

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2025年9月9日提出
【計算期間】	第9計算期間 (自 2024年6月18日 至 2025年6月16日)
【ファンド名】	ダイワファンドラップ TOPIXインデックス ダイワファンドラップ 日経225インデックス ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) 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) 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) ダイワファンドラップ 日本債券インデックス ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) 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) 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) ダイワファンドラップ J-REITインデックス ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジあり) 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)
【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
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、特定の指数の動きに連動する投資成果をめざすマザーファンドを通じて、特定の有価証券に投資し、各市場の動きを反映した投資成果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。

#### <FW TOPIXインデックス>

##### 商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	
	内外	不動産投信	特殊型
		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	対象インデックス
株式	年1回	グローバル		
一般	年2回	日本		日経 225
大型株	年4回	北米	ファミリー ファンド	
中小型株	年6回 (隔月)	欧州		TOPIX
債券	年12回 (毎月)	アジア		
一般	日々	オセアニア		
公債	その他 ( )	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 ( )
社債		アフリカ		
その他債券		中近東 (中東)		
クレジット属性 ( )		エマージング		
不動産投信				
その他資産 (投資信託証券) (株式 一般)				
資産複合 ( )				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## <FW 日経225インデックス>

### 商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	
	内外	不動産投信	特殊型
		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	対象インデックス
株式	年1回	グローバル		
一般		日本		日経225
大型株	年2回	北米	ファミリー ファンド	
中小型株	年4回	欧州		
債券	年6回 (隔月)	アジア		TOPIX
一般	年12回 (毎月)	オセアニア		
公債	日々	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 ( )
社債	その他 ( )	アフリカ		
その他債券		中近東 (中東)		
クレジット属性 ( )		エマージング		
不動産投信				
その他資産 (投資信託証券) (株式 一般)				
資産複合 ( )				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## &lt;FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)&gt;

## 商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	
	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ( )	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## &lt;FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)&gt;

## 商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産(収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	
	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ( )	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## &lt;FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)&gt;

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## &lt;FW 日本債券インデックス&gt;

## 商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	
	内外	不動産投信	特殊型
		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	対象インデックス
株式	年1回	グローバル		
一般	年2回	日本		日経 225
大型株	年4回	北米	ファミリー ファンド	
中小型株	年6回 (隔月)	欧州		TOPIX
債券	年12回 (毎月)	アジア		
一般	日々	オセアニア		
公債	その他 ( )	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 (DBI総合指数)
社債		アフリカ		
その他債券		中近東 (中東)		
クレジット属性 ( )		エマージング		
不動産投信				
その他資産 (投資信託証券)				
(債券 一般)				
資産複合 ( )				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## &lt;FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)&gt;

## 商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	
	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ( )	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

## &lt;FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)&gt;

## 商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産(収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	
	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ( )	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## &lt;FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)&gt;

## 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 (除く日本)		
大型株				
中小型株	年2回	日本		
債券				
一般	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ( )
公債		欧州		
社債	年6回 (隔月)	アジア		
その他債券 クレジット属性 ( )		オセアニア		
不動産投信	年12回 (毎月)	中南米		
その他資産 (投資信託証券) (債券 一般)	日々	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
資産複合 ( )	その他 ( )	中近東 (中東)		
資産配分固定型		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。

## <FW J-REITインデックス>

### 商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信	国内	株式 債券	インデックス型
追加型投信	海外	不動産投信	特殊型
	内外	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	対象インデックス
株式	年1回	グローバル		
一般	年2回	日本		日経 225
大型株	年4回	北米	ファミリー ファンド	
中小型株	年6回 (隔月)	欧州		TOPIX
債券	年12回 (毎月)	アジア		
一般	日々	オセアニア		
公債	その他 ( )	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	その他 (東証REIT指数 (配当込み))
社債		アフリカ		
その他債券 クレジット属性 ( )		中近東 (中東)		
不動産投信		エマージング		
その他資産 (投資信託証券) (不動産投信)				
資産複合 ( )				
資産配分固定型 資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## &lt;FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)&gt;

## 商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産(収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	
	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ( )	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## &lt;FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)&gt;

## 商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信	国内	株式 債券	インデックス型
追加型投信	海外	不動産投信 その他資産 ( )	特殊型
	内外	資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

## (注1) 商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行なわれないファンド
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
投資対象地域	国内	目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	海外	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	内外	目論見書等において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの

投資対象 資産	株式	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるもの
	債券	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるもの
	不動産投信(リート)	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるもの
	その他資産	目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券、不動産投信(リート)以外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	資産複合	目論見書等において、株式、債券、不動産投信(リート)およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
独立区分	MMF(マネー・マネージメント・ファンド)	「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMF
	MRF(マネー・リザーブ・ファンド)	「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRF
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令(平成12年政令480号)第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法(昭和32年法律第26号)第9条の4の2に規定する上場証券投資信託
補足分類	インデックス型	目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	特殊型	目論見書等において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

(注2) 属性区分の定義

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

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

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

< 信託金の限度額 >

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、各ファンドについて次の額を限度として信託金を追加することができます。

ファンド名	限度額
FW TOPIXインデックス	2,500億円
FW 日経225インデックス	各ファンドについて 5,000億円
FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)	
FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)	
FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)	
FW 日本債券インデックス	
FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)	
FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)	
FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)	
FW J-REITインデックス	
FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)	
FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)	

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

< ファンドの特色 >

# 1 「ダイワファンドラップ インデックス・シリーズ」は、投資者と販売会社が締結する投資一任契約に基づいて、資産を管理する口座の資金を運用するためのファンドです。

- 「ダイワファンドラップ インデックス・シリーズ」の購入の申込みを行なう投資者は、販売会社と投資一任契約の資産を管理する口座に関する契約および投資一任契約を締結する必要があります。

# 2 「ダイワファンドラップ インデックス・シリーズ」を構成する各ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて実質的な運用を行ないます。

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



※各ファンド、マザーファンドおよび特定の有価証券については後掲の「各ファンドの基本情報」をご参照下さい。

## ●各ファンドの基本情報

特定の 有価証券	各ファンド	特定の指数	マザーファンド
わが国の 株式	FW TOPIXインデックス	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)	トピックス・インデックス・マザーファンド
	FW 日経225インデックス	日経平均トータルリターン・インデックス	ストックインデックス225・マザーファンド
海外の 株式	FW 外国株式インデックス (為替ヘッジあり)	MSCIコクサイ指数 (配当込み、円ヘッジ・ベース)	外国株式インデックス 為替ヘッジ型マザーファンド
	FW 外国株式インデックス (為替ヘッジなし)	MSCIコクサイ指数 (配当込み、円ベース)	外国株式インデックス マザーファンド
	FW 外国株式インデックスEM+ (為替ヘッジなし)	MSCIコクサイ指数 (配当込み、円ベース)	外国株式インデックス マザーファンド
		FTSE RAFI エマージング インデックス(円換算)	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
わが国の 債券	FW 日本債券インデックス	ダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数	日本債券インデックス マザーファンド
海外の 債券	FW 外国債券インデックス (為替ヘッジあり)	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)	外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド
	FW 外国債券インデックス (為替ヘッジなし)	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)	外国債券インデックス マザーファンド
	FW 外国債券インデックスEM+ (為替ヘッジなし)	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)	外国債券インデックス マザーファンド
		JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド(円換算)	ダイワ新興国債券インデックス・ マザーファンド
わが国の リート	FW J-REITインデックス	東証REIT指数(配当込み)	ダイワJ-REIT マザーファンド
海外の リート	FW 外国REITインデックス (為替ヘッジあり)	S&P先進国REIT指数(除く日本) (円ヘッジ・円ベース)	先進国リート・インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド
	FW 外国REITインデックス (為替ヘッジなし)	S&P先進国REIT指数(除く日本) (円ベース)	ダイワ・グローバルREITインデックス・ マザーファンド

※各ファンド(FW 外国株式インデックスEM+(為替ヘッジなし)、FW 外国債券インデックスEM+(為替ヘッジなし)およびFW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)を除きます。)において、マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

※特定の指数の内容については、後掲の「特定の指数について」をご参照下さい。

## ●各ファンドの運用方針

## FW TOPIXインデックス

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)に連動する投資成果をあげることがをめざして運用を行いません。

◆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、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いません。

(a)上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行いません。

(b)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。

(c)株式の組入比率は、高位を保ちます。

◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル<sup>(注)</sup>を用います。

TOPIX(配当込み)への連動性を随時チェックし、必要があればリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行いません。

## FW 日経225インデックス

日経平均トータルリターン・インデックスに連動する投資成果をあげることがをめざして運用を行いません。

日経平均トータルリターン・インデックスは、配当込みの日経平均株価(日経225)の値動きを示す指数です。

◆わが国の株式のうち日経平均トータルリターン・インデックスに採用された銘柄を主要投資対象とします。投資成果を指数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いません。

(a)上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、等株数投資を行いません。

(b)株式の組入比率は、高位を保ちます。

◆指数に採用されている銘柄すべての組入れを行ないポートフォリオを構築することを基本とします(ただし、財務リスクが高いと判断される銘柄については除く場合があります。)

指数への連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行いません。

**FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)**

MSCIコクサイ指数(配当込み、円ヘッジ・ベース)に連動する投資成果をあげることがをめざして運用を行ないます。

◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル<sup>(注)</sup>を用います。

MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)への連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ないます。なお、保有外貨建資産については、MSCIコクサイ指数(配当込み、円ヘッジ・ベース)の動きに連動させることをめざして為替ヘッジを行ないます。

※為替ヘッジを行なう際、日本円の金利が組入資産の通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

※マザーファンドにおいて、運用の効率化をはかるため、株価指数先物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。

**FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)**

MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)に連動する投資成果をあげることがをめざして運用を行ないます。

◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル<sup>(注)</sup>を用います。

MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)への連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ないます。

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

(注)ポートフォリオ理論に基づき、株価変動に影響を与える複数の要素からポートフォリオのリスクを分析するモデルです。このモデルを用いることにより、さまざまな制約条件下で指数に最も連動すると推定されるポートフォリオを構築することができます。

## FW 外国株式インデックスEM+ (為替ヘッジなし)

主として、海外の株価指数に連動する投資成果をめざす複数のマザーファンドに投資し、海外の株式市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。

◆投資先のマザーファンドおよび連動する投資成果をめざす株価指数は以下のとおりです。また、各マザーファンドへの投資にあたっては、下記の組入比率を目標に行ないます。

マザーファンド	連動する投資成果をめざす株価指数	組入比率の目標
外国株式インデックスマザーファンド	MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)	80%
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	FTSE RAFI エマージング インデックス(円換算)	20%

◆ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドにおいて、株式およびETF(上場投資信託証券)の組入比率の合計は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。

※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。

※ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドにおいて、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。

## FW 日本債券インデックス

ダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

◆ポートフォリオの構築にあたっては、マルチファクターモデル<sup>(注1)</sup>を用いるとともに、残存年限別構成比率等をチェックします。

(注1)マルチファクターモデルは、ポートフォリオのリスク分析、ポートフォリオの構築を主目的としたモデルです。

同モデルにより、イールドカーブファクター、スプレッドファクター、スペシフィックファクターなどについてリスクの計測、分析、推定を行ない、ポートフォリオを効率的に構築および管理します。

## FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)に連動する投資成果をあげることをめざして運用を行ないます。

◆ファンドの通貨別構成比率を同インデックスに近づけ、リスクモデル<sup>(注2)</sup>を用い債券価格変動への連動をめざしてポートフォリオを構築します。また、同インデックスへの連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ないます。なお、保有外貨建資産については、同インデックスに連動させるため為替ヘッジを行ないます。

※為替ヘッジを行なう際、日本円の金利が組入資産の通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

※マザーファンドにおいて、運用の効率化をはかるため、債券先物取引を利用することがあります。このため、マザーファンドにおいて、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。

## FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)

FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)に連動する投資成果をあげることをめざして運用を行ないます。

◆ファンドの通貨別構成比率を同インデックスに近づけ、リスクモデル<sup>(注2)</sup>を用い債券価格変動への連動をめざしてポートフォリオを構築します。また、同インデックスへの連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ないます。

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

## FW 外国債券インデックスEM+(為替ヘッジなし)

主として、海外の債券指数に連動する投資成果をめざす複数のマザーファンドに投資し、海外の債券市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。

◆投資先のマザーファンドおよび連動する投資成果をめざす債券指数は以下のとおりです。また、各マザーファンドへの投資にあたっては、下記の組入比率を目標に行ないます。

マザーファンド	連動する投資成果をめざす債券指数	組入比率の目標
外国債券インデックスマザーファンド	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)	80%
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド(円換算)	20%

※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。

※ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドにおいて、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。

(注2)リスクモデルでは、個別債券のキャッシュフロー(利金と償還金)や価格変化を分析することにより、債券価格変動が同インデックスの騰落に与える影響度とファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるようなポートフォリオを構築することができます。

## FW J-REITインデックス

東証REIT指数(配当込み)に連動する投資成果をあげることをめざして運用を行ないます。

◆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。組入銘柄それぞれの時価総額に応じた投資比率に基づきポートフォリオを構築することを基本とします。東証REIT指数への連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ない、連動性を維持するように運用を行ないます。

※マザーファンドにおいて、運用の効率化をはかるため、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。

## FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

S&P先進国REIT指数(除く日本)(円ヘッジ・円ベース)に連動する投資成果をあげることをめざして運用を行ないます。

◆主として、先進国(日本を除きます。)の金融商品取引所上場(上場予定を含みます。)または店頭登録(登録予定を含みます。)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に投資します。

※効率性の観点から先進国のリート指数との連動をめざすETF(上場投資信託証券)に投資する場合があります。

◆保有外貨建資産については、S&P先進国REIT指数(除く日本)(円ヘッジ・円ベース)の動きに連動させることめざして為替ヘッジを行ないます。

※為替ヘッジを行なう際、日本円の金利が組入資産の通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

※運用の効率化をはかるため、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、マザーファンドの受益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。

## FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

S&P先進国REIT指数(除く日本)(円ベース)に連動する投資成果をあげることめざして運用を行ないます。

◆S&P先進国REIT指数(除く日本)(円ベース)の構成銘柄すべての組入れを行ないポートフォリオを構築することを基本とします。同指数への連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ないます。

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

※運用の効率化をはかるため、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、マザーファンドの受益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。

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

## ●特定の指数について

## ◆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。

## ◆日経平均株価(日経225)

日本経済新聞社が発表している株価指標で、東京証券取引所に上場する市場を代表する225銘柄を対象に算出されます。1950年から算出が開始された、わが国の株式市場全体の動向を示す代表的な指標の一つです。

## ◆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。

## ◆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。

## ◆ダイワ・ボンド・インデックス(DBI) 総合指数

ダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本の債券市場のパフォーマンス・インデックスです。日本で発行されている公募の確定利付円建債のうち、残存額、残存期間などの水準により選定された債券で構成され、時価総額加重平均方式で算出されます。

## ◆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。

## ◆JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス

## －エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド(円換算)

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

## ◆東証REIT指数(配当込み)

東京証券取引所上場の不動産投信全銘柄を対象とする時価総額加重平均の指数で、2003年4月より算出・公表されています。

## ◆S&amp;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。

# 3 毎年6月15日(休業日の場合翌営業日)に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

(注)第1計算期間は、2017年6月15日(休業日の場合翌営業日)までとします。

## 〈分配方針〉

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

- FW TOPIXインデックス
- FW 日経225インデックス
  - ①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
  - ②株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。
  - ③外貨建資産への投資は、行ないません。
- FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり/為替ヘッジなし)
- FW 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)
  - ①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
  - ②株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。
  - ③外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- FW 日本債券インデックス
  - ①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
  - ②株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使等により取得したものに限り、株式および株式を組入可能な投資信託証券(マザーファンドの受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
  - ③外貨建資産への投資は、行ないません。
- FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)
  - ①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
  - ②株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使等により取得したものに限り、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
  - ③投資信託証券(マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
  - ④外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)
  - ①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
  - ②株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使等により取得したものに限り、株式および株式を組入可能な投資信託証券(マザーファンドの受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
  - ③外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

**●FW 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マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- ②株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使等により取得したものに限り、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
- ③投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

**●FW J-REITインデックス**

- ①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- ②株式への直接投資は、行ないません。
- ③マザーファンドを通じて行なう投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
- ④外貨建資産への直接投資は、行ないません。

**●FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり／なし）**

- ①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- ②株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。
- ③外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

## ● 基準価額の動きに関する留意点

各ファンド\*は、特定の指数の動きに連動する投資成果をあげることがをめざして運用を行いません。ただし、主として次の理由から、基準価額の動きが指数と完全に一致するものではありません。

\*[FW 外国株式インデックスEM+(為替ヘッジなし)]および[FW 外国債券インデックスEM+(為替ヘッジなし)]を除きます。

### FW TOPIXインデックス

### FW 日経225インデックス

### FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)

### FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)

- 指数の構成銘柄のすべてを指数の算出方法どおりに組入れない場合があること
- 運用管理費用(信託報酬)、売買委託手数料等の費用負担
- 株式売買時の約定価格と基準価額の算出に使用する株価の不一致
- 指数の算出に使用する株価と基準価額の算出に使用する株価の不一致
- 指数の算出に使用する為替レートと基準価額の算出に使用する為替レートの不一致\*
- 株価指数先物と指数の動きの不一致(先物を利用した場合)
- 株式および株価指数先物取引の最低取引単位の影響
- 株式および株価指数先物の流動性低下時における売買対応の影響
- 指数の構成銘柄の入替えおよび指数の算出方法の変更による影響

\*[FW TOPIXインデックス]および[FW 日経225インデックス]を除きます。

### FW 日本債券インデックス

### FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

### FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)

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

\*[FW 日本債券インデックス]を除きます。

### FW J-REITインデックス

- 東証REIT指数の構成銘柄のすべてを指数の算出方法どおりに組入れない場合があること
- 運用管理費用(信託報酬)、売買委託手数料等を負担することによる影響
- 追加設定および解約に対応して行なったJリート<sup>®</sup>の売買の約定価格と東証REIT指数の算出に使用する価格の差
- Jリエートの銘柄数、市場規模が限られること
- 不動産投信指数先物と指数の動きの不一致(先物を利用した場合)
- Jリートおよび不動産投信指数先物の流動性が低下した場合における売買の影響
- Jリートおよび不動産投信指数先物取引の最低取引単位の影響
- 東証REIT指数の構成銘柄の入替えおよび指数の算出方法の変更による影響
- 追加設定および組入銘柄の配当金や権利処理等によって信託財産に現金が発生すること

※税法その他の法規上の規制や組入銘柄の財務リスクや流動性などの理由から、東証REIT指数の採用銘柄をすべて組入れない場合や時価総額に応じた組入れを行わない場合があります。

### FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

### FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

- 指数の構成銘柄のすべてを指数の算出方法どおりに組入れるとは限らないこと
- 運用管理費用(信託報酬)、売買委託手数料等の費用負担および組入銘柄にかかる配当課税等の影響
- リート売買時の約定価格と基準価額の算出に使用するリエートの価格の不一致
- 指数の算出に使用するリエートの価格と基準価額の算出に使用するリエートの価格の不一致
- 指数の算出に使用する為替レートと基準価額の算出に使用する為替レートの不一致
- 不動産投信指数先物と指数の動きの不一致(先物を利用した場合)
- 指数の構成銘柄の入替えおよび指数の算出方法の変更による影響
- ベンチマークに指数先物取引が存在しないこと
- 追加設定および組入銘柄の配当金や権利処理によって信託財産に現金が発生すること

## ●各マザーファンドが連動対象とする指数の著作権等について

- ①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。
- ②JPXは、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止または同指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができます。
- ③JPXは、同指数の指数値および同指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④JPXは、同指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ⑤本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑥JPXは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ⑦JPXは、当社または本件商品の購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。
- ⑧以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、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責任を有しません。

- ①「日経平均株価」および「日経平均トータルリターン・インデックス」（以下「日経平均株価」といいます。）は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体および「日経平均株価」を算出する手法に対して著作権その他一切の知的財産権を有しています。
- ②「日経」および「日経平均株価」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、すべて株式会社日本経済新聞社に帰属しています。
- ③当ファンドは、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用および受益権の取引に関して、一切の責任を負いません。
- ④株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。
- ⑤株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」の構成銘柄、計算方法、その他「日経平均株価」の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

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> ]

「FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)」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FTSE RAFI®エマージング 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な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 Daiwa Fund Wrap Global Equity Index EM plus are 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.

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。

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

- ①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。
- ②JPXは、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止または同指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができます。
- ③JPXは、同指数の指数値および同指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④JPXは、同指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ⑤本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑥JPXは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ⑦JPXは、当社または本件商品の購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。
- ⑧以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、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責任を負いません。

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

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2016年9月26日  
2022年3月9日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始  
< FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり) > 商品分類の変更

## (3) 【ファンドの仕組み】

受益者

お申込者

## 収益分配金(注)、償還金など お申込金(3)

お取扱窓口	販売会社	<p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約(1)に基づき、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など</p>
-------	------	--

1

## 収益分配金、償還金など お申込金(3)

委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約(以下「信託契約」といいます。)(2)の委託者であり、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
------	------------------	---

運用指図

2

## 損益 信託金(3)

受託会社	<p>&lt;FW 日経225インデックス&gt; みずほ信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行</p>	<p>信託契約(2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など</p>
	<p>&lt;上記以外の各ファンド&gt; 三井住友信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行</p>	<p>信託契約(2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など</p>
		損益 投資

## 投資対象

ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

<FW TOPIXインデックス>  
東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。） など

<FW 日経225インデックス>  
わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均トータルリターン・インデックスに採用された銘柄 など

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり/為替ヘッジなし）>  
外国の株式（DR（預託証券）を含みます。） など

<FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>  
外国の株式（DR（預託証券）を含みます。）、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。）、新興国の企業のDR（預託証券）、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） など

<FW 日本債券インデックス>  
わが国の公社債 など

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり/為替ヘッジなし）>  
外国の公社債 など

<FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>  
外国の公社債、新興国通貨建ての債券 など

<FW J-REITインデックス>  
わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）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 など

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり/為替ヘッジなし）>  
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 など

（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6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	株式会社かんぼ生命保険と資本業務提携

## ・大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

## 主要投資対象

ファンド名	主要投資対象
FW TOPIXインデックス	トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
FW 日経225インデックス	ストックインデックス225・マザーファンドの受益証券
FW 外国株式インデックス (為替ヘッジあり)	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの受益証券
FW 外国株式インデックス (為替ヘッジなし)	外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
FW 外国株式インデックス EM+ (為替ヘッジなし)	外国株式インデックスマザーファンドの受益証券および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
FW 日本債券インデックス	日本債券インデックスマザーファンドの受益証券
FW 外国債券インデックス (為替ヘッジあり)	外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンドの受益証券
FW 外国債券インデックス (為替ヘッジなし)	外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
FW 外国債券インデックス EM+ (為替ヘッジなし)	外国債券インデックスマザーファンドの受益証券および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
FW J-REITインデックス	ダイワJ-REITマザーファンドの受益証券
FW 外国REITインデックス (為替ヘッジあり)	先進国リート・インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンドの受益証券
FW 外国REITインデックス (為替ヘッジなし)	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

以下、各ファンドにおいて(「FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)」および「FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)」は総称して)「マザーファンド」といいます。

## 投資態度

## &lt;FW TOPIXインデックス&gt;

- イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の株式に投資し、投資成果を東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
- ロ．マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ハ．株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- 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。

## &lt;FW 日経225インデックス&gt;

- イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の株式に投資し、投資成果を日経平均トータルリターン・インデックスの動きに連動させることをめざして運用を行いません。
- ロ．マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ハ．株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- 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。

## &lt;FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）&gt;

- イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、外国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数（配当込み、円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
- ロ．マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ハ．マザーファンドにおける外貨建資産について、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いません。
- ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

## &lt;FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）&gt;

- イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、外国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数（配当込み、円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
- ロ．マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
- ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

## &lt;FW 外国株式インデックス EM+ (為替ヘッジなし) &gt;

- イ．主として、海外の株価指数に連動する投資成果をめざす複数のマザーファンドに投資し、海外の株式市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。
- ロ．各マザーファンドの受益証券への投資にあたっては、下記の組入比率を目標に行ないます。
- 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券.....信託財産の純資産総額の80%程度
- 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...信託財産の純資産総額の20%程度
- 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。

## &lt;FW 日本債券インデックス&gt;

- イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の公社債に投資し、投資成果をダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合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。
- ロ．マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ハ．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。

## &lt;FW 外国債券インデックス (為替ヘッジあり) &gt;

- イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
- ロ．マザーファンドにおいて、運用の効率化を図るため、債券先物取引を利用することがあります。このため、マザーファンドにおいて、債券の組入総額および債券先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ハ．マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ニ．マザーファンドにおいて、投資成果をFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)の動きに連動させるため、外貨建資産については為替ヘッジを行ないます。
- 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。

## &lt;FW 外国債券インデックス (為替ヘッジなし) &gt;

- イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
- ロ．マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

二．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。

<FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

イ．主として、海外の債券指数に連動する投資成果をめざす複数のマザーファンドに投資し、海外の債券市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。

ロ．各マザーファンドの受益証券への投資にあたっては、下記の組入比率を目標に行ないます。

外国債券インデックスマザーファンドの受益証券.....信託財産の純資産総額の80%程度

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.....信託財産の純資産総額の20%程度

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。

二．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。

<FW J - R E I Tインデックス>

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）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に投資し、投資成果を東証REIT指数（配当込み、以下同じ。）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

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

ハ．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。

<FW 外国R E I Tインデックス（為替ヘッジあり）>

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、先進国（日本を除きます。）の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）または店頭登録（登録予定を含みます。）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「リート」といいます。）に投資し、投資成果をベンチマーク（S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース））の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

効率性の観点から先進国のリート指数との連動をめざすETF（上場投資信託証券）に投資する場合があります。

ロ．マザーファンドにおいて、保有外貨建資産については、S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして為替ヘッジを行ないます。

ハ．運用の効率化をはかるため、リート指数先物取引を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額とリート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。

二．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。

<FW 外国R E I Tインデックス（為替ヘッジなし）>

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）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に投資し、投資成果をS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

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

ハ．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．運用の効率化をはかるため、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、マザーファンドの受益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。

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。

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

## (2)【投資対象】

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

<FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

<FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

当ファンドにおいて投資の対象とする資産（「FW TOPIXインデックス」、「FW 日経225インデックス」および「FW 日本債券インデックス」は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(5)、および に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、「FW 日経225インデックス」は、みずほ信託銀行株式会社、「FW 日経225インデックス」以外の各ファ

ンドは三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された各マザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができます。

<FW T O P I Xインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国R E I Tインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国R E I Tインデックス(為替ヘッジなし)>

1. 株券または新株引受権証券

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

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

<FW T O P I Xインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国R E I Tインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国R E I Tインデックス(為替ヘッジなし)>

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

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

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

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。 )

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

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

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

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

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

#### <FW J - R E I Tインデックス>

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(5)に定めるものに限りま。

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、主として、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ダイワJ-REITマザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1．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.の証券の性質を有するもの

