,870.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,877,720.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	7,900,000.000	7,051,619.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	4,058,856.000	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	5,200,000.000	3,199,196.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	1,847,250.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,733,300.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	5,000,000.000	4,875,750.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,885,730.000	
		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,917,550.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	6,300,000.000	5,961,690.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	3,542,550.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,258,125.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,933,370.000	

		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,960,490.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	5,000,000.000	4,864,250.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,968,460.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,958,960.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,984,520.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	4,010,985.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	9,500,000.000	8,888,960.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	5,200,000.000	3,776,500.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	2,000,000.000	1,701,280.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,248,952.000	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,480,800.000	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,445,785.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,530,750.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	3,500,000.000	3,541,895.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031	3,000,000.000	3,037,260.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	6,700,000.000	6,825,692.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	3,700,000.000	3,256,851.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	3,051,420.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	2,500,000.000	2,530,500.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	3,000,000.000	3,023,070.000	

		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20421115	2,500,000.000	2,306,975.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	5,000,000.000	5,061,300.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271231	1,500,000.000	1,512,210.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	3,000,000.000	2,991,360.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	8,000,000.000	7,816,960.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	2,500,000.000	2,264,675.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	4,500,000.000	3,698,055.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131	3,700,000.000	3,699,630.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300228	7,500,000.000	7,633,575.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280229	3,000,000.000	3,035,430.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,800,000.000	1,803,258.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280331	3,700,000.000	3,712,062.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	3,000,000.000	2,989,260.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280430	2,000,000.000	2,000,180.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	6,300,000.000	6,091,155.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	5,600,000.000	4,596,760.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	2,500,000.000	2,259,900.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280531	3,700,000.000	3,711,766.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531	1,500,000.000	1,510,425.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	3,000,000.000	3,020,490.000	

4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630	3,500,000.000	3,547,285.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	3,500,000.000	3,559,990.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815	9,000,000.000	8,988,210.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815	5,000,000.000	4,493,750.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430815	2,300,000.000	2,216,625.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	3,000,000.000	3,052,890.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300831	3,100,000.000	3,172,106.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	3,000,000.000	3,073,980.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260915	3,000,000.000	3,027,240.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930	1,500,000.000	1,569,285.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	4,200,000.000	4,336,416.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261015	1,000,000.000	1,009,960.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	6,241,980.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20331115	10,000,000.000	10,406,000.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261115	3,800,000.000	3,840,508.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20431115	2,300,000.000	2,322,540.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301031	3,100,000.000	3,280,792.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20531115	5,300,000.000	5,283,199.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301130	3,000,000.000	3,105,270.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	4,000,000.000	4,104,360.000	

		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261215	2,000,000.000	2,017,500.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310131	2,000,000.000	2,034,760.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301231	4,500,000.000	4,524,075.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	8,500,000.000	8,630,135.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	1,000,000.000	1,007,260.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270115	7,000,000.000	7,032,480.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340215	10,200,000.000	10,238,046.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270215	4,000,000.000	4,027,160.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540215	4,400,000.000	4,038,100.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440215	3,000,000.000	2,931,660.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310228	3,600,000.000	3,706,488.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,200,000.000	5,323,552.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270315	5,000,000.000	5,047,350.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	5,000,000.000	5,100,150.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310331	2,000,000.000	2,046,860.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270415	5,000,000.000	5,070,000.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340515	8,500,000.000	8,750,325.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270515	4,000,000.000	4,059,520.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	2,500,000.000	2,593,100.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310430	1,600,000.000	1,677,328.000	

		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540515	5,200,000.000	5,078,684.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440515	3,500,000.000	3,470,320.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	5,600,000.000	5,787,096.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310531	2,300,000.000	2,411,251.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270615	4,500,000.000	4,581,540.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310630	2,500,000.000	2,572,800.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	100,000.000	102,521.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270715	2,200,000.000	2,232,164.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	8,300,000.000	8,436,618.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310731	5,000,000.000	5,112,200.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340815	10,500,000.000	10,398,465.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270815	7,000,000.000	7,027,020.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540815	5,300,000.000	4,862,538.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310831	4,000,000.000	4,009,120.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440815	1,800,000.000	1,667,952.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	4,500,000.000	4,501,755.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	5,000,000.000	5,014,700.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270915	1,000,000.000	997,360.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	4,500,000.000	4,490,550.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	800,000.000	798,544.000	

		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310930	2,300,000.000	2,288,523.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271015	1,310,000.000	1,319,301.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	5,000,000.000	5,108,650.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20341115	9,000,000.000	9,151,290.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271115	4,200,000.000	4,253,382.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20541115	6,100,000.000	5,837,883.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	5,700,000.000	5,726,448.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311031	3,300,000.000	3,371,775.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	6,000,000.000	6,040,140.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	5,500,000.000	5,620,505.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20441115	2,400,000.000	2,374,584.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311130	3,500,000.000	3,575,040.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271215	4,000,000.000	4,043,560.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	4,000,000.000	4,128,400.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311231	3,500,000.000	3,647,105.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	1,500,000.000	1,511,160.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280115	3,000,000.000	3,049,440.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	6,500,000.000	6,677,970.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350215	8,600,000.000	8,986,312.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280215	5,500,000.000	5,594,600.000	

		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550215	5,600,000.000	5,470,472.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20450215	3,500,000.000	3,515,295.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270131	6,500,000.000	6,541,860.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320131	4,000,000.000	4,139,600.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320229	4,000,000.000	4,083,040.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	4,000,000.000	4,028,800.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280315	3,000,000.000	3,027,870.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	5,020,500.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320331	3,500,000.000	3,571,960.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	7,000,000.000	7,122,990.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280415	3,000,000.000	3,018,210.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	2,500,000.000	2,506,625.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320430	3,500,000.000	3,545,710.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550515	5,300,000.000	5,282,192.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350515	9,500,000.000	9,634,330.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280515	4,000,000.000	4,025,600.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	4,500,000.000	4,556,565.000	
		5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20450515	1,200,000.000	1,243,776.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	5,800,000.000	5,828,768.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320531	3,500,000.000	3,569,580.000	

		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531	5,800,000.000	5,905,328.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280615	2,000,000.000	2,020,060.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	5,800,000.000	5,819,662.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320630	3,300,000.000	3,340,722.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	3,200,000.000	3,240,000.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280715	2,000,000.000	2,020,060.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	6,000,000.000	6,075,000.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350815	3,800,000.000	3,849,552.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280815	6,000,000.000	6,022,260.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	8,000,000.000	8,047,440.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550815	2,700,000.000	2,691,333.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320731	4,600,000.000	4,654,602.000	
	アメリカ・ドル 小計			1,077,312,593.630 (159,948,600,776)	
	イギリス・ポンド	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,282,000.000	679,716.400	
		1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	883,484.800	
		1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,044,768.500	
		1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	804,599.300	
		1.25% United Kingdom Gilt 20270722	2,610,000.000	2,492,863.200	
		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,406,550.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,740,000.000	675,781.200	

		1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	624,287.400	
		1.625% United Kingdom Gilt 20541022	1,600,000.000	709,648.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20291022	2,100,000.000	1,863,687.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20411022	2,190,000.000	1,263,213.900	
		0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,300,000.000	1,086,800.000	
		0.5% United Kingdom Gilt 20611022	3,000,000.000	745,860.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20280131	2,200,000.000	2,022,196.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,700,000.000	598,910.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20350731	3,700,000.000	2,529,098.000	
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	2,007,350.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20460131	1,550,000.000	693,036.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20261022	2,700,000.000	2,603,448.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20510731	2,200,000.000	921,294.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	3,100,000.000	1,951,233.000	
		0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	2,700,000.000	2,416,770.000	
		0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	3,100,000.000	2,372,554.000	
		1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	1,300,000.000	564,616.000	
		1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	4,100,000.000	3,369,298.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	1,220,000.000	377,590.000	
		4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	2,000,000.000	2,004,600.000	

		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	1,000,000.000	890,690.000	
		3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	2,600,000.000	2,415,114.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	2,500,000.000	1,857,000.000	
		4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	1,000,000.000	765,000.000	
		4.5% UNITED KINGDOM GILT 20280607	3,400,000.000	3,451,204.000	
		4.625% UNITED KINGDOM GILT 20340131	3,300,000.000	3,325,542.000	
		4.75% UNITED KINGDOM GILT 20431022	1,500,000.000	1,399,500.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20270307	2,300,000.000	2,294,664.000	
		4.375% UNITED KINGDOM GILT 20540731	1,280,000.000	1,071,744.000	
		4% UNITED KINGDOM GILT 20311022	2,200,000.000	2,173,600.000	
		4.125% UNITED KINGDOM GILT 20290722	2,800,000.000	2,813,860.000	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT 20340731	3,100,000.000	3,027,243.000	
		4.375% UNITED KINGDOM GILT 20400131	2,300,000.000	2,134,032.000	
		4.375% UNITED KINGDOM GILT 20280307	2,000,000.000	2,021,000.000	
		4.375% UNITED KINGDOM GILT 20300307	2,300,000.000	2,330,038.000	
		4.5% UNITED KINGDOM GILT 20350307	1,800,000.000	1,779,696.000	
		5.375% UNITED KINGDOM GILT 20560131	350,000.000	343,840.000	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,013,180.870	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,440,000.000	1,443,009.600	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,862,000.000	1,787,054.500	

		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,757,000.000	1,723,283.170	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	1,398,476.240	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,167,438.240	
		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,245,983.200	
		4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	1,937,811.640	
		4.75% United Kingdom Gilt 20301207	2,300,000.000	2,381,144.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,143,000.000	960,085.710	
		4.25% United Kingdom Gilt 20390907	846,000.000	779,961.240	
		4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,554,774.000	
		4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	908,042.040	
		4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,430,118.220	
		3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,176,679.840	
		3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,466,000.000	1,866,515.400	
		3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	953,526.420	
		3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,724,000.000	1,339,668.680	
	イギリス・ポンド 小計			97,873,772.710 (19,606,074,150)	
	イスラエル・シュケル	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	1,846,350.000	
		5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	2,200,000.000	2,485,120.000	
		2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,748,394.000	
		3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,143,104.000	

	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,142,640.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,108,328.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	3,000,000.000	2,249,790.000	
	1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	2,700,000.000	2,274,318.000	
	2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129	1,720,000.000	1,227,185.600	
	3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290228	3,800,000.000	3,777,580.000	
	4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20350330	2,700,000.000	2,674,647.000	
	3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20270930	2,500,000.000	2,490,900.000	
	4.6% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290831	1,600,000.000	1,638,144.000	
イスラエル・シュケル 小計			27,806,500.600 (1,236,085,152)	
オーストラリア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,031,127.020	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,341,935.860	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	2,258,000.000	2,321,901.400	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,042,235.460	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	2,207,000.000	1,930,065.640	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	683,385.120	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,649,127.040	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,142,341.940	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	928,858.800	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,467,540.000	

	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,839,846.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,731,838.200	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,088,244.900	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,505,249.200	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	2,700,000.000	2,274,723.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,742,120.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	730,562.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,108,400.000	
	0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,164,624.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,600,000.000	1,373,984.000	
	3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,700,000.000	1,564,136.000	
	3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	2,000,000.000	1,932,920.000	
	3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221	2,300,000.000	2,163,794.000	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20540621	900,000.000	855,216.000	
	4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340621	1,100,000.000	1,102,706.000	
	4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20351221	1,700,000.000	1,685,210.000	
	4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20360321	1,500,000.000	1,484,355.000	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20361021	1,400,000.000	1,379,364.000	
オーストラリア・ドル 小計			44,265,810.580 (4,307,506,028)	
オフショア・人民元	3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,301,950.000	

		3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,349,950.000	
		3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,290,760.000	
		3.13% China Government Bond 20291121	25,000,000.000	26,732,250.000	
		2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,343,460.000	
		2.68% China Government Bond 20300521	29,500,000.000	30,942,255.000	
		3.28% China Government Bond 20271203	29,000,000.000	30,309,060.000	
		3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	13,630,625.000	
		3.81% China Government Bond 20500914	16,300,000.000	21,612,659.000	
		3.01% China Government Bond 20280513	27,000,000.000	28,171,530.000	
		3.72% China Government Bond 20510412	17,000,000.000	22,514,120.000	
		3.02% China Government Bond 20310527	15,800,000.000	17,039,668.000	
		3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,757,840.000	
		3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,338,000.000	
		3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,805,325.000	
		4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	7,000,000.000	9,586,920.000	
		3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	8,800,000.000	11,738,496.000	
		3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	23,000,000.000	28,643,740.000	
		2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	15,500,000.000	16,193,625.000	
		3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	11,500,000.000	14,795,555.000	
		2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	16,000,000.000	17,169,600.000	