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。

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

1．預金

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

3．コール・ローン

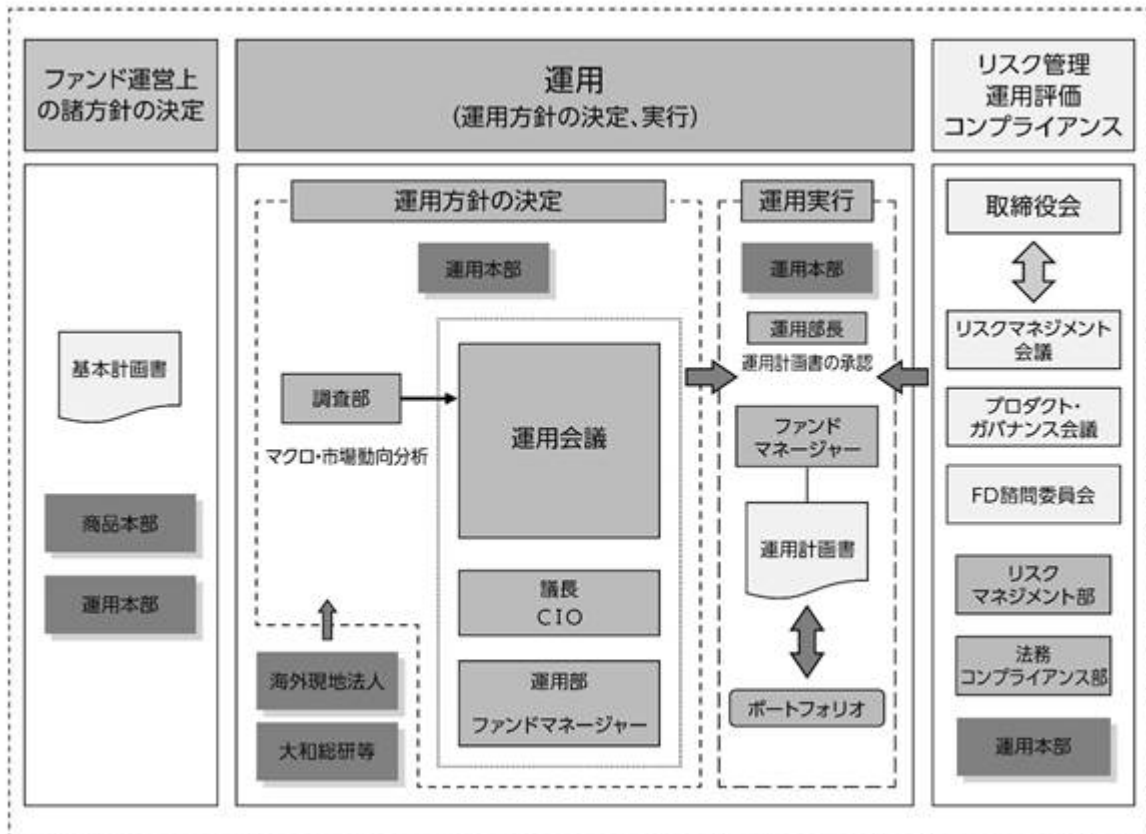
4．手形割引市場において売買される手形

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

### (3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



### 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

#### イ．基本計画書の策定

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

#### ロ．基本的な運用方針の決定

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

#### ハ．運用計画書の作成・承認

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

### 職務権限

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

#### イ．CIO (Chief Investment Officer) (1名)

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・基本的な運用方針の決定
- ・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

#### ロ．Deputy-CIO (0~5名程度)

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

#### ハ．インベストメント・オフィサー (0~5名程度)

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

リスクマネジメント会議、プロダクト・ガバナンス会議および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。

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6月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

<各ファンド共通>

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

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

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

マザーファンドの受益証券（信託約款）

<各ファンド共通>

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

株式（信託約款）

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

<FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

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

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

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

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

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

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

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

<FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

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

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

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

<FW J-REITインデックス>

株式への直接投資は、行ないません。

新株引受権証券等（信託約款）

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

- <FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>
- <FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>
- <FW 日本債券インデックス>
- <FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>
- <FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>
- <FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>
- <FW 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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

ロ．前イ．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<上記以外の各ファンド>

（規定なし）

投資信託証券（信託約款）

- <FW TOPIXインデックス>
- <FW 日経225インデックス>
- <FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>
- <FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>
- <FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>
- <FW 日本債券インデックス>
- <FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>
- <FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>
- <FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>
- <FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>
- <FW 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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

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

<FW J-REITインデックス>

マザーファンドを通じて行なう投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。

投資する株式等の範囲（信託約款）

- <FW TOPIXインデックス>

- <FW 日経225インデックス>
- <FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>
- <FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>
- <FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>
- <FW 日本債券インデックス>
- <FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>
- <FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>
- <FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>
- <FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

- <FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

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

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

- <FW J-REITインデックス>

(規定なし)

同一銘柄の新株引受権証券等(信託約款)

- <FW TOPIXインデックス>
- <FW 日経225インデックス>
- <FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>
- <FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>
- <FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>
- <FW 日本債券インデックス>
- <FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>
- <FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>
- <FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>
- <FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

ロ．前イ．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

<上記以外の各ファンド>

(規定なし)

信用取引(信託約款)

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 日本債券インデックス>

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

ロ．前イ．の信用取引の指図は、次の1.から6.までに掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の1.から6.までに掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(前5.に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

<上記以外の各ファンド>

(規定なし)

先物取引等(信託約款)

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 日本債券インデックス>

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。

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

- <FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>
- <FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>
- <FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>
- <FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>
- <FW 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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。

#### <FW J - REITインデックス>

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。

#### スワップ取引（信託約款）

- <FW TOPIXインデックス>
- <FW 日経225インデックス>
- <FW 日本債券インデックス>

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とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本八．において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．前八．においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

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

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下本八．において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．前八．においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

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

<FW J-REITインデックス>

(規定なし)

金利先渡取引(信託約款)

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 日本債券インデックス>

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とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本八．において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2) の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本八．において「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が保有金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．前八．においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ホ．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。

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

<上記以外の各ファンド>

(規定なし)

金利先渡取引および為替先渡取引(信託約款)

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本八．において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本八．において「保有金利商品の時価

総額の合計額」といいます。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が保有金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．前八．においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ホ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ホ．において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ホ．において「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

#### < 上記以外の各ファンド >

（規定なし）

直物為替先渡取引（信託約款）

#### < FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり） >

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、直物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．直物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．直物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。

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

<上記以外の各ファンド>

(規定なし)

デリバティブ取引等(信託約款)

<各ファンド共通>

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

有価証券の貸付け(信託約款)

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 日本債券インデックス>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
3. 投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。

ロ．前イ．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

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

<FW J-REITインデックス>

(規定なし)

外貨建資産(信託約款)

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

<FW 日本債券インデックス>

外貨建資産への投資は、行ないません。

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>  
<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>  
<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>  
<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>  
<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>  
<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>  
外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

<FW J-REITインデックス>

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>  
<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>  
<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>  
<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>  
<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>  
<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>  
<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>  
<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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。

<上記以外の各ファンド>

(規定なし)

外国為替予約取引(信託約款)

<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>  
<FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>  
<FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>  
<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>  
<FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>  
<FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>  
<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>  
<FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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

ハ. 前ロ.においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産

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

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

#### <上記以外の各ファンド>

(規定なし)

信用リスク集中回避(信託約款)

#### <各ファンド共通>

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がい当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

資金の借入れ(信託約款)

#### <各ファンド共通>

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。

二．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

##### トピックス・インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、東証株価指数(配当込み)をモデルとして運用を行ないます。
主要投資対象	東京証券取引所上場株式(上場予定を含みます。)を投資対象とします。

投資態度	<p>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。</p> <p>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せん。</p> <p>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。</p> <p>ハ. 株式の組入比率は、高位を保ちます。</p>
主な投資制限	<p>株式 株式への投資には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>ホ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。</p>

### ストックインデックス225・マザーファンド

運用の基本方針	<p>わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、日経平均トータルリターン・インデックスをモデルとして運用を行ないます。</p>
主要投資対象	<p>わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均トータルリターン・インデックスに採用された銘柄を主要投資対象とします。</p>
投資態度	<p>イ. 投資成果を日経平均トータルリターン・インデックス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。</p> <p>1. 上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、等株数投資を行ないません。</p> <p>2. 株式の組入比率は、高位を保ちます。</p> <p>ロ. 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、日経平均トータルリターン・インデックスが改廃されたとき、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。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>先物取引等</p> <p>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。)</p> <p>ロ. 委託会社は、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。</p> <p>スワップ取引</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>ホ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。</p>
--------	---

#### 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

運用の基本方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	海外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。以下同じ。)を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主として海外の株式(預託証券を含みます。)に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数(配当込み、円ヘッジ・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。</p> <p>保有外貨建資産については、MSCIコクサイ指数(配当込み、円ヘッジ・ベース)の動きに連動させることをめざして為替ヘッジを行ないます。</p> <p>運用の効率化を図るため、株式指数先物取引等を利用することがあります。このため、株式等の組入総額ならびに株式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。</p> <p>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。</p>

主な投資制限	<p>株式 株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券等 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権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。</p> <p>同一銘柄の転換社債等 同一銘柄の転換社債、ならびに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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>八. 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。</p> <p>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。</p> <p>二. 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。</p> <p>ホ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。</p> <p>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。</p> <p>二. 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</p>
--------	--

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

#### 外国株式インデックスマザーファンド

運用の基本方針	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。
主要投資対象	外国の株式(預託証券を含みます。)を主要投資対象とします。
投資態度	<p>イ. 主として外国の株式(預託証券を含みます。)に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

#### 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

運用の基本方針	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。
主要投資対象	<p>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。)</p> <p>ロ. 新興国の企業のDR(預託証券)</p> <p>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)</p>
投資態度	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>ロ. 株式およびETF(上場投資信託証券)の組入比率の合計は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

<p>主な投資制限</p>	<p>株式 株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。)</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>ホ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>ヘ. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。</p>
---------------	--

## 日本債券インデックスマザーファンド

運用の基本方針	投資成果をダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数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。
主要投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	イ. 主としてわが国の公社債に投資し、投資成果をダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数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. 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。
主な投資制限	株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使等により取得したものに限り、株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資は、行ないません。

## 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド

運用の基本方針	投資成果をFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	外国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	イ. 主として、外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。 ロ. 運用の効率化を図るため、債券先物取引を利用することがあります。このため、債券の組入総額および債券先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ハ. 投資成果をFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)の動きに連動させるため、外貨建資産については為替ヘッジを行ないます。 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。

<p>主な投資制限</p>	<p>株式</p> <p>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、</p> <p>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。</p> <p>投資信託証券</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>先物取引等</p> <p>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。)</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>スワップ取引</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>ホ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。</p> <p>金利先渡取引および為替先渡取引</p>
---------------	--

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

#### 外国債券インデックスマザーファンド

運用の基本方針	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。
主要投資対象	外国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使等により取得したものに限り、株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p>

#### ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使等により取得したものに限り、株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>先物取引等</p> <p>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。)</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>スワップ取引</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>ホ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。</p> <p>金利先渡取引および為替先渡取引</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>ヘ. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。</p>
---------------	---

運用の基本方針	「東証REIT指数」(配当込み、以下同じ。)に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所( )上場(上場予定を含みます。以下同じ。)の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券(以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。)を主要投資対象とします。 金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下当マザーファンドについて同じ。
投資態度	イ. 「東証REIT指数」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 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。
主な投資制限	株式 株式への直接投資は、行ないません。 投資信託証券 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 同一銘柄の投資信託証券 同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、当該同一銘柄の「東証REIT指数」における時価の構成割合が30%を超える場合には、当該指数における構成割合の範囲で組入れることができるものとします。 外貨建資産 外貨建資産への直接投資は、行ないません。 先物取引 委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。)および外国の金融商品取引所におけるこの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

## 先進国リート・インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド

運用の基本方針	S&P先進国REIT指数(除く日本)(円ヘッジ・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	イ. 先進国(日本を除きます。以下同じ。)の金融商品取引所上場(上場予定を含みます。以下同じ。)または店頭登録(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および不動産投資法人の投資証券(以下総称して「リート」といいます。) ロ. 先進国のリート指数との連動をめざすETF(上場投資信託証券) ハ. 先進国のリートを対象としたリート指数先物取引
投資態度	イ. 主として、先進国の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、投資成果をベンチマーク(S&P先進国REIT指数(除く日本)(円ヘッジ・円ベース))の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。 効率性の観点から先進国のリート指数との連動をめざすETF(上場投資信託証券)に投資する場合があります。 ロ. 運用の効率化を図るため、先進国のリートを対象としたリート指数先物取引を利用することがあります。このため、リートの組入総額とリート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。 ハ. 保有外貨建資産については、S&P先進国REIT指数(除く日本)(円ヘッジ・円ベース)の動きに連動させることをめざして為替ヘッジを行ないます。 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。

主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>先物取引 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。</p>
--------	--

### ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

運用の基本方針	S & P先進国REIT指数(除く日本)(円ベース)に連動した投資成果をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	<p>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。</p> <p>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。以下当マザーファンドについて同じ。</p>
投資態度	<p>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 &amp; 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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>株式への直接投資は、行ないません。</p> <p>投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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。</p>

### 3【投資リスク】

#### (1) 価額変動リスク

当ファンドは、主として、特定の有価証券を実質的な投資対象としますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。委託会社の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

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。

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。

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

（FW TOPIXインデックスおよびFW 日経225インデックスの と同内容）

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。

保有実質外貨建資産については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いません。ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。為替ヘッジを行なう際、日本円の金利が組入資産の通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

ロ．カントリー・リスク

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

その他

（FW TOPIXインデックスおよびFW 日経225インデックスの と同内容）

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

（FW TOPIXインデックスおよびFW 日経225インデックスの と同内容）

## 外国証券への投資に伴うリスク

### イ．為替リスク

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

なお、当ファンドにおいては、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。そのため基準価額は、為替レートの変動の影響を直接受けます。

### ロ．カントリー・リスク

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

その他

(FW TOPIXインデックスおよびFW 日経225インデックスの と同内容)

## <FW 外国株式インデックス EM+ (為替ヘッジなし) >

### 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。

当ファンドの基準価額は、株価変動の影響を大きく受けます。

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。

## 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。

なお、当ファンドにおいては、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。そのため基準価額は、為替レートの変動の影響を直接受けます。

### ロ．カントリー・リスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落したり、方針に沿った運用が困難となることがあります。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場合があります。また、税制が変更されたり、あるいは新たな税制が適用されることにより、基準価額が影響を受ける可能性があります。

その他

(FW TOPIXインデックスおよびFW 日経225インデックスの と同内容)

#### <FW 日本債券インデックス>

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。

その他

(FW TOPIXインデックスおよびFW 日経225インデックスの と同内容)

#### <FW外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

公社債の価格変動(価格変動リスク・信用リスク)

(FW 日本債券インデックスの と同内容)

外国証券への投資に伴うリスク

(FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)の と同内容)

その他

(FW TOPIXインデックスおよびFW 日経225インデックスの と同内容)

#### <FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

公社債の価格変動(価格変動リスク・信用リスク)

(FW 日本債券インデックスの と同内容)

外国証券への投資に伴うリスク

(FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)の と同内容)

その他

(FW TOPIXインデックスおよびFW 日経225インデックスの と同内容)

#### <FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

公社債の価格変動(価格変動リスク・信用リスク)

(FW日本債券インデックスの と同内容)

外国証券への投資に伴うリスク

(FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)の と同内容)

その他

(FW T O P I XインデックスおよびFW 日経225インデックスの と同内容)

#### <FW J - R E I Tインデックス>

リート(不動産投資信託)への投資に伴うリスク

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

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

ロ. リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

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

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

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

その他

(FW T O P I XインデックスおよびFW 日経225インデックスの と同内容)

#### <FW 外国R E I Tインデックス(為替ヘッジあり)>

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

ニ．当ファンドの基準価額は、海外のリート市場の変動の影響を大きく受けます。

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

外国証券への投資に伴うリスク

（FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の と同内容）

その他

（FW T O P I XインデックスおよびFW 日経225インデックスの と同内容）

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

（FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）の と同内容）

外国証券への投資に伴うリスク

（FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の と同内容）

その他

（FW T O P I XインデックスおよびFW 日経225インデックスの と同内容）

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止(「FW TOPIXインデックス」、「FW 日経225インデックス」、「FW 日本債券インデックス」および「FW J-REITインデックス」を除きます。)その他やむを得ない事情が発生した場合には、お買付けの申込みの受付を中止すること、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。

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(「FW TOPIXインデックス」、「FW 日経225インデックス」、「FW 日本債券インデックス」および「FW J-REITインデックス」を除きます。)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\*)があるときは、ご換金の申込みの受付を中止することがあります。ご換金の申込みの受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。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。

\*「FW外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)」および「FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)」に限ります。

### (3)その他の留意点

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

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

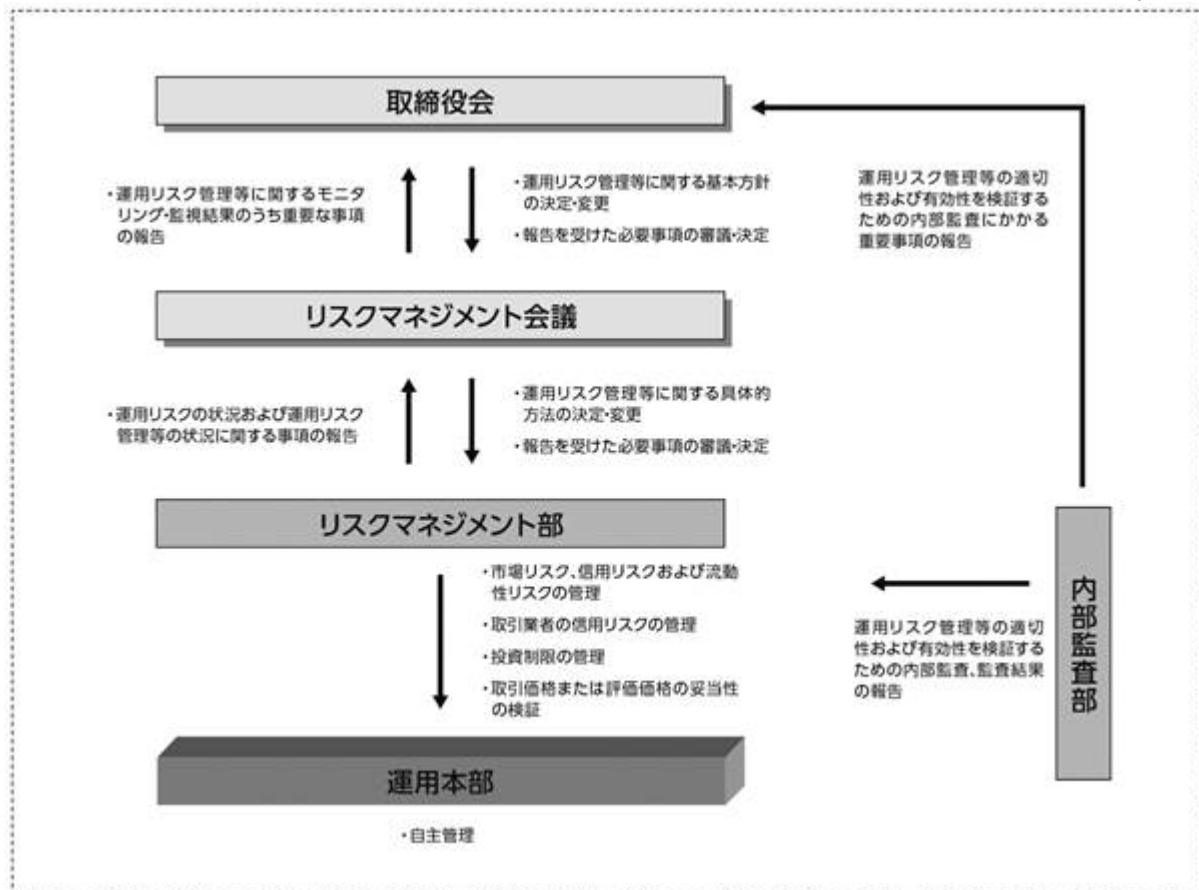
#### 流動性リスクに関する事項

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

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

### (4)リスク管理体制

運用リスク管理体制( )は、以下のとおりとなっています。



#### 流動性リスクに対する管理体制

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

## 参考情報

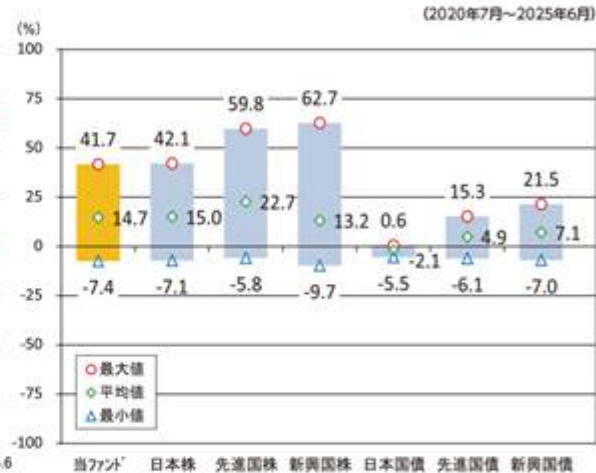
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間に於ける年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間に於ける年間騰落率の推移を表示しています。

### ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

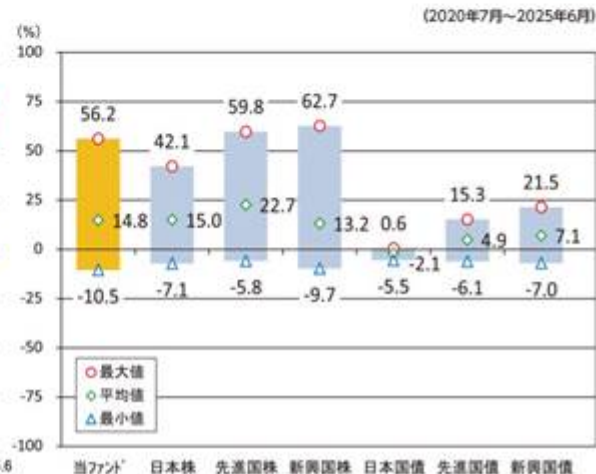
#### [FW TOPIXインデックス]



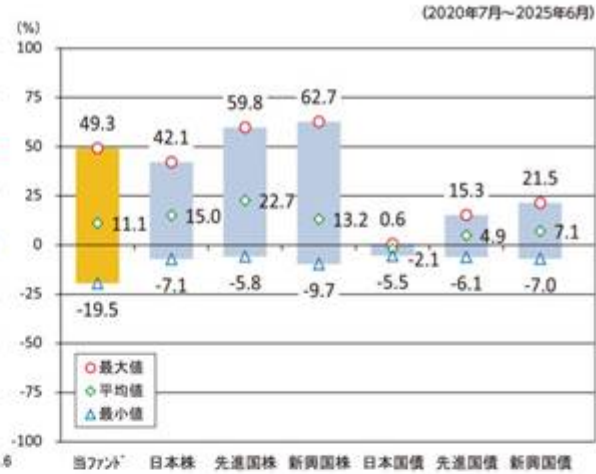
### 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



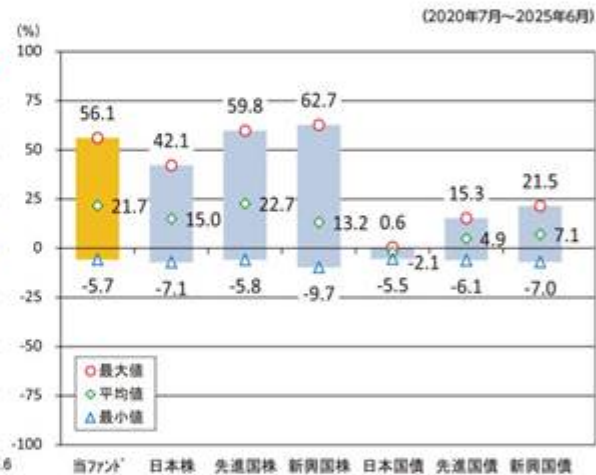
#### [FW 日経225インデックス]



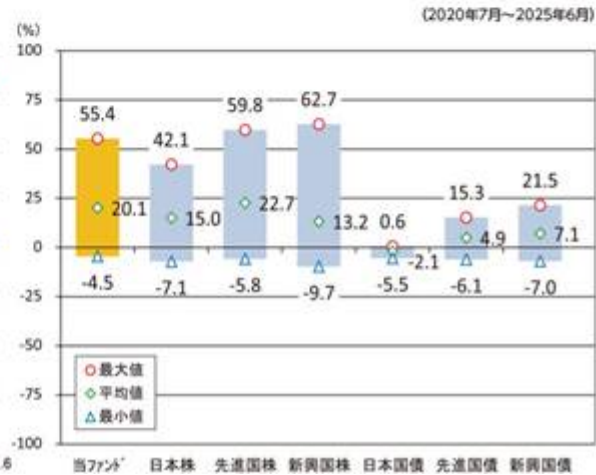
## [FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)]



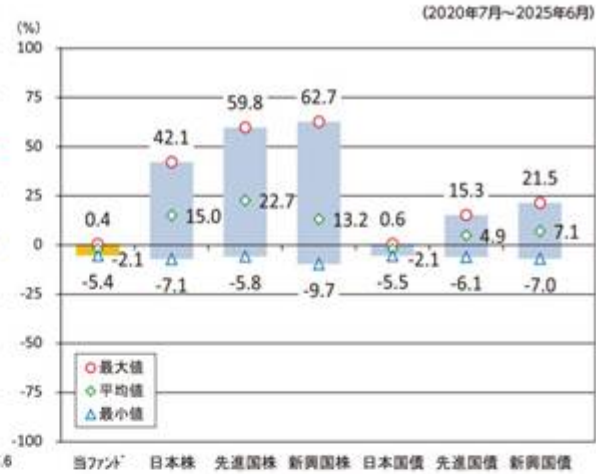
## [FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)]



## [FW 外国株式インデックスEM+(為替ヘッジなし)]



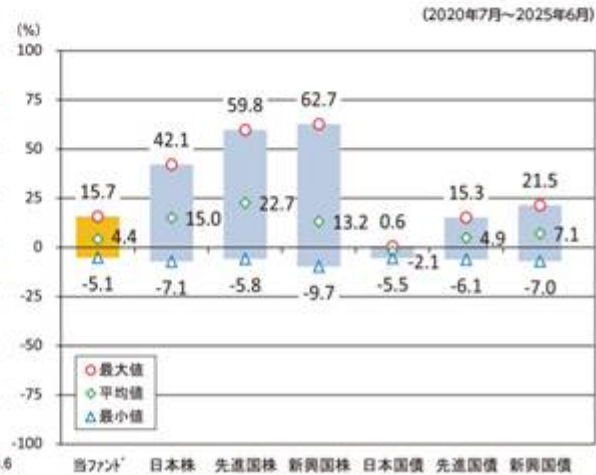
## [FW 日本債券インデックス]



## [FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)]



## [FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)]



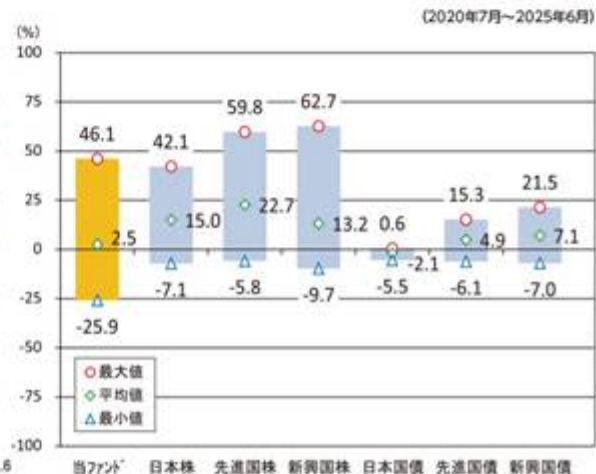
## [FW 外国債券インデックスEM+(為替ヘッジなし)]



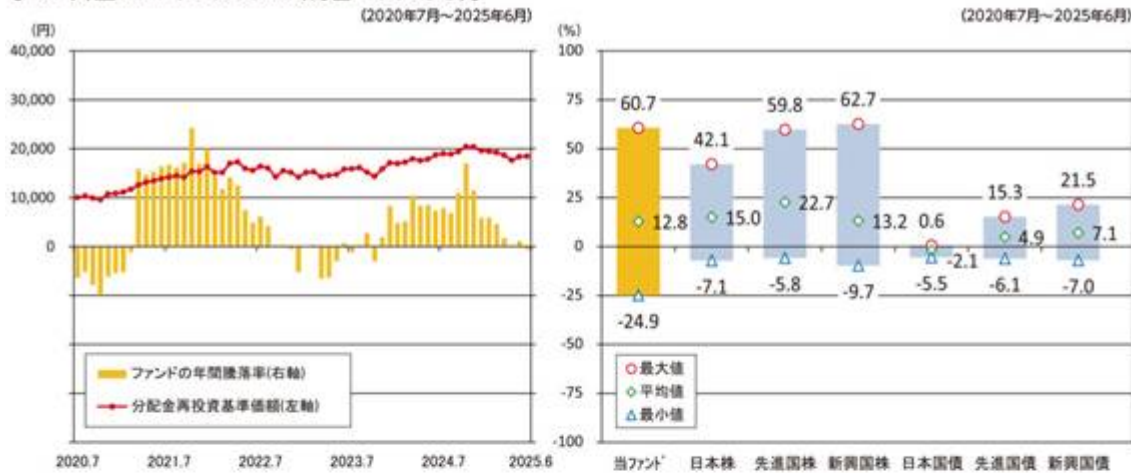
## [FW J-REITインデックス]