		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	17,000,000.000	17,224,740.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	15,200,000.000	16,177,968.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	15,672,900.000	
		2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	15,000,000.000	15,257,250.000	
		3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	6,857,675.000	
		2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	5,332,200.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	19,000,000.000	19,858,040.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	19,000,000.000	20,153,680.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	32,000,000.000	33,848,960.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	9,891,495.000	
		2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	17,200,000.000	17,542,968.000	
		3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	19,500,000.000	23,635,950.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	5,500,000.000	5,901,115.000	
		2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	19,000,000.000	19,965,960.000	
		2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	20,000,000.000	20,560,800.000	
		2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	15,000,000.000	16,236,750.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	15,000,000.000	15,809,700.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	25,000,000.000	25,755,250.000	
		3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	21,700,000.000	26,665,177.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	35,000,000.000	37,346,400.000	

		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	33,000,000.000	34,536,480.000	
		2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	35,000,000.000	35,944,300.000	
		2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	28,000,000.000	29,541,680.000	
		2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925	25,000,000.000	25,755,250.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	30,000,000.000	31,429,500.000	
		3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	26,000,000.000	31,267,080.000	
		2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	20,000,000.000	20,653,800.000	
		2.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20261115	60,000,000.000	60,715,800.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	36,000,000.000	38,464,200.000	
		2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225	50,000,000.000	52,258,000.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20290115	58,000,000.000	59,646,040.000	
		2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20270225	35,000,000.000	35,316,400.000	
		2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225	16,000,000.000	16,707,680.000	
		2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325	35,000,000.000	36,150,450.000	
		2.05% CHINA GOVERNMENT BOND 20290415	73,000,000.000	74,336,630.000	
		1.85% CHINA GOVERNMENT BOND 20270515	85,000,000.000	85,617,950.000	
		2.27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525	21,000,000.000	21,807,240.000	
		2.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20310625	20,000,000.000	20,493,000.000	
		1.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20290715	28,000,000.000	28,367,360.000	
		1.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20270815	45,000,000.000	45,182,700.000	

		2.11% CHINA GOVERNMENT BOND 20340825	44,000,000.000	45,156,760.000	
		1.87% CHINA GOVERNMENT BOND 20310915	33,000,000.000	33,359,700.000	
		1.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20260925	10,000,000.000	9,993,400.000	
		1.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20291015	1,000,000.000	1,006,910.000	
		1.42% CHINA GOVERNMENT BOND 20271115	13,000,000.000	12,999,480.000	
		2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20341125	11,000,000.000	11,237,600.000	
		1.06% CHINA GOVERNMENT BOND 20261215	5,000,000.000	4,979,150.000	
		1.49% CHINA GOVERNMENT BOND 20311225	9,100,000.000	8,983,338.000	
		1.43% CHINA GOVERNMENT BOND 20300125	20,000,000.000	19,871,600.000	
		1.92% CHINA GOVERNMENT BOND 20550115	4,000,000.000	3,864,640.000	
		1.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20350215	29,000,000.000	28,556,300.000	
		1.45% CHINA GOVERNMENT BOND 20280225	5,000,000.000	5,004,100.000	
		1.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270315	10,000,000.000	10,028,500.000	
		1.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20320325	52,000,000.000	52,313,040.000	
		1.65% CHINA GOVERNMENT BOND 20350515	17,000,000.000	16,805,010.000	
		1.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20280525	30,000,000.000	30,024,300.000	
		1.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20350525	37,000,000.000	36,658,860.000	
		1.38% CHINA GOVERNMENT BOND 20270615	20,000,000.000	19,988,600.000	
		1.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20300725	8,000,000.000	7,976,160.000	
		1.42% CHINA GOVERNMENT BOND 20280815	10,000,000.000	9,981,600.000	

	1.83% CHINA GOVERNMENT BOND 20350825	19,000,000.000	19,019,380.000	
オフショア・人民元 小計			1,882,962,334.000 (39,208,736,385)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	555,000.000	443,972.250	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,383,000.000	1,532,405.490	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,317,613.200	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,168,687.960	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	965,150.560	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	944,807.150	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,142,840.860	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,207,946.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	640,100.500	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,637,327.700	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,202,432.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,215,503.500	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,772,620.000	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	295,671.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	3,148,842.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	2,650,000.000	1,734,928.500	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	2,200,000.000	2,159,454.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,700,000.000	2,476,899.000	

		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,407,735.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	98,119.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	1,200,000.000	1,204,704.000	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	2,270,000.000	2,188,075.700	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	1,300,000.000	1,328,522.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,700,000.000	1,658,979.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201	1,180,000.000	969,547.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280901	1,200,000.000	1,221,192.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20331201	1,000,000.000	1,007,610.000	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290301	1,800,000.000	1,879,272.000	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340601	1,700,000.000	1,675,486.000	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340301	1,500,000.000	1,537,185.000	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290901	800,000.000	823,544.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20341201	2,600,000.000	2,602,678.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,700,000.000	1,713,736.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300301	2,000,000.000	1,998,580.000	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270201	1,700,000.000	1,710,727.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20350601	2,100,000.000	2,096,325.000	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20571201	950,000.000	906,091.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270501	3,200,000.000	3,210,592.000	

	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300901	2,400,000.000	2,392,488.000	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270801	500,000.000	499,640.000	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20351201	700,000.000	696,178.000	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20271101	900,000.000	899,118.000	
カナダ・ドル 小計			63,733,325.370 (6,837,948,478)	
シンガポール・ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	795,623.200	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	860,589.930	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	444,000.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	635,876.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	656,312.500	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	818,000.000	925,836.940	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	776,250.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	566,610.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	650,000.000	682,500.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	529,200.000	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	600,600.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	500,000.000	484,750.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	199,740.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	254,520.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	620,000.000	749,890.000	

	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	500,000.000	514,060.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20280801	400,000.000	415,960.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20290401	600,000.000	631,260.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20340501	300,000.000	337,500.000	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20540601	100,000.000	126,081.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20350301	230,000.000	247,923.900	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20300401	160,000.000	167,120.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20400701	90,000.000	93,575.700	
シンガポール・ドル 小計			11,695,779.170 (1,350,979,452)	
スウェーデン・クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	3,655,000.000	3,997,948.650	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	7,109,707.800	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,910,216.000	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,310,098.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	6,095,680.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,477,300.000	
	1.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20331111	4,000,000.000	3,824,280.000	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20350511	2,700,000.000	2,647,323.000	
スウェーデン・クローナ 小計			36,372,553.450 (575,413,796)	
デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	16,611,625.800	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,976,070.000	

	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	4,090,000.000	3,861,491.700	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	1,784,685.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	2,900,000.000	2,545,939.000	
	2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20331115	2,000,000.000	1,990,780.000	
	2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20261115	50,000.000	50,400.000	
	2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20351115	500,000.000	489,435.000	
デンマーク・クローネ 小計			32,310,426.500 (752,509,834)	
ニュージーランド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	600,000.000	614,136.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	1,500,000.000	1,436,205.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	407,983.800	
	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	1,100,000.000	1,085,337.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	530,000.000	467,465.300	
	1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	228,308.500	
	0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	1,100,000.000	1,017,159.000	
	2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	940,000.000	829,954.200	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	247,319.200	
	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20340515	500,000.000	498,065.000	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20300515	1,100,000.000	1,141,855.000	
	5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20540515	700,000.000	672,098.000	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20350515	500,000.000	503,755.000	

	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20360515	1,300,000.000	1,271,465.000	
ニュージーランド・ドル 小計			10,421,106.000 (911,638,353)	
ノルウェー・クローネ	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,335,724.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,361,225.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,576,688.500	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,297,008.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	3,031,175.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	3,200,000.000	2,887,232.000	
	3.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20421006	1,600,000.000	1,515,376.000	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20330815	4,000,000.000	3,772,840.000	
	3.625% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20340413	3,500,000.000	3,438,155.000	
	3.625% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20390531	2,000,000.000	1,928,960.000	
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20350612	3,900,000.000	3,843,645.000	
ノルウェー・クローネ 小計			35,988,028.500 (532,262,942)	
ポーランド・ズロチ	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	3,072,712.700	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,501,587.200	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,522,790.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	2,114,090.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	5,000,000.000	4,091,900.000	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	3,700,000.000	3,674,248.000	

	7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	5,000,000.000	5,407,300.000	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	5,000,000.000	5,260,500.000	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725	7,000,000.000	7,027,720.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20341025	4,500,000.000	4,396,410.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300125	4,000,000.000	4,037,160.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20270125	1,000,000.000	946,620.000	
	4.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300725	2,900,000.000	2,857,573.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20280125	100,000.000	90,004.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20351025	100,000.000	97,065.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	859,037.980	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,512,066.500	
ポーランド・ズロチ 小計			54,468,784.380 (2,226,683,905)	
マレーシア・リンギット	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,393,858.670	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	3,378,000.000	3,572,809.260	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,800,000.000	1,894,230.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	741,314.410	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,474,091.000	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,915,817.660	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,503,671.000	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,304,058.000	

		4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,051,681.200	
		3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,569,266.500	
		3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,212,693.300	
		4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,173,450.500	
		4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	2,200,000.000	2,397,824.000	
		4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	2,000,000.000	2,264,040.000	
		3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,373,109.200	
		4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,394,832.000	
		3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	2,000,000.000	2,066,020.000	
		3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	2,550,000.000	2,592,355.500	
		4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,736,628.500	
		2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,744,074.000	
		3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	1,400,000.000	1,422,260.000	
		4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	1,900,000.000	2,132,997.000	
		4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	523,555.000	
		4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	2,200,000.000	2,401,432.000	
		3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	1,000,000.000	1,012,180.000	
		4.054% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390418	1,200,000.000	1,256,196.000	
		4.18% MALAYSIAN GOVERNMENT 20440516	1,500,000.000	1,586,025.000	
		3.336% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300515	1,000,000.000	1,009,310.000	

	3.476% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350702	50,000.000	50,292.500	
	3.917% MALAYSIAN GOVERNMENT 20550715	30,000.000	30,167.400	
マレーシア・リンギット 小計			49,800,239.600 (1,750,822,043)	
メキシコ・ペソ	8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	18,506,718.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	14,000,000.000	13,583,360.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	37,000,000.000	31,843,680.000	
	7.5% MEXICAN BONOS 20330526	30,000,000.000	28,185,300.000	
	7% MEXICAN BONOS 20260903	23,000,000.000	22,852,110.000	
	8% MEXICAN BONOS 20350524	5,000,000.000	4,742,100.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20290301	20,000,000.000	20,243,000.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20280302	10,000,000.000	10,135,700.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20300228	10,000,000.000	10,102,500.000	
	8% MEXICAN BONOS 20360221	1,000,000.000	942,590.000	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	27,882,697.600	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,614,712.780	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	29,900,891.520	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	18,035,078.760	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	44,515,000.000	43,374,080.550	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	29,654,000.000	25,581,319.640	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	35,944,000.000	33,826,538.960	
メキシコ・ペソ 小計			349,352,377.810 (2,770,154,745)	
ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	330,828.680	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	239,598.000	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	776,560.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	406,564.100	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	476,415.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	465,955.000	

		0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	226,417.800	
		0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	251,696.000	
		Finland Government Bond 20300915	500,000.000	442,895.000	
		0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	162,320.000	
		0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	518,382.000	
		FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	196,160.000	
		0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	272,925.000	
		1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	800,000.000	738,040.000	
		1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	267,402.600	
		2.75% FINLAND GOVERNMENT BOND 20380415	400,000.000	378,300.000	
		3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20330915	600,000.000	606,942.000	
		2.875% FINLAND GOVERNMENT BOND 20290415	1,000,000.000	1,021,950.000	
		2.95% FINLAND GOVERNMENT BOND 20550415	400,000.000	341,716.000	
		3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20340915	600,000.000	602,670.000	
		2.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20300415	500,000.000	502,415.000	
		3.2% FINLAND GOVERNMENT BOND 20450415	350,000.000	331,411.500	
		3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20350915	500,000.000	498,335.000	
		2.625% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320415	100,000.000	99,743.000	
		0.75% Austria Government Bond 20261020	626,000.000	617,918.340	
		1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	540,920.800	

		1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	114,096.000	
		0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,250,700.800	
		2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	320,430.600	
		0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,163,340.000	
		0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,207,936.000	
		Austria Government Bond 20300220	980,000.000	883,195.600	
		0.75% Austria Government Bond 20510320	1,200,000.000	627,708.000	
		Austria Government Bond 20401020	400,000.000	240,044.000	
		0.85% Austria Government Bond 21200630	750,000.000	229,305.000	
		Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	1,048,944.000	
		0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	438,720.000	
		0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	105,123.000	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	1,800,000.000	1,684,242.000	
		0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	1,500,000.000	1,346,700.000	
		1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	1,000,000.000	720,070.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	1,300,000.000	1,313,039.000	
		3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20531020	500,000.000	447,615.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20290523	200,000.000	204,772.000	
		3.45% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20301020	800,000.000	838,392.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20340220	500,000.000	501,250.000	

		3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20390715	500,000.000	493,030.000	
		2.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20291020	800,000.000	806,280.000	
		2.95% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20350220	300,000.000	299,238.000	
		1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,620,460.300	
		1.9% Belgium Government Bond 20380622	758,000.000	632,149.260	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	812,195.160	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	441,447.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,077,879.000	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	379,865.200	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	485,352.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,437,954.300	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	1,350,000.000	1,200,703.500	
		0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,423,875.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	439,985.000	
		0.1% Belgium Government Bond 20300622	420,000.000	375,232.200	
		0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	539,030.800	
		Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,150,932.000	
		Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,358,560.000	
		0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	159,784.400	
		0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	1,400,000.000	1,189,020.000	

		1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	438,384.000	
		2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	800,000.000	728,944.000	
		3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	1,500,000.000	1,505,970.000	
		3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	600,000.000	510,684.000	
		3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20430622	700,000.000	662,011.000	
		2.85% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20341022	1,100,000.000	1,075,437.000	
		3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20550622	1,000,000.000	876,890.000	
		2.7% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20291022	100,000.000	101,247.000	
		3.1% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20350622	200,000.000	197,944.000	
		3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20420622	700,000.000	666,267.000	
		2.6% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20301022	550,000.000	551,122.000	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,261,877.100	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,342,224.320	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,022,504.000	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,280,562.920	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,541,288.320	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,705,000.000	2,001,294.900	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	1,371,000.000	1,533,998.190	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	2,725,000.000	3,129,417.250	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,103,529.180	

		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,174,000.000	1,200,332.820	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,708,000.000	2,466,311.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	2,403,839.910	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	2,200,000.000	2,149,752.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,213,474.000	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	3,470,000.000	2,370,495.800	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,837,737.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,903,282.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	4,700,000.000	4,429,233.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,769,240.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	3,150,000.000	1,416,996.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,594,687.500	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,800,000.000	2,170,868.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,919,860.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	3,500,000.000	3,151,190.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,900,000.000	1,711,064.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,900,000.000	1,687,466.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	2,400,000.000	1,792,272.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,879,820.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,700,000.000	767,448.000	

		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,600,000.000	1,401,456.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,000,000.000	876,450.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	3,100,000.000	2,673,564.000	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	1,600,000.000	1,278,544.000	
		1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,585,655.000	
		1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	2,650,000.000	1,940,860.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	3,200,000.000	3,197,120.000	
		2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	2,400,000.000	2,377,704.000	
		2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,000,000.000	991,290.000	
		1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,000,000.000	733,680.000	
		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330815	2,400,000.000	2,419,704.000	
		2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,513,050.000	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340215	2,400,000.000	2,339,520.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20540815	2,100,000.000	1,795,584.000	
		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20410515	1,200,000.000	1,131,828.000	
		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340815	3,500,000.000	3,507,105.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20350215	1,900,000.000	1,881,361.000	
		2.9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20560815	1,250,000.000	1,153,312.500	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20350215	800,000.000	792,432.000	
		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20350815	1,600,000.000	1,591,616.000	

		GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	2,100,000.000	886,032.000	
		2.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260917	1,000,000.000	1,007,830.000	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20261210	100,000.000	100,111.000	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270311	2,000,000.000	2,008,400.000	
		1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270610	100,000.000	99,621.000	
		1.9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270916	100,000.000	99,949.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	2,800,000.000	2,743,888.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	2,600,000.000	2,523,118.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,964,450.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	424,934.600	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	1,000,000.000	1,006,930.000	
		2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20281019	100,000.000	101,205.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	100,000.000	100,146.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	1,100,000.000	1,101,793.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291011	10,000.000	10,149.600	
		2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300418	500,000.000	505,070.000	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301010	400,000.000	399,704.000	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,675,902.600	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,927,000.000	3,430,502.540	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	2,949,735.060	

		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	2,964,000.000	2,791,495.200	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,432,851.460	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,374,880.600	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	1,590,148.040	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,099,000.000	5,166,816.700	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,788,000.000	2,475,548.840	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	5,063,447.190	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,773,120.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	5,369,000.000	4,270,663.670	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	703,708.320	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	3,050,000.000	2,988,085.000	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,770,000.000	2,166,721.700	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,342,302.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	1,739,712.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	5,195,610.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	6,350,000.000	5,370,576.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,712,004.000	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	3,250,000.000	1,896,115.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	4,550,000.000	4,242,056.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,784,200.000	

		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,230,932.600	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,500,000.000	1,558,150.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	5,000,000.000	4,350,650.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	980,000.000	248,586.800	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	2,400,000.000	1,291,872.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	5,200,000.000	4,355,260.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	4,000,000.000	3,886,040.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,600,000.000	1,120,626.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	4,200,000.000	3,445,638.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	3,000,000.000	2,244,690.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	4,300,000.000	4,156,251.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	4,100,000.000	3,818,822.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	807,880.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	2,100,000.000	1,639,785.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260924	3,200,000.000	3,217,728.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20330525	4,600,000.000	4,551,194.000	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290225	4,300,000.000	4,352,116.000	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20331125	3,200,000.000	3,260,640.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20490625	700,000.000	574,518.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270924	3,100,000.000	3,125,420.000	

		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550525	1,200,000.000	977,676.000	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300225	4,600,000.000	4,633,350.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20341125	3,700,000.000	3,590,702.000	
		3.6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20420525	1,200,000.000	1,141,548.000	
		3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20560525	1,100,000.000	979,374.000	
		3.2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350525	2,700,000.000	2,645,487.000	
		2.4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280924	1,500,000.000	1,504,845.000	
		2.7% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310225	1,200,000.000	1,195,656.000	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,229,846.640	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	1,929,096.000	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	1,842,837.360	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,460,293.000	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,879,000.000	1,709,852.420	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,153,096.000	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,301,967.000	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,115,352.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	1,200,000.000	836,244.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,253,700.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	1,300,000.000	1,266,863.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,450,000.000	599,691.000	

		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,129,843.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	617,733.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	838,800.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	1,000,000.000	873,140.000	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	1,500,000.000	1,106,190.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715	900,000.000	891,144.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300115	1,300,000.000	1,313,091.000	
		3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20440115	600,000.000	597,666.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20340715	1,000,000.000	981,210.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20350715	800,000.000	777,312.000	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,176,122.700	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,611,083.280	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,311,954.780	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,910,765.150	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,271,948.300	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	2,051,441.280	
		1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,059,018.120	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	674,105.520	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,425,675.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,514,741.400	

		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,650,000.000	1,464,540.000	
		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,700,054.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,194,141.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,094,141.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,592,942.000	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	2,470,000.000	2,468,295.700	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,450,000.000	1,359,157.500	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	2,900,000.000	2,963,075.000	
		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,143,250.000	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,802,625.000	
		0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,315,784.000	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,112,683.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,228,875.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,846,260.000	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,992,123.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	2,151,842.000	
		1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,125,330.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	2,600,000.000	2,350,426.000	
		1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	721,500.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	1,200,000.000	899,976.000	

		0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,812,125.000	
		0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,583,154.000	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	1,100,000.000	716,463.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	560,000.000	322,756.000	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	2,300,000.000	2,191,371.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,691,437.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	2,300,000.000	2,018,480.000	
		0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,600,000.000	2,438,514.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	524,880.000	
		1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	295,695.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	1,800,000.000	1,823,580.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,600,000.000	1,542,336.000	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	2,300,000.000	2,189,830.000	
		2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	1,000,000.000	1,010,780.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	1,500,000.000	1,581,960.000	
		4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	1,800,000.000	1,953,522.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	3,100,000.000	3,262,843.000	
		3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,500,000.000	1,544,475.000	
		4.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20430901	1,600,000.000	1,668,560.000	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	1,200,000.000	1,212,252.000	

		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311030	900,000.000	958,122.000	
		3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	1,200,000.000	1,255,872.000	
		4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	2,100,000.000	2,268,315.000	
		3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280801	700,000.000	729,848.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260915	900,000.000	916,038.000	
		4.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340301	2,100,000.000	2,243,451.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,590,960.000	
		4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290201	600,000.000	633,348.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270215	200,000.000	202,368.000	
		3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,000,000.000	1,035,320.000	
		4.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20391001	2,000,000.000	2,060,800.000	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290701	400,000.000	412,620.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340701	1,600,000.000	1,664,160.000	
		4.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20371030	50,000.000	51,809.000	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310715	1,200,000.000	1,237,260.000	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270715	1,500,000.000	1,535,475.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350201	500,000.000	517,905.000	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291001	200,000.000	203,652.000	
		4.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20541001	1,000,000.000	972,800.000	
		3.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311115	1,300,000.000	1,315,873.000	

		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271015	800,000.000	808,760.000	
		3.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350801	1,000,000.000	1,015,060.000	
		4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460430	200,000.000	198,310.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20401001	300,000.000	296,322.000	
		2.55% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270225	800,000.000	805,032.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300701	500,000.000	506,185.000	
		2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280615	500,000.000	504,975.000	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320715	1,700,000.000	1,720,978.000	
		3.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20351001	600,000.000	605,232.000	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301001	1,500,000.000	1,497,675.000	
		2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270826	200,000.000	199,796.000	
		2.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290115	300,000.000	299,586.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	1,254,000.000	1,392,604.620	
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,331,506.640	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,117,932.850	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,597,199.600	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,845,709.200	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,544,000.000	1,739,686.560	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,522,096.490	

4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,580,772.600	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,313,000.000	1,423,909.110	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,414,938.760	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	2,006,000.000	2,173,681.540	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,192,589.280	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,504,000.000	1,593,939.200	
4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	836,768.400	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	626,957.150	
3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	743,003.550	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	964,661.410	
2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	738,971.940	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	474,842.500	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	777,112.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	678,765.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	710,467.500	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	913,957.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	398,502.000	
0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	275,205.000	
0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	485,825.000	
0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	716,616.000	

		IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	687,288.000	
		0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	264,776.000	
		0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	85,282.000	
		3% IRISH TREASURY 20431018	200,000.000	188,430.000	
		2.6% IRISH TREASURY 20341018	300,000.000	293,064.000	
		3.15% IRISH TREASURY 20551018	320,000.000	287,955.200	
		6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	887,939.250	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,504,135.230	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	340,609.360	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	687,920.040	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	1,371,000.000	1,320,780.270	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	396,507.700	
		2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	363,621.940	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	2,975,623.560	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,001,705.480	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,752,000.000	1,499,221.440	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,250,000.000	1,053,100.000	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,610,669.500	
		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,886,605.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,676,762.500	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,026,486.500	

		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,357,688.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	2,200,000.000	1,782,088.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,838,810.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,553,392.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	3,950,000.000	3,504,203.000	
		0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	3,800,000.000	3,535,368.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	2,560,000.000	2,342,195.200	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,700,000.000	900,728.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,600,000.000	2,543,762.000	
		1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,251,008.000	
		1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,600,000.000	1,139,376.000	
		0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,912,614.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	287,033.500	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	2,500,000.000	2,381,050.000	
		0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	700,000.000	523,635.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,666,072.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	393,576.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	2,200,000.000	2,140,820.000	
		0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,838,067.000	
		1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	1,600,000.000	1,032,448.000	

		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	3,100,000.000	2,922,060.000	
		2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,700,000.000	1,667,394.000	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,300,000.000	1,231,737.000	
		3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	2,600,000.000	2,638,948.000	
		3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730	2,100,000.000	2,162,244.000	
		3.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20331031	1,500,000.000	1,558,245.000	
		3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290531	1,400,000.000	1,457,834.000	
		3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20340430	2,600,000.000	2,633,852.000	
		2.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270531	200,000.000	201,682.000	
		4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20541031	1,000,000.000	972,030.000	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20341031	1,600,000.000	1,639,808.000	
		3.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310730	1,200,000.000	1,227,012.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300131	200,000.000	202,092.000	
		3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350430	1,200,000.000	1,195,968.000	
		2.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280531	500,000.000	503,160.000	
		3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410131	500,000.000	485,410.000	
		3.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20351031	1,300,000.000	1,294,514.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,579,652.730	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,888,391.480	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,858,000.000	2,115,853.240	