## [FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)]



## [FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)]



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

## ※資産クラスについて

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

## ※指数について

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

## (2)【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

### (3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に次の率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。

ファンド名	信託報酬率
FW TOPIXインデックス	年率0.341%（税抜0.31%）
FW 日経225インデックス	
FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	年率0.4455%（税抜0.405%）
FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	
FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）	年率0.4565%（税抜0.415%）
FW 日本債券インデックス	年率0.3355%（税抜0.305%）以内（ ）
FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）	年率0.418%（税抜0.38%）
FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	
FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）	年率0.429%（税抜0.39%）
FW J-REITインデックス	年率0.341%（税抜0.31%）
FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）	年率0.4345%（税抜0.395%）
FW 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）	

（ ）毎月10日（休業日の場合翌営業日）における新発10年国債の利回り（日本相互証券株式会社発表の終値）に応じて、純資産総額に対して以下の率とします。

（新発10年固定利付国債利回りが）

イ．1%未満の場合 ..... 年率0.1485%（税抜0.135%）

ロ．1%以上の場合 ..... 年率0.3355%（税抜0.305%）

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

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

<FW TOPIXインデックス>

<FW 日経225インデックス>

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.19% （税抜）	年率0.10% （税抜）	年率0.02% （税抜）

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

## &lt;FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)&gt;

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.285% (税抜)	年率0.10% (税抜)	年率0.02% (税抜)

## &lt;FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)&gt;

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.295% (税抜)	年率0.10% (税抜)	年率0.02% (税抜)

## &lt;FW 日本債券インデックス&gt;

	委託会社	販売会社	受託会社
前 イ.の場合	年率0.075% (税抜)	年率0.05% (税抜)	年率0.01% (税抜)
前 口.の場合	年率0.185% (税抜)	年率0.10% (税抜)	年率0.02% (税抜)

## &lt;FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)&gt;

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.26% (税抜)	年率0.10% (税抜)	年率0.02% (税抜)

## &lt;FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)&gt;

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.26% (税抜)	年率0.10% (税抜)	年率0.02% (税抜)

## &lt;FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)&gt;

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.27% (税抜)	年率0.10% (税抜)	年率0.02% (税抜)

## &lt;FW J-REITインデックス&gt;

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.19% (税抜)	年率0.10% (税抜)	年率0.02% (税抜)

## &lt;FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)&gt;

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.275% (税抜)	年率0.10% (税抜)	年率0.02% (税抜)

## &lt;FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)&gt;

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.275% (税抜)	年率0.10% (税抜)	年率0.02% (税抜)

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

#### (4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。また、上場不動産投資信託およびETF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 >

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

#### (5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。

なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります（「FW T O P I X インデックス」および「FW 日経 2 2 5 インデックス」のみ。）。）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)」について

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

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

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

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

## 法人の投資者に対する課税

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

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

## <注1> 個別元本について

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

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

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

個別元本について、詳しくは販売会社にお問合わせ下さい。

## <注2> 収益分配金の課税について

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

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

- ( ) 外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- ( ) 上記は、2025年6月末日現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- ( ) 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

## 【ダイワファンドラップ TOPIXインデックス】

## (1)【投資状況】（2025年6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	38,708,276,042	99.99
内 日本	38,708,276,042	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,662,103	0.01
純資産総額	38,710,938,145	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6月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	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	18,204,522,430	2.0673 37,634,829,467	2.1263 38,708,276,042	99.99

(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	99.99%
合計	99.99%

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	4,959,328,847	4,959,328,847	1.1964	1.1964
第2計算期間末 (2018年6月15日)	8,562,303,733	8,562,303,733	1.3726	1.3726
第3計算期間末 (2019年6月17日)	8,839,299,537	8,839,299,537	1.2045	1.2045
第4計算期間末 (2020年6月15日)	11,171,069,655	11,171,069,655	1.2246	1.2246
第5計算期間末 (2021年6月15日)	13,378,185,785	13,378,185,785	1.6103	1.6103
第6計算期間末 (2022年6月15日)	14,582,062,122	14,582,062,122	1.5446	1.5446
第7計算期間末 (2023年6月15日)	19,886,764,549	19,886,764,549	1.9542	1.9542
第8計算期間末 (2024年6月17日)	25,395,000,513	25,395,000,513	2.3450	2.3450
2024年6月末日	26,794,001,383	-	2.4428	-
7月末日	27,514,871,627	-	2.4289	-
8月末日	28,108,046,209	-	2.3584	-
9月末日	28,567,459,289	-	2.3210	-
10月末日	29,697,707,389	-	2.3641	-
11月末日	30,542,417,454	-	2.3512	-
12月末日	32,459,324,675	-	2.4452	-
2025年1月末日	33,645,857,940	-	2.4479	-
2月末日	33,184,462,331	-	2.3543	-
3月末日	34,062,482,106	-	2.3585	-
4月末日	35,043,724,291	-	2.3662	-
5月末日	37,326,770,766	-	2.4861	-
第9計算期間末 (2025年6月16日)	37,389,693,695	37,389,693,695	2.4642	2.4642
6月末日	38,710,938,145	-	2.5342	-

## 【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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	19.6
第2計算期間	14.7
第3計算期間	12.2
第4計算期間	1.7
第5計算期間	31.5
第6計算期間	4.1
第7計算期間	26.5
第8計算期間	20.0
第9計算期間	5.1

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	4,454,641,067	310,563,294
第2計算期間	4,087,459,929	1,994,650,943
第3計算期間	2,901,918,904	1,801,264,876
第4計算期間	4,061,789,160	2,278,428,042
第5計算期間	2,257,267,174	3,071,269,514
第6計算期間	2,926,939,275	1,794,346,768
第7計算期間	2,583,526,613	1,847,644,658
第8計算期間	3,825,653,131	3,172,488,799
第9計算期間	6,553,530,642	2,210,002,398

(注) 当初設定数量は1,000,000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6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		442,981,603,220	98.36
	内 日本	442,981,603,220	98.36
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		7,386,504,116	1.64
純資産総額		450,368,107,336	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)		7,367,190,000	1.64
	内 日本	7,367,190,000	1.64

(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6月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	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	5,830,600	2,620.61 15,279,754,091	2,493.00 14,535,685,800	3.23
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	3,783,600	2,733.17 10,341,232,809	3,730.00 14,112,828,000	3.13
3	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	6,929,500	1,503.21 10,416,496,490	1,983.00 13,741,198,500	3.05
4	日立	日本	株式	電気機器	2,818,000	3,706.09 10,443,762,496	4,205.00 11,849,690,000	2.63
5	任天堂	日本	株式	その他製品	692,500	8,012.37 5,548,572,532	13,880.00 9,611,900,000	2.13
6	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	2,230,500	3,061.82 6,829,405,326	3,634.00 8,105,637,000	1.80

7	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	833,900	9,258.49 7,720,662,839	8,535.00 7,117,336,500	1.58
8	三菱重工業	日本	株式	機械	1,937,200	1,947.20 3,772,124,188	3,610.00 6,993,292,000	1.55
9	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	232,100	23,080.74 5,357,041,533	27,680.00 6,424,528,000	1.43
10	キーエンス	日本	株式	電気機器	109,700	66,717.05 7,318,860,475	57,840.00 6,345,048,000	1.41
11	東京海上HD	日本	株式	保険業	1,031,200	5,255.75 5,419,738,512	6,111.00 6,301,663,200	1.40
12	三菱商事	日本	株式	卸売業	2,144,800	2,854.91 6,123,230,987	2,888.00 6,194,182,400	1.38
13	伊藤忠	日本	株式	卸売業	780,100	7,610.65 5,937,072,859	7,556.00 5,894,435,600	1.31
14	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,443,500	2,958.71 4,270,907,914	3,993.00 5,763,895,500	1.28
15	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	542,600	8,427.55 4,572,791,609	10,515.00 5,705,439,000	1.27
16	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	32,721,100	150.18 4,914,176,583	154.00 5,039,049,400	1.12
17	三井物産	日本	株式	卸売業	1,668,300	2,942.92 4,909,689,320	2,947.00 4,916,480,100	1.09
18	信越化学	日本	株式	化学	977,000	5,652.93 5,522,913,909	4,772.00 4,662,244,000	1.04
19	武田薬品	日本	株式	医薬品	978,800	4,264.67 4,174,268,538	4,425.00 4,331,190,000	0.96
20	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	17,646,100	198.34 3,500,092,876	223.00 3,935,080,300	0.87
21	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	78,300	46,647.31 3,652,485,026	49,520.00 3,877,416,000	0.86
22	KDDI	日本	株式	情報・通信業	1,545,900	2,412.24 3,729,092,267	2,480.00 3,833,832,000	0.85
23	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	345,700	6,632.73 2,292,935,704	10,655.00 3,683,433,500	0.82
24	本田技研	日本	株式	輸送用機器	2,598,800	1,526.81 3,967,880,043	1,394.50 3,624,026,600	0.80
25	HOYA	日本	株式	精密機器	211,100	19,169.14 4,046,605,982	17,155.00 3,621,420,500	0.80
26	富士通	日本	株式	電気機器	1,019,400	2,928.12 2,984,929,665	3,515.00 3,583,191,000	0.80

27	三菱電機	日本	株式	電気機器	1,126,800	2,298.02 2,589,412,769	3,111.00 3,505,474,800	0.78
28	第一三共	日本	株式	医薬品	1,010,100	4,840.33 4,889,224,552	3,365.00 3,398,986,500	0.75
29	日本電気	日本	株式	電気機器	783,400	2,730.32 2,138,938,218	4,219.00 3,305,164,600	0.73
30	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	1,281,900	2,184.40 2,800,193,048	2,323.00 2,977,853,700	0.66

(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	98.36%
合計	98.36%

(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	0.25%
建設業	2.24%
食料品	2.98%
繊維製品	0.39%
パルプ・紙	0.14%
化学	4.72%
医薬品	3.89%
石油・石炭製品	0.42%
ゴム製品	0.60%
ガラス・土石製品	0.61%
鉄鋼	0.73%
非鉄金属	0.91%
金属製品	0.48%
機械	6.04%
電気機器	17.60%
輸送用機器	6.60%
精密機器	1.97%
その他製品	3.37%
電気・ガス業	1.20%
陸運業	2.37%

海運業	0.60%
空運業	0.35%
倉庫・運輸関連業	0.16%
情報・通信業	8.08%
卸売業	6.74%
小売業	4.80%
銀行業	8.66%
証券、商品先物取引業	0.89%
保険業	3.23%
その他金融業	1.09%
不動産業	1.84%
サービス業	4.38%
合計	98.36%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX 先物 0709月	買建	258	7,195,641,900	7,367,190,000	1.64%

(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。

#### (参考情報) 運用実績

## ●FW TOPIXインデックス

2025年6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	25,342円
純資産総額	387億円



## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	1.9%
3カ月間	7.4%
6カ月間	3.6%
1年間	3.7%
3年間	62.6%
5年間	102.9%
設定来	153.4%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期		
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月	22年6月	23年6月	24年6月	25年6月		
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円		

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	1,676	98.4%	電気機器	17.6%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.2%
国内株式先物	1	1.6%	銀行業	8.7%	ソニーグループ	電気機器	3.1%
不動産投資信託等	-	-	情報・通信業	8.1%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	3.1%
コール・ローン、その他		1.6%	卸売業	6.7%	日立	電気機器	2.6%
合計	1,677	-	輸送用機器	6.6%	任天堂	その他製品	2.1%
株式市場・上場別構成			機械	6.0%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.8%
東証プライム市場		98.0%	小売業	4.8%	TOPIX 先物 0709月	-	1.6%
東証スタンダード市場		0.4%	化学	4.7%	リクルートホールディングス	サービス業	1.6%
東証グロース市場		-	サービス業	4.4%	三菱重工業	機械	1.6%
地方市場・その他		-	その他	30.7%	東京エレクトロン	電気機器	1.4%
合計		98.4%	合計	98.4%	合計		22.2%

※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

当ファンドのベンチマークは東証株価指数(TOPIX)(配当込み)です。



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

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2025年は6月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 【ダイワファンドラップ 日経225インデックス】

## (1) 【投資状況】 (2025年6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		26,895,504,650	99.98
	内 日本	26,895,504,650	99.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		4,551,005	0.02
純資産総額		26,900,055,655	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6月30日現在)

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ストックインデックス225・マザーファン ド	日本	親投資信 託受益証 券	4,725,639,500	5.3787 25,418,173,704	5.6914 26,895,504,650	99.98

(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	99.98%
合計	99.98%

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

#### ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

### 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)

第1計算期間末 (2017年6月15日)	3,303,197,938	3,303,197,938	1.2007	1.2007
第2計算期間末 (2018年6月15日)	6,623,555,793	6,623,555,793	1.4057	1.4057
第3計算期間末 (2019年6月17日)	8,152,341,843	8,152,341,843	1.3227	1.3227
第4計算期間末 (2020年6月15日)	11,210,563,802	11,210,563,802	1.3749	1.3749
第5計算期間末 (2021年6月15日)	14,516,397,552	14,516,397,552	1.9054	1.9054
第6計算期間末 (2022年6月15日)	14,452,677,600	14,452,677,600	1.7300	1.7300
第7計算期間末 (2023年6月15日)	19,299,142,442	19,299,142,442	2.2421	2.2421
第8計算期間末 (2024年6月17日)	24,047,464,398	24,047,464,398	2.5884	2.5884
2024年6月末日	25,083,926,278	-	2.6911	-
7月末日	24,568,388,125	-	2.6579	-
8月末日	24,246,781,477	-	2.6278	-
9月末日	23,997,666,229	-	2.5938	-
10月末日	24,707,734,679	-	2.6721	-
11月末日	24,226,615,290	-	2.6120	-
12月末日	25,443,520,465	-	2.7294	-
2025年1月末日	25,269,391,092	-	2.7066	-
2月末日	23,708,974,300	-	2.5418	-
3月末日	23,037,298,306	-	2.4562	-
4月末日	23,868,475,906	-	2.4856	-
5月末日	25,250,488,339	-	2.6178	-
第9計算期間末 (2025年6月16日)	25,375,449,225	25,375,449,225	2.6413	2.6413
6月末日	26,900,055,655	-	2.7946	-

## 【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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	20.1
第2計算期間	17.1
第3計算期間	5.9
第4計算期間	3.9
第5計算期間	38.6
第6計算期間	9.2
第7計算期間	29.6
第8計算期間	15.4
第9計算期間	2.0

## (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	2,867,193,216	117,139,415
第2計算期間	2,980,382,583	1,019,368,476
第3計算期間	2,731,635,338	1,280,509,751
第4計算期間	3,775,885,438	1,785,574,418
第5計算期間	2,128,271,246	2,663,324,439
第6計算期間	2,488,303,056	1,752,829,196
第7計算期間	1,947,250,912	1,693,734,159
第8計算期間	3,716,226,558	3,033,069,088
第9計算期間	1,965,081,837	1,648,641,476

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

ストックインデックス225・マザーファンド

## (1) 投資状況 (2025年6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	395,597,150,000	98.96
内 日本	395,597,150,000	98.96

コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,169,978,733	1.04
純資産総額	399,767,128,733	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)	4,132,020,000	1.03
内 日本	4,132,020,000	1.03

(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。

## (2) 投資資産 (2025年6月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	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	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	780,000	45,877.28 35,784,279,372	49,520.00 38,625,600,000	9.66
2	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	2,600,000	6,291.70 16,358,446,400	10,655.00 27,703,000,000	6.93
3	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	975,000	22,802.87 22,232,798,340	27,680.00 26,988,000,000	6.75
4	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信 業	1,950,000	8,306.46 16,197,613,440	10,515.00 20,504,250,000	5.13
5	KDDI	日本	株式	情報・通信 業	3,900,000	2,404.52 9,377,656,560	2,480.00 9,672,000,000	2.42
6	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	975,000	9,095.80 8,868,411,600	8,535.00 8,321,625,000	2.08
7	T D K	日本	株式	電気機器	4,875,000	1,748.20 8,522,523,000	1,695.50 8,265,562,500	2.07
8	信越化学	日本	株式	化学	1,625,000	5,587.97 9,080,460,900	4,772.00 7,754,500,000	1.94
9	コナミグループ	日本	株式	情報・通信 業	325,000	14,619.62 4,751,377,280	22,815.00 7,414,875,000	1.85
10	中外製薬	日本	株式	医薬品	975,000	6,814.00 6,643,650,000	7,525.00 7,336,875,000	1.84

11	テルモ	日本	株式	精密機器	2,600,000	2,686.11 6,983,894,720	2,650.00 6,890,000,000	1.72
12	NTTデータグループ	日本	株式	情報・通信業	1,625,000	2,500.93 4,064,027,100	3,999.00 6,498,375,000	1.63
13	ファナック	日本	株式	電気機器	1,625,000	3,841.30 6,242,126,000	3,940.00 6,402,500,000	1.60
14	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	1,625,000	2,726.70 4,430,904,000	3,730.00 6,061,250,000	1.52
15	ダイキン工業	日本	株式	機械	325,000	17,724.22 5,760,374,680	17,025.00 5,533,125,000	1.38
16	バンダイナムコHLDGS	日本	株式	その他製品	975,000	3,479.10 3,392,128,200	5,171.00 5,041,725,000	1.26
17	日東電工	日本	株式	化学	1,625,000	2,444.36 3,972,099,200	2,791.50 4,536,187,500	1.13
18	任天堂	日本	株式	その他製品	325,000	7,958.32 2,586,457,080	13,880.00 4,511,000,000	1.13
19	京セラ	日本	株式	電気機器	2,600,000	1,712.43 4,452,327,360	1,733.50 4,507,100,000	1.13
20	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	1,625,000	2,609.01 4,239,652,200	2,493.00 4,051,125,000	1.01
21	セコム	日本	株式	サービス業	650,000	5,450.92 3,543,099,960	5,183.00 3,368,950,000	0.84
22	第一三共	日本	株式	医薬品	975,000	4,786.88 4,667,212,948	3,365.00 3,280,875,000	0.82
23	トレンドマイクロ	日本	株式	情報・通信業	325,000	8,973.40 2,916,357,600	9,977.00 3,242,525,000	0.81
24	豊田通商	日本	株式	卸売業	975,000	2,620.13 2,554,634,160	3,269.00 3,187,275,000	0.80
25	富士フイルムHLDGS	日本	株式	化学	975,000	3,668.59 3,576,877,380	3,142.00 3,063,450,000	0.77
26	東京海上HD	日本	株式	保険業	487,500	5,200.95 2,535,465,450	6,111.00 2,979,112,500	0.75
27	三菱商事	日本	株式	卸売業	975,000	2,848.92 2,777,699,940	2,888.00 2,815,800,000	0.70
28	HOYA	日本	株式	精密機器	162,500	18,903.70 3,071,851,400	17,155.00 2,787,687,500	0.70
29	ディスコ	日本	株式	機械	65,000	35,078.94 2,280,131,272	42,630.00 2,770,950,000	0.69
30	本田技研	日本	株式	輸送用機器	1,950,000	1,525.28 2,974,306,920	1,394.50 2,719,275,000	0.68

(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	98.96%
合計	98.96%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.07%
鉱業	0.07%
建設業	1.67%
食料品	2.88%
繊維製品	0.10%
パルプ・紙	0.06%
化学	5.49%
医薬品	5.42%
石油・石炭製品	0.20%
ゴム製品	0.64%
ガラス・土石製品	0.56%
鉄鋼	0.05%
非鉄金属	1.20%
金属製品	0.01%
機械	4.63%
電気機器	26.48%
輸送用機器	3.60%
精密機器	3.17%
その他製品	2.98%
電気・ガス業	0.17%
陸運業	0.89%
海運業	0.39%
空運業	0.26%
情報・通信業	13.39%
卸売業	3.16%
小売業	12.70%
銀行業	0.76%
証券、商品先物取引業	0.16%
保険業	1.28%

その他金融業	0.82%
不動産業	1.20%
サービス業	4.49%
合計	98.96%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	NK225 先物 0709月	買建	102	3,927,572,100	4,132,020,000	1.03%

(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。

#### (参考情報) 運用実績

## ●FW 日経225インデックス

2025年6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	27,946円
純資産総額	269億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	6.8%
3カ月間	13.8%
6カ月間	2.4%
1年間	3.8%
3年間	61.0%
5年間	96.1%
設定来	179.5%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

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

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

## 主要な資産の状況

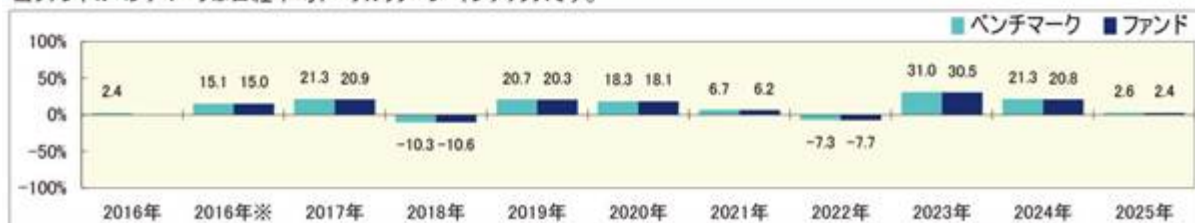
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	225	98.9%	電気機器	26.5%	ファーストリテイリング	小売業	9.7%
国内株式先物	1	1.0%	情報・通信業	13.4%	アドバンテスト	電気機器	6.9%
不動産投資信託等	-	-	小売業	12.7%	東京エレクトロン	電気機器	6.7%
コール・ローン、その他	-	1.1%	化学	5.5%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	5.1%
合計	226	-	医薬品	5.4%	KDDI	情報・通信業	2.4%
株式市場・上場別構成			機械	4.6%	リクルートホールディングス	サービス業	2.1%
東証プライム市場		98.9%	サービス業	4.5%	T D K	電気機器	2.1%
東証スタンダード市場		-	輸送用機器	3.6%	信越化学	化学	1.9%
東証グロース市場		-	精密機器	3.2%	コナミグループ	情報・通信業	1.9%
地方市場・その他		-	その他	19.6%	中外製薬	医薬品	1.8%
合計		98.9%	合計	98.9%	合計		40.7%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは日経平均トータルリターン・インデックスです。



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

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2025年は6月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)】

## (1) 【投資状況】 (2025年6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	95,916,444,156	99.99
内 日本	95,916,444,156	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	14,099,295	0.01
純資産総額	95,930,543,451	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6月30日現在)

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	外国株式インデックス為替ヘッジ型 マザーファンド	日本	親投資信 託受益証 券	27,899,719,060	3.3551 93,608,177,854	3.4379 95,916,444,156	99.99

(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	99.99%
合計	99.99%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)

第1計算期間末 (2017年6月15日)	16,740,001,185	16,740,001,185	1.1194	1.1194
第2計算期間末 (2018年6月15日)	31,820,531,530	31,820,531,530	1.2400	1.2400
第3計算期間末 (2019年6月17日)	36,065,457,483	36,065,457,483	1.2648	1.2648
第4計算期間末 (2020年6月15日)	42,369,088,321	42,369,088,321	1.2825	1.2825
第5計算期間末 (2021年6月15日)	56,165,645,906	56,165,645,906	1.7819	1.7819
第6計算期間末 (2022年6月15日)	53,716,109,956	53,716,109,956	1.5540	1.5540
第7計算期間末 (2023年6月15日)	68,296,881,791	68,296,881,791	1.7433	1.7433
第8計算期間末 (2024年6月17日)	84,165,891,249	84,165,891,249	2.0021	2.0021
2024年6月末日	86,012,709,380	-	2.0186	-
7月末日	86,749,992,273	-	2.0013	-
8月末日	90,005,360,217	-	2.0433	-
9月末日	92,709,002,229	-	2.0827	-
10月末日	92,900,303,514	-	2.0893	-
11月末日	95,908,985,091	-	2.1401	-
12月末日	93,536,222,354	-	2.1195	-
2025年1月末日	96,275,143,201	-	2.1670	-
2月末日	94,669,108,433	-	2.1103	-
3月末日	91,234,831,886	-	2.0139	-
4月末日	87,544,896,278	-	1.9958	-
5月末日	93,164,062,090	-	2.1129	-
第9計算期間末 (2025年6月16日)	93,162,582,061	93,162,582,061	2.1292	2.1292
6月末日	95,930,543,451	-	2.1814	-

## 【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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	11.9
第2計算期間	10.8
第3計算期間	2.0
第4計算期間	1.4
第5計算期間	38.9
第6計算期間	12.8
第7計算期間	12.2
第8計算期間	14.8
第9計算期間	6.3

## (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	15,911,823,542	958,970,794
第2計算期間	15,243,885,793	4,536,508,120
第3計算期間	9,938,067,643	7,085,414,359
第4計算期間	12,720,408,945	8,198,873,384
第5計算期間	7,978,557,364	9,493,197,837
第6計算期間	10,317,685,523	7,272,108,784
第7計算期間	12,181,359,226	7,570,904,254
第8計算期間	13,600,258,382	10,737,911,528
第9計算期間	12,127,063,344	10,412,415,001

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

## (1) 投資状況 (2025年6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	136,295,401,849	94.35
内 香港	740,622,761	0.51

内 シンガポール	629,766,085	0.44
内 イスラエル	372,598,455	0.26
内 ノルウェー	246,621,057	0.17
内 スウェーデン	1,428,451,209	0.99
内 デンマーク	887,342,978	0.61
内 イギリス	5,382,335,752	3.73
内 アイルランド	165,627,647	0.11
内 オランダ	1,704,843,561	1.18
内 ベルギー	367,455,722	0.25
内 フランス	3,921,179,883	2.71
内 ドイツ	3,726,189,302	2.58
内 スイス	3,504,241,438	2.43
内 ポルトガル	62,452,780	0.04
内 スペイン	1,190,372,324	0.82
内 イタリア	1,126,260,611	0.78
内 フィンランド	382,377,195	0.26
内 オーストリア	74,464,086	0.05
内 カナダ	4,284,994,142	2.97
内 アメリカ	103,737,546,473	71.81
内 オーストラリア	2,284,861,631	1.58
内 ニュージーランド	74,796,757	0.05
投資証券	2,448,436,937	1.69
内 香港	39,667,759	0.03
内 シンガポール	38,552,841	0.03
内 イギリス	36,858,541	0.03
内 フランス	52,732,408	0.04
内 アメリカ	2,076,351,674	1.44
内 オーストラリア	204,273,714	0.14
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,719,027,005	3.96
純資産総額	144,462,865,791	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)	7,381,301,698	5.11
内 イギリス	279,937,830	0.19
内 ドイツ	1,209,545,847	0.84
内 カナダ	638,739,629	0.44
内 アメリカ	5,092,125,992	3.52

	内 オーストラリア	160,952,400	0.11
為替予約取引(売建)		138,042,547,304	95.56
	内 日本	138,042,547,304	95.56

(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6月30日現在)

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	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	331,410	19,952.64 6,612,552,085	22,843.77 7,570,656,301	5.24
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	95,866	61,337.89 5,880,226,680	71,817.07 6,884,815,367	4.77
3	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	204,063	34,877.92 7,117,312,073	29,118.39 5,941,986,998	4.11
4	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	129,785	31,835.03 4,131,725,617	32,336.07 4,196,737,234	2.91
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	29,767	88,550.01 2,635,869,827	106,236.96 3,162,355,597	2.19
6	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	60,680	32,698.38 1,984,144,828	39,004.57 2,366,797,520	1.64
7	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	79,168	27,714.46 2,194,108,930	25,852.92 2,046,724,707	1.42
8	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	39,346	55,532.17 2,184,970,556	46,864.86 1,843,944,793	1.28