		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,199,342.560	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	1,926,397.200	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,699,000.000	1,992,621.180	
		4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20370415	850,000.000	918,263.500	
		4.125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20270414	680,000.000	703,228.800	
		3.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20300215	630,000.000	672,084.000	
		2.125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20281017	1,300,000.000	1,303,445.000	
		4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20450215	570,000.000	594,874.800	
		2.25% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20340418	720,000.000	682,596.000	
		1.95% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20290615	1,000,000.000	992,670.000	
		0.475% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20301018	900,000.000	818,523.000	
		0.7% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20271015	620,000.000	604,636.400	
		0.9% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20351012	750,000.000	607,357.500	
		1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20520412	630,000.000	330,252.300	
		0.3% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20311017	750,000.000	655,207.500	
		1.15% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20420411	520,000.000	358,779.200	
		1.65% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20320716	570,000.000	533,121.000	
		3.5% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20380618	500,000.000	504,205.000	
		2.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20341020	630,000.000	623,662.200	
		3.625% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20540612	240,000.000	224,872.800	

		3% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20350615	300,000.000	297,918.000	
		3.375% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20400615	300,000.000	292,830.000	
	ユーロ 小計			598,650,024.280 (104,081,293,221)	
国債証券 合計				346,096,709,260 [346,096,709,260]	
合計				346,096,709,260 [346,096,709,260]	

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券	286銘柄	100%	46.1%
イギリス・ポンド	国債証券	62銘柄	100%	5.7%
イスラエル・シュケル	国債証券	13銘柄	100%	0.4%
オーストラリア・ドル	国債証券	28銘柄	100%	1.2%
オフショア・人民元	国債証券	82銘柄	100%	11.3%
カナダ・ドル	国債証券	42銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券	23銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	100%	0.2%
デンマーク・クローネ	国債証券	8銘柄	100%	0.2%
ニュージーランド・ドル	国債証券	14銘柄	100%	0.3%
ノルウェー・クローネ	国債証券	11銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券	17銘柄	100%	0.6%
マレーシア・リンギット	国債証券	30銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	17銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券	408銘柄	100%	30.1%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年9月9日現在	2025年9月8日現在
1．　※1 期首	2023年9月8日	2024年9月10日
期首元本額	136,692,550,176円	94,350,059,834円
期中追加設定元本額	7,339,411,864円	4,761,095,051円
期中一部解約元本額	49,681,902,206円	30,291,033,886円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン	3,578,820,300円	2,828,391,027円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（毎月分配型）	74,819,549,026円	48,321,826,502円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（年1回決算型）	672,034,345円	779,747,561円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	23,749,159円	27,798,955円

	ｉＦｒｅｅ Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	641,563,821円	505,553,169円
	ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	3,035,489,065円	3,382,075,391円
	ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（奇数月決算型）	102,242,888円	99,127,135円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	352,019円	452,067円
	ＤＣ・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン	5,186,316,965円	5,390,657,348円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	8,750,476円	8,533,477円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	9,885,771円	9,682,553円
	ダイワ国内ＲＥＩＴインデックス（投資一任専用）	5,652,304円	7,967,562円
	ダイワ・ノーロード Ｊ－ＲＥＩＴファンド	86,270,280円	65,815,111円
	ダイワファンドラップ Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	3,999,594,498円	5,051,263,663円
	ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	843,765,822円	1,070,024,485円
	ダイワファンドラップオンライン Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	609,719,689円	669,829,082円
	スタイル9（6資産分散・保守型）	53,416円	55,864円
	スタイル9（6資産分散・バランス型）	1,843,754円	3,288,033円
	スタイル9（6資産分散・積極型）	1,002,513円	1,693,554円
	スタイル9（8資産分散・保守型）	73,843円	62,687円
	スタイル9（8資産分散・バランス型）	1,367,883円	2,481,763円
	スタイル9（8資産分散・積極型）	726,159円	3,683,245円
	ダイワ・インデックスセレクト Ｊ－ＲＥＩＴ	721,235,838円	590,110,765円
計		94,350,059,834円	68,820,120,999円
2.	期末日における受益権の総数	94,350,059,834口	68,820,120,999口

3. ※2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券　755,000,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券　799,500,000円

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年9月10日 至2025年9月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年9月8日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年9月9日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2025年9月8日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	2,623,019,802	27,241,171,946
合計	2,623,019,802	27,241,171,946

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

種類	2024年9月9日現在				2025年9月8日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
不動産投信指数先物取引								
買建	9,695,784,000	-	9,679,600,000	△16,184,000	10,618,160,000	-	10,558,800,000	△59,360,000
合計	9,695,784,000	-	9,679,600,000	△16,184,000	10,618,160,000	-	10,558,800,000	△59,360,000

（注）　1．時価の算定方法
不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
2．不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4．　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2024年9月9日現在	2025年9月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.2380円 (32,380円)	3.7100円 (37,100円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	4,912	614,000,000	
	サンケイリアルエステート	7,109	676,776,800	
	SOSILA物流リート投	11,073	1,301,077,500	
	東海道リート投資法	4,569	508,986,600	
	三井不動産アコモデーションファンド投資法人	38,316	4,774,173,600	
	森ヒルズリート	25,687	3,629,573,100	
	産業ファンド	40,634	5,160,518,000	
	アドバンス・レジデンス	45,699	7,416,947,700	
	ＡＰＩ投資法人	34,265	4,560,671,500	
	ＧＬＰ投資法人	73,024	9,661,075,200	
	コンフォリア・レジデンシャル	11,252	3,521,876,000	
	日本プロロジスリート	114,246	9,391,021,200	
	星野リゾート・リート	8,917	2,416,507,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	10,968	961,893,600	
	イオンリート投資	26,949	3,535,708,800	
	ヒューリックリート投資法	19,610	3,216,040,000	
	日本リート投資法人	28,332	2,765,203,200	
	積水ハウス・リート投資	66,292	5,243,697,200	
	トーセイ・リート投資法人	4,825	698,177,500	
	ヘルスケア&メディカル投資	5,760	679,104,000	
	サムティ・レジデンシャル	6,148	678,739,200	
	野村不動産マスターＦ	70,720	11,308,128,000	※

	いちごホテルリート投資	3,673	496,589,600	
	ラサールロジポート投資	29,009	4,069,962,700	
	スターアジア不動産投	40,898	2,457,969,800	
	マリモ地方創生リート	4,059	451,766,700	
	三井不ロジパーク	49,006	5,292,648,000	
	日本ホテル＆レジデンシャル投資法人	4,734	375,406,200	
	投資法人みらい	30,560	1,442,432,000	
	三菱地所物流REIT	22,990	2,745,006,000	
	CREロジスティクスファンド	9,415	1,428,255,500	
	ザイマックス・リート	3,600	429,120,000	
	タカラレーベン不動産投	14,593	1,344,015,300	
	日本ビルファンド	131,658	18,629,607,000	
	ジャパンリアルエステイト	113,983	14,681,010,400	
	日本都市ファンド投資法人	115,240	12,941,452,000	
	オリックス不動産投資	88,439	8,543,207,400	
	日本プライムリアルティ	60,018	6,115,834,200	
	NTT都市開発リート投資法人	22,347	3,005,671,500	
	東急リアル・エステート	14,633	2,870,994,600	
	グローバル・ワン不動産投資法人	15,999	2,332,654,200	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	49,068	8,660,502,000	
	森トラストリート投資法人	42,778	3,195,516,600	
	インヴィンシブル投資法人	122,509	8,061,092,200	
	フロンティア不動産投資	39,005	3,412,937,500	
	平和不動産リート	17,044	2,536,147,200	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	43,998	4,175,410,200	
	福岡リート投資法人	12,528	2,257,545,600	
	KDX不動産投資法人	64,715	10,859,177,000	
	いちごオフィスリート投資法人	16,193	1,559,385,900	
	大和証券オフィス投資法人	9,067	3,309,455,000	
	阪急阪神リート投資法人	10,581	1,786,072,800	
	スターツプロシード投資法人	3,710	730,128,000	
	大和ハウスリート投資法人	69,870	8,775,672,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	81,662	6,949,436,200	
	大和証券リビング投資法人	32,778	3,507,246,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	18,608	2,685,134,400	
投資証券 合計			244,834,357,400	
合計			244,834,357,400	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

野村不動産マスターＦ　5,000口

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年9月9日現在 金　額（円）	2025年9月8日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	434,799,819	511,890,251
コール・ローン	337,551,711	376,644,293
投資信託受益証券	1,922,377,070	1,934,968,206
投資証券	40,541,502,106	49,506,376,297
派生商品評価勘定	146,176,066	23,181,396
未収入金	2,774,040	3,621,685
未収配当金	62,361,722	78,758,772
差入委託証拠金	349,690,914	450,724,089
流動資産合計	43,797,233,448	52,886,164,989
資産合計	43,797,233,448	52,886,164,989
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,297,983	17,682,217
未払金	35,251,811	77,577,357
未払解約金	3,653,600	15,500,000
流動負債合計	46,203,394	110,759,574
負債合計	46,203,394	110,759,574
純資産の部		
元本等		

元本　※1	11,178,461,295	12,844,489,558
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	32,572,568,759	39,930,915,857
元本等合計	43,751,030,054	52,775,405,415
純資産合計	43,751,030,054	52,775,405,415
負債純資産合計	43,797,233,448	52,886,164,989

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2024年9月10日 至2025年9月8日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のない有価証券については投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。また、市場価格のある有価証券については、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の１口当たり純資産額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年9月9日現在	2025年9月8日現在
1. ※1 期首	2023年9月8日	2024年9月10日
期首元本額	10,116,723,115円	11,178,461,295円
期中追加設定元本額	2,114,341,286円	2,570,076,503円
期中一部解約元本額	1,052,603,106円	904,048,240円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワバランスファンド2023-01（適格機関投資家専用）	82,616,918円	-円

ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）	2,096,952,787円	2,812,777,388円
ダイワファンドラップオンライン 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）	352,447,616円	273,241,143円
Ｄ－Ｉ's グローバルＲＥＩＴインデックス	1,480,147円	1,381,357円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	19,599,696円	22,460,237円
ｉＦｒｅｅ 外国ＲＥＩＴインデックス	640,252,524円	593,646,532円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	2,473,064,144円	3,063,070,087円
グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成型）	380,225,890円	444,953,671円
グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）	234,595,966円	219,435,626円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	3,804,284円	6,569,090円
ＤＣダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックスファンド	4,219,241,496円	4,619,615,827円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	7,239,335円	7,868,075円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	8,245,286円	8,987,650円
ダイワ海外ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	4,525,126円	6,537,165円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	130,015,618円	127,623,683円
スタイル9（6資産分散・保守型）	27,608円	24,685円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	1,251,871円	2,397,622円
スタイル9（6資産分散・積極型）	1,058,285円	3,296,331円
スタイル9（8資産分散・保守型）	35,065円	38,792円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	834,483円	1,678,464円
スタイル9（8資産分散・積極型）	847,750円	3,720,526円

	ダイワ・インデックスセレクト グローバルＲＥＩＴ	198,278,659円	163,286,978円
	ダイワ・ノーロード グローバルＲＥＩＴファンド	63,434,254円	54,624,680円
	ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	17,587,214円	252,198,675円
	ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	82,346,237円	-円
	ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	79,777,774円	78,001,867円
	ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	78,675,262円	77,053,407円
	計	11,178,461,295円	12,844,489,558円
2.	期末日における受益権の総数	11,178,461,295口	12,844,489,558口

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年9月10日 至2025年9月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年9月9日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2025年9月8日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	158,456,830	55,286,546
投資証券	6,174,110,709	△2,028,340,887
合計	6,332,567,539	△1,973,054,341

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．不動産投信関連

種類	2024年9月9日現在				2025年9月8日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								

不動産投信指数先物取引								
買建	1,176,218,395	-	1,322,394,461	146,176,066	1,402,067,857	-	1,404,233,764	2,165,907
合計	1,176,218,395	-	1,322,394,461	146,176,066	1,402,067,857	-	1,404,233,764	2,165,907

（注）　1．時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2．通貨関連

種類	2024年9月9日現在				2025年9月8日現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	366,909,447	-	359,611,464	△7,297,983	428,495,311	-	431,828,583	3,333,272
アメリカ・ドル	267,038,607	-	261,775,030	△5,263,577	251,382,382	-	252,991,743	1,609,361
ユーロ	99,870,840	-	97,836,434	△2,034,406	177,112,929	-	178,836,840	1,723,911
合計	366,909,447	-	359,611,464	△7,297,983	428,495,311	-	431,828,583	3,333,272

（注）　1．時価の算定方法

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

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

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

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

・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2024年9月9日現在	2025年9月8日現在
1口当たり純資産額	3.9139円	4.1088円
（1万口当たり純資産額）	(39,139円)	(41,088円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REAL ESTATE ETF	140,940	13,032,721.800	
	アメリカ・ドル 小計			13,032,721.800 (1,934,968,206)	
投資信託受益証券 合計				1,934,968,206 [1,934,968,206]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	25,585	301,647.150	
		URBAN EDGE PROPERTIES	27,617	585,480.400	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	21,380	308,085.800	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	31,229	6,102,458.890	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	67,388	12,281,463.000	
		BXP INC	31,990	2,457,791.700	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	28,097	219,999.510	
		VORNADO REALTY TRUST	36,676	1,514,352.040	

EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	9,091	210,911.200	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	15,451	514,518.300	
NEXPOINT RESIDENTIAL	4,831	167,490.770	
EQUITY RESIDENTIAL	75,101	5,017,497.810	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	48,594	633,665.760	
EPR PROPERTIES	16,706	889,761.560	
CITY OFFICE REIT INC	8,863	61,509.220	
GLOBAL NET LEASE INC	41,594	333,999.820	
EQUINIX INC	21,483	16,620,967.440	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	22,066	576,143.260	
CHATHAM LODGING TRUST	9,853	73,010.730	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	13,177	1,327,978.060	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	5,248	82,183.680	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	10,300	30,694.000	
HOST HOTELS & RESORTS INC	152,358	2,655,599.940	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	69,796	2,432,390.600	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	72,728	223,274.960	
RLJ LODGING TRUST	32,902	259,267.760	
FARMLAND PARTNERS INC	8,636	92,577.920	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	17,053	124,486.900	
KIMCO REALTY CORP	148,577	3,381,612.520	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	13,195	100,282.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	77,182	1,393,906.920	
WHITESTONE REIT	9,836	129,638.480	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	60,360	2,923,234.800	
PIEDMONT REALTY TRUST INC CLASS A	26,473	232,432.940	
PARK HOTELS & RESORTS INC	43,901	526,812.000	
INVITATION HOMES INC	125,197	3,787,209.250	
OUTFRONT MEDIA INC	30,456	554,908.320	
LAMAR ADVERTISING CO-A	19,320	2,472,960.000	
JBG SMITH PROPERTIES	15,745	357,883.850	

		ALEXANDER & BALDWIN INC	15,969	310,437.360	
		GLADSTONE LAND CORP	6,732	60,453.360	
		AMERICOLD REALTY TRUST	57,531	803,708.070	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	12,928	79,377.920	
		VICI PROPERTIES INC	232,082	7,797,955.200	
		BRT APARTMENTS CORP	2,485	38,964.800	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	6,039	346,034.700	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	43,379	1,336,073.200	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	8,417	188,540.800	
		BROADSTONE NET LEASE INC	41,525	775,687.000	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	23,552	132,833.280	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	10,370	216,940.400	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	51,258	924,694.320	
		PARAMOUNT GROUP INC	40,444	305,352.200	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	29,603	235,935.910	
		NETSTREIT CORP	17,944	322,453.680	
		CTO REALTY GROWTH INC	6,246	108,805.320	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	51,859	2,224,232.510	
		STAG INDUSTRIAL INC	40,986	1,514,842.560	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	2,366	36,602.020	
		POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	4,914	78,427.440	
		PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	27,541	995,607.150	
		ORION OFFICE REIT INC	9,048	27,234.480	
		DIGITAL CORE REIT UNITS	196,700	99,333.500	
		VENTAS INC	99,117	6,731,035.470	
		CARETRUST REIT INC	46,327	1,572,338.380	
		INVENTRUST PROPERTIES CORP	17,036	510,398.560	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	67,219	1,895,575.800	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	52,257	994,450.710	
		UMH PROPERTIES INC	16,851	256,809.240	
		CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	3,125	100,000.000	

		NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C	7,709	29,294.200	
		PEAKSTONE REALTY TRUST CLASS E	7,600	103,284.000	
		NET LEASE OFFICE PROPERTIES	3,253	95,605.670	
		AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	35,029	1,496,789.170	
		LINEAGE INC	13,053	529,821.270	
		MODIV INDUSTRIAL INC CLASS C	1,600	24,416.000	
		SILA RLTY TR INC TRUST	12,111	308,346.060	
		CURBLINE PROPERTIES	20,797	477,291.150	
		FRONTVIEW REIT INC	3,619	48,530.790	
		MILLROSE PROPERTIES INC CLASS A	26,413	903,588.730	
		IRON MOUNTAIN INC	64,799	5,973,171.820	
		TERRENO REALTY CORP	22,692	1,340,643.360	
		SUN COMMUNITIES INC	26,351	3,420,886.820	
		ACADIA REALTY TRUST	28,762	578,403.820	
		ALEXANDER'S INC	462	108,320.520	
		PROLOGIS INC	203,798	23,161,642.700	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	33,813	2,863,961.100	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	36,941	161,432.170	
		SAUL CENTERS INC	2,561	85,306.910	
		VERIS RESIDENTIAL INC	17,484	283,765.320	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	23,464	2,612,951.040	
		COUSINS PROPERTIES INC	36,878	1,086,794.660	
		SITE CENTERS CORP	10,022	93,605.480	
		EASTGROUP PROPERTIES INC	11,517	1,936,813.890	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	14,140	3,791,216.800	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	29,078	1,519,325.500	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	17,050	1,750,523.500	
		GETTY REALTY CORP	11,202	323,401.740	
		WELLTOWER INC	136,444	22,898,032.080	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	152,582	2,805,982.980	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	23,678	754,144.300	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	36,597	105,399.360	
		KILROY REALTY CORP	23,380	998,326.000	

		LTC PROPERTIES INC	9,899	362,501.380	
		LXP INDUSTRIAL TRUST	64,956	594,347.400	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	25,709	3,738,088.600	
		MACERICH CO/THE	55,488	1,040,400.000	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	41,990	2,591,622.800	
		NATL HEALTH INVESTORS INC	10,255	803,992.000	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	41,279	1,789,444.650	
		REALTY INCOME CORP	198,341	11,759,637.890	
		COPT DEFENSE PROPERTIES TRUST	24,740	758,528.400	
		PUBLIC STORAGE	34,676	10,326,512.800	
		REGENCY CENTERS CORP	35,881	2,643,712.080	
		SAFEHOLD INC	9,705	158,191.500	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	24,856	864,491.680	
		SL GREEN REALTY CORP	15,597	966,858.030	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	46,467	191,444.040	
		UDR INC	66,213	2,588,266.170	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,798	115,725.280	
		WP CAREY INC	48,093	3,276,095.160	
		ELME	19,362	333,413.640	
		AGREE REALTY CORP	24,116	1,761,673.800	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	63,559	2,741,935.260	
		CUBESMART	50,065	2,089,713.100	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	42,952	410,621.120	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	69,530	11,350,077.200	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	46,607	6,864,278.960	
		CENTERSPACE	3,606	218,163.000	
		KITE REALTY GROUP TRUST	48,276	1,122,899.760	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3,397	80,305.080	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	9,974	131,856.280	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	45,311	388,768.380	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	131,952	608,298.720	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES C	16,005	26,888.400	
		DOUGLAS EMMETT INC	36,775	621,865.250	

	MANULIFE US REAL ESTATE INV	341,662	25,966.310	
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	171,300	40,255.500	
	EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	0.000	
	PRIME US REIT	155,920	29,780.720	
アメリカ・ドル 小計			259,068,863.850 (38,463,954,216)	
イギリス・ポンド	WAREHOUSE REIT PLC	86,763	98,562.760	
	HELICAL PLC	23,433	50,615.280	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	74,423	29,099.390	
	HAMMERSON REIT PLC	97,368	266,983.050	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	144,983	130,774.660	
	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITE	76,976	4,164.400	
	CLS HOLDINGS PLC	29,656	16,785.290	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	118,918	87,642.560	
	REGIONAL REIT LTD	36,280	44,624.400	
	NEWRIVER REIT PLC	101,749	72,241.790	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	437,179	618,608.280	
	CUSTODIAN REIT PLC	96,834	74,659.010	
	PRS REIT PLC/THE	113,932	111,653.360	
	SOCIAL HOUSING REIT PLC	72,416	50,039.450	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	138,827	132,579.780	
	AEW UK REIT PLC	32,682	33,858.550	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	278,945	221,761.270	
	HOME REIT PLC	117,587	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	166,740	899,562.300	
	SEGRO PLC	302,927	1,901,775.700	
	UNITE GROUP PLC/THE	92,998	657,960.850	
	BRITISH LAND CO PLC	223,641	752,775.600	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	90,917	272,751.000	
	DERWENT LONDON PLC	25,134	421,245.840	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	548,938	494,044.200	
	WORKSPACE GROUP PLC	30,965	123,705.170	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	48,904	309,562.320	
	BIG YELLOW GROUP PLC	44,030	407,277.500	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	518,447	936,315.280	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	104,674	51,028.570	

	TRITAX BIG BOX REIT PLC	555,249	759,580.630	
イギリス・ポンド 小計			10,032,238.240 (2,009,657,964)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	169,724	379,842.310	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	50,267	534,840.880	
	REIT 1 LTD	44,595	1,070,280.000	
イスラエル・シュケル 小計			1,984,963.190 (88,237,768)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	249,153	1,831,274.550	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	88,653	65,603.220	
	ABACUS STORAGE KING STAPLED UNITS	122,443	172,032.410	
	DIGICO INFRASTRUCTURE REIT STAPLED	88,604	266,698.040	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	75,197	252,661.920	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	308,949	139,027.050	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	123,548	412,650.320	
	RURAL FUNDS GROUP	86,746	165,684.860	
	WAYPOINT REIT	155,667	421,857.570	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	151,349	687,124.460	
	CENTURIA OFFICE REIT	86,351	107,075.240	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	192,289	453,802.040	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	407,518	554,224.480	
	REGION GROUP	269,372	651,880.240	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	60,426	148,647.960	
	NATIONAL STORAGE REIT	322,324	786,470.560	
	DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	48,020	133,015.400	
	SCENTRE GROUP	1,206,580	4,898,714.800	
	ARENA REIT	92,663	378,065.040	
	BWP TRUST	128,921	465,404.810	
	GPT GROUP	443,740	2,405,070.800	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	119,830	503,286.000	
	MIRVAC GROUP	914,053	2,138,884.020	

	STOCKLAND	555,914	3,457,785.080	
	ABACUS GROUP UNIT	100,940	122,642.100	
	GOODMAN GROUP	470,513	15,752,775.240	
	VICINITY CENTRES	898,437	2,299,998.720	
	CHARTER HALL GROUP	109,569	2,552,957.700	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	86,862	489,033.060	
オーストラリア・ドル 小計			42,714,347.690 (4,156,533,173)	
カナダ・ドル	NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	7,000	54,180.000	
	PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	11,496	173,934.480	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	11,230	82,989.700	
	SLATE GROCERY REIT	6,100	87,413.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	13,621	249,400.510	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	3,900	53,781.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	27,639	139,853.340	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6,952	547,261.440	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	31,743	391,073.760	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	15,565	208,415.350	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	23,654	459,833.760	
	CHOICE PROPERTIES REIT	37,233	567,803.250	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	3,800	71,136.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	12,000	198,000.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	16,112	435,507.360	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	18,189	782,672.670	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	29,803	360,616.300	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	33,681	628,487.460	

	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	1,650	29,865.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,445	392,530.050	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	12,391	187,723.650	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	14,524	281,475.120	
カナダ・ドル 小計			6,383,953.200 (684,934,339)	
シンガポール・ドル	KEPPEL DC REIT	423,283	986,249.390	
	AIMS APAC REIT	149,400	204,678.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	681,090	633,413.700	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	114,700	82,010.500	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	408,040	248,904.400	
	EC WORLD REIT	36,500	0.000	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	815,477	2,258,871.290	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,304,522	2,948,219.720	
	SUNTEC REIT	510,400	668,624.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	786,300	967,149.000	
	KEPPEL REIT	557,300	543,367.500	
	CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	592,256	530,069.120	
	ESR-REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	146,850	414,117.000	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	155,400	125,874.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	313,801	734,294.340	
	STARHILL GLOBAL REIT	316,000	178,540.000	
	CAPITALAND CHINA TRUST	274,042	211,012.340	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	96,700	404,206.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	482,169	1,007,733.210	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	537,184	746,685.760	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	237,600	141,372.000	
	OUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	513,500	172,022.500	