9	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	67,340	27,939.06 1,881,421,450	25,815.27 1,738,400,868	1.20
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	37,969	35,278.17 1,339,478,898	41,576.39 1,578,614,297	1.09
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	アメリカ	株式	金融	18,159	66,200.76 1,202,142,106	70,331.32 1,277,146,454	0.88
12	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	10,965	114,599.44 1,256,583,808	112,292.91 1,231,291,807	0.85
13	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	23,360	45,963.56 1,073,709,732	50,482.21 1,179,264,521	0.82
14	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	5,803	128,580.41 746,152,930	191,601.00 1,111,860,645	0.77
15	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネル ギー	58,729	15,491.04 909,776,278	15,839.31 930,227,295	0.64
16	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	11,098	75,278.32 835,439,532	79,691.83 884,420,031	0.61
17	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需 品	6,020	135,552.15 816,024,305	142,658.12 858,801,903	0.59
18	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需 品	59,667	13,338.59 795,881,031	14,085.66 840,449,594	0.58
19	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需 品	31,848	23,559.57 750,327,787	23,149.32 737,259,754	0.51
20	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	32,694	20,857.99 681,933,457	22,070.49 721,572,669	0.50
21	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	13,454	55,883.77 751,860,587	53,397.23 718,406,459	0.50
22	ORACLE CORP	アメリカ	株式	情報技術	22,720	23,447.49 532,729,693	30,444.85 691,707,092	0.48
23	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	98,449	6,629.54 652,677,450	6,823.44 671,761,553	0.47
24	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	23,859	26,150.36 623,923,544	26,400.31 629,885,023	0.44
25	SAP SE	ドイツ	株式	情報技術	13,799	41,897.53 578,145,538	43,772.28 604,013,692	0.42

26	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	5,123	123,500.43 632,692,908	115,792.95 593,207,283	0.41
27	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	55,333	9,047.72 500,645,304	10,184.48 563,538,236	0.39
28	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	12,369	75,046.62 928,251,951	44,762.21 553,663,888	0.38
29	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	アメリカ	株式	情報技術	29,148	10,437.03 304,220,329	18,932.45 551,843,327	0.38
30	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	アメリカ	株式	生活必需品	21,045	18,126.30 381,469,971	26,214.95 551,693,713	0.38

(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	94.35%
投資証券	1.69%
合計	96.04%

(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	3.49%
素材	3.05%
資本財・サービス	10.24%
一般消費財・サービス	9.43%
生活必需品	5.76%
ヘルスケア	9.32%
金融	16.32%
情報技術	25.72%
コミュニケーション・サービス	8.15%
公益事業	2.59%
不動産	0.28%
合計	94.35%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 EMINI SEP 25	買建	113	4,979,518,087	5,092,125,992	3.52%
	イギリス	FTSE 100 INDEX SEP 25	買建	16	281,227,279	279,937,830	0.19%
	オーストラ リア	SPI 200 SEP 25	買建	8	161,125,902	160,952,400	0.11%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX SEP 25	買建	19	635,910,255	638,739,629	0.44%
	ドイツ	SWISS MKT IX SEP 25	買建	9	196,012,760	195,223,357	0.14%
		EURO STOXX 50 SEP 25	買建	112	1,007,153,846	1,014,322,490	0.70%
為替予約取引	日本	スウェーデン・クロー ネ売/円買 2025年7月	売建	78,431,700	1,176,599,002	1,197,283,429	0.83%
		米ドル売/円買 2025年 7月	売建	724,774,500	103,712,228,720	104,866,680,197	72.59%
		ユーロ売/円買 2025年 7月	売建	77,506,200	12,642,252,280	13,144,640,736	9.10%
		デンマーク・クローネ 売/円買 2025年7月	売建	40,610,000	888,262,439	923,187,129	0.64%
		ノルウェー・クローネ 売/円買 2025年7月	売建	17,133,000	240,799,415	245,658,093	0.17%
		カナダ・ドル売/円買 2025年7月	売建	41,654,400	4,354,200,481	4,400,316,664	3.05%
		シンガポール・ドル 売/円買 2025年7月	売建	4,626,000	514,808,339	524,892,327	0.36%
		香港ドル売/円買 2025 年7月	売建	38,556,400	705,954,168	710,891,336	0.49%
		英ポンド売/円買 2025 年7月	売建	28,124,900	5,429,552,602	5,579,952,034	3.86%
		イスラエル・シュケル 売/円買 2025年7月	売建	5,146,100	209,420,539	219,648,413	0.15%
		豪ドル売/円買 2025年 7月	売建	26,649,500	2,463,090,235	2,516,698,831	1.74%
		スイス・フラン売/円 買 2025年7月	売建	20,086,500	3,514,319,718	3,639,117,403	2.52%
		ニュージーランド・ド ル売/円買 2025年7月	売建	839,400	72,083,475	73,580,712	0.05%

- (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。

(参考情報) 運用実績

## ●FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)

2025年6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	21,814円
純資産総額	959億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	3.2%
3カ月間	8.3%
6カ月間	2.9%
1年間	8.1%
3年間	38.0%
5年間	68.5%
設定来	118.1%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月	第5期 21年6月	第6期 22年6月	第7期 23年6月	第8期 24年6月	第9期 25年6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を約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	株式業種別構成	比率	組入上位10銘柄	国・地域名	比率
外国株式・先物	1,099	99.4%	日本円	96.4%	情報技術	25.7%	NVIDIA CORP	アメリカ	5.2%
外国リート	46	1.6%	米ドル	3.5%	金融	16.3%	MICROSOFT CORP	アメリカ	4.8%
外国投資証券	3	0.1%	カナダ・ドル	0.1%	資本財・サービス	10.2%	APPLE INC	アメリカ	4.1%
外国ワラント	1	0.0%	英ポンド	0.0%	一般消費財・サービス	9.4%	S&P500 EMINI SEP 25	アメリカ	3.5%
コール・ローン、その他		4.0%	香港ドル	0.0%	ヘルスケア	9.3%	AMAZON.COM INC	アメリカ	2.9%
合計	1,149	-	豪ドル	0.0%	コミュニケーション・サービス	8.1%	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	2.2%
国・地域別構成			イスラエル・シケル	0.0%	生活必需品	5.8%	BROADCOM INC	アメリカ	1.6%
アメリカ		76.8%	ノルウェー・クローネ	0.0%	エネルギー	3.5%	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.4%
イギリス		3.9%	シンガポール・ドル	0.0%	素材	3.0%	TESLA INC	アメリカ	1.3%
その他		20.4%	その他	-0.1%	公益事業、他	2.9%	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.2%
合計		101.1%	合計	100.0%	合計	94.3%	合計		28.3%

※株式業種別構成は、原則としてS&PとMSCI Incが共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

※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

当ファンドのベンチマークはMSCIコクサイ指数(税引後配当込み、円ヘッジ・ベース)です。



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

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2025年は6月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)】

## (1) 【投資状況】 (2025年6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	49,695,581,965	99.99
内 日本	49,695,581,965	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,924,148	0.01
純資産総額	49,700,506,113	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6月30日現在)

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	外国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	6,973,448,300	6.9124 48,203,875,061	7.1264 49,695,581,965	99.99

(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	99.99%
合計	99.99%

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

#### ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

### 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	1,719,851,096	1,719,851,096	1.2232	1.2232
第2計算期間末 (2018年6月15日)	3,307,440,968	3,307,440,968	1.3931	1.3931
第3計算期間末 (2019年6月17日)	4,523,386,578	4,523,386,578	1.4011	1.4011
第4計算期間末 (2020年6月15日)	5,717,881,883	5,717,881,883	1.4231	1.4231
第5計算期間末 (2021年6月15日)	9,292,062,179	9,292,062,179	2.0848	2.0848
第6計算期間末 (2022年6月15日)	10,844,781,442	10,844,781,442	2.1770	2.1770
第7計算期間末 (2023年6月15日)	17,911,076,601	17,911,076,601	2.6685	2.6685
第8計算期間末 (2024年6月17日)	34,939,206,897	34,939,206,897	3.6322	3.6322
2024年6月末日	36,514,886,906	-	3.7458	-
7月末日	35,125,759,509	-	3.5361	-
8月末日	35,768,523,187	-	3.4736	-
9月末日	36,927,668,845	-	3.5128	-
10月末日	40,494,906,616	-	3.7779	-
11月末日	41,981,541,377	-	3.7992	-
12月末日	44,279,021,335	-	3.9491	-
2025年1月末日	45,225,346,581	-	3.9564	-
2月末日	43,464,331,467	-	3.7472	-
3月末日	42,693,976,244	-	3.6111	-
4月末日	42,255,998,965	-	3.4571	-
5月末日	46,590,392,049	-	3.7048	-
第9計算期間末 (2025年6月16日)	47,829,844,439	47,829,844,439	3.7633	3.7633
6月末日	49,700,506,113	-	3.8795	-

## 【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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	22.3
第2計算期間	13.9
第3計算期間	0.6
第4計算期間	1.6
第5計算期間	46.5
第6計算期間	4.4
第7計算期間	22.6
第8計算期間	36.1
第9計算期間	3.6

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	1,475,674,063	70,680,538
第2計算期間	1,380,206,909	412,026,062
第3計算期間	1,523,438,524	669,208,679
第4計算期間	1,946,108,703	1,156,513,875
第5計算期間	1,622,654,198	1,183,681,857
第6計算期間	1,798,628,403	1,274,027,097
第7計算期間	2,849,753,966	1,119,335,471
第8計算期間	5,219,463,826	2,312,115,128
第9計算期間	5,294,473,327	2,204,124,579

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

外国株式インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況 (2025年6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	679,834,914,235	95.35
内 香港	3,658,481,765	0.51
内 シンガポール	3,110,697,911	0.44
内 イスラエル	1,855,275,953	0.26
内 ノルウェー	1,200,903,062	0.17
内 スウェーデン	7,030,981,713	0.99
内 デンマーク	4,408,121,288	0.62
内 イギリス	26,373,391,458	3.70
内 アイルランド	837,053,178	0.12
内 オランダ	8,561,764,771	1.20
内 ベルギー	1,851,208,771	0.26
内 フランス	19,775,805,880	2.77
内 ドイツ	18,788,965,259	2.64
内 スイス	16,552,843,357	2.32
内 ポルトガル	305,306,898	0.04
内 スペイン	5,989,177,088	0.84
内 イタリア	5,637,116,717	0.79
内 フィンランド	1,912,794,782	0.27
内 オーストリア	372,588,224	0.05
内 カナダ	21,782,811,883	3.06
内 アメリカ	518,587,127,414	72.73
内 オーストラリア	10,880,836,501	1.53
内 ニュージーランド	361,660,362	0.05
投資証券	12,258,289,063	1.72
内 香港	199,845,897	0.03
内 シンガポール	181,212,515	0.03
内 イギリス	172,588,998	0.02
内 フランス	270,070,287	0.04
内 アメリカ	10,449,345,901	1.47
内 オーストラリア	985,225,465	0.14
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	20,915,328,020	2.93
純資産総額	713,008,531,318	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)	20,804,566,484	2.92
内 イギリス	1,207,231,894	0.17

	内 ドイツ	4,320,645,756	0.61
	内 カナダ	2,218,779,763	0.31
	内 アメリカ	12,031,837,521	1.69
	内 オーストラリア	1,026,071,550	0.14
為替予約取引(買建)		4,853,368,810	0.68
	内 日本	4,853,368,810	0.68

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

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

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

(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6月30日現在）

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	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	1,655,100	19,958.58 33,033,477,526	22,843.77 37,808,736,140	5.30
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	478,600	61,309.51 29,342,798,024	71,817.07 34,371,650,372	4.82
3	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	1,018,800	34,272.90 34,917,256,946	29,118.39 29,665,820,622	4.16
4	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	647,400	30,112.37 19,494,765,753	32,336.07 20,934,373,660	2.94
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	148,500	83,806.61 12,445,295,050	106,236.96 15,776,188,605	2.21
6	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	302,720	23,919.13 7,240,817,655	39,004.57 11,807,464,490	1.66
7	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	395,300	24,478.39 9,676,365,663	25,852.92 10,219,662,952	1.43

8	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	196,250	49,721.09 9,757,777,121	46,864.86 9,197,228,834	1.29
9	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	335,240	24,698.64 8,280,009,114	25,815.27 8,654,314,031	1.21
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	189,470	36,233.77 6,865,216,110	41,576.39 7,877,480,337	1.10
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	90,850	70,178.54 6,375,722,049	70,331.32 6,389,600,495	0.90
12	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	54,685	115,537.38 6,318,167,713	112,292.91 6,140,738,029	0.86
13	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	116,850	46,163.83 5,394,255,042	50,482.21 5,898,846,718	0.83
14	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	28,990	129,707.04 3,760,210,588	191,601.00 5,554,513,199	0.78
15	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネル ギー	293,009	17,052.82 4,996,646,118	15,839.31 4,641,062,669	0.65
16	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	55,200	77,431.06 4,274,195,886	79,691.83 4,398,989,524	0.62
17	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需 品	30,160	141,303.13 4,261,704,257	142,658.12 4,302,569,002	0.60
18	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需 品	298,800	13,437.49 4,015,162,799	14,085.66 4,208,797,808	0.59
19	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需 品	158,867	25,912.01 4,116,566,207	23,149.32 3,677,664,069	0.52
20	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	163,300	22,491.16 3,672,808,065	22,070.49 3,604,111,360	0.51
21	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	67,350	61,825.32 4,163,944,141	53,397.23 3,596,304,074	0.50
22	ORACLE CORP	アメリカ	株式	情報技術	114,033	26,598.12 3,033,066,407	30,444.85 3,471,718,082	0.49
23	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	490,401	6,842.12 3,355,404,458	6,823.44 3,346,225,330	0.47
24	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	119,872	26,616.36 3,190,564,983	26,400.31 3,164,658,092	0.44

25	SAP SE	ドイツ	株式	情報技術	69,258	38,503.31 2,666,667,254	43,772.28 3,031,580,568	0.43
26	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	26,150	111,756.22 2,922,429,108	115,792.95 3,027,985,643	0.42
27	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	277,050	9,332.13 2,585,505,946	10,184.48 2,821,612,206	0.40
28	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	62,066	87,179.24 5,410,873,466	44,762.21 2,778,211,891	0.39
29	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	アメリカ	株式	生活必需品	105,500	19,509.52 2,058,264,755	26,214.95 2,765,677,679	0.39
30	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	アメリカ	株式	情報技術	145,300	10,218.51 1,484,771,395	18,932.45 2,750,886,351	0.39

(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	95.35%
投資証券	1.72%
合計	97.07%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	3.52%
素材	3.07%
資本財・サービス	10.34%
一般消費財・サービス	9.54%
生活必需品	5.82%
ヘルスケア	9.38%
金融	16.48%
情報技術	26.06%
コミュニケーション・サービス	8.22%
公益事業	2.63%
不動産	0.29%
合計	95.35%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 EMINI SEP 25	買建	267	11,781,697,172	12,031,837,521	1.69%
	イギリス	FTSE 100 INDEX SEP 25	買建	69	1,212,539,353	1,207,231,894	0.17%
	オーストラ リア	SPI 200 SEP 25	買建	51	1,027,298,113	1,026,071,550	0.14%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX SEP 25	買建	66	2,209,718,642	2,218,779,763	0.31%
	ドイツ	SWISS MKT IX SEP 25	買建	66	1,438,360,535	1,431,637,951	0.20%
		EURO STOXX 50 SEP 25	買建	319	2,867,323,815	2,889,007,805	0.41%
為替予約取引	日本	カナダ・ドル買/円売 2025年7月	買建	11,300,000	1,180,523,840	1,193,717,310	0.17%
		ユーロ買/円売 2025年7 月	買建	3,600,000	588,903,480	610,540,920	0.09%
		米ドル買/円売 2025年7 月	買建	10,000,000	1,429,872,680	1,446,887,000	0.20%
		豪ドル買/円売 2025年7 月	買建	5,200,000	480,765,800	491,072,400	0.07%
		英ポンド買/円売 2025年 7月	買建	1,400,000	270,110,120	277,758,600	0.04%
		スイス・フラン買/円売 2025年7月	買建	4,600,000	805,228,570	833,392,580	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) 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。

(参考情報) 運用実績

## ●FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)

2025年6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	38,795円
純資産総額	497億円



## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	4.7%
3カ月間	7.4%
6カ月間	-1.8%
1年間	3.6%
3年間	72.5%
5年間	169.0%
設定来	288.0%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期		
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月	22年6月	23年6月	24年6月	25年6月		
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円		

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	株式業種別構成	比率	組入上位10銘柄	国・地域名	比率
外国株式・先物	1,099	98.3%	米ドル	76.3%	情報技術	26.1%	NVIDIA CORP	アメリカ	5.3%
外国リート	46	1.7%	ユーロ	9.4%	金融	16.5%	MICROSOFT CORP	アメリカ	4.8%
外国投資証券	3	0.1%	英ポンド	3.9%	資本財・サービス	10.3%	APPLE INC	アメリカ	4.2%
			カナダ・ドル	3.4%	一般消費財・サービス	9.5%	AMAZON.COM INC	アメリカ	2.9%
コール・ローン、その他		2.9%	スイス・フラン	2.5%	ヘルスケア	9.4%	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	2.2%
合計	1,148	-	豪ドル	1.8%	コミュニケーション・サービス	8.2%	S&P500 EMINI SEP 25	アメリカ	1.7%
			スウェーデン・クローネ	0.8%	生活必需品	5.8%	BROADCOM INC	アメリカ	1.7%
国・地域別構成			デンマーク・クローネ	0.6%	エネルギー	3.5%	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.4%
アメリカ		75.9%	香港ドル	0.5%	素材	3.1%	TESLA INC	アメリカ	1.3%
イギリス		3.9%	その他	0.8%	公益事業、他	2.9%	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.2%
その他		20.2%	合計	100.0%	合計	95.3%	合計		26.7%
合計		100.0%							

※株式業種別構成は、原則としてS&PとMSCI Inc.が共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

※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

当ファンドのベンチマークはMSCIコクサイ指数(税引後配当込み、円ベース)です。



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

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2025年は6月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 【ダイワファンドラップ 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)】

## (1) 【投資状況】 (2025年6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	7,184,560,030	99.20
内 日本	7,184,560,030	99.20
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	57,602,114	0.80
純資産総額	7,242,162,144	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6月30日現在)

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	外国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	804,424,507	6.9118 5,560,070,171	7.1264 5,732,650,806	79.16
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	479,827,233	2.9582 1,419,448,516	3.0259 1,451,909,224	20.05

(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	99.20%
合計	99.20%

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

#### ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	826,097,593	826,097,593	1.2158	1.2158
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,697,993,255	1,697,993,255	1.3778	1.3778
第3計算期間末 (2019年6月17日)	1,747,579,023	1,747,579,023	1.3793	1.3793
第4計算期間末 (2020年6月15日)	1,800,845,481	1,800,845,481	1.3573	1.3573
第5計算期間末 (2021年6月15日)	2,402,518,423	2,402,518,423	1.9822	1.9822
第6計算期間末 (2022年6月15日)	2,605,876,138	2,605,876,138	2.0510	2.0510
第7計算期間末 (2023年6月15日)	3,957,729,997	3,957,729,997	2.4679	2.4679
第8計算期間末 (2024年6月17日)	6,422,264,022	6,422,264,022	3.2881	3.2881
2024年6月末日	6,666,729,636	-	3.3888	-
7月末日	6,216,340,554	-	3.1953	-
8月末日	6,173,171,400	-	3.1410	-
9月末日	6,337,479,338	-	3.2145	-
10月末日	6,723,478,493	-	3.4304	-
11月末日	6,742,435,216	-	3.4051	-
12月末日	7,023,781,928	-	3.5548	-
2025年1月末日	6,952,766,445	-	3.5528	-
2月末日	6,643,362,781	-	3.4110	-
3月末日	6,650,004,238	-	3.3166	-
4月末日	6,442,595,455	-	3.1629	-
5月末日	6,902,563,300	-	3.3839	-
第9計算期間末 (2025年6月16日)	7,010,796,263	7,010,796,263	3.4419	3.4419
6月末日	7,242,162,144	-	3.5417	-

## 【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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	21.6
第2計算期間	13.3
第3計算期間	0.1
第4計算期間	1.6
第5計算期間	46.0
第6計算期間	3.5
第7計算期間	20.3
第8計算期間	33.2
第9計算期間	4.7

## (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	702,644,049	33,190,572
第2計算期間	695,338,362	142,407,106
第3計算期間	339,152,791	304,533,894
第4計算期間	415,919,823	356,157,946
第5計算期間	193,724,602	308,457,694
第6計算期間	295,982,191	237,478,525
第7計算期間	541,659,096	208,501,672
第8計算期間	802,382,236	452,915,615
第9計算期間	415,794,997	332,050,411

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

(参考) マザーファンド

外国株式インデックスマザーファンド

前記「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)」の記載と同じ。

## 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6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	42,531,032,512	88.46
内 中国	17,343,261,757	36.07
内 台湾	7,430,259,770	15.45
内 タイ	1,022,915,615	2.13
内 マレーシア	232,057,688	0.48
内 インドネシア	500,598,441	1.04
内 インド	5,796,671,632	12.06
内 サウジアラビア	904,056,385	1.88
内 トルコ	683,337,589	1.42
内 カナダ	30,352,900	0.06
内 メキシコ	1,128,240,436	2.35
内 チリ	116,972,324	0.24
内 ブラジル	5,813,551,866	12.09
内 南アフリカ	1,528,756,109	3.18
投資証券	3,169,992,267	6.59
内 アメリカ	3,169,992,267	6.59
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,377,864,906	4.95
純資産総額	48,078,889,685	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)	2,228,444,888	4.63
内 アメリカ	2,228,444,888	4.63
為替予約取引(買建)	14,468,870	0.03
内 日本	14,468,870	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6月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	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	-	935,500	3,067.79 2,870,013,646	3,388.55 3,169,992,267	6.59
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技術	428,000	4,979.88 2,131,393,133	5,380.02 2,302,648,560	4.79
3	CHINA CONSTRUCTION BANK- H	中国	株式	金融	8,592,000	105.21 904,151,537	148.07 1,272,244,934	2.65
4	IND & COMM BK OF CHINA-H	中国	株式	金融	10,101,000	89.95 908,682,328	116.54 1,177,178,621	2.45
5	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	中国	株式	一般消費 財・サービ ス	534,800	1,472.30 787,389,277	2,067.12 1,105,497,915	2.30
6	VALE SA	ブラジル	株式	素材	755,090	1,604.43 1,211,495,101	1,398.04 1,055,653,499	2.20
7	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	102,500	7,304.13 748,675,758	9,459.72 969,621,300	2.02
8	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	999,902	934.31 934,223,715	821.94 821,866,949	1.71
9	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	株式	金融	879,500	708.33 622,994,633	929.37 817,386,192	1.70
10	BANK OF CHINA LTD-H	中国	株式	金融	8,967,000	72.24 647,979,688	86.11 772,191,412	1.61
11	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	株式	エネル ギー	260,907	2,442.19 637,185,018	2,576.18 672,143,395	1.40
12	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	ブラジル	株式	エネル ギー	783,300	978.00 766,078,082	823.26 644,864,840	1.34
13	ITAU UNIBANCO HOLDING S- PREF	ブラジル	株式	金融	584,519	827.72 483,825,484	956.74 559,233,258	1.16
14	HDFC BANK LIMITED	インド	株式	金融	157,809	2,985.41 471,124,840	3,425.33 540,547,902	1.12
15	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	ブラジル	株式	エネル ギー	539,700	1,039.38 560,959,058	891.58 481,189,256	1.00

16	BANCO BRADESCO SA-PREF	ブラジル	株式	金融	1,085,759	337.37 366,315,047	437.08 474,572,698	0.99
17	JD.COM INC - CL A	中国	株式	一般消費 財・サービ ス	192,895	2,048.70 395,187,000	2,402.73 463,474,989	0.96
18	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国	株式	エネル ギー	5,521,800	94.41 521,372,256	75.97 419,506,607	0.87
19	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	中国	株式	金融	3,741,000	67.25 251,631,160	105.66 395,278,549	0.82
20	PETROCHINA CO LTD-H	中国	株式	エネル ギー	2,884,000	142.24 410,248,005	125.57 362,162,338	0.75
21	MEDIATEK INC	台湾	株式	情報技術	52,003	6,792.39 353,225,054	6,401.22 332,883,034	0.69
22	CHINA MERCHANTS BANK-H	中国	株式	金融	315,500	658.27 207,684,846	1,016.96 320,852,773	0.67
23	BAIDU INC-CLASS A	中国	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	203,300	1,640.27 333,471,190	1,546.19 314,341,240	0.65
24	ICICI BANK LTD	インド	株式	金融	120,003	2,251.05 270,133,281	2,485.74 298,296,257	0.62
25	XIAOMI CORP-CLASS B	中国	株式	情報技術	259,000	386.70 100,157,260	1,087.03 281,542,842	0.59
26	INFOSYS LTD	インド	株式	情報技術	98,020	2,839.85 278,362,328	2,733.60 267,947,472	0.56
27	CHINA CITIC BANK CORP LTD- H	中国	株式	金融	1,677,000	93.08 156,112,344	141.25 236,876,921	0.49
28	UNITED MICROELECTRONICS CORP	台湾	株式	情報技術	1,073,000	253.37 271,876,382	220.68 236,790,123	0.49
29	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	122.57 202,760,369	126.46 209,179,822	0.44
30	QUANTA COMPUTER INC	台湾	株式	情報技術	145,000	1,481.30 214,789,089	1,422.21 206,221,646	0.43

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	88.46%

投資証券	6.59%
合計	95.05%

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	8.81%
素材	8.95%
資本財・サービス	4.09%
一般消費財・サービス	7.59%
生活必需品	3.33%
ヘルスケア	1.03%
金融	30.55%
情報技術	13.89%
コミュニケーション・サービス	5.97%
公益事業	2.85%
不動産	1.41%
合計	88.46%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	MSCI EMER MKT INDEX (ICE) SEP 25	買建	250	2,174,713,137	2,228,444,888	4.63%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2025年7 月	買建	100,000	14,306,360	14,468,870	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。

#### (参考情報) 運用実績

## ●FW 外国株式インデックスEM+(為替ヘッジなし)

2025年6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	35,417円
純資産総額	72億円

## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	4.7%
3カ月間	6.8%
6カ月間	-0.4%
1年間	4.5%
3年間	67.9%
5年間	158.2%
設定来	254.2%



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

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	株式業種別構成	比率	組入上位10銘柄	国・地域名	比率
外国株式・先物	1,521	96.4%	米ドル	62.4%	情報技術	23.4%	NVIDIA CORP	アメリカ	4.2%
外国投資証券	4	1.4%	ユーロ	7.4%	金融	19.2%	MICROSOFT CORP	アメリカ	3.8%
外国リート	46	1.3%	香港ドル	6.5%	一般消費財・サービス	9.1%	APPLE INC	アメリカ	3.3%
			台湾ドル	3.2%	資本財・サービス	9.0%	AMAZON.COM INC	アメリカ	2.3%
コール・ローン、その他		4.1%	英ポンド	3.1%	コミュニケーション・サービス	7.7%	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	1.8%
合計	1,571	-	カナダ・ドル	2.7%	ヘルスケア	7.6%	S&P500 EMINI SEP 25	アメリカ	1.3%
国・地域別構成			ブラジル・リアル	2.6%	生活必需品	5.3%	INVECO FTSE RAFI EMERGING M	アメリカ	1.3%
アメリカ		62.3%	インド・ルピー	2.4%	エネルギー	4.6%	BROADCOM INC	アメリカ	1.3%
中国		7.2%	スイス・フラン	2.0%	素材	4.2%	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.1%
その他		29.6%	その他	7.8%	公益事業、他	3.2%	TESLA INC	アメリカ	1.0%
合計		99.1%	合計	100.0%	合計	93.2%	合計		21.5%