シンガポール・ドル 小計			14,207,413.770 (1,641,098,365)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	242,388	523,558.080	
ニュージーランド・ドル 小計			523,558.080 (45,800,860)	
ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	8,650	231,820.000	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	6,048	198,072.000	
	STONEWEG EUROPE STAPLED TRUST	64,220	99,541.000	
	HAMBORNER REIT AG	13,318	75,646.240	
	WERELDHAVE NV	7,150	133,419.000	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	20,345	1,781,815.100	
	NSI NV	3,397	72,525.950	
	ICADE	6,192	126,192.960	
	CARMILA	12,358	209,097.360	
	ALTAREA	1,004	98,291.600	
	GECINA SA	10,338	865,807.500	
	KLEPIERRE	43,761	1,467,743.940	
	COVIVIO	10,615	597,093.750	
	MERCIALYS	17,002	184,641.720	
	AEDIFICA	9,420	592,989.000	
	COFINIMMO	7,547	557,723.300	
	RETAIL ESTATES	2,505	170,089.500	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	35,348	766,344.640	
	CARE PROPERTY INVEST	6,928	84,798.720	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	7,352	218,722.000	
	MONTEA NV	4,102	272,783.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	9,559	31,927.060	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	67,116	377,863.080	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	78,179	978,019.290	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	98,529	97,248.120	
ユーロ 小計			10,290,215.830 (1,789,056,924)	
韓国・ウォン	SK REITS LTD	32,181	163,801,290.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT LTD	3,663	366,300.000	

		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	23,689	132,421,510.000	
		LOTTE REIT CO LTD	32,639	128,924,050.000	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	10,468	42,918,800.000	
		JR REIT XXVII	41,466	119,214,750.000	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	10,067	44,043,125.000	
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	41,944	190,425,760.000	
	韓国・ウォン 小計			822,115,585.000 (87,884,157)	
	香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	571,000	542,450.000	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	181,000	394,580.000	
		FORTUNE REIT	350,000	1,704,500.000	
		LINK REIT	597,874	24,811,771.000	
		CHAMPION REIT	425,000	867,000.000	
	香港・ドル 小計			28,320,301.000 (539,218,531)	
投資証券 合計				49,506,376,297 [49,506,376,297]	
合計				51,441,344,503 [51,441,344,503]	

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

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄 投資証券 140銘柄	4.8%	95.2%	78.5%
イギリス・ポンド	投資証券 31銘柄	-%	100%	3.9%
イスラエル・シュケル	投資証券 3銘柄	-%	100%	0.2%
オーストラリア・ドル	投資証券 29銘柄	-%	100%	8.1%
カナダ・ドル	投資証券 22銘柄	-%	100%	1.3%

シンガポール・ドル	投資証券	22銘柄	-%	100%	3.2%
ニュージーランド・ドル	投資証券	1銘柄	-%	100%	0.1%
ユーロ	投資証券	25銘柄	-%	100%	3.5%
韓国・ウォン	投資証券	8銘柄	-%	100%	0.2%
香港・ドル	投資証券	5銘柄	-%	100%	1.0%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年9月9日現在 金　額（円）	2025年9月8日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	195,343,382	799,236,514
国債証券	81,477,050,720	93,656,545,570
地方債証券	5,374,875,336	5,085,705,197
特殊債券	4,402,418,286	4,267,855,688
社債券	7,028,210,200	7,192,700,000
未収入金	-	185,536,000
未収利息	202,543,354	276,219,368
前払費用	17,018,172	35,002,376
流動資産合計	98,697,459,450	111,498,800,713
資産合計	98,697,459,450	111,498,800,713
負債の部		
流動負債		
未払金	-	800,000,000
未払解約金	3,234,488	1,219,686
流動負債合計	3,234,488	801,219,686
負債合計	3,234,488	801,219,686
純資産の部		
元本等		

元本　※1	81,894,612,584	96,635,396,862
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	16,799,612,378	14,062,184,165
元本等合計	98,694,224,962	110,697,581,027
純資産合計	98,694,224,962	110,697,581,027
負債純資産合計	98,697,459,450	111,498,800,713

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	2024年9月9日現在	2025年9月8日現在
1.　※1 期首	2023年9月8日	2024年9月10日
期首元本額	41,118,291,684円	81,894,612,584円
期中追加設定元本額	42,482,462,228円	16,759,962,937円
期中一部解約元本額	1,706,141,328円	2,019,178,659円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
日本債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	3,822,409,530円	5,361,367,589円
日本債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	30,964,825,168円	35,486,306,096円
ｉＦｒｅｅ 日本債券インデックス	2,772,696,062円	2,392,950,447円

	ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	8,115,070,138円	10,620,795,370円
	ダイワ・ライフ・バランス３０	13,104,740,465円	15,137,492,051円
	ダイワ・ライフ・バランス５０	10,972,473,547円	12,847,076,877円
	ダイワ・ライフ・バランス７０	4,447,693,771円	5,284,717,815円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	2,203,900,623円	2,577,699,451円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	1,802,706,364円	2,108,246,375円
	ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	741,243,964円	1,012,512,251円
	ダイワつみたてインデックス日本債券	2,596,469,317円	3,198,791,778円
	ダイワつみたてインデックスバランス３０	55,133,049円	62,666,425円
	ダイワつみたてインデックスバランス５０	29,481,573円	38,609,806円
	ダイワつみたてインデックスバランス７０	24,911,566円	259,182,912円
	ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	192,331,972円	194,578,361円
	ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	48,525,475円	52,403,258円
計		81,894,612,584円	96,635,396,862円
2.	期末日における受益権の総数	81,894,612,584口	96,635,396,862口

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年9月10日 至2025年9月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。

3． 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4． 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

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

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

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

（1口当たり情報）

	2024年9月9日現在	2025年9月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2051円 (12,051円)	1.1455円 (11,455円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
国債証券	465 2年国債	100,000,000	99,705,000	
	466 2年国債	800,000,000	798,176,000	
	467 2年国債	450,000,000	449,370,000	
	469 2年国債	710,000,000	709,552,700	
	470 2年国債	575,000,000	575,373,750	
	473 2年国債	450,000,000	450,112,500	
	474 2年国債	400,000,000	399,284,000	
	475 2年国債	350,000,000	350,584,500	
	150 5年国債	1,450,000,000	1,436,848,500	
	151 5年国債	600,000,000	593,250,000	
	152 5年国債	290,000,000	287,155,100	
	153 5年国債	1,520,000,000	1,498,932,800	
	154 5年国債	1,900,000,000	1,872,868,000	
	155 5年国債	90,000,000	88,932,600	
	156 5年国債	1,870,000,000	1,843,633,000	
	157 5年国債	60,000,000	59,013,600	
	158 5年国債	2,050,000,000	2,011,214,000	
	159 5年国債	200,000,000	195,690,000	
	161 5年国債	810,000,000	796,934,700	
	162 5年国債	280,000,000	274,839,600	
	163 5年国債	1,810,000,000	1,781,981,200	
	164 5年国債	1,200,000,000	1,171,188,000	
	166 5年国債	620,000,000	609,057,000	
	168 5年国債	700,000,000	690,816,000	
	169 5年国債	1,800,000,000	1,770,246,000	
	170 5年国債	300,000,000	295,521,000	
	171 5年国債	650,000,000	635,453,000	
	173 5年国債	150,000,000	147,475,500	

174 5年国債	920,000,000	908,067,600	
175 5年国債	50,000,000	49,692,500	
176 5年国債	745,000,000	743,621,750	
177 5年国債	400,000,000	400,900,000	
178 5年国債	1,075,000,000	1,071,742,750	
179 5年国債	500,000,000	497,840,000	
1 40年国債	30,000,000	27,842,400	
2 40年国債	48,000,000	42,324,000	
3 40年国債	19,000,000	16,434,240	
4 40年国債	54,000,000	45,769,860	
5 40年国債	61,000,000	48,748,760	
6 40年国債	268,000,000	206,435,040	
7 40年国債	190,000,000	137,740,500	
8 40年国債	100,000,000	66,099,000	
9 40年国債	40,000,000	18,574,400	
10 40年国債	290,000,000	160,074,200	
11 40年国債	85,000,000	44,477,100	
12 40年国債	99,000,000	44,848,980	
13 40年国債	252,000,000	111,787,200	
14 40年国債	273,000,000	127,941,450	
15 40年国債	650,000,000	335,211,500	
16 40年国債	710,000,000	399,864,900	
17 40年国債	1,050,000,000	779,394,000	
18 40年国債	550,000,000	510,548,500	
3 CT5年国債	150,000,000	149,352,000	
1 CT10年国債	130,000,000	122,791,500	
345 10年国債	410,000,000	406,773,300	
346 10年国債	20,000,000	19,803,800	
347 10年国債	500,000,000	493,905,000	
348 10年国債	430,000,000	423,859,600	
349 10年国債	430,000,000	422,973,800	
350 10年国債	400,000,000	392,432,000	
351 10年国債	500,000,000	489,225,000	
352 10年国債	150,000,000	146,329,500	
353 10年国債	520,000,000	505,861,200	
355 10年国債	200,000,000	193,306,000	
356 10年国債	600,000,000	578,070,000	
357 10年国債	600,000,000	576,300,000	
358 10年国債	1,280,000,000	1,225,331,200	

359 10年国債	1,060,000,000	1,011,187,000	
360 10年国債	1,380,000,000	1,312,021,200	
361 10年国債	1,250,000,000	1,184,375,000	
362 10年国債	1,530,000,000	1,444,641,300	
363 10年国債	830,000,000	780,664,800	
364 10年国債	1,000,000,000	936,820,000	
365 10年国債	1,180,000,000	1,100,987,200	
366 10年国債	1,500,000,000	1,403,685,000	
367 10年国債	1,250,000,000	1,165,062,500	
368 10年国債	1,300,000,000	1,206,712,000	
369 10年国債	1,370,000,000	1,294,526,700	
370 10年国債	1,250,000,000	1,176,600,000	
371 10年国債	1,200,000,000	1,116,216,000	
372 10年国債	1,180,000,000	1,128,481,200	
373 10年国債	1,260,000,000	1,181,262,600	
374 10年国債	1,170,000,000	1,111,020,300	
375 10年国債	600,000,000	582,282,000	
376 10年国債	858,000,000	815,434,620	
377 10年国債	950,000,000	924,141,000	
378 10年国債	950,000,000	938,163,000	
379 10年国債	700,000,000	696,136,000	
2 30年国債	9,000,000	9,520,470	
3 30年国債	4,000,000	4,221,720	
4 30年国債	8,000,000	8,716,480	
5 30年国債	8,000,000	8,457,840	
6 30年国債	9,000,000	9,642,420	
7 30年国債	12,000,000	12,813,840	
10 30年国債	25,000,000	24,606,500	
11 30年国債	9,000,000	9,234,720	
12 30年国債	11,000,000	11,601,810	
13 30年国債	11,000,000	11,510,950	
14 30年国債	22,000,000	23,711,820	
15 30年国債	21,000,000	22,796,760	
16 30年国債	26,000,000	28,213,380	
17 30年国債	17,000,000	18,298,290	
18 30年国債	20,000,000	21,342,400	
19 30年国債	15,000,000	16,002,750	
20 30年国債	16,000,000	17,349,440	
21 30年国債	16,000,000	17,033,760	

22 30年国債	17,000,000	18,394,850	
23 30年国債	16,000,000	17,284,000	
24 30年国債	15,000,000	16,182,150	
25 30年国債	17,000,000	17,956,760	
26 30年国債	32,000,000	34,060,160	
27 30年国債	120,000,000	128,432,400	
28 30年国債	34,000,000	36,228,700	
29 30年国債	43,000,000	45,080,340	
30 30年国債	56,000,000	57,696,240	
31 30年国債	76,000,000	76,906,680	
32 30年国債	115,000,000	117,038,950	
33 30年国債	95,000,000	92,383,700	
34 30年国債	110,000,000	109,052,900	
35 30年国債	120,000,000	114,975,600	
36 30年国債	138,000,000	131,545,740	
37 30年国債	165,000,000	153,540,750	
38 30年国債	250,000,000	227,012,500	
39 30年国債	105,000,000	96,356,400	
40 30年国債	80,000,000	71,922,400	
41 30年国債	80,000,000	70,467,200	
42 30年国債	200,000,000	175,192,000	
43 30年国債	335,000,000	292,163,550	
44 30年国債	155,000,000	134,499,700	
45 30年国債	200,000,000	166,612,000	
46 30年国債	250,000,000	207,140,000	
47 30年国債	355,000,000	298,302,950	
48 30年国債	300,000,000	241,452,000	
49 30年国債	340,000,000	272,095,200	
50 30年国債	320,000,000	224,576,000	
51 30年国債	350,000,000	216,307,000	
52 30年国債	350,000,000	225,536,500	
53 30年国債	280,000,000	183,428,000	
54 30年国債	290,000,000	197,881,500	
55 30年国債	350,000,000	237,170,500	
56 30年国債	250,000,000	168,127,500	
57 30年国債	315,000,000	210,375,900	
58 30年国債	480,000,000	318,163,200	
59 30年国債	290,000,000	186,026,300	
60 30年国債	250,000,000	167,540,000	

61 30年国債	260,000,000	164,294,000	
62 30年国債	390,000,000	231,429,900	
63 30年国債	270,000,000	154,172,700	
64 30年国債	300,000,000	169,539,000	
65 30年国債	275,000,000	153,815,750	
66 30年国債	440,000,000	243,438,800	
67 30年国債	340,000,000	197,740,600	
68 30年国債	300,000,000	172,746,000	
69 30年国債	300,000,000	176,337,000	
70 30年国債	460,000,000	268,442,200	
71 30年国債	310,000,000	179,366,000	
72 30年国債	300,000,000	172,212,000	
73 30年国債	340,000,000	193,643,600	
74 30年国債	450,000,000	278,761,500	
75 30年国債	360,000,000	241,185,600	
76 30年国債	290,000,000	198,650,000	
77 30年国債	275,000,000	197,535,250	
78 30年国債	260,000,000	176,521,800	
79 30年国債	300,000,000	191,871,000	
80 30年国債	280,000,000	209,098,400	
81 30年国債	350,000,000	247,740,500	
82 30年国債	350,000,000	259,871,500	
83 30年国債	300,000,000	244,611,000	
84 30年国債	280,000,000	222,751,200	
85 30年国債	290,000,000	241,422,100	
86 30年国債	410,000,000	349,074,000	
87 30年国債	80,000,000	74,215,200	
92 20年国債	60,000,000	61,053,000	
93 20年国債	18,000,000	18,342,180	
94 20年国債	45,000,000	45,923,400	
95 20年国債	30,000,000	30,796,800	
96 20年国債	63,000,000	64,452,150	
97 20年国債	25,000,000	25,699,000	
98 20年国債	64,000,000	65,661,440	
99 20年国債	53,000,000	54,523,750	
100 20年国債	35,000,000	36,172,850	
101 20年国債	18,000,000	18,692,100	
102 20年国債	10,000,000	10,413,600	
103 20年国債	21,000,000	21,811,440	

104 20年国債	64,000,000	66,126,080	
105 20年国債	38,000,000	39,339,120	
106 20年国債	16,000,000	16,611,040	
107 20年国債	40,000,000	41,489,200	
108 20年国債	68,000,000	70,087,600	
109 20年国債	60,000,000	61,912,800	
110 20年国債	27,000,000	28,049,760	
111 20年国債	35,000,000	36,548,750	
113 20年国債	170,000,000	177,175,700	
114 20年国債	45,000,000	46,983,150	
115 20年国債	42,000,000	44,023,140	
116 20年国債	27,000,000	28,347,570	
117 20年国債	77,000,000	80,492,720	
118 20年国債	13,000,000	13,549,510	
119 20年国債	23,000,000	23,757,620	
120 20年国債	98,000,000	100,314,760	
123 20年国債	42,000,000	44,095,380	
124 20年国債	100,000,000	104,464,000	
125 20年国債	25,000,000	26,405,000	
126 20年国債	21,000,000	21,955,920	
127 20年国債	110,000,000	114,435,200	
128 20年国債	32,000,000	33,309,120	
129 20年国債	95,000,000	98,344,950	
130 20年国債	110,000,000	113,902,800	
131 20年国債	150,000,000	154,434,000	
132 20年国債	25,000,000	25,737,250	
133 20年国債	150,000,000	155,346,000	
134 20年国債	15,000,000	15,539,850	
135 20年国債	20,000,000	20,592,600	
136 20年国債	180,000,000	184,188,600	
137 20年国債	18,000,000	18,529,200	
139 20年国債	250,000,000	255,705,000	
140 20年国債	100,000,000	102,874,000	
141 20年国債	140,000,000	143,914,400	
142 20年国債	210,000,000	217,343,700	
143 20年国債	100,000,000	101,986,000	
144 20年国債	130,000,000	131,645,800	
145 20年国債	40,000,000	41,043,200	
146 20年国債	160,000,000	163,937,600	

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

	186 20年国債	600,000,000	513,618,000	
	187 20年国債	490,000,000	403,078,900	
	188 20年国債	400,000,000	344,600,000	
	189 20年国債	350,000,000	315,500,500	
	190 20年国債	400,000,000	352,968,000	
	191 20年国債	430,000,000	390,594,800	
	192 20年国債	360,000,000	347,522,400	
	193 20年国債	300,000,000	293,397,000	
	1 フイリピン共和国	100,000,000	98,842,700	
国債証券 合計			93,656,545,570	
地方債証券	797 東京都公債	100,000,000	95,637,100	
	866 東京都公債	200,000,000	200,251,600	
	5 東京都30年	100,000,000	56,223,900	
	28 東京都20年	100,000,000	100,970,200	
	3-5 北海道公債	100,000,000	93,527,800	
	262 神奈川県公債	300,000,000	288,367,500	
	457 大阪府公債	100,000,000	94,772,400	
	26-5 京都府20年	100,000,000	98,740,100	
	6-1 京都府5年	200,000,000	195,601,400	
	11兵庫県公債20年	100,000,000	102,925,300	
	8 静岡県20年	100,000,000	104,233,400	
	5-3 愛知県公債	100,000,000	94,173,000	
	6-1 愛知県5年	300,000,000	293,369,700	
	24-1 広島県20年	100,000,000	101,888,000	
	25-1 広島県20年	100,000,000	101,773,800	
	1 埼玉県15年	100,000,000	99,144,200	
	9 埼玉県20年	100,000,000	104,292,800	
	29-6 千葉県公債	100,000,000	98,328,800	
	30-3 新潟県公債	134,160,000	129,842,597	
	3-1 茨城県公債	100,000,000	93,548,000	
	168 共同発行地方	100,000,000	99,001,400	
	170 共同発行地方	200,000,000	197,545,400	
	206 共同発行地方	200,000,000	190,144,200	
	244 共同発行地方	100,000,000	93,274,100	
	255 共同発行地方	300,000,000	287,395,800	
	270 共同発行地方	300,000,000	301,899,300	
	3-3 堺市公債	100,000,000	92,653,200	
	4-3 長崎県公債	100,000,000	93,415,400	

	2-1 静岡市公債	100,000,000	94,438,200	
	6-1 大阪市5年	200,000,000	196,098,800	
	6-2 大阪市公債	200,000,000	190,423,400	
	11 名古屋市20年	100,000,000	103,968,000	
	10 京都市20年	100,000,000	102,769,100	
	24-3 神戸市20年	100,000,000	101,536,200	
	2-2 横浜市公債	100,000,000	94,745,300	
	6 札幌市20年	100,000,000	104,111,500	
	17 北九州市20年	100,000,000	99,491,600	
	2-1 千葉市公債	100,000,000	95,182,700	
地方債証券 合計			5,085,705,197	
特殊債券	86 政保政策投資C	300,000,000	298,141,800	
	47日本政策投資CO	100,000,000	99,300,100	
	174 日本政策投資	100,000,000	93,435,300	
	184 日本政策投資	200,000,000	195,299,000	
	79 政保道路機構	100,000,000	103,580,100	
	81 政保道路機構	100,000,000	103,631,200	
	97 政保道路機構	100,000,000	103,968,500	
	143 政保道路機構	200,000,000	205,693,800	
	235 政保道路機構	100,000,000	96,455,000	
	321 政保道路機構	100,000,000	98,546,300	
	397 政保道路機構	100,000,000	95,468,900	
	478 政保道路機構	300,000,000	287,985,600	
	23 地方公共団20	100,000,000	101,527,500	
	F163地方公共団体	100,000,000	100,014,600	
	F168地方公共団体	200,000,000	201,831,400	
	3 地方公共団15年	100,000,000	100,133,500	
	F231地方公共団体	100,000,000	99,644,700	
	129 地方公共団体	100,000,000	95,009,600	
	F568地方公共団体	300,000,000	260,859,000	
	95 日本政策金融	300,000,000	297,360,000	
	4 国際協力銀行CO	100,000,000	98,258,400	
	47 住宅機構RMBS	158,868,000	161,584,642	
	92 住宅機構RMBS	74,256,000	69,622,425	
	100 住宅機構RMBS	45,663,000	42,553,349	
	120 住宅機構RMBS	859,544,000	763,275,072	
	33 沖縄振興開発	100,000,000	94,675,900	
特殊債券 合計			4,267,855,688	
社債券	39 BPCE S.A.	100,000,000	98,912,200	

4 香港上海銀行	100,000,000	99,421,400	
33 首都高速道路	300,000,000	294,078,600	
30 阪神高速道路	200,000,000	197,864,200	
8 ビーエヌピーパリバ	100,000,000	98,629,800	
111 東日本高速道	300,000,000	293,877,300	
101 中日本高速道	200,000,000	196,147,600	
88 西日本高速道	300,000,000	291,332,400	
22 積水ハウス	100,000,000	97,831,000	
11サントリーホールデイング	100,000,000	97,963,700	
3 伊藤園	100,000,000	97,620,300	
29 東急不動産HD	100,000,000	97,783,200	
18 セブンアンドアイ	100,000,000	96,784,100	
35 東レ	100,000,000	97,164,500	
57 三井化学	200,000,000	198,119,600	
16 武田薬品	100,000,000	91,822,000	
32 住友電工	100,000,000	96,794,200	
16 クボタ	100,000,000	98,174,300	
34 ダイキン工業	200,000,000	200,075,200	
40 ソニーG	100,000,000	97,980,400	
31 トヨタ自動車	100,000,000	93,490,800	
6 楽天カード	100,000,000	98,185,000	
4 オリツクス銀行	100,000,000	98,038,400	
26 りそなホールデイン	100,000,000	97,870,500	
39 芙蓉総合リース	200,000,000	197,920,800	
5 NTTファイナンス	100,000,000	91,614,700	
33 NTTファイナンス	200,000,000	194,598,600	
38 NTTファイナンス	100,000,000	94,756,300	
58 日産フイナンシヤル	200,000,000	193,683,200	
81 ホンダファイナンス	100,000,000	97,468,700	
102 トヨタファイナンス	100,000,000	99,100,400	
103 トヨタファイナンス	200,000,000	195,577,400	
42 リコーリース	100,000,000	98,673,200	
214 オリツクス	100,000,000	92,559,500	
1 SOMPOHD	100,000,000	97,931,800	
7 三井住友海上	100,000,000	99,088,300	
82 三井不動産	100,000,000	97,742,400	
80 三菱地所	100,000,000	101,955,400	
143 三菱地所	100,000,000	94,223,000	
55 西日本鉄道	200,000,000	195,457,600	

	52 阪急阪神HLDG	100,000,000	95,489,700	
	20 三菱倉庫	100,000,000	95,997,500	
	34 KDDI	100,000,000	97,636,100	
	9 ソフトバンク	100,000,000	97,888,900	
	46 光通信	100,000,000	97,909,600	
	566 中部電力	200,000,000	186,713,800	
	448 中国電力	100,000,000	93,203,100	
	563 東北電力	200,000,000	186,760,200	
	489 九州電力	100,000,000	95,440,400	
	87 電源開発	100,000,000	93,475,600	
	83 東京電力PG	200,000,000	200,730,800	
	16 JERA	100,000,000	98,300,700	
	65 東京瓦斯	100,000,000	94,446,200	
	44 大阪瓦斯	100,000,000	92,586,700	
	50 大阪瓦斯	100,000,000	97,981,800	
	60 ソフトバンクグループ	100,000,000	99,826,900	
社債券 合計			7,192,700,000	
合計			110,202,806,455	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2025年9月30日

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

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2025年9月30日

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

(参考) ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

純資産額計算書

2025年9月30日

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

(参考) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

純資産額計算書

2025年9月30日

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

(参考) ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2025年9月30日

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

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2025年9月30日

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

(参考) ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2025年9月30日

Ⅰ　資産総額	53,700,325,115円
Ⅱ　負債総額	97,891,549円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	53,602,433,566円
Ⅳ　発行済数量	13,024,444,798口

Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.1155円

(参考) ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2025年9月30日

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

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2025年9月30日

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

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

2025年9月末日現在

資本金の額　　414億2,454万1,896円

発行可能株式総数　799万9,980株

発行済株式総数　　326万657株

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

ｂ．委託会社の機構

①　会社の意思決定機構

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

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

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

②　投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ．商品会議

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

ロ．商品担当役員

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

ハ．運用会議

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

ニ．運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ．リスクマネジメント会議

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2025年9月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	86	406,448
追加型株式投資信託	784	34,024,819
株式投資信託　　合計	870	34,431,267
単位型公社債投資信託	71	132,664
追加型公社債投資信託	14	1,488,448
公社債投資信託　合計	85	1,621,112
総合計	955	36,052,379

３【委託会社等の経理状況】

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

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、当事業年度(2024年４月１日から2025年３月31日まで)の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