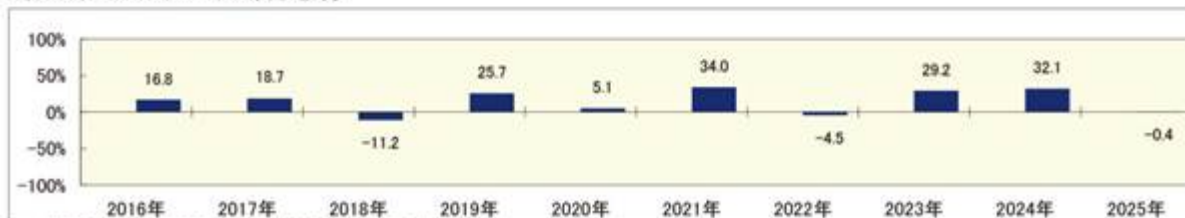
※株式業種別構成は、原則としてS&PとMSCI Inc.が共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2016年は設定日(9月26日)から年末、2025年は6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。

## 【ダイワファンドラップ 日本債券インデックス】

## (1) 【投資状況】 (2025年6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	40,778,095,983	99.90
内 日本	40,778,095,983	99.90
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	39,701,531	0.10
純資産総額	40,817,797,514	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6月30日現在)

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本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	31,942,735,378	1.2738 40,689,135,586	1.2766 40,778,095,983	99.90

(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	99.90%
合計	99.90%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	14,248,194,432	14,248,194,432	0.9858	0.9858
第2計算期間末 (2018年6月15日)	25,120,930,051	25,120,930,051	0.9915	0.9915
第3計算期間末 (2019年6月17日)	27,372,292,105	27,372,292,105	1.0149	1.0149
第4計算期間末 (2020年6月15日)	33,339,891,042	33,339,891,042	1.0024	1.0024
第5計算期間末 (2021年6月15日)	36,597,337,061	36,597,337,061	0.9987	0.9987
第6計算期間末 (2022年6月15日)	36,841,618,949	36,841,618,949	0.9645	0.9645
第7計算期間末 (2023年6月15日)	36,693,031,052	36,693,031,052	0.9659	0.9659
第8計算期間末 (2024年6月17日)	37,969,994,751	37,969,994,751	0.9244	0.9244
2024年6月末日	37,887,879,628	-	0.9173	-
7月末日	37,866,708,684	-	0.9161	-
8月末日	39,058,962,943	-	0.9267	-
9月末日	39,131,150,616	-	0.9291	-
10月末日	39,108,667,149	-	0.9243	-
11月末日	39,290,331,311	-	0.9179	-
12月末日	39,656,944,990	-	0.9167	-
2025年1月末日	39,891,744,751	-	0.9097	-
2月末日	39,513,909,321	-	0.9034	-
3月末日	39,501,281,681	-	0.8944	-
4月末日	40,139,987,047	-	0.8991	-
5月末日	40,159,926,097	-	0.8874	-
第9計算期間末 (2025年6月16日)	40,577,855,047	40,577,855,047	0.8901	0.8901
6月末日	40,817,797,514	-	0.8919	-

## 【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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.4
第2計算期間	0.6
第3計算期間	2.4
第4計算期間	1.2
第5計算期間	0.4
第6計算期間	3.4
第7計算期間	0.1
第8計算期間	4.3
第9計算期間	3.7

## (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	15,709,737,796	1,257,184,902
第2計算期間	17,894,969,975	7,012,636,355
第3計算期間	9,926,740,515	8,292,385,149
第4計算期間	14,370,293,804	8,081,979,073
第5計算期間	12,736,682,056	9,351,040,686
第6計算期間	10,246,997,124	8,694,888,536
第7計算期間	6,956,197,111	7,164,976,774
第8計算期間	13,620,058,958	10,530,319,029
第9計算期間	12,868,104,378	8,357,189,767

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況 (2025年6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	114,694,698,360	85.66
内 日本	114,694,698,360	85.66
地方債証券	6,107,262,500	4.56
内 日本	6,107,262,500	4.56
特殊債券	3,850,313,900	2.88
内 日本	3,850,313,900	2.88
社債券	8,731,156,600	6.52
内 日本	8,731,156,600	6.52
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	511,458,366	0.38
純資産総額	133,894,889,726	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6月30日現在)

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	365 10年国債	日本	国債証券	1,600,000,000	95.10 1,521,646,500	93.87 1,501,968,000	0.100000 2031/12/20	1.12
2	370 10年国債	日本	国債証券	1,550,000,000	96.30 1,492,749,800	94.88 1,470,748,500	0.500000 2033/03/20	1.10
3	150 5年国債	日本	国債証券	1,400,000,000	98.79 1,383,147,500	99.07 1,387,036,000	0.005000 2026/12/20	1.04
4	158 5年国債	日本	国債証券	1,310,000,000	98.18 1,286,195,600	98.20 1,286,459,300	0.100000 2028/03/20	0.96
5	154 5年国債	日本	国債証券	1,300,000,000	98.54 1,281,123,000	98.60 1,281,800,000	0.100000 2027/09/20	0.96
6	360 10年国債	日本	国債証券	1,300,000,000	96.09 1,249,260,600	95.41 1,240,395,000	0.100000 2030/09/20	0.93
7	349 10年国債	日本	国債証券	1,250,000,000	98.40 1,230,012,500	98.39 1,229,987,500	0.100000 2027/12/20	0.92
8	364 10年国債	日本	国債証券	1,280,000,000	95.16 1,218,168,300	94.20 1,205,811,200	0.100000 2031/09/20	0.90
9	369 10年国債	日本	国債証券	1,250,000,000	96.87 1,210,951,000	95.20 1,190,000,000	0.500000 2032/12/20	0.89

10	368 10年国債	日本	国債証券	1,250,000,000	94.80 1,185,063,500	93.44 1,168,087,500	0.200000 2032/09/20	0.87
11	149 5年国債	日本	国債証券	1,150,000,000	98.94 1,137,832,200	99.27 1,141,628,000	0.005000 2026/09/20	0.85
12	363 10年国債	日本	国債証券	1,190,000,000	95.61 1,137,798,900	94.53 1,124,907,000	0.100000 2031/06/20	0.84
13	371 10年国債	日本	国債証券	1,160,000,000	95.46 1,107,361,000	93.80 1,088,138,000	0.400000 2033/06/20	0.81
14	166 5年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	98.78 1,086,626,400	98.48 1,083,302,000	0.400000 2028/12/20	0.81
15	377 10年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	98.28 1,081,131,450	98.24 1,080,695,000	1.200000 2034/12/20	0.81
16	354 10年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	97.43 1,071,818,000	97.19 1,069,101,000	0.100000 2029/03/20	0.80
17	156 5年国債	日本	国債証券	1,080,000,000	98.74 1,066,394,800	98.65 1,065,452,400	0.200000 2027/12/20	0.80
18	358 10年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	96.51 1,061,638,000	95.96 1,055,626,000	0.100000 2030/03/20	0.79
19	178 5年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	100.04 1,050,513,500	100.09 1,050,945,000	1.000000 2030/03/20	0.78
20	362 10年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	95.86 1,054,474,000	94.85 1,043,350,000	0.100000 2031/03/20	0.78
21	366 10年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	95.31 1,048,424,500	94.16 1,035,793,000	0.200000 2032/03/20	0.77
22	348 10年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	98.55 1,034,838,000	98.60 1,035,300,000	0.100000 2027/09/20	0.77
23	161 5年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	98.41 1,033,369,700	98.57 1,035,069,000	0.300000 2028/06/20	0.77
24	372 10年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	98.36 1,032,848,300	96.50 1,013,260,500	0.800000 2033/09/20	0.76
25	163 5年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	98.97 989,775,000	98.68 986,810,000	0.400000 2028/09/20	0.74
26	153 5年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	98.45 984,583,300	98.61 986,110,000	0.005000 2027/06/20	0.74
27	367 10年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	95.33 1,000,971,300	93.80 984,994,500	0.200000 2032/06/20	0.74
28	375 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	99.91 999,126,000	97.99 979,990,000	1.100000 2034/06/20	0.73
29	359 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	96.41 964,184,000	95.71 957,160,000	0.100000 2030/06/20	0.71

30	373 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	96.78 967,843,100	94.58 945,860,000	0.600000 2033/12/20	0.71
----	-----------	----	------	---------------	----------------------	----------------------	------------------------	------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	85.66%
地方債証券	4.56%
特殊債券	2.88%
社債券	6.52%
合計	99.62%

(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。

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### (参考情報) 運用実績

## ●FW 日本債券インデックス

2025年6月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	8,919円
純資産総額	408億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.5%
3カ月間	-0.3%
6カ月間	-2.7%
1年間	-2.8%
3年間	-7.8%
5年間	-10.7%
設定来	-10.8%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期		
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月	22年6月	23年6月	24年6月	25年6月		
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円		

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

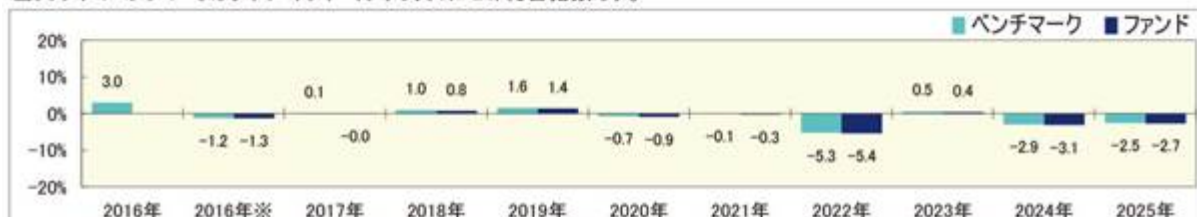
資産別構成	銘柄数	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	利率(%)	償還日	比率
国内債券	432	99.5%	直接利回り(%)	365 10年国債	0.100	2031/12/20	1.1%
国内債券先物	-	-	最終利回り(%)	370 10年国債	0.500	2033/03/20	1.1%
コール・ローン、その他		0.5%	修正デュレーション	150 5年国債	0.005	2026/12/20	1.0%
合計	432	100.0%	残存年数	158 5年国債	0.100	2028/03/20	1.0%
債券種別構成	比率	格付別構成	比率	154 5年国債	0.100	2027/09/20	1.0%
国債	85.4%	AAA	88.5%	360 10年国債	0.100	2030/09/20	0.9%
事業債	7.1%	AA	6.9%	349 10年国債	0.100	2027/12/20	0.9%
地方債	5.4%	A	2.6%	364 10年国債	0.100	2031/09/20	0.9%
政府保証債	1.1%	BBB	-	369 10年国債	0.500	2032/12/20	0.9%
その他	0.4%	BB以下・無格付	2.1%	368 10年国債	0.200	2032/09/20	0.9%
合計	99.5%	合計	100.0%	合計			9.7%

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.1%保有しております。

※格付別構成については、当社所定の基準で採用した格付けを基準に算出しています。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数です。



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

※2016年※は設定日(9月26日)から年末、2025年は6月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)】

## (1) 【投資状況】(2025年6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	98,084,453,349	99.71
内 日本	98,084,453,349	99.71
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	289,713,507	0.29
純資産総額	98,374,166,856	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6月30日現在)

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	117,255,772,086	0.8339 97,780,462,109	0.8365 98,084,453,349	99.71

(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	99.71%
合計	99.71%

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

#### ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

### 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	33,745,104,093	33,745,104,093	0.9710	0.9710
第2計算期間末 (2018年6月15日)	61,154,884,176	61,154,884,176	0.9475	0.9475
第3計算期間末 (2019年6月17日)	72,847,478,521	72,847,478,521	0.9905	0.9905
第4計算期間末 (2020年6月15日)	87,728,604,640	87,728,604,640	1.0451	1.0451
第5計算期間末 (2021年6月15日)	98,409,882,734	98,409,882,734	1.0198	1.0198
第6計算期間末 (2022年6月15日)	97,518,003,285	97,518,003,285	0.8787	0.8787
第7計算期間末 (2023年6月15日)	98,451,825,948	98,451,825,948	0.8378	0.8378
第8計算期間末 (2024年6月17日)	98,185,393,699	98,185,393,699	0.8148	0.8148
2024年6月末日	98,491,676,633	-	0.8108	-
7月末日	99,638,447,635	-	0.8174	-
8月末日	100,814,474,495	-	0.8249	-
9月末日	101,613,874,608	-	0.8302	-
10月末日	99,102,892,558	-	0.8110	-
11月末日	100,046,458,876	-	0.8167	-
12月末日	97,842,168,125	-	0.8036	-
2025年1月末日	98,226,457,293	-	0.8045	-
2月末日	98,727,762,109	-	0.8101	-
3月末日	97,715,929,418	-	0.8044	-
4月末日	98,277,614,852	-	0.8114	-
5月末日	97,730,963,664	-	0.8044	-
第9計算期間末 (2025年6月16日)	97,637,894,820	97,637,894,820	0.8047	0.8047
6月末日	98,374,166,856	-	0.8071	-

## 【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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.9
第2計算期間	2.4
第3計算期間	4.5
第4計算期間	5.5
第5計算期間	2.4
第6計算期間	13.8
第7計算期間	4.7
第8計算期間	2.7
第9計算期間	1.2

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	37,021,440,339	2,368,454,114
第2計算期間	41,568,085,908	11,780,237,725
第3計算期間	27,255,813,662	18,253,054,308
第4計算期間	32,566,137,503	22,163,944,927
第5計算期間	31,995,491,437	19,438,727,028
第6計算期間	32,610,525,682	18,127,288,357
第7計算期間	26,147,697,038	19,623,292,759
第8計算期間	32,679,578,644	29,682,567,886
第9計算期間	24,888,452,073	24,066,511,869

(注) 当初設定数量は100,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド

## (1) 投資状況(2025年6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	133,741,048,182	98.82
内 ユーロ	41,502,992,214	30.67
内 中国	15,418,011,851	11.39
内 シンガポール	586,599,401	0.43
内 マレーシア	686,889,075	0.51
内 イスラエル	460,687,445	0.34
内 ノルウェー	178,831,351	0.13
内 スウェーデン	260,099,279	0.19
内 デンマーク	305,211,645	0.23
内 イギリス	7,888,085,888	5.83
内 ポーランド	825,824,261	0.61
内 カナダ	2,684,872,298	1.98
内 アメリカ	59,913,081,494	44.27
内 メキシコ	1,031,233,794	0.76
内 オーストラリア	1,649,430,512	1.22
内 ニュージーランド	349,197,674	0.26
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,592,978,645	1.18
純資産総額	135,334,026,827	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
債券先物取引(買建)	1,977,753,376	1.46
内 ドイツ	153,956,270	0.11
内 アメリカ	1,823,797,106	1.35
為替予約取引(売建)	136,280,569,530	100.70
内 日本	136,280,569,530	100.70

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

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

## (2) 投資資産 (2025年6月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	21,000,000	96.51 2,935,030,801	96.95 2,948,350,425	2.250000 2027/08/15	2.18
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,350,000	97.20 1,456,862,525	97.47 1,460,894,253	2.000000 2026/11/15	1.08
3	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	100.67 1,457,845,713	100.72 1,458,526,320	4.875000 2026/05/31	1.08
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,950,000	105.08 1,209,745,491	105.39 1,213,291,309	6.125000 2027/11/15	0.90
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	95.50 898,936,312	96.19 905,468,692	2.625000 2029/02/15	0.67
6	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,200,000	99.73 879,902,907	99.81 880,564,581	2.500000 2030/05/25	0.65
7	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	84.39 855,517,206	85.34 865,096,388	1.375000 2031/11/15	0.64
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,000,000	92.77 806,119,619	93.36 811,211,139	1.250000 2028/04/30	0.60
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	92.61 804,729,443	93.32 810,820,152	1.750000 2029/01/31	0.60
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,750,000	97.07 808,327,247	97.31 810,275,666	1.500000 2026/08/15	0.60
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	92.97 740,464,213	93.54 745,067,723	1.250000 2028/03/31	0.55
12	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	5,000,000	101.00 731,355,664	101.73 736,590,546	4.250000 2029/06/30	0.54
13	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	5,000,000	100.91 730,704,019	101.21 732,825,486	4.500000 2027/04/15	0.54
14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	5,000,000	99.61 721,247,926	99.95 723,695,215	3.750000 2027/04/30	0.53
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,000,000	97.20 703,798,321	97.53 706,173,205	2.250000 2027/02/15	0.52
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,000,000	97.08 702,972,904	97.48 705,861,864	2.375000 2027/05/15	0.52
17	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,700,000	100.16 681,709,583	101.19 688,740,253	4.375000 2034/05/15	0.51
18	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,700,000	99.83 679,483,998	100.70 685,418,891	4.000000 2030/07/31	0.51

19	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,800,000	97.13 675,152,876	98.16 682,326,184	3.875000 2033/08/15	0.50
20	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,500,000	101.74 662,996,655	102.78 669,819,379	4.625000 2035/02/15	0.49
21	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,500,000	101.34 660,422,658	102.38 667,180,216	4.500000 2033/11/15	0.49
22	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	5,000,000	91.46 662,216,130	92.10 666,871,771	1.000000 2028/07/31	0.49
23	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,000,000	95.87 650,666,459	95.99 651,474,040	0.750000 2028/05/25	0.48
24	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,800,000	92.09 640,155,195	93.05 646,779,384	2.875000 2032/05/15	0.48
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,500,000	97.73 636,852,658	97.92 638,110,333	1.875000 2026/06/30	0.47
26	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,000,000	92.90 630,470,132	93.01 631,243,782	0.500000 2029/05/25	0.47
27	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,600,000	103.16 630,082,629	103.13 629,917,719	3.500000 2033/11/25	0.47
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,000,000	85.00 615,464,221	85.86 621,734,494	0.625000 2030/05/15	0.46
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,000,000	84.64 612,835,920	85.55 619,453,737	0.875000 2030/11/15	0.46
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,900,000	85.37 605,815,820	86.30 612,386,429	1.125000 2031/02/15	0.45

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.82%
合計	98.82%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位:円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
債券先物取引	アメリカ	US LONG BOND SEP 25	買建	2	32,799,465	33,152,439	0.02%
		US 10YR NOTE SEP 25	買建	10	160,173,443	161,915,681	0.12%
		US 5YR NOTE SEP 25	買建	15	234,541,285	236,475,867	0.17%
		US 2YR NOTE SEP 25	買建	40	1,200,293,888	1,204,638,188	0.89%
		US ULTRA T-BOND SEP 25	買建	11	185,424,680	187,614,931	0.14%
	ドイツ	EURO-SCHATZ SEP 25	買建	5	90,988,658	90,954,726	0.07%
EURO-OAT SEP 25		買建	3	63,103,340	63,001,544	0.05%	
為替予約取引	日本	ユーロ売/円買 2025年7月	売建	252,106,000	41,949,931,665	42,755,841,437	31.59%
		デンマーク・クローネ 売/円買 2025年7月	売建	14,557,000	324,752,113	330,924,281	0.24%
		ノルウェー・クローネ 売/円買 2025年7月	売建	16,298,000	236,728,450	233,685,613	0.17%
		ポーランド・ズロチ売/ 円買 2025年7月	売建	21,766,000	846,518,918	870,071,907	0.64%
		カナダ・ドル売/円買 2025年7月	売建	26,214,000	2,781,829,680	2,769,212,881	2.05%
		メキシコ・ペソ売/円買 2025年7月	売建	146,867,000	1,113,648,400	1,127,688,886	0.83%
		マレーシア・リングギット 売/円買 2025年7月	売建	19,130,000	652,539,604	653,075,244	0.48%
		米ドル売/円買 2025年7月	売建	417,500,000	60,154,087,508	60,407,532,249	44.64%
		スウェーデン・クローネ 売/円買 2025年7月	売建	17,171,000	260,466,899	262,120,466	0.19%
		シンガポール・ドル売/ 円買 2025年7月	売建	5,253,000	590,673,585	596,035,322	0.44%
		英ポンド売/円買 2025年 7月	売建	40,522,000	7,909,448,658	8,039,524,278	5.94%
		ニュージーランド・ドル 売/円買 2025年7月	売建	4,339,000	376,738,014	380,351,099	0.28%
		イスラエル・シケル 売/円買 2025年7月	売建	10,961,000	436,423,176	467,842,882	0.35%
		豪ドル売/円買 2025年7月	売建	17,895,000	1,674,506,730	1,689,950,115	1.25%

	オフショア人民元売/円 買 2025年7月	売建	777,550,000	15,605,895,030	15,696,712,870	11.60%
--	--------------------------	----	-------------	----------------	----------------	--------

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

## ●FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

2025年6月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	8,071円
純資産総額	983億円



## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.3%
3カ月間	0.3%
6カ月間	0.4%
1年間	-0.5%
3年間	-10.1%
5年間	-23.2%
設定来	-19.3%

※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6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月	第5期 21年6月	第6期 22年6月	第7期 23年6月	第8期 24年6月	第9期 25年6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を分配をお約束するものではありません。分配金を支払わない場合もあります。

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	償還日	比率
外国債券・先物	710	100.0%	日本円	99.9%	直接利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2027/08/15	2.2%
			米ドル	0.3%	最終利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2026/11/15	1.1%
コール・ローン、その他		1.5%	英ポンド	0.1%	修正デュレーション	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2026/05/31	1.1%
合計	710	-	オフショア人民元	0.1%	残存年数	United States Treasury Note/Bond	2027/11/15	0.9%
債券種別構成			マレーシア・リンギット	0.0%	格付別構成	US 2YR NOTE SEP 25	-	0.9%
国債		98.5%	シンガポール・ドル	0.0%	AAA	United States Treasury Note/Bond	2029/02/15	0.7%
			イスラエル・シェケル	0.0%	AA	FRENCH GOVERNMENT BOND	2030/05/25	0.6%
			カナダ・ドル	0.0%	A	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2031/11/15	0.6%
			ニュージーランド・ドル	0.0%	BBB	United States Treasury Note/Bond	2028/04/30	0.6%
			その他	-0.4%	BB	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2029/01/31	0.6%
合計		98.5%	合計	100.0%	合計	合計		9.3%

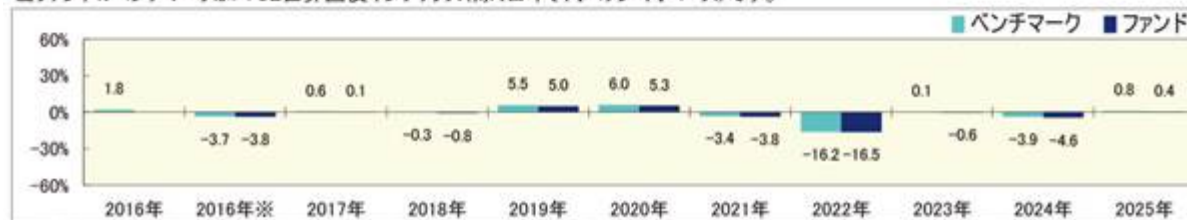
※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※格付別構成については、当社所定の基準で採用した格付けを基準に算出しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

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



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

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2025年は6月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)】

## (1) 【投資状況】 (2025年6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	26,724,211,050	99.71
内 日本	26,724,211,050	99.71
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	78,798,766	0.29
純資産総額	26,803,009,816	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6月30日現在)

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	7,230,967,869	3.6477 26,376,844,840	3.6958 26,724,211,050	99.71

(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	99.71%
合計	99.71%

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

#### ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

### 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	1,404,884,490	1,404,884,490	1.0622	1.0622
第2計算期間末 (2018年6月15日)	2,405,883,300	2,405,883,300	1.0709	1.0709
第3計算期間末 (2019年6月17日)	3,676,403,565	3,676,403,565	1.0978	1.0978
第4計算期間末 (2020年6月15日)	4,949,959,877	4,949,959,877	1.1579	1.1579
第5計算期間末 (2021年6月15日)	6,651,390,787	6,651,390,787	1.2187	1.2187
第6計算期間末 (2022年6月15日)	7,620,837,859	7,620,837,859	1.2025	1.2025
第7計算期間末 (2023年6月15日)	10,267,011,957	10,267,011,957	1.2526	1.2526
第8計算期間末 (2024年6月17日)	18,536,758,820	18,536,758,820	1.4350	1.4350
2024年6月末日	19,280,960,734	-	1.4606	-
7月末日	19,554,970,153	-	1.4071	-
8月末日	20,149,449,625	-	1.3707	-
9月末日	20,865,801,921	-	1.3733	-
10月末日	22,197,991,286	-	1.4293	-
11月末日	22,424,088,656	-	1.3999	-
12月末日	23,789,494,925	-	1.4431	-
2025年1月末日	24,031,648,393	-	1.4125	-
2月末日	24,013,415,362	-	1.3845	-
3月末日	24,748,113,826	-	1.3988	-
4月末日	24,771,756,490	-	1.3741	-
5月末日	25,399,616,972	-	1.3813	-
第9計算期間末 (2025年6月16日)	26,129,474,574	26,129,474,574	1.3965	1.3965
6月末日	26,803,009,816	-	1.4148	-

## 【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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	6.2
第2計算期間	0.8
第3計算期間	2.5
第4計算期間	5.5
第5計算期間	5.3
第6計算期間	1.3
第7計算期間	4.2
第8計算期間	14.6
第9計算期間	2.7

## (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	1,394,396,399	72,737,713
第2計算期間	1,454,615,593	530,660,407
第3計算期間	1,649,381,625	547,264,585
第4計算期間	2,078,908,391	1,152,538,780
第5計算期間	1,968,605,898	785,747,124
第6計算期間	2,102,589,183	1,223,247,507
第7計算期間	2,866,101,938	1,006,563,093
第8計算期間	6,628,810,445	1,907,908,319
第9計算期間	8,320,396,861	2,527,399,427

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

外国債券インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況 (2025年6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	336,460,118,447	97.53
内 ユーロ	103,779,106,184	30.08
内 中国	37,772,818,883	10.95
内 シンガポール	1,331,895,374	0.39
内 マレーシア	1,713,296,009	0.50
内 イスラエル	1,116,858,996	0.32
内 ノルウェー	517,844,124	0.15
内 スウェーデン	560,353,004	0.16
内 デンマーク	672,718,942	0.19
内 イギリス	19,286,986,880	5.59
内 ポーランド	2,148,199,950	0.62
内 カナダ	6,282,361,662	1.82
内 アメリカ	153,848,708,222	44.59
内 メキシコ	2,484,568,392	0.72
内 オーストラリア	4,038,306,048	1.17
内 ニュージーランド	906,095,777	0.26
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	8,532,567,163	2.47
純資産総額	344,992,685,610	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)	2,962,580,974	0.86
内 日本	2,962,580,974	0.86

(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6月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	85,000,000	100.98 1,733,363,096	100.84 1,731,028,670	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 1,604,991,911	97.68 1,626,696,345	2.875000 2028/05/15	0.47

3	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	11,000,000	97.76 1,557,276,603	98.16 1,563,664,172	3.875000 2033/08/15	0.45
4	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	73,000,000	101.70 1,499,355,428	102.06 1,504,529,737	2.050000 2029/04/15	0.44
5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	102.31 1,481,637,996	102.38 1,482,622,704	4.500000 2033/11/15	0.43
6	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,500,000	97.46 1,481,884,173	97.28 1,479,192,879	3.875000 2034/08/15	0.43
7	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,200,000	98.12 1,449,433,141	98.61 1,456,604,691	4.000000 2034/02/15	0.42
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	84.02 1,301,939,646	86.30 1,337,251,999	1.125000 2031/02/15	0.39
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,000,000	98.28 1,280,978,578	99.94 1,302,573,190	4.250000 2034/11/15	0.38
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,600,000	102.84 1,280,812,933	102.78 1,280,099,257	4.625000 2035/02/15	0.37
11	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	83.24 1,241,679,716	85.33 1,272,778,388	1.250000 2031/08/15	0.37
12	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	90.78 1,248,897,191	91.97 1,265,309,233	2.750000 2032/08/15	0.37
13	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,500,000	101.38 1,247,895,830	101.19 1,245,594,075	4.375000 2034/05/15	0.36
14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,500,000	99.16 1,220,640,393	100.80 1,240,781,315	4.000000 2029/01/31	0.36
15	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	83.41 1,207,889,172	85.34 1,235,851,983	1.375000 2031/11/15	0.36
16	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	60,000,000	101.85 1,234,128,038	101.37 1,228,275,817	2.390000 2026/11/15	0.36
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	83.18 1,180,481,562	85.55 1,214,129,324	0.875000 2030/11/15	0.35
18	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,300,000	99.59 1,197,055,211	100.81 1,211,658,576	4.000000 2029/07/31	0.35
19	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	58,000,000	102.85 1,204,667,819	103.12 1,207,841,912	2.370000 2029/01/15	0.35
20	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	95.37 1,104,935,054	96.12 1,113,565,730	3.500000 2033/02/15	0.32
21	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,500,000	99.85 1,084,451,584	100.82 1,095,002,536	4.000000 2030/02/28	0.32
22	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	50,000,000	103.99 1,050,077,903	105.11 1,061,366,349	2.540000 2030/12/25	0.31

23	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	100.19 1,015,625,060	100.77 1,021,566,489	4.000000 2030/03/31	0.30
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	85.94 995,678,805	87.99 1,019,369,721	1.625000 2031/05/15	0.30
25	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	99.50 1,008,663,953	100.22 1,015,920,347	4.000000 2027/01/15	0.29
26	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	99.04 1,004,019,861	100.00 1,013,670,000	3.750000 2027/08/15	0.29
27	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,900,000	85.84 982,070,295	87.61 1,002,268,963	1.875000 2032/02/15	0.29
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	82.41 954,703,368	85.10 985,947,573	0.625000 2030/08/15	0.29
29	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	94.40 956,924,753	96.41 977,299,520	1.125000 2026/10/31	0.28
30	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	103.98 1,054,054,612	96.28 975,971,612	4.625000 2054/05/15	0.28

(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	97.53%
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

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2025年7 月	買建	288,000	27,275,328	27,213,408	0.01%
		イスラエル・シュケル 買/円売 2025年7月	買建	1,097,000	44,810,036	46,822,702	0.01%

オフショア人民元買/円 売 2025年7月	買建	41,135,000	824,273,198	830,464,895	0.24%
シンガポール・ドル買/ 円売 2025年7月	買建	267,000	29,822,378	30,295,341	0.01%
英ポンド買/円売 2025年 7月	買建	613,000	121,515,801	121,696,833	0.04%
米ドル買/円売 2025年7 月	買建	6,731,000	972,703,541	974,599,663	0.28%
ユーロ買/円売 2025年7 月	買建	3,836,000	648,475,800	650,780,085	0.19%
カナダ・ドル買/円売 2025年7月	買建	2,484,000	260,703,816	262,420,218	0.08%
スウェーデン・クローネ 買/円売 2025年7月	買建	1,198,000	17,962,692	18,287,829	0.01%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

## ●FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)

2025年6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	14,148円
純資産総額	268億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	2.4%
3カ月間	1.1%
6カ月間	-2.0%
1年間	-3.1%
3年間	13.6%
5年間	21.2%
設定来	41.5%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期		
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月	22年6月	23年6月	24年6月	25年6月		
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円		

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	償還日	比率	
外国債券	1,048	97.2%	米ドル	45.2%	直接利回り(%)	3.0	CHINA GOVERNMENT BOND	2027/05/15	0.5%
			ユーロ	30.6%	最終利回り(%)	3.4	United States Treasury Note/Bond	2028/05/15	0.5%
			オフショア人民元	11.3%	修正デュレーション	6.3	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2033/08/15	0.5%
合計	1,048	100.0%	英ポンド	5.7%	残存年数	8.2	CHINA GOVERNMENT BOND	2029/04/15	0.4%
債券種別構成			カナダ・ドル	1.9%	格付別構成		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2033/11/15	0.4%
国債		97.2%	豪ドル	1.2%	AAA	72.7%	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2034/08/15	0.4%
			メキシコ・ペソ	0.8%	AA	17.9%	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2034/02/15	0.4%
			ポーランド・ズロチ	0.7%	A	9.4%	United States Treasury Note/Bond	2031/02/15	0.4%
			マレーシア・リンギット	0.5%	BBB	-	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2034/11/15	0.4%
			その他	1.9%	BB	-	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2035/02/15	0.4%
合計		97.2%	合計	100.0%	合計	100.0%	合計		4.3%

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※格付別構成については、当社所定の基準で採用した格付けを基準に算出しています。

## 年間収益率の推移

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



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

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2025年は6月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 【ダイワファンドラップ 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)】

## (1) 【投資状況】 (2025年6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	4,768,085,797	99.71
内 日本	4,768,085,797	99.71
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	14,038,489	0.29
純資産総額	4,782,124,286	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6月30日現在)

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,031,027,623	3.6474 3,760,593,978	3.6958 3,810,471,889	79.68
2	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	485,975,087	1.9365 941,134,721	1.9705 957,613,908	20.02

(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	99.71%
合計	99.71%

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

#### ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	599,181,409	599,181,409	1.0747	1.0747
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,195,532,865	1,195,532,865	1.0746	1.0746
第3計算期間末 (2019年6月17日)	1,344,487,088	1,344,487,088	1.1026	1.1026
第4計算期間末 (2020年6月15日)	1,706,986,677	1,706,986,677	1.1508	1.1508
第5計算期間末 (2021年6月15日)	1,952,886,340	1,952,886,340	1.2204	1.2204
第6計算期間末 (2022年6月15日)	2,294,610,149	2,294,610,149	1.1993	1.1993
第7計算期間末 (2023年6月15日)	3,070,851,690	3,070,851,690	1.2748	1.2748
第8計算期間末 (2024年6月17日)	4,464,179,145	4,464,179,145	1.4566	1.4566
2024年6月末日	4,556,185,578	-	1.4841	-
7月末日	4,459,711,196	-	1.4309	-
8月末日	4,339,629,585	-	1.3967	-
9月末日	4,387,238,650	-	1.4046	-
10月末日	4,569,358,932	-	1.4567	-
11月末日	4,491,645,021	-	1.4245	-
12月末日	4,650,787,434	-	1.4703	-
2025年1月末日	4,576,425,572	-	1.4432	-
2月末日	4,480,383,177	-	1.4133	-
3月末日	4,626,854,476	-	1.4283	-
4月末日	4,584,999,155	-	1.4030	-
5月末日	4,618,437,158	-	1.4175	-
第9計算期間末 (2025年6月16日)	4,702,504,909	4,702,504,909	1.4326	1.4326
6月末日	4,782,124,286	-	1.4526	-

## 【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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	7.5
第2計算期間	0.0
第3計算期間	2.6
第4計算期間	4.4
第5計算期間	6.0
第6計算期間	1.7
第7計算期間	6.3
第8計算期間	14.3
第9計算期間	1.6

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	571,935,222	15,390,972
第2計算期間	683,181,594	128,182,978
第3計算期間	364,448,905	257,568,148
第4計算期間	564,211,268	300,318,547
第5計算期間	288,268,635	171,349,249
第6計算期間	483,164,155	170,071,251
第7計算期間	728,642,263	233,099,150
第8計算期間	1,231,686,050	575,660,196
第9計算期間	611,590,534	394,038,184

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

外国債券インデックスマザーファンド

前記「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)」の記載と同じ。

## 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6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	54,558,595,139	96.84
内 中国	5,408,164,276	9.60
内 タイ	4,880,962,747	8.66
内 マレーシア	5,555,593,456	9.86
内 インドネシア	5,557,158,249	9.86
内 インド	5,359,948,292	9.51
内 ポーランド	4,052,546,139	7.19
内 ハンガリー	1,241,547,798	2.20
内 セルビア	169,972,950	0.30
内 ルーマニア	1,764,469,124	3.13
内 トルコ	636,012,776	1.13
内 チェコ	2,787,944,844	4.95
内 メキシコ	5,607,073,281	9.95
内 ドミニカ共和国	159,162,286	0.28
内 コロンビア	1,922,910,139	3.41
内 ペルー	1,007,842,183	1.79
内 チリ	947,569,581	1.68
内 ブラジル	3,437,916,918	6.10
内 ウルグアイ	93,844,586	0.17
内 南アフリカ	3,967,955,514	7.04
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,778,572,567	3.16
純資産総額	56,337,167,706	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)	441,860,315	0.78
内 日本	441,860,315	0.78

(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6月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	30,000,000	80.19 634,590,676	87.12 689,470,729	- 2026/07/01	1.22
2	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	71,000,000	86.98 475,084,812	91.27 498,501,424	7.750000 2034/11/23	0.88
3	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	67,850,000	89.20 465,595,088	95.18 496,781,545	7.750000 2031/05/29	0.88
4	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	19,000,000	96.51 483,707,300	94.77 474,990,618	10.000000 2027/01/01	0.84
5	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	72,000,000	76.12 445,576,032	80.50 471,255,775	8.750000 2048/02/28	0.84
6	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	58,500,000	92.78 441,288,580	98.36 467,819,346	8.000000 2030/01/31	0.83
7	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	60,000,000	95.08 438,838,789	99.85 460,878,000	8.500000 2029/03/01	0.82
8	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	60,500,000	93.46 434,950,358	98.83 459,971,732	7.500000 2027/06/03	0.82
9	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	59,500,000	94.49 432,491,131	99.70 456,318,774	8.500000 2029/05/31	0.81
10	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	58,000,000	86.16 406,278,864	93.54 441,102,093	8.875000 2035/02/28	0.78
11	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	52,000,000	104.12 440,177,712	103.79 438,786,831	10.500000 2026/12/21	0.78
12	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	18,000,000	93.86 445,665,599	91.12 432,670,065	10.000000 2029/01/01	0.77
13	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	55,000,000	88.17 394,252,155	95.52 427,148,980	8.250000 2032/03/31	0.76
14	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	65,000,000	80.44 402,245,382	82.73 413,684,586	7.750000 2042/11/13	0.73
15	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	9,400,000	106.96 402,370,684	108.02 406,373,325	7.500000 2028/07/25	0.72
16	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	55,000,000	89.49 378,625,179	95.93 405,861,517	5.500000 2027/03/04	0.72
17	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	10,850,000	87.27 378,945,518	92.24 400,556,498	2.750000 2029/10/25	0.71

18	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	55,000,000	80.42 359,634,224	87.20 389,928,214	8.500000 2037/01/31	0.69
19	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	55,400,000	85.76 365,503,373	91.24 388,852,211	7.500000 2033/05/26	0.69
20	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	9,200,000	101.83 374,947,540	104.11 383,331,089	6.000000 2033/10/25	0.68
21	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	60,000,000	80.30 370,622,717	82.29 379,813,466	8.000000 2053/07/31	0.67
22	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	15,500,000	89.40 365,542,256	86.84 355,073,548	10.000000 2031/01/01	0.63
23	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	49,400,000	80.38 322,823,763	86.70 348,230,371	9.000000 2040/01/31	0.62
24	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	20,000,000	61.50 324,482,865	64.52 340,406,685	- 2029/01/01	0.60
25	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	8,600,000	95.92 330,136,585	96.83 333,289,281	5.000000 2034/10/25	0.59
26	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	43,000,000	93.16 308,151,384	98.35 325,337,674	5.750000 2026/03/05	0.58
27	INDONESIA TREASURY BOND	インドネシア	国債証券	36,300,000,000	96.23 314,393,211	99.22 324,177,876	6.375000 2032/04/15	0.58
28	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	8,000,000	98.59 315,671,396	100.54 321,917,678	5.000000 2030/01/25	0.57
29	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	8,000,000	97.43 311,944,734	99.88 319,798,219	4.750000 2029/07/25	0.57
30	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	47,700,000	76.61 297,094,346	81.36 315,545,917	8.750000 2044/01/31	0.56

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	96.84%
合計	96.84%

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

#### 八 . 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	タイ・パーツ買/円売 2025年7月	買建	13,000,000	57,548,400	57,840,900	0.10%
		南アフリカ・ランド買/ 円売 2025年7月	買建	4,000,000	32,429,200	32,460,000	0.06%
		インド・ルピー買/円売 2025年7月	買建	130,000,000	219,050,000	221,000,000	0.39%
		米ドル買/円売 2025年7 月	買建	450,000	65,039,400	65,156,715	0.12%
		ルーマニア・レイ買/円 売 2025年7月	買建	750,000	24,937,500	25,031,700	0.04%
		オフショア人民元買/円 売 2025年7月	買建	2,000,000	39,684,800	40,371,000	0.07%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

## ●FW 外国債券インデックスEM+(為替ヘッジなし)

2025年6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	14,526円
純資産総額	47億円

## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	2.5%
3カ月間	1.7%
6カ月間	-1.2%
1年間	-2.1%
3年間	17.4%
5年間	25.5%
設定来	45.3%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期		
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月	22年6月	23年6月	24年6月	25年6月		
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円		

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

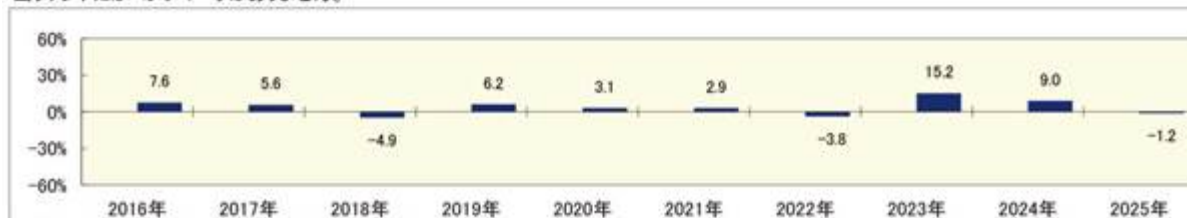
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	償還日	比率	
外国債券	1,322	97.1%	米ドル	36.2%	直接利回り(%)	3.6	CHINA GOVERNMENT BOND	2027/05/15	0.4%
			ユーロ	24.5%	最終利回り(%)	4.0	United States Treasury Note/Bond	2028/05/15	0.4%
			オフショア人民元	11.0%	修正デュレーション	6.1	CHINA GOVERNMENT BOND	2029/04/15	0.4%
コール・ローン、その他		2.9%	英ポンド	4.6%	残存年数	8.2	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2033/08/15	0.4%
合計	1,322	100.0%	メキシコ・ペソ	2.7%	格付別構成		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2033/11/15	0.3%
債券種別構成			マレーシア・リンギット	2.4%	AAA	58.2%	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2034/08/15	0.3%
国債		97.1%	インド・ルピー	2.0%	AA	19.7%	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2034/02/15	0.3%
			ポーランド・ズロチ	2.0%	A	15.7%	United States Treasury Note/Bond	2031/02/15	0.3%
			インドネシア・ルピア	2.0%	BBB	4.6%	CHINA GOVERNMENT BOND	2026/11/15	0.3%
			その他	12.7%	BB	1.7%	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2034/11/15	0.3%
合計		97.1%	合計	100.0%	合計	100.0%	合計		3.4%

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※格付別構成については、当社所定の基準で採用した格付けを基準に算出しています。

## 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26日)から年末、2025年は6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。

## 【ダイワファンドラップ J - REIT インデックス】

## (1) 【投資状況】 (2025年6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	17,098,327,027	99.95
内 日本	17,098,327,027	99.95
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	8,577,572	0.05
純資産総額	17,106,904,599	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6月30日現在)

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	4,970,299,418	3.4328 17,062,227,167	3.4401 17,098,327,027	99.95

(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	99.95%
合計	99.95%

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

#### ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

### 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	1,224,211,506	1,224,211,506	0.9906	0.9906
第2計算期間末 (2018年6月15日)	2,355,374,969	2,355,374,969	1.0250	1.0250
第3計算期間末 (2019年6月17日)	3,254,479,810	3,254,479,810	1.1818	1.1818
第4計算期間末 (2020年6月15日)	4,081,513,165	4,081,513,165	1.0318	1.0318
第5計算期間末 (2021年6月15日)	6,102,975,985	6,102,975,985	1.4075	1.4075
第6計算期間末 (2022年6月15日)	6,943,298,664	6,943,298,664	1.2709	1.2709
第7計算期間末 (2023年6月15日)	8,364,043,604	8,364,043,604	1.3091	1.3091
第8計算期間末 (2024年6月17日)	11,714,101,865	11,714,101,865	1.2514	1.2514
2024年6月末日	11,956,131,094	-	1.2623	-
7月末日	12,249,014,918	-	1.2659	-
8月末日	13,083,838,611	-	1.3012	-
9月末日	13,155,540,703	-	1.2795	-
10月末日	13,095,513,702	-	1.2504	-
11月末日	13,405,533,652	-	1.2391	-
12月末日	13,896,592,140	-	1.2391	-
2025年1月末日	14,836,651,318	-	1.2825	-
2月末日	15,231,584,180	-	1.2895	-
3月末日	15,472,777,180	-	1.2850	-
4月末日	15,768,812,472	-	1.3044	-
5月末日	16,362,940,189	-	1.3267	-
第9計算期間末 (2025年6月16日)	16,953,333,407	16,953,333,407	1.3613	1.3613
6月末日	17,106,904,599	-	1.3641	-

## 【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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.9
第2計算期間	3.5
第3計算期間	15.3
第4計算期間	12.7
第5計算期間	36.4
第6計算期間	9.7
第7計算期間	3.0
第8計算期間	4.4
第9計算期間	8.8

## (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	1,295,129,456	60,344,463
第2計算期間	1,366,263,589	304,124,518
第3計算期間	1,052,662,291	596,816,922
第4計算期間	2,033,327,838	831,339,359
第5計算期間	1,408,443,585	1,028,117,605
第6計算期間	1,972,084,634	844,873,025
第7計算期間	1,930,903,164	1,005,022,992
第8計算期間	4,354,491,040	1,382,986,259
第9計算期間	5,016,373,943	1,923,423,409

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

ダイワJ-REITマザーファンド

(1) 投資状況 (2025年6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	241,860,351,400	96.12
内 日本	241,860,351,400	96.12
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	9,771,881,107	3.88
純資産総額	251,632,232,507	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	9,853,200,000	3.92
内 日本	9,853,200,000	3.92

(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6月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	137,247	126,466.29 17,357,119,749	132,900.00 18,240,126,300	7.25
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	120,848	106,094.61 12,821,322,267	117,900.00 14,247,979,200	5.66
3	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	122,011	93,052.25 11,353,398,658	102,000.00 12,445,122,000	4.95
4	野村不動産マスターF	日本	投資証券	74,980	140,548.12 10,538,298,780	147,200.00 11,037,056,000	4.39
5	KDX不動産投資法人	日本	投資証券	65,182	146,862.56 9,572,795,683	156,100.00 10,174,910,200	4.04
6	GLP投資法人	日本	投資証券	77,422	122,739.38 9,502,728,893	129,700.00 10,041,633,400	3.99
7	日本プロロジスリート	日本	投資証券	121,127	78,444.37 9,501,732,116	79,600.00 9,641,709,200	3.83
8	オリックス不動産投資	日本	投資証券	46,883	175,473.80 8,226,738,482	187,800.00 8,804,627,400	3.50

9	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	35,090	235,067.73 8,248,526,766	243,500.00 8,544,415,000	3.40
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	52,023	143,704.64 7,475,946,587	155,100.00 8,068,767,300	3.21
11	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	129,641	62,589.97 8,114,226,325	62,000.00 8,037,742,000	3.19
12	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	46,250	145,034.97 6,707,867,798	149,600.00 6,919,000,000	2.75
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	86,443	71,522.59 6,182,627,661	76,100.00 6,578,312,300	2.61
14	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	64,367	84,932.92 5,466,877,390	92,600.00 5,960,384,200	2.37
15	三井不ロジパーク	日本	投資証券	51,290	102,407.14 5,252,462,448	104,500.00 5,359,805,000	2.13
16	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	70,285	77,406.34 5,440,505,116	75,900.00 5,334,631,500	2.12
17	産業ファンド	日本	投資証券	43,082	115,829.06 4,990,147,696	121,500.00 5,234,463,000	2.08
18	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	40,623	114,417.77 4,647,993,225	117,700.00 4,781,327,100	1.90
19	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	46,920	93,206.35 4,373,241,989	93,500.00 4,387,020,000	1.74
20	API投資法人	日本	投資証券	34,311	111,738.60 3,833,863,127	122,700.00 4,209,959,700	1.67
21	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	29,219	137,706.12 4,023,635,222	139,100.00 4,064,362,900	1.62
22	森ヒルズリート	日本	投資証券	27,669	133,696.17 3,699,239,351	133,800.00 3,702,112,200	1.47
23	イオンリート投資	日本	投資証券	28,572	123,428.17 3,526,589,757	126,800.00 3,622,929,600	1.44
24	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	43,651	78,334.97 3,419,399,913	82,100.00 3,583,747,100	1.42
25	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	11,914	276,047.75 3,288,832,978	286,700.00 3,415,743,800	1.36
26	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	34,752	91,024.79 3,163,293,692	95,600.00 3,322,291,200	1.32
27	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	20,792	141,788.01 2,948,056,357	156,000.00 3,243,552,000	1.29
28	森トラストリート投資法人	日本	投資証券	45,354	61,644.32 2,795,816,808	69,000.00 3,129,426,000	1.24

29	東急リアル・エステート	日本	投資証券	15,776	166,701.54 2,629,883,506	194,800.00 3,073,164,800	1.22
30	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	9,613	285,050.33 2,740,188,881	319,500.00 3,071,353,500	1.22

(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	96.12%
合計	96.12%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	日本	TREIT 先物 0709月	買建	5,600	9,676,744,000	9,853,200,000	3.92%

(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。

#### (参考情報) 運用実績

## ●FW J-REITインデックス

2025年6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	13,641円
純資産総額	171億円

## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	2.8%
3カ月間	6.2%
6カ月間	10.1%
1年間	8.1%
3年間	2.4%
5年間	29.4%
設定来	36.4%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期		
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月	22年6月	23年6月	24年6月	25年6月		
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円		

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	種別構成	比率	組入上位10銘柄	種別名	比率
国内リート	57	96.1%	各種不動産投資信託	29.7%	日本ビルファンド	オフィス不動産投資信託	7.2%
国内リート 先物	1	3.9%	オフィス不動産投資信託	24.8%	ジャパリアルエステイト	オフィス不動産投資信託	5.7%
			工業用不動産投資信託	17.7%	日本都市ファンド投資法人	店舗用不動産投資信託	4.9%
			店舗用不動産投資信託	8.7%	野村不動産マスターF	各種不動産投資信託	4.4%
			集合住宅用不動産投資信託	7.8%	KDX不動産投資法人	各種不動産投資信託	4.0%
			ホテル・リゾート不動産投資信託	7.1%	GLP投資法人	工業用不動産投資信託	4.0%
			ヘルスケア不動産投資信託	0.3%	TREIT 先物 0709月	-	3.9%
					日本プロロジスリート	工業用不動産投資信託	3.8%
					オリックス不動産投資	オフィス不動産投資信託	3.5%
コール・ローン、その他		3.9%			大和ハウスリート投資法人	各種不動産投資信託	3.4%
合計	58	-	合計	96.1%	合計		44.9%

※種別構成は、原則としてS&PとMSCI Inc.が共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

※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

当ファンドのベンチマークは東証REIT指数(配当込み)です。



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

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2025年は6月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 【ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)】

(1) 【投資状況】 (2025年6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	21,070,300,378	100.00
内 日本	21,070,300,378	100.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	875,641	0.00
純資産総額	21,071,176,019	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6月30日現在)

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	先進国リート・インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	24,288,530,696	0.8749 21,252,165,572	0.8675 21,070,300,378	100.00

(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	100.00%
合計	100.00%

(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。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

### 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	5,285,588,386	5,285,588,386	0.9844	0.9844
第2計算期間末 (2018年6月15日)	8,688,426,682	8,688,426,682	0.9722	0.9722
第3計算期間末 (2019年6月17日)	10,895,667,977	10,895,667,977	1.0760	1.0760
第4計算期間末 (2020年6月15日)	12,056,922,582	12,056,922,582	0.9117	0.9117
第5計算期間末 (2021年6月15日)	17,785,453,405	17,785,453,405	1.2187	1.2187
第6計算期間末 (2022年6月15日)	16,269,529,050	16,269,529,050	1.0481	1.0481
第7計算期間末 (2023年6月15日)	18,252,096,148	18,252,096,148	1.0021	1.0021
第8計算期間末 (2024年6月17日)	20,782,102,925	20,782,102,925	0.9952	0.9952
2024年6月末日	20,942,548,447	-	0.9934	-
7月末日	21,953,542,102	-	1.0571	-
8月末日	22,931,646,536	-	1.0927	-
9月末日	23,789,901,204	-	1.1281	-
10月末日	23,126,923,298	-	1.1076	-
11月末日	23,605,727,752	-	1.1242	-
12月末日	21,254,253,560	-	1.0287	-
2025年1月末日	21,658,091,857	-	1.0417	-
2月末日	22,204,878,456	-	1.0575	-
3月末日	21,643,360,934	-	1.0211	-
4月末日	20,510,410,383	-	1.0016	-
5月末日	21,196,218,021	-	1.0300	-
第9計算期間末 (2025年6月16日)	21,144,166,518	21,144,166,518	1.0312	1.0312
6月末日	21,071,176,019	-	1.0222	-

## 【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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.6
第2計算期間	1.2
第3計算期間	10.7
第4計算期間	15.3
第5計算期間	33.7
第6計算期間	14.0
第7計算期間	4.4
第8計算期間	0.7
第9計算期間	3.6

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	5,609,575,520	250,487,506
第2計算期間	4,660,565,456	1,092,724,304
第3計算期間	3,628,593,466	2,439,154,634
第4計算期間	5,683,570,118	2,585,491,447
第5計算期間	4,211,375,221	2,841,924,781
第6計算期間	5,111,449,724	4,182,934,798
第7計算期間	5,389,055,347	2,696,863,327
第8計算期間	6,627,669,356	3,958,936,952
第9計算期間	4,922,529,420	5,301,962,987

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

(参考) マザーファンド

先進国リート・インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド

(1) 投資状況(2025年6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	479,380,602	1.70
内 アメリカ	479,380,602	1.70
投資証券	26,765,858,104	95.17
内 ガーンジー	48,323,946	0.17
内 韓国	49,577,775	0.18
内 香港	288,461,715	1.03
内 シンガポール	928,436,742	3.30
内 イスラエル	45,181,862	0.16
内 イギリス	1,292,069,736	4.59
内 アイルランド	11,492,926	0.04
内 オランダ	45,398,360	0.16
内 ベルギー	273,721,075	0.97
内 フランス	534,699,248	1.90
内 ドイツ	8,610,924	0.03
内 スペイン	129,975,535	0.46
内 イタリア	3,491,299	0.01
内 カナダ	369,598,986	1.31
内 アメリカ	20,506,966,873	72.92
内 オーストラリア	2,204,668,160	7.84
内 ニュージーランド	25,182,942	0.09
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	878,293,408	3.12
純資産総額	28,123,532,114	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)	1,172,692,038	4.17
内 ドイツ	165,713,708	0.59
内 アメリカ	1,006,978,330	3.58
為替予約取引(売建)	28,098,332,399	99.91
内 日本	28,098,332,399	99.91

(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6月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	115,638	17,683.76 2,044,927,386	15,294.83 1,768,663,806	6.29
2	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	77,420	17,795.26 1,377,714,921	22,029.94 1,705,558,365	6.06
3	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	12,190	122,335.48 1,491,270,261	113,691.77 1,385,902,787	4.93
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	39,452	21,993.88 867,704,225	24,814.64 978,987,240	3.48
5	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	112,541	8,669.48 975,683,315	8,258.51 929,421,458	3.30
6	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	38,237	22,963.53 878,059,468	23,242.00 888,704,545	3.16
7	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	270,896	3,277.82 887,955,330	3,222.45 872,948,815	3.10
8	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	19,676	46,420.14 913,363,583	41,977.52 825,949,739	2.94
9	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	131,686	4,601.04 605,911,258	4,674.46 615,561,835	2.19
10	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	26,446	23,913.63 632,421,558	21,121.98 558,592,058	1.99
11	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	36,812	15,376.93 566,059,456	14,814.06 545,335,287	1.94
12	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	17,720	30,988.18 549,111,975	29,596.26 524,445,865	1.86
13	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	56,241	8,723.64 490,628,039	9,105.65 512,111,019	1.82
14	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	37,410	12,939.64 484,076,240	12,814.23 479,380,602	1.70
15	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	42,614	10,326.98 440,075,904	9,752.95 415,612,360	1.48
16	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	71,038	5,066.75 359,941,581	4,738.18 336,591,058	1.20
17	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	8,024	41,603.91 333,829,988	41,330.22 331,633,702	1.18
18	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	14,588	22,434.83 327,280,803	21,410.15 312,331,392	1.11