３．財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (2024年３月31日)		当事業年度 (2025年３月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		4,813		13,153
有価証券		503		1,194
前払費用		481		513
未収委託者報酬		16,513		19,097
未収収益		78		110
関係会社短期貸付金		23,400		70,000
その他		88		94
流動資産計		45,878		104,164
固定資産				
有形固定資産	※1	176	※1	61
建物		2		0
器具備品		174		59
建設仮勘定		0		0
無形固定資産		1,342		1,160
ソフトウェア		1,063		1,062
ソフトウェア仮勘定		279		97
その他		-		0
投資その他の資産		13,660		14,856
投資有価証券		8,448		9,348
関係会社株式		3,475		3,414
出資金		177		34
長期差入保証金		1,021		1,049
繰延税金資産		524		995
その他		12		13

固定資産計	15,180	16,077
資産合計	61,058	120,241

(単位:百万円)

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

その他有価証券評価差額金	1,530	1,361
評価・換算差額等合計	1,530	1,361
純資産合計	41,623	98,649
負債・純資産合計	61,058	120,241

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

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

固定資産減価償却費	478	444
諸経費	1,888	2,164
一般管理費計	12,346	14,293
営業利益	17,368	22,061

(単位:百万円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自　2023年４月１日 至　2024年３月31日)

（単位：百万円）

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

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

当事業年度(自　2024年４月１日 至　2025年３月31日)

（単位:百万円）

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

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

注記事項

(重要な会計方針)

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	４～20年

（２）無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

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

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

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

４．収益及び費用の計上基準

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

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

５．その他財務諸表の作成のための基本となる重要な事項

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

(重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

(未適用の会計基準等)

リースに関する会計基準等

・「リースに関する会計基準」(企業会計基準第34号 2024年９月13日　企業会計基準委員会) 等

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

(１)概要

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

(２)適用予定日

2028年3月期の期首から適用予定であります。

(３)当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

(表示方法の変更)

(損益計算書関係)

前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「受取利息」は、金額的重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」の「その他」に表示していた93百万円は、「受取利息」4百万円、「その他」89百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

※１　有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2024年３月31日)	当事業年度 (2025年３月31日)
建物	39百万円	40百万円
器具備品	308百万円	269百万円

※２　関係会社項目

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

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

３　保証債務

前事業年度(2024年３月31日)

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

当事業年度(2025年３月31日)

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

(損益計算書関係)

※１　投資有価証券売却益の項目

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

※２　固定資産売却益の項目

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

※３　固定資産売却損の項目

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自　2023年４月１日　至　2024年３月31日)

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

２．配当に関する事項

（１）配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額(百万円)	１株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日

2023年６月26日 定時株主総会	普通株式	10,316	3,955	2023年 ３月31日	2023年 ６月27日

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

2024年６月19日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

当事業年度(自　2024年４月１日　至　2025年３月31日)

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

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

２．配当に関する事項

(１) 配当金支払額

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

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

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

①剰余金の配当の総額	16,551百万円
②配当の原資	利益剰余金
③１株当たり配当額	5,076円
④基準日	2025年３月31日
⑤効力発生日	2025年６月20日

(金融商品関係)

１．金融商品の状況に関する事項

(１)金融商品に対する取組方針

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

(２)金融商品の内容及びそのリスク

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

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に関係する業務を委託したことにより発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが１年以内の支払期日であります。

（３）金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

(ⅰ)為替変動リスクの管理

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

(ⅱ)価格変動リスクの管理

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

②信用リスクの管理

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

２．金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

前事業年度(2024年３月31日)

(１)時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

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

当事業年度(2025年３月31日)

(１)時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

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

(２)時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注１)時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

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

(単位：百万円)

区分	前事業年度	当事業年度
非上場株式	666	342
子会社株式	1,448	1,386
関連会社株式	2,027	2,027

(有価証券関係)

１．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(2024年３月31日)

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

当事業年度(2025年３月31日)

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

２．その他有価証券

前事業年度(2024年３月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)

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

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

当事業年度(2025年３月31日)

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

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

３．売却したその他有価証券

前事業年度(自　2023年４月１日　至　2024年３月31日)

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

当事業年度(自　2024年４月１日　至　2025年３月31日)

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

４．減損処理を行った有価証券

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

(退職給付関係)

１．採用している退職給付制度の概要

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

２．確定給付制度

(１)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(３)退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(注)その他には、臨時に支払った割増退職金等を含んでおります。

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度187百万円、当事業年度191百万円であります。

(税効果会計関係)

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

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

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

前事業年度(2024年３月31日)

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

当事業年度(2025年３月31日)

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

３．法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

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

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

(収益認識関係)

（１）顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が91,634百万円、その他1,233百万円であります。

（２）収益を理解するための基礎となる情報

(重要な会計方針)の４．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

［セグメント情報］

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

［関連情報］

１.サービスごとの情報

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

２.地域ごとの情報

(１)営業収益

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

(２)有形固定資産

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

３.主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度(自　2023年４月１日　至　2024年３月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自　2024年４月１日　至　2025年３月31日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

１．関連当事者との取引

(ア)財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

前事業年度(自　2023年４月１日　至　2024年３月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度(自　2024年４月１日　至　2025年３月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(イ)財務諸表提出会社の子会社

前事業年度(自　2023年４月１日　至　2024年３月31日)

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関係内容		取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有直接100.0	なし	経営管理	債務保証(注)	2,354	－	－

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度(自　2024年４月１日　至　2025年３月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(ウ)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度(自　2023年４月１日　至　2024年３月31日)

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関係内容		取引の内容	取引金額(百万円)(注１)	科目	期末残高(百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	－	なし	証券投資信託受益証券の募集販売 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)	13,749 1,030	未払手数料 長期差入保証金	3,491 1,010

同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	―	なし	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守（注４）	902	未払費用	87

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度(自　2024年4月1日　至　2025年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

２.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社(東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

(１株当たり情報)

前事業年度 (自　2023年４月１日 至　2024年３月31日)	当事業年度 (自　2024年４月１日 至　2025年３月31日)
１株当たり純資産額　15,956.63円	１株当たり純資産額　30,254.44円
１株当たり当期純利益　4,546.57円	１株当たり当期純利益　5,642.31円

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

(注２）１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自　2023年４月１日 至　2024年３月31日)	当事業年度 (自　2024年４月１日 至　2025年３月31日)
当期純利益(百万円)	11,859	16,552
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,933,697

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

③ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。

④ 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

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

5【その他】

ａ．定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2024年5月15日、株式会社かんぽ生命保険と資本業務提携を締結し、本提携に基づき2024年10月1日、かんぽ生命保険を引き受け先とする第三者割当増資を実施いたしました。

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

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

ｂ．訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

	①　名　称	②　資本金の額 (2025年03月末日現在)	③　事業の内容	④　備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	（注6）	
再信託受託会社	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円	（注6）	

販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	（注1）	
	アイザワ証券株式会社	3,000百万円	（注1）	
	岩井コスモ証券株式会社	13,500百万円	（注1）	
	ＳＭＢＣ日興証券株式会社	135,000百万円	（注1）	
	株式会社ＳＢＩ証券	54,323百万円	（注1）	
	ＯＫＢ証券株式会社	1,500百万円	（注1）	
	岡三証券株式会社	5,000百万円	（注1）	
	岡地証券株式会社	1,500百万円	（注1）	
	岡安証券株式会社	650百万円	（注1）	
	京銀証券株式会社	3,000百万円	（注1）	
	篠山証券株式会社	100百万円	（注1）	
	静岡東海証券株式会社	600百万円	（注1）	
	ＧＭＯクリック証券株式会社	4,346百万円	（注1）	
	立花証券株式会社	6,695百万円	（注1）	
	大熊本証券株式会社	343百万円	（注1）	
	第四北越証券株式会社	600百万円	（注1）	
	東海東京証券株式会社	6,000百万円	（注1）	
	中原証券株式会社	506百万円	（注1）	
	西日本シティＴＴ証券株式会社	3,000百万円	（注1）	
	野村證券株式会社	10,000百万円	（注1）	
	播陽証券株式会社	112百万円	（注1）	
	百五証券株式会社	3,000百万円	（注1）	
	ＰａｙＰａｙ証券株式会社	10,224百万円	（注1）	
	ほくほくＴＴ証券株式会社	1,250百万円	（注1）	
	松井証券株式会社	11,945百万円	（注1）	
	マネックス証券株式会社	13,195百万円	（注1）	
	三菱ＵＦＪ　ｅスマート証券株式会社	7,196百万円	（注1）	
	ｍｏｏｍｏｏ証券株式会社	2,250百万円	（注1）	
	むさし証券株式会社	5,000百万円	（注1）	
	楽天証券株式会社	19,495百万円	（注1）	
	リテラ・クレア証券株式会社	3,794百万円	（注1）	
	ワイエム証券株式会社	1,270百万円	（注1）	
	株式会社あいち銀行	18,000百万円	（注3）	
	株式会社青森みちのく銀行	19,562百万円	（注3）	
	株式会社イオン銀行	51,250百万円	（注3）	
		140,000百万円	（注3）	

	株式会社ＳＢＩ新生銀行			
	株式会社大垣共立銀行	46,773百万円	（注3）	
	株式会社沖縄銀行	22,725百万円	（注3）	
	株式会社香川銀行	14,105百万円	（注3）	
	株式会社関西みらい銀行	38,971百万円	（注3）	
	株式会社北九州銀行	10,000百万円	（注3）	
	株式会社きらやか銀行	24,000百万円	（注3）	
	株式会社高知銀行	15,444百万円	（注3）	
	湘南信用金庫	25,058百万円	（注7）	(*1)
	株式会社静岡銀行	90,845百万円	（注3）	
	株式会社静岡中央銀行	2,000百万円	（注3）	
	株式会社島根銀行	7,886百万円	（注3）	
	株式会社清水銀行	10,816百万円	（注3）	
	信金中央金庫	890,998百万円	（注4）	(*1)
	スルガ銀行株式会社	30,043百万円	（注3）	
	全国信用協同組合連合会	123,715百万円	（注5）	(*1)
	株式会社但馬銀行	5,481百万円	（注3）	
	株式会社大東銀行	14,743百万円	（注3）	
	株式会社千葉銀行	145,069百万円	（注3）	
	株式会社筑波銀行	48,868百万円	（注3）	
	株式会社鳥取銀行	9,061百万円	（注3）	
	株式会社徳島大正銀行	14,173百万円	（注3）	
	株式会社トマト銀行	14,310百万円	（注3）	
	株式会社富山第一銀行	10,182百万円	（注3）	
	株式会社長崎銀行	7,621百万円	（注3）	
	株式会社長野銀行	13,017百万円	（注3）	
	株式会社名古屋銀行	25,090百万円	（注3）	
	株式会社西日本シティ銀行	85,745百万円	（注3）	
	株式会社八十二銀行	52,243百万円	（注3）	
	株式会社百五銀行	20,000百万円	（注3）	
	株式会社福島銀行	19,638百万円	（注3）	
	ＰａｙＰａｙ銀行株式会社	72,216百万円	（注3）	
	株式会社豊和銀行	13,495百万円	（注3）	
	株式会社三菱ＵＦＪ銀行	1,711,958百万円	（注3）	
	三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社	324,279百万円	（注6）	
	株式会社武蔵野銀行	45,743百万円	（注3）	
	株式会社もみじ銀行	10,000百万円	（注3）	
	株式会社山口銀行	10,005百万円	（注3）	

（注1）金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

（注2）主として中小企業向け融資業を営んでいます。
（注3）銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
（注4）全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
（注5）協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。
（注6）銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
（注7）信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。
（注8）保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。
（注9）保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
（注10）全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。
（注11）労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。
（注12）農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでいます。
（注13）資産運用業務を行なっています。
（注14）資産運用業務、投資助言業務および情報提供業務を行なっています。
（*1）出資金を記載しています。

2【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

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

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

3【資本関係】

委託会社は、播陽証券株式会社の株式を6,500株所有しています。
委託会社は、むさし証券株式会社の株式を41,600株所有しています。

第３【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について
・金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。
・目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。
・委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。
・詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

①委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等

②請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨

・使用開始日を記載することがあります。

・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。

①届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

②届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日

・次の事項を記載することがあります。

①投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨

②請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨

③「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載

・委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。

・ファンドの形態等を記載することがあります。

・図案を採用することがあります。

・ファンドの管理番号等を記載することがあります。

・委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。

・UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

・「iFreeのポイント」を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

2025年５月26日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2024年４月１日から2025年３月31日までの第66期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2025年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注) 1．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2025年10月17日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

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ｉＦｒｅｅ　８資産バランスの2024年9月10日から2025年9月8日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ｉＦｒｅｅ　８資産バランスの2025年9月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。