19	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	14,952	19,018.04 284,359,193	18,338.73 274,200,817	0.97
20	LINK REIT	香港	投資証券	344,400	651.15 224,260,108	783.70 269,906,280	0.96
21	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	84,305	3,181.91 268,263,148	3,030.87 255,517,774	0.91
22	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	27,289	8,380.15 228,687,148	9,104.20 248,444,642	0.88
23	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	174,934	1,735.61 303,631,928	1,364.10 238,628,729	0.85
24	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	694,683	325.45 226,129,065	339.25 235,674,681	0.84
25	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	アメリカ	投資証券	34,387	7,191.55 247,296,843	6,716.28 230,952,989	0.82
26	UDR INC	アメリカ	投資証券	37,732	6,097.80 230,087,245	5,895.21 222,438,256	0.79
27	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	13,369	17,357.94 232,058,681	16,473.58 220,235,366	0.78
28	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	86,577	3,113.41 269,553,507	2,513.90 217,646,059	0.77
29	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	23,826	10,231.55 243,779,821	8,900.02 212,051,938	0.75
30	REGENCY CENTERS CORP	アメリカ	投資証券	20,456	10,246.32 209,599,814	10,214.89 208,955,941	0.74

(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	1.70%
投資証券	95.17%
合計	96.88%

(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。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	アメリカ	DOW JONES US REAL ESTATE SEP 25	買建	193	1,015,449,469	1,006,978,330	3.58%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE SEP 25	買建	146	161,561,701	165,713,708	0.59%
為替予約取引	日本	ニュージーランド・ドル 売/円買 2025年7月	売建	351,900	30,221,136	30,847,096	0.11%
		香港ドル売/円買 2025年 7月	売建	16,355,300	299,469,892	301,554,113	1.07%
		シンガポール・ドル売/ 円買 2025年7月	売建	7,578,200	843,027,765	859,865,767	3.06%
		ユーロ売/円買 2025年7 月	売建	6,772,300	1,104,605,564	1,148,546,186	4.08%
		カナダ・ドル売/円買 2025年7月	売建	3,862,700	403,744,286	408,050,605	1.45%
		英ポンド売/円買 2025年 7月	売建	6,992,900	1,349,694,734	1,387,384,367	4.93%
		イスラエル・シケル 売/円買 2025年7月	売建	1,035,500	42,139,672	44,197,728	0.16%
		豪ドル売/円買 2025年7 月	売建	23,104,100	2,135,150,037	2,181,881,891	7.76%
		米ドル売/円買 2025年7 月	売建	150,226,000	21,491,872,374	21,736,004,646	77.29%

(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

## ●FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

2025年6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

当初設定日(2016年9月26日)～2025年6月30日

基準価額	10,222円
純資産総額	210億円



## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1か月間	-0.8%
3か月間	0.1%
6か月間	-0.6%
1年間	2.9%
3年間	-6.4%
5年間	15.9%
設定来	2.2%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期		
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月	22年6月	23年6月	24年6月	25年6月		
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円		

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	287	99.3%	日本円	100.0%	小売	18.3%	PROLOGIS INC	産業用	アメリカ	6.3%
外国投資信託等	2	1.7%	韓国ウォン	0.3%	産業用	15.3%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	6.1%
コール・ローン、その他		3.1%	シンガポール・ドル	0.2%	住宅	13.4%	EQUINIX INC	データセンター	アメリカ	4.9%
合計	289	-	豪ドル	0.2%	ヘルスケア	12.8%	DOW JONES US REAL ESTATE SEP 25	-	アメリカ	3.6%
国・地域別構成			香港ドル	0.1%	データセンター	8.7%	DIGITAL REALTY TRUST INC	データセンター	アメリカ	3.5%
アメリカ		78.2%	ユーロ	0.1%	ダイバーシファイド	8.3%	REALTY INCOME CORP	小売	アメリカ	3.3%
オーストラリア		7.8%	イスラエル・シケル	0.0%	倉庫	8.2%	SIMON PROPERTY GROUP INC	小売	アメリカ	3.2%
イギリス		4.6%	カナダ・ドル	0.0%	オフィススペース	4.0%	GOODMAN GROUP	産業用	オーストラリア	3.1%
シンガポール		3.3%	ニュージーランド・ドル	0.0%	特殊	4.0%	PUBLIC STORAGE	倉庫	アメリカ	2.9%
その他		7.1%	その他	-0.7%	その他	2.0%	VICI PROPERTIES INC	特殊	アメリカ	2.2%
合計		101.0%	合計	100.0%	合計	95.1%	合計			39.0%

※リート用途別構成の用途は、原則としてS&P Global Property Indexの分類によるものです。なお、優先リート(会社が発行する優先株に相当するリート)は、用途別の分類はしていません。

※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

当ファンドのベンチマークはS&amp;P先進国REIT指数(除く日本)(税引後配当込み、円ヘッジ・円ベース)です。



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

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2025年は6月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 【ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)】

## (1) 【投資状況】 (2025年6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	10,227,396,159	99.99
内 日本	10,227,396,159	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	798,164	0.01
純資産総額	10,228,194,323	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6月30日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,649,515,857	3.8701 10,253,932,532	3.8601 10,227,396,159	99.99

(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	99.99%
合計	99.99%

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	609,843,907	609,843,907	1.0729	1.0729
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,189,127,891	1,189,127,891	1.0864	1.0864
第3計算期間末 (2019年6月17日)	1,667,702,163	1,667,702,163	1.1931	1.1931
第4計算期間末 (2020年6月15日)	2,091,937,862	2,091,937,862	1.0120	1.0120
第5計算期間末 (2021年6月15日)	3,226,829,877	3,226,829,877	1.4252	1.4252
第6計算期間末 (2022年6月15日)	3,454,275,087	3,454,275,087	1.4737	1.4737
第7計算期間末 (2023年6月15日)	4,650,947,962	4,650,947,962	1.5400	1.5400
第8計算期間末 (2024年6月17日)	7,453,636,072	7,453,636,072	1.8320	1.8320
2024年6月末日	7,697,758,472	-	1.8717	-
7月末日	8,035,064,074	-	1.9009	-
8月末日	8,278,389,696	-	1.8909	-
9月末日	8,615,917,339	-	1.9387	-
10月末日	9,158,288,327	-	2.0424	-
11月末日	9,362,201,844	-	2.0379	-
12月末日	9,175,948,168	-	1.9632	-
2025年1月末日	9,305,476,774	-	1.9458	-
2月末日	9,389,555,915	-	1.9234	-
3月末日	9,319,262,606	-	1.8683	-
4月末日	9,223,634,615	-	1.7631	-
5月末日	9,889,242,060	-	1.8373	-
第9計算期間末 (2025年6月16日)	10,164,469,940	10,164,469,940	1.8525	1.8525
6月末日	10,228,194,323	-	1.8474	-

## 【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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	7.3
第2計算期間	1.3
第3計算期間	9.8
第4計算期間	15.2
第5計算期間	40.8
第6計算期間	3.4
第7計算期間	4.5
第8計算期間	19.0
第9計算期間	1.1

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	593,727,416	35,333,000
第2計算期間	637,956,340	111,827,964
第3計算期間	579,621,490	276,337,306
第4計算期間	1,036,279,306	366,994,605
第5計算期間	758,967,899	561,930,084
第6計算期間	709,209,320	629,454,617
第7計算期間	1,053,030,359	376,743,698
第8計算期間	1,871,437,793	823,067,892
第9計算期間	2,192,925,167	774,529,794

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

(参考) マザーファンド

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6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	1,121,245,729	2.32
内 アメリカ	1,121,245,729	2.32
投資証券	45,884,484,471	94.82
内 ガーンジー	75,627,507	0.16
内 韓国	84,573,381	0.17
内 香港	492,062,826	1.02
内 シンガポール	1,565,210,994	3.23
内 イスラエル	83,016,344	0.17
内 イギリス	2,169,254,427	4.48
内 アイルランド	17,318,221	0.04
内 オランダ	72,077,320	0.15
内 ベルギー	439,395,476	0.91
内 フランス	860,037,143	1.78
内 ドイツ	13,557,191	0.03
内 スペイン	207,573,315	0.43
内 イタリア	4,978,864	0.01
内 カナダ	615,307,756	1.27
内 アメリカ	35,404,364,678	73.17
内 オーストラリア	3,739,987,817	7.73
内 ニュージーランド	40,141,211	0.08
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,383,732,923	2.86
純資産総額	48,389,463,123	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)	1,368,629,935	2.83
内 ドイツ	408,609,144	0.84
内 アメリカ	960,020,791	1.98
為替予約取引(買建)	354,065,271	0.73
内 日本	354,065,271	0.73

(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6月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	199,988	16,794.62 3,358,737,708	15,294.83 3,058,782,902	6.32
2	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	133,893	20,022.87 2,680,929,480	22,029.94 2,949,655,466	6.10
3	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	21,082	140,600.80 2,964,148,692	113,691.77 2,396,850,087	4.95
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	68,230	27,901.84 1,903,752,186	24,814.64 1,693,102,996	3.50
5	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	194,633	8,331.78 1,621,653,984	8,258.51 1,607,379,414	3.32
6	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	66,128	26,360.63 1,743,182,731	23,242.00 1,536,947,307	3.18
7	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	461,599	3,528.44 1,628,757,663	3,222.45 1,487,479,698	3.07
8	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	34,028	49,702.26 1,691,268,775	41,977.52 1,428,411,146	2.95
9	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	87,500	12,890.11 1,127,889,771	12,814.23 1,121,245,729	2.32
10	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	227,743	4,688.07 1,067,682,688	4,674.46 1,064,577,092	2.20
11	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	45,736	24,435.23 1,117,572,386	21,121.98 966,035,179	2.00
12	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	63,588	17,600.78 1,119,202,635	14,814.06 941,996,638	1.95
13	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	30,645	33,773.60 1,034,993,839	29,596.26 906,977,627	1.87
14	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	97,264	9,244.23 899,144,823	9,105.65 885,652,214	1.83
15	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	73,697	11,009.32 811,358,066	9,752.95 718,763,414	1.49
16	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	122,856	4,939.03 606,794,764	4,738.18 582,114,235	1.20
17	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	13,876	44,600.17 618,873,334	41,330.22 573,498,162	1.19
18	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	25,228	23,647.76 596,587,608	21,410.15 540,135,479	1.12

19	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	25,859	18,271.54 472,484,120	18,338.73 474,221,436	0.98
20	LINK REIT	香港	投資証券	586,874	628.21 368,684,474	783.70 459,933,154	0.95
21	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	145,485	3,656.45 531,962,062	3,030.87 440,946,602	0.91
22	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	47,194	8,271.69 390,376,038	9,104.20 429,663,837	0.89
23	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	297,274	1,537.05 456,945,872	1,364.10 405,513,604	0.84
24	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	1,183,720	347.00 410,809,778	339.25 401,582,929	0.83
25	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	アメリカ	投資証券	59,232	7,417.45 439,358,927	6,716.28 397,819,159	0.82
26	UDR INC	アメリカ	投資証券	64,975	6,590.73 428,241,885	5,895.21 383,041,601	0.79
27	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	23,025	18,072.28 416,117,704	16,473.58 379,304,308	0.78
28	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	149,740	3,153.38 472,193,349	2,513.90 376,431,626	0.78
29	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	41,205	10,232.27 421,621,609	8,900.02 366,725,431	0.76
30	REGENCY CENTERS CORP	アメリカ	投資証券	35,211	10,905.64 383,999,299	10,214.89 359,676,752	0.74

(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	2.32%
投資証券	94.82%
合計	97.14%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	アメリカ	DOW JONES US REAL ESTATE SEP 25	買建	184	968,189,581	960,020,791	1.98%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE SEP 25	買建	360	399,745,563	408,609,144	0.84%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2025年7 月	買建	1,240,000	177,382,000	179,392,412	0.37%
		ユーロ買/円売 2025年7 月	買建	1,030,000	167,960,452	174,672,859	0.36%

(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

## ●FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

2025年6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

当初設定日(2016年9月26日)～2025年6月30日

基準価額	18,474円
純資産総額	102億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.5%
3カ月間	-1.1%
6カ月間	-5.9%
1年間	-1.3%
3年間	18.8%
5年間	87.8%
設定来	84.7%

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

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	租入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	288	97.6%	米ドル	77.4%	小売	18.2%	PROLOGIS INC	産業用	アメリカ	6.3%
外国投資信託等	2	2.4%	豪ドル	7.8%	産業用	15.3%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	6.1%
コール・ローン、その他		2.9%	英ポンド	4.7%	住宅	13.4%	EQUINIX INC	データセンター	アメリカ	5.0%
合計	290	-	ユーロ	4.1%	ヘルスケア	12.9%	DIGITAL REALTY TRUST INC	データセンター	アメリカ	3.5%
国・地域別構成			シンガポール・ドル	3.1%	データセンター	8.8%	REALTY INCOME CORP	小売	アメリカ	3.3%
アメリカ		77.5%	カナダ・ドル	1.3%	倉庫	8.2%	SIMON PROPERTY GROUP INC	小売	アメリカ	3.2%
オーストラリア		7.7%	香港ドル	1.1%	ダイバーシファイド	8.1%	GOODMAN GROUP	産業用	オーストラリア	3.1%
イギリス		4.5%	韓国ウォン	0.2%	特殊	4.0%	PUBLIC STORAGE	倉庫	アメリカ	3.0%
シンガポール		3.2%	イスラエル・シェケル	0.2%	オフィススペース	4.0%	VANGUARD REAL ESTATE ETF	-	アメリカ	2.3%
その他		7.1%	その他	0.1%	その他	2.0%	VICI PROPERTIES INC	特殊	アメリカ	2.2%
合計		100.0%	合計	100.0%	合計	94.8%	合計			37.9%

※リート用途別構成の用途は、原則としてS&P Global Property Indexの分類によるものです。なお、優先リート(会社が発行する優先株に相当するリート)は、用途別の分類はしていません。

※先物の控玉がある場合は、「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

当ファンドのベンチマークはS&amp;P先進国REIT指数(除く日本)(税引後配当込み、円ベース)です。



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

・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2025年は6月30日までの騰落率を表しています。

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

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## (参考情報)ファンドの総経費率

	総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
ダイワファンドラップ TOPIXインデックス	0.35%	0.34%	0.01%
ダイワファンドラップ 日経225インデックス	0.35%	0.34%	0.01%
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)	0.47%	0.45%	0.02%
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)	0.47%	0.45%	0.02%
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)	0.50%	0.46%	0.05%
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	0.28%	0.27%	0.01%
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)	0.43%	0.42%	0.01%
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)	0.44%	0.42%	0.02%
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)	0.46%	0.43%	0.04%
ダイワファンドラップ J-REITインデックス	0.35%	0.34%	0.01%
ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)	0.48%	0.44%	0.05%
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)	0.48%	0.44%	0.05%

※対象期間は2024年6月18日～2025年6月16日です。

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

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

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

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

ただし、販売会社は、後掲の別表Aに掲げる各ファンドについて、後掲の別表Aに掲げる該当日のいずれかと同じ日付の日を申込受付日とする受益権の取得申込みの受け付けを行いません。

お買付価額（1万口当たり）は、各ファンドについて後掲の別表Bに掲げる価額です。

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。

#### <FW 日本債券インデックス>

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

#### <「FW 日本債券インデックス」以外のファンド>

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（「FW TOPIXインデックス」、「FW 日経225インデックス」、「FW 日本債券インデックス」および「FW J-REITインデックス」を除きます。）その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等\*）が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受け付けを中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消することができるものとします。

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

り生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないます。

\* 「FW 外国株式インデックス EM+ (為替ヘッジなし)」および「FW 外国債券インデックス EM+ (為替ヘッジなし)」に限ります。

## 2【換金(解約)手続等】

### <FW 日本債券インデックス>

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

### <「FW 日本債券インデックス」以外のファンド>

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、後掲の別表Aに掲げる各ファンドについて、後掲の別表Aに掲げる該当日のいずれかと同じ日付の日を請求受付日とする一部解約の実行の請求の受け付けは行ないません。

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、各ファンドについて後掲の別表Bに掲げる価額とします。

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(「FW T O P I Xインデックス」、「FW 日経225インデックス」、「FW 日本債券インデックス」および「FW J - R E I Tインデックス」を除きます。)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\*)があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、上記に準じて算出した価額とします。

一部解約金は、販売会社の営業所等において、各ファンドにつ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次の日から受益者に支払います。

ファンド名	解約代金支払開始日
FW TOPIXインデックス FW 日経225インデックス FW 日本債券インデックス	4営業日目
FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし) FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし) FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし) FW J-REITインデックス FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり) FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)	5営業日目
FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)	6営業日目

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。

\* 「FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)」および「FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)」に限ります。

「1 申込(販売)手続等」「2 換金(解約)手続等」中の別表AおよびBは、次のものとします。

[別表A]

ファンド名	該当日
FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし) FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし) FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)	ニューヨーク証券取引所の休業日
FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)	ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、シカゴ商品取引所における米国債先物取引の休業日
FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)	ニューヨークの銀行またはロンドンの銀行の休業日
FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり) FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)	ニューヨーク証券取引所またはオーストラリア証券取引所の休業日

## [ 別表 B ]

ファンド名	価額
FW TOPIXインデックス FW 日経225インデックス FW 日本債券インデックス FW J-REITインデックス	申込受付日の基準価額
FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし） FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし） FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり） FW 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）	申込受付日の翌営業日の基準価額

## 3【資産管理等の概要】

## (1)【資産の評価】

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

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

\*「FW J-REITインデックス」は除きます。

## (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

- ・わが国の金融商品取引所上場株式：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。
- ・外国の金融商品取引所上場の投資信託証券：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で評価します。
- ・わが国および外国の公社債：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。
  1. 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

- ・不動産投資信託証券：原則として金融商品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時において知り得る直近の日の最終相場で評価します。

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(「FW TOPIXインデックス」、「FW 日経225インデックス」、「FW 日本債券インデックス」および「FW J-REITインデックス」を除きます。)

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

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

#### (4)【計算期間】

毎年6月16日から翌年6月15日までとします。ただし、第1計算期間は、2016年9月26日から2017年6月15日までとします。

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

#### (5)【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合、特定の指数が改廃された場合(「FW 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)」および「FW 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)」を除きます。)、もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

3. 前2.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 前2.から前4.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2.から前4.までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
6. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
8. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### 信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本の1.から7.までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。
2. 委託会社は、前1.の事項(前1.の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1.の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行ないます。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送します。
3. 前2.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

6. 前2.から前5.までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1.から前6.までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっては、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前7.までの規定にしたがいます。

#### 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

#### 運用報告書

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

#### 公告

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

#### 関係法人との契約の更改

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

## 4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

#### <収益分配金および償還金にかかる請求権>

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

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

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

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

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

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

#### < 換金請求権 >

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

### 第3 【ファンドの経理状況】

#### 【ダイワファンドラップ TOPIXインデックス】

(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6月18日から2025年6月16日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップ TOPIXインデックス

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	48,219,241	106,966,338
親投資信託受益証券	25,393,167,933	37,387,045,694
流動資産合計	25,441,387,174	37,494,012,032
資産合計	25,441,387,174	37,494,012,032
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	5,342,110	46,076,655
未払受託者報酬	2,605,967	3,697,851
未払委託者報酬	37,787,180	53,619,458
その他未払費用	651,404	924,373
流動負債合計	46,386,661	104,318,337
負債合計	46,386,661	104,318,337
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sub>1</sub> 10,829,538,359	<sub>1</sub> 15,173,066,603
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	14,565,462,154	22,216,627,092
（分配準備積立金）	7,213,805,976	7,807,207,329
元本等合計	25,395,000,513	37,389,693,695
純資産合計	25,395,000,513	37,389,693,695
負債純資産合計	25,441,387,174	37,494,012,032

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期		第9期	
	自	2023年6月16日 至 2024年6月17日	自	2024年6月18日 至 2025年6月16日
<b>営業収益</b>				
受取利息		10,721		171,333
有価証券売買等損益		4,077,801,780		1,920,377,761
営業収益合計		4,077,812,501		1,920,549,094
<b>営業費用</b>				
支払利息		5,817		-
受託者報酬		4,809,651		6,816,621
委託者報酬		69,741,328		98,842,233
その他費用		1,202,247		1,703,993
営業費用合計		75,759,043		107,362,847
営業利益又は営業損失（ ）		4,002,053,458		1,813,186,247
経常利益又は経常損失（ ）		4,002,053,458		1,813,186,247
当期純利益又は当期純損失（ ）		4,002,053,458		1,813,186,247
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（ ）		494,333,546		83,273,734
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		9,710,390,522		14,565,462,154
剰余金増加額又は欠損金減少額		4,407,245,589		8,901,570,417
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		4,407,245,589		8,901,570,417
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,059,893,869		2,980,317,992
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,059,893,869		2,980,317,992
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		14,565,462,154		22,216,627,092

## (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6月18日 至2025年6月16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6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2024年6月17日としており、2025年6月15日が休日のため、当計算期間末日を2025年6月16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	第9期
	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1. 1 期首元本額	10,176,374,027円	10,829,538,359円
期中追加設定元本額	3,825,653,131円	6,553,530,642円
期中一部解約元本額	3,172,488,799円	2,210,002,398円
2. 計算期間末日における受益権の総数	10,829,538,359口	15,173,066,603口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第8期	第9期
	自2023年6月16日 至2024年6月17日	自2024年6月18日 至2025年6月16日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (5,877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 (3,507,706,443円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (7,351,656,178円)及び分配準備積立金(3,706,093,656円)より分配対象額は14,565,462,154円(1万口当たり13,449.75円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (160,581円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (1,729,751,932円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (14,409,419,763円)及び分配準備積立金(6,077,294,816円)より分配対象額は22,216,627,092円(1万口当たり14,642.15円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	--	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第9期
	2025年6月16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	第9期
	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	3,732,492,992	1,874,624,984
合計	3,732,492,992	1,874,624,984

## (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	第9期
2024年6月17日現在	2025年6月16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6月18日
至2025年6月16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	第9期
	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	2,345円	2,464円
(1万口当たり純資産額)	(23,450円)	(24,642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	トピックス・インデックス・マザーファンド	18,084,963,815	37,387,045,694	
親投資信託受益証券 合計			37,387,045,694	
合計			37,387,045,694	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2024年6月17日現在 金額(円)	2025年6月16日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		

コール・ローン		13,587,748,333	12,954,554,845
株式	2 3	343,000,160,660	431,296,451,840
派生商品評価勘定		-	2,544,500
未収入金		10,915,000	-
未収配当金		2,265,208,148	3,224,373,669
前払金		89,950,000	75,430,000
その他未収収益	4	19,964,962	62,670,631
差入委託証拠金		11,887,237	-
流動資産合計		358,985,834,340	447,616,025,485
資産合計		358,985,834,340	447,616,025,485
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		249,710,050	12,534,400
未払金		5,061,600	1,548,700
未払解約金		50,517,570	197,661,170
未払利息		-	2,002,165
受入担保金		7,592,342,003	9,499,915,411
流動負債合計		7,897,631,223	9,713,661,846
負債合計		7,897,631,223	9,713,661,846
純資産の部			
元本等			
元本	1	179,077,569,301	211,826,457,370
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		172,010,633,816	226,075,906,269
元本等合計		351,088,203,117	437,902,363,639
純資産合計		351,088,203,117	437,902,363,639
負債純資産合計		358,985,834,340	447,616,025,485

## 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6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1. 1 期首	2023年6月16日	2024年6月18日
期首元本額	155,385,420,480円	179,077,569,301円
期中追加設定元本額	39,993,423,771円	58,539,565,430円
期中一部解約元本額	16,301,274,950円	25,790,677,361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	2,805,279,280円	2,816,144,305円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA	4,071,973,852円	3,541,764,641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	907,848円	901,535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	8,694,234円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	139,851,291円	101,848,648円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	11,667,234円	9,684,377円

ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	344,658,301円	256,901,047円
国内株式ファンド(適格機関投 資家専用)	1,209,547,484円	1,491,494,139円
日本株式インデックスファンド (F0Fs用)(適格機関投資家専 用)	725,039,138円	935,176,883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)	-円	838,959,109円
D-I's TOPIXインデッ クス	12,953,393円	10,777,091円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	240,654,595円	238,587,466円
iFree TOPIXインデッ クス	8,054,701,433円	10,982,479,990円
iFree 8資産バランス	4,637,002,543円	5,466,222,980円
iFree 年金バランス	1,099,589,540円	1,269,176,267円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2060	3,602,255円	5,613,242円
DCダイワ日本株式インデッ クス	71,150,512,428円	72,586,462,326円
ダイワ・ライフ・バランス30	2,999,401,241円	2,925,579,709円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,894,560,071円	5,227,986,997円
ダイワ・ライフ・バランス70	5,901,383,202円	6,287,931,709円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	7,735,661,770円	10,737,241,945円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	46,288,571円	38,232,962円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	72,209,078円	72,797,436円
ダイワつみたてインデックス日 本株式	5,724,760,722円	7,378,410,418円
ダイワつみたてインデックスバ ランス30	12,074,009円	12,589,096円
ダイワつみたてインデックスバ ランス50	11,970,580円	14,921,757円
ダイワつみたてインデックスバ ランス70	30,025,521円	286,160,972円
ダイワ国内株式インデックス (ラップ専用)	17,911,277,269円	29,168,373,075円

ダイワ世界バランスファンド4 0VA	46,931,794円	41,004,364円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	19,120,292円	18,674,040円
ダイワ・バランスファンド35 VA	3,211,199,892円	2,590,382,424円
ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	316,893,779円	258,958,330円
ダイワ国内バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専用)	40,650,926円	33,642,397円
ダイワ国内バランスファンド3 0VA(適格機関投資家専用)	59,424,894円	49,301,187円
ダイワ・ノーロードTOPIX ファンド	240,955,317円	230,161,708円
ダイワファンドラップTOPI Xインデックス	12,952,393,743円	18,084,963,815円
ダイワTOPIXインデックス (ダイワSMA専用)	9,075,948,646円	15,145,711,546円
ダイワファンドラップオンライ ンTOPIXインデックス	3,363,788,425円	3,338,653,574円
スタイル9(4資産分散・保守 型)	318,862円	1,384,065円
スタイル9(4資産分散・ balan ス型)	2,618,805円	9,232,632円
スタイル9(4資産分散・積極 型)	3,657,307円	13,684,044円
スタイル9(6資産分散・保守 型)	193,671円	568,080円
スタイル9(6資産分散・ balan ス型)	4,615,927円	17,304,656円
スタイル9(6資産分散・積極 型)	5,822,082円	19,341,659円
スタイル9(8資産分散・保守 型)	258,358円	927,097円
スタイル9(8資産分散・ balan ス型)	3,813,320円	15,203,931円
スタイル9(8資産分散・積極 型)	11,114,936円	39,473,075円
ダイワ国内株式インデックス (投資一任専用)	-円	6,099,620円
ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,057,446,757円	921,304,263円

	ダイワライフスタイル2 5	92,819,702円	85,281,713円
	ダイワライフスタイル5 0	440,379,096円	413,468,231円
	ダイワライフスタイル7 5	381,811,643円	370,161,705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）	7,888,735,670円	7,410,454,858円
計		179,077,569,301円	211,826,457,370円
2.	期末日における受益権の総数	179,077,569,301口	211,826,457,370口
3.	2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 7,145,926,840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 9,012,751,320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 731,860,000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 925,595,000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)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年6月16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6月17日現在	2025年6月16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	32,396,981,321	22,761,626,778
合計	32,396,981,321	22,761,626,778

(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6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株値指数								
先物取引								
買建	8,087,635,000	-	7,838,085,000	249,550,000	6,071,360,000	-	6,061,490,000	9,870,000
合計	8,087,635,000	-	7,838,085,000	249,550,000	6,071,360,000	-	6,061,490,000	9,870,000

## (注) 1. 時価の算定方法

株値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. 株値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6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	1.9605円	2.0673円
(1万口当たり純資産額)	(19,605円)	(20,673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	6,400	4,515.00	28,896,000	
ニッスイ	153,400	842.00	129,162,800	
マルハニチロ	22,800	3,036.00	69,220,800	
ユキグニファクトリー	13,100	1,098.00	14,383,800	
カネコ種苗	4,300	1,365.00	5,869,500	貸付株式数 1,100株
サカタのタネ	19,000	3,375.00	64,125,000	貸付株式数 400株
ホクト	13,700	1,813.00	24,838,100	

ショーボンドHD	20,200	4,827.00	97,505,400	
ミライト・ワン	48,600	2,463.00	119,701,800	
タマホーム	9,600	3,315.00	31,824,000	貸付株式数 3,800株
住石ホールディングス	19,300	673.00	12,988,900	貸付株式数 7,600株
日鉄鉱業	6,200	7,520.00	46,624,000	貸付株式数 2,400株
三井松島HLDGS	7,500	4,605.00	34,537,500	貸付株式数 500株
I N P E X	463,800	2,114.00	980,473,200	
石油資源開発	84,200	1,051.00	88,494,200	貸付株式数 15,000株
K&Oエナジーグループ	7,000	2,966.00	20,762,000	
リョーサン菱洋HD	17,700	2,530.00	44,781,000	貸付株式数 6,600株
第一カッター興業	3,900	1,365.00	5,323,500	
安藤・間	88,900	1,448.00	128,727,200	
東急建設	48,100	1,020.00	49,062,000	
コムシスホールディングス	54,400	3,277.00	178,268,800	
ピーアールホールディングス	22,500	328.00	7,380,000	貸付株式数 8,900株
高松コンストラクションGP	11,400	2,841.00	32,387,400	
東建コーポレーション	3,300	13,580.00	44,814,000	貸付株式数 500株 (500株)
ヤマウラ	7,800	1,212.00	9,453,600	貸付株式数 3,000株
オリエンタル白石	56,800	366.00	20,788,800	
大成建設	97,500	8,022.00	782,145,000	
大林組	354,400	2,207.00	782,160,800	
清水建設	293,300	1,601.00	469,573,300	
長谷工コーポレーション	98,500	2,141.50	210,937,750	
松井建設	10,000	1,110.00	11,100,000	貸付株式数 2,600株
鹿島建設	238,000	3,654.00	869,652,000	
不動テトラ	6,700	2,182.00	14,619,400	貸付株式数 2,600株
鉄建建設	6,700	2,776.00	18,599,200	
西松建設	17,100	4,897.00	83,738,700	
三井住友建設	85,500	595.00	50,872,500	
大豊建設	14,800	797.00	11,795,600	
奥村組	19,000	4,275.00	81,225,000	貸付株式数 1,700株
東鉄工業	11,800	3,690.00	43,542,000	
浅沼組	43,000	740.00	31,820,000	
戸田建設	132,100	898.90	118,744,690	
熊谷組	17,700	4,230.00	74,871,000	
矢作建設	14,600	1,687.00	24,630,200	貸付株式数 100株
ピーエス・コンストラクション	7,800	1,770.00	13,806,000	貸付株式数 2,700株

日本ハウスHLDGS	22,900	293.00	6,709,700	貸付株式数	9,200株
大東建託	36,700	15,850.00	581,695,000		
新日本建設	15,100	1,596.00	24,099,600		
東亜道路	18,600	1,486.00	27,639,600		
日本道路	10,700	2,517.00	26,931,900		
東亜建設	32,400	1,493.00	48,373,200		
日本国土開発	32,900	464.00	15,265,600		
若築建設	3,200	3,970.00	12,704,000		
東洋建設	30,900	1,471.00	45,453,900		
五洋建設	140,500	884.50	124,272,250		
世紀東急	15,300	1,447.00	22,139,100	貸付株式数	6,000株
福田組	4,000	4,880.00	19,520,000		
住友林業	92,800	4,314.00	400,339,200	貸付株式数	34,900株
大和ハウス	323,900	4,856.00	1,572,858,400		
ライト工業	20,500	2,831.00	58,035,500		
積水ハウス	325,600	3,024.00	984,614,400		
日特建設	10,300	1,068.00	11,000,400		
北陸電気工事	7,400	1,179.00	8,724,600		
ユアテック	19,800	1,959.00	38,788,200		
日本リーテック	8,400	1,720.00	14,448,000	貸付株式数	2,900株
四電工	13,500	1,285.00	17,347,500	貸付株式数	200株
中電工	16,700	3,350.00	55,945,000		
関電工	58,800	3,185.00	187,278,000		
きんでん	73,700	4,047.00	298,263,900		
東京エネシス	11,400	1,230.00	14,022,000	貸付株式数	4,500株
トーエネック	17,800	1,169.00	20,808,200		
住友電設	8,800	6,290.00	55,352,000		
日本電設工業	20,100	2,482.00	49,888,200		
エクシオグループ	111,000	1,825.50	202,630,500		
新日本空調	13,900	2,327.00	32,345,300		
九電工	23,200	5,762.00	133,678,400		
三機工業	22,400	3,955.00	88,592,000		
日揮ホールディングス	106,300	1,259.50	133,884,850		
中外炉工業	3,500	3,335.00	11,672,500	貸付株式数	1,400株
太平電業	7,100	5,260.00	37,346,000		
高砂熱学	25,900	6,881.00	178,217,900	貸付株式数	9,700株
朝日工業社	10,000	2,402.00	24,020,000		
明星工業	18,000	1,433.00	25,794,000		
大気社	27,500	2,476.00	68,090,000		
ダイダン	18,800	4,175.00	78,490,000		

日比谷総合設備	8,800	3,530.00	31,064,000	貸付株式数	3,400株
ニッポン	35,500	2,137.00	75,863,500	貸付株式数	3,400株
日清製粉G本社	107,100	1,732.00	185,497,200		
日東富士製粉	1,900	7,100.00	13,490,000		
昭和産業	9,100	2,927.00	26,635,700		
中部飼料	14,900	1,562.00	23,273,800		
フィード・ワン	15,700	975.00	15,307,500		
日本甜菜糖	5,600	2,340.00	13,104,000	貸付株式数	2,200株
DM三井製糖	10,700	3,085.00	33,009,500		
ウェルネオシュガー	6,000	2,254.00	13,524,000		
L I F U L L	33,000	191.00	6,303,000		
M I X I	21,100	3,305.00	69,735,500		
ジェイエイシーリクルート メント	40,700	985.00	40,089,500		
日本M&Aセンターホールデ メンバーズ	165,500	711.80	117,802,900		
メンバーズ	4,400	1,261.00	5,548,400	貸付株式数	1,700株
UTグループ	14,700	2,355.00	34,618,500		
アイティメディア	6,000	1,615.00	9,690,000	貸付株式数	1,300株
ケアネット	23,000	670.00	15,410,000	貸付株式数	9,100株
E・Jホールディングス	6,500	1,479.00	9,613,500		
オープンアップグループ	37,600	1,715.00	64,484,000		
コシダカホールディングス	30,900	1,085.00	33,526,500	貸付株式数	13,200株
パソナグループ	13,200	2,162.00	28,538,400		
リンクアンドモチベーショ ン	26,800	495.00	13,266,000	貸付株式数	10,700株
エス・エム・エス	43,000	1,401.00	60,243,000	貸付株式数	17,000株
パーソルホールディングス	1,025,800	277.10	284,249,180		
クックパッド	30,800	188.00	5,790,400	貸付株式数	12,100株
森永製菓	43,200	2,341.50	101,152,800		
中村屋	2,700	3,120.00	8,424,000		
江崎グリコ	30,800	4,634.00	142,727,200		
名糖産業	4,800	2,016.00	9,676,800		
井村屋グループ	5,900	2,423.00	14,295,700		
不二家	7,400	2,352.00	17,404,800	貸付株式数	2,900株
山崎製パン	72,100	3,235.00	233,243,500		
モロゾフ	10,400	1,601.00	16,650,400	貸付株式数	4,100株
亀田製菓	6,900	3,695.00	25,495,500	貸付株式数	2,400株
寿スピリッツ	63,700	2,124.00	135,298,800	貸付株式数	25,400株
カルビー	49,300	2,735.00	134,835,500		
森永乳業	40,100	3,335.00	133,733,500		

六甲バター	7,900	1,232.00	9,732,800	貸付株式数	3,000株
ヤクルト	154,000	2,868.00	441,672,000	貸付株式数	60,800株
明治ホールディングス	138,600	3,208.00	444,628,800		
雪印メグミルク	29,000	2,774.00	80,446,000		
プリマハム	14,500	2,297.00	33,306,500		
日本ハム	44,600	5,125.00	228,575,000		
丸大食品	10,800	1,784.00	19,267,200	貸付株式数	3,900株
S Foods	11,900	2,575.00	30,642,500	貸付株式数	4,700株
柿安本店	4,600	2,623.00	12,065,800	貸付株式数	1,800株
伊藤ハム米久HLDGS	16,500	4,985.00	82,252,500		
学情	5,700	1,773.00	10,106,100	貸付株式数	600株
スタジオアリス	5,600	2,136.00	11,961,600	貸付株式数	2,200株 (300株)
クロスキャット	6,300	1,040.00	6,552,000	貸付株式数	100株
システナ	156,900	407.00	63,858,300		
N J S	2,800	5,910.00	16,548,000	貸付株式数	1,100株
デジタルアーツ	6,900	7,540.00	52,026,000	貸付株式数	2,700株
日鉄ソリューションズ	37,400	4,146.00	155,060,400	貸付株式数	14,900株
総合警備保障	187,900	1,024.50	192,503,550		
キューブシステム	5,800	1,093.00	6,339,400	貸付株式数	2,200株
いちご	91,200	393.00	35,841,600	貸付株式数	36,400株
日本駐車場開発	128,300	254.00	32,588,200		
コア	4,900	1,907.00	9,344,300		
カカクコム	81,100	2,667.00	216,293,700		
セントケア・ホールディング	7,200	791.00	5,695,200	貸付株式数	2,800株
ルネサンス	8,700	1,004.00	8,734,800	貸付株式数	3,400株
ディップ	19,700	2,150.00	42,355,000	貸付株式数	7,400株
SBSホールディングス	9,800	2,810.00	27,538,000	貸付株式数	3,000株
デジタルホールディングス	5,700	1,251.00	7,130,700	貸付株式数	2,200株
新日本科学	11,900	1,338.00	15,922,200	貸付株式数	2,400株
エムスリー	222,300	2,013.00	447,489,900		
ワールドホールディングス	4,400	2,162.00	9,512,800	貸付株式数	400株
ディー・エヌ・エー	45,000	2,672.00	120,240,000	貸付株式数	17,900株
博報堂D Y HLDGS	127,600	1,170.50	149,355,800		
ぐるなび	21,000	250.00	5,250,000	貸付株式数	8,200株
タカミヤ	15,300	346.00	5,293,800	貸付株式数	6,000株
ファンコミュニケーションズ	13,500	422.00	5,697,000	貸付株式数	5,400株

ライク	5,900	1,380.00	8,142,000	貸付株式数 2,300株 (2,000株)
エスプール	35,600	334.00	11,890,400	
WDBホールディングス	5,700	1,902.00	10,841,400	貸付株式数 2,200株
手間いらず	1,600	3,090.00	4,944,000	貸付株式数 500株
アドウェイズ	13,800	324.00	4,471,200	貸付株式数 5,500株
バリューコマース	9,900	794.00	7,860,600	
インフォマート	106,200	406.00	43,117,200	貸付株式数 42,300株
サッポロホールディングス	35,500	7,335.00	260,392,500	
アサヒグループホールディングン	809,300	1,923.50	1,556,688,550	
麒麟HD	448,900	2,057.50	923,611,750	
シマダヤ	3,100	1,779.00	5,514,900	
宝ホールディングス	72,700	1,197.50	87,058,250	
オエノンホールディングス	34,900	578.00	20,172,200	貸付株式数 12,300株
養命酒	3,500	3,105.00	10,867,500	貸付株式数 1,300株
飛島ホールディングス	11,000	1,840.00	20,240,000	
コカ・コーラボトラーズJHD	67,500	2,358.50	159,198,750	
ライフドリンクカンパニー	23,500	2,009.00	47,211,500	貸付株式数 9,400株
サントリー食品インター	75,900	4,636.00	351,872,400	
ダイドーグループHD	12,200	2,668.00	32,549,600	貸付株式数 4,800株
伊藤園	34,900	3,228.00	112,657,200	貸付株式数 8,600株
キーコーヒー	12,100	1,974.00	23,885,400	貸付株式数 4,800株
日清オイリオグループ	15,200	4,725.00	71,820,000	
不二製油	21,500	2,853.00	61,339,500	
J-オイルミルズ	12,300	1,940.00	23,862,000	
インターメスティック	8,800	1,662.00	14,625,600	貸付株式数 3,400株
サンエー	19,600	2,950.00	57,820,000	
カワチ薬品	9,100	2,753.00	25,052,300	
エービーシー・マート	50,700	2,863.50	145,179,450	
ハードオフコーポレーション	4,600	1,702.00	7,829,200	
高千穂交易	9,200	2,186.00	20,111,200	貸付株式数 3,600株
アスクル	27,200	1,503.00	40,881,600	
ゲオホールディングス	13,000	1,559.00	20,267,000	
アダストリア	16,000	2,846.00	45,536,000	貸付株式数 6,100株
リガク・ホールディングス	74,400	709.00	52,749,600	
伊藤忠食品	2,600	9,990.00	25,974,000	貸付株式数 1,000株
くら寿司	13,600	3,215.00	43,724,000	貸付株式数 5,300株
キャンドウ	4,100	3,400.00	13,940,000	貸付株式数 1,600株

パルグループHLDGS	26,500	3,575.00	94,737,500	
エディオン	50,400	1,993.00	100,447,200	貸付株式数 20,100株
あらた	17,700	2,989.00	52,905,300	
サーラコーポレーション	24,300	939.00	22,817,700	
トーメンデバイス	1,700	5,760.00	9,792,000	貸付株式数 500株
ハローズ	4,600	4,770.00	21,942,000	貸付株式数 1,700株
JPホールディングス	28,800	533.00	15,350,400	貸付株式数 11,400株
フジオフードG本社	14,500	1,198.00	17,371,000	貸付株式数 5,800株 (100株)
あみやき亭	8,400	1,448.00	12,163,200	貸付株式数 3,200株
東京エレクトロンデバイス	11,500	2,701.00	31,061,500	貸付株式数 4,600株
円谷フィールズホールディ	18,700	2,198.00	41,102,600	貸付株式数 7,400株
双日	128,900	3,515.00	453,083,500	
アルフレッサホールディン グス	101,800	1,957.50	199,273,500	
大黒天物産	4,200	6,970.00	29,274,000	貸付株式数 1,500株
ハニーズホールディングス	10,300	1,513.00	15,583,900	貸付株式数 3,100株
キッコーマン	357,100	1,283.50	458,337,850	
味の素	493,900	3,698.00	1,826,442,200	
ブルドックソ - ス	5,700	1,803.00	10,277,100	貸付株式数 2,200株
キューピー	57,900	3,350.00	193,965,000	
ハウス食品G本社	36,300	2,816.00	102,220,800	
カゴメ	46,100	2,924.00	134,796,400	
アリアケジャパン	10,700	6,500.00	69,550,000	
エバラ食品工業	2,700	2,544.00	6,868,800	
キオクシアホールディング ス	66,200	2,009.00	132,995,800	貸付株式数 26,400株
ニチレイ	84,100	1,884.00	158,444,400	
横浜冷凍	29,100	897.00	26,102,700	貸付株式数 11,200株
東洋水産	49,900	9,376.00	467,862,400	
イトアンドHLDGS	5,600	2,043.00	11,440,800	貸付株式数 2,200株
ヨシムラ・フード・HLDGS	5,900	991.00	5,846,900	貸付株式数 2,200株
日清食品HD	136,200	2,968.00	404,241,600	
フジッコ	11,100	1,603.00	17,793,300	貸付株式数 4,400株
ロックフィールド	12,100	1,483.00	17,944,300	貸付株式数 4,700株
日本たばこ産業	654,900	4,360.00	2,855,364,000	
ケンコーマヨネーズ	6,700	1,798.00	12,046,600	貸付株式数 2,600株
わらべや日洋HD	7,200	2,254.00	16,228,800	
なとり	6,800	2,035.00	13,838,000	
ファーマフーズ	14,300	902.00	12,898,600	貸付株式数 5,500株

北の達人コーポ	46,200	138.00	6,375,600	貸付株式数 17,600株 (1,300株)
ユーグレナ	66,900	430.00	28,767,000	貸付株式数 26,700株
紀文食品	9,300	1,069.00	9,941,700	貸付株式数 3,400株
ピクルスホールディングス	6,300	915.00	5,764,500	
スター・マイカ・HLDGS	11,100	991.00	11,000,100	貸付株式数 4,300株
SREホールディングス	4,000	3,540.00	14,160,000	貸付株式数 200株
片倉工業	10,100	2,208.00	22,300,800	
グンゼ	15,600	3,515.00	54,834,000	
ヒューリック	251,400	1,449.50	364,404,300	
ラサ商事	6,100	1,454.00	8,869,400	貸付株式数 900株
アルペン	11,100	2,374.00	26,351,400	貸付株式数 4,400株
ラクーンホールディングス	8,200	726.00	5,953,200	貸付株式数 3,200株
クオールホールディングス	14,300	1,873.00	26,783,900	
アルコニックス	16,500	1,790.00	29,535,000	
神戸物産	89,600	4,700.00	421,120,000	貸付株式数 34,600株
ソリトンシステムズ	5,700	1,336.00	7,615,200	
ジンスホールディングス	7,900	8,250.00	65,175,000	貸付株式数 2,100株
ビックカメラ	61,600	1,529.00	94,186,400	貸付株式数 24,600株
DCMホールディングス	60,000	1,329.00	79,740,000	貸付株式数 22,600株
ペッパーフードサービス	34,500	217.00	7,486,500	貸付株式数 13,600株
Monotaro	164,200	2,870.50	471,336,100	貸付株式数 65,500株
あいホールディングス	20,800	2,403.00	49,982,400	
J. フロントリテイリング	132,900	2,014.50	267,727,050	貸付株式数 51,300株
ドトール・日レスHD	20,500	2,676.00	54,858,000	
マツキヨココカラ&カンパニー	204,200	2,847.50	581,459,500	
ブロンコビリー	6,800	3,745.00	25,466,000	貸付株式数 2,700株
ZOZO	258,300	1,530.00	395,199,000	貸付株式数 33,200株
トレジャー・ファクトリー	8,000	1,843.00	14,744,000	貸付株式数 3,100株
物語コーポレーション	22,500	3,800.00	85,500,000	貸付株式数 8,900株
三越伊勢丹HD	171,200	2,300.50	393,845,600	
東洋紡	47,400	889.00	42,138,600	貸付株式数 18,700株
ユニチカ	35,400	161.00	5,699,400	貸付株式数 13,200株
富士紡ホールディングス	4,200	5,210.00	21,882,000	
日清紡ホールディングス	83,100	905.10	75,213,810	
倉敷紡績	7,400	7,480.00	55,352,000	
ダイワボウHD	51,300	2,477.50	127,095,750	

シキボウ	7,900	951.00	7,512,900	貸付株式数	3,100株
日東紡績	12,400	5,080.00	62,992,000		
トヨタ紡織	46,100	1,910.00	88,051,000		
マクニカホールディングス	88,000	1,902.50	167,420,000	貸付株式数	5,200株
H a m e e	5,300	1,282.00	6,794,600		
ラクト・ジャパン	4,900	3,730.00	18,277,000	貸付株式数	1,900株
ウエルシアHD	60,100	2,541.50	152,744,150		
クリエイトSDH	16,400	3,155.00	51,742,000	貸付株式数	3,700株
グリムス	4,900	2,340.00	11,466,000	貸付株式数	1,900株
パイタルKSKHD	15,900	1,214.00	19,302,600		
八洲電機	9,400	1,682.00	15,810,800	貸付株式数	3,700株
メディアスホールディングス	7,500	950.00	7,125,000	貸付株式数	2,900株
レスター	9,800	2,470.00	24,206,000		
TOKAIホールディングス	62,900	1,005.00	63,214,500		
三洋貿易	14,300	1,430.00	20,449,000		
シュッピン	11,400	1,099.00	12,528,600	貸付株式数	4,500株
ビューティガレージ	3,100	1,658.00	5,139,800	貸付株式数	100株
オイシックス・ラ・大地	18,700	1,628.00	30,443,600	貸付株式数	7,400株
ウイン・パートナーズ	8,400	1,316.00	11,054,400	貸付株式数	3,300株
ネクステージ	26,500	1,641.00	43,486,500	貸付株式数	10,100株
ジョイフル本田	32,100	2,018.00	64,777,800	貸付株式数	12,700株
エターナルホスピタリティ グル	4,800	3,050.00	14,640,000	貸付株式数	1,800株
ホットランドホールディング グ	8,900	2,130.00	18,957,000	貸付株式数	3,500株 (200株)
すかいらくHD	158,300	3,078.00	487,247,400	貸付株式数	62,500株
SFPホールディングス	6,500	2,213.00	14,384,500	貸付株式数	2,600株
綿半ホールディングス	9,000	1,557.00	14,013,000	貸付株式数	3,600株
日本毛織	28,100	1,394.00	39,171,400		
ヨシックスホールディング ス	3,800	2,521.00	9,579,800	貸付株式数	1,300株
ユナイテッド・スーパー マーケ	49,400	920.00	45,448,000	貸付株式数	19,600株
野村不動産HLDGS	338,000	840.50	284,089,000		
三重交通グループHD	23,100	481.00	11,111,100	貸付株式数	9,100株
地主	9,500	2,151.00	20,434,500	貸付株式数	3,400株
フィル・カンパニー	2,100	881.00	1,850,100	貸付株式数	800株
JPMC	6,200	1,186.00	7,353,200		
フージャースHD	16,600	1,217.00	20,202,200		

オープンハウスグループ	34,600	6,267.00	216,838,200	
東急不動産HD	324,100	1,036.50	335,929,650	
飯田GHD	103,300	1,977.50	204,275,750	
帝国繊維	12,400	2,659.00	32,971,600	貸付株式数 4,900株
日本コークス工業	111,300	83.00	9,237,900	貸付株式数 44,700株
ゴルフダイジェスト・オン	6,700	428.00	2,867,600	
B E E N O S	1,700	3,980.00	6,766,000	
あさひ	9,700	1,367.00	13,259,900	貸付株式数 3,800株
日本調剤	7,600	3,315.00	25,194,000	貸付株式数 2,300株
コスモス薬品	22,900	9,116.00	208,756,400	貸付株式数 7,200株
シップヘルスケアHD	45,800	1,928.00	88,302,400	
ソフトクリエイトHD	7,900	2,214.00	17,490,600	
セブン&アイ・HLDGS	1,279,200	2,221.00	2,841,103,200	
クリエイト・レストラン ツ・ホール	87,100	1,398.00	121,765,800	貸付株式数 34,700株
明治電機工業	5,700	1,817.00	10,356,900	貸付株式数 2,200株
ツルハホールディングス	20,300	11,315.00	229,694,500	
サンマルクホールディング ス	11,400	2,333.00	26,596,200	
トリドールホールディング ス	32,600	4,108.00	133,920,800	貸付株式数 13,000株 (400株)
帝人	105,300	1,114.50	117,356,850	
東レ	801,300	980.00	785,274,000	
クラレ	146,300	1,799.00	263,193,700	
旭化成	726,700	954.30	693,489,810	
TOKYO BASE	12,400	409.00	5,071,600	
稲葉製作所	6,300	1,741.00	10,968,300	貸付株式数 2,400株
宮地エンジニアリングG	13,600	1,863.00	25,336,800	貸付株式数 5,400株
トーカロ	32,600	1,843.00	60,081,800	
SUMCO	215,000	1,014.50	218,117,500	貸付株式数 85,800株
川田テクノロジーズ	7,200	3,685.00	26,532,000	
RS TECHNOLOGIES	8,700	2,920.00	25,404,000	
AND DOホールディングス	6,500	1,181.00	7,676,500	貸付株式数 2,500株
ケイアイスター不動産	5,800	4,755.00	27,579,000	貸付株式数 2,300株
ジェイ・エス・ビー	4,500	3,860.00	17,370,000	貸付株式数 1,800株
ロードスターキャピタル	6,100	2,720.00	16,592,000	
霞ヶ関キャピタル	4,400	14,020.00	61,688,000	貸付株式数 1,700株
JMホールディングス	8,300	2,629.00	21,820,700	貸付株式数 3,200株
コメダホールディングス	30,300	2,962.00	89,748,600	

アレンザホールディングス	8,700	1,014.00	8,821,800	貸付株式数 3,400株 (1,200株)
串カツ田中HLDGS	3,500	1,430.00	5,005,000	貸付株式数 900株
バロックジャパン	13,500	790.00	10,665,000	貸付株式数 5,300株
クスリのアオキHLDGS	30,100	3,532.00	106,313,200	貸付株式数 11,900株
力の源HD	8,700	1,357.00	11,805,900	貸付株式数 3,400株
FOOD&LIFE COMPAN	66,500	6,579.00	437,503,500	貸付株式数 23,800株
アセンテック	4,500	1,466.00	6,597,000	貸付株式数 1,800株
セーレン	21,200	2,337.00	49,544,400	
小松マテーレ	15,900	716.00	11,384,400	
ワコールホールディングス	22,700	4,683.00	106,304,100	
ホギメディカル	14,800	3,780.00	55,944,000	貸付株式数 5,800株
T S Iホールディングス	33,400	1,094.00	36,539,600	
ワールド	16,900	2,510.00	42,419,000	
T I S	116,000	4,793.00	555,988,000	
グリーホールディングス	36,800	505.00	18,584,000	
GMOペパボ	1,300	1,566.00	2,035,800	貸付株式数 500株
コーエーテクモHD	82,500	2,338.00	192,885,000	
三菱総合研究所	5,300	4,640.00	24,592,000	
ファインデックス	8,700	765.00	6,655,500	貸付株式数 400株
ブレインパッド	8,200	1,452.00	11,906,400	貸付株式数 3,400株
K L a b	31,200	116.00	3,619,200	貸付株式数 12,300株
ポールトゥウィンホール ディン	15,600	338.00	5,272,800	
ネクソン	235,800	2,722.50	641,965,500	
アイスタイル	33,600	534.00	17,942,400	貸付株式数 13,300株
エムアップホールディング ス	13,400	2,102.00	28,166,800	
エイチームホールディング ス	7,300	1,263.00	9,219,900	貸付株式数 2,800株
セルシス	20,800	1,528.00	31,782,400	貸付株式数 8,200株
エニグモ	12,100	281.00	3,400,100	貸付株式数 4,800株 (4,700株)
コロプラ	37,300	520.00	19,396,000	
ブロードリーフ	44,100	720.00	31,752,000	貸付株式数 4,400株
デジタルハーツHLDGS	7,800	914.00	7,129,200	
メディアドゥ	5,000	1,775.00	8,875,000	貸付株式数 1,900株
じげん	27,400	464.00	12,713,600	貸付株式数 10,900株
ブイキューブ	15,100	165.00	2,491,500	貸付株式数 5,100株
フィックスターズ	15,100	2,192.00	33,099,200	貸付株式数 6,000株

CARTA HOLDINGS	6,200	1,531.00	9,492,200	貸付株式数	2,400株
オブティム	11,300	567.00	6,407,100	貸付株式数	4,400株
セレス	4,900	2,365.00	11,588,500	貸付株式数	1,900株
S H I F T	98,500	1,761.00	173,458,500	貸付株式数	42,300株
特種東海製紙	5,300	3,660.00	19,398,000	貸付株式数	2,100株
セック	1,900	5,630.00	10,697,000		
テクマトリックス	23,700	2,293.00	54,344,100		
プロシップ	4,800	2,652.00	12,729,600	貸付株式数	1,900株
ガンホー・オンライン・エンター	22,600	2,711.00	61,268,600		
GMOペイメントゲートウェイ	21,900	8,886.00	194,603,400	貸付株式数	1,000株
システムリサーチ	7,500	1,884.00	14,130,000	貸付株式数	3,000株
インターネットイニシアティブ	60,000	2,825.00	169,500,000		
さくらインターネット	17,100	4,050.00	69,255,000	貸付株式数	6,700株
GMOグローバルサインHD	3,300	2,015.00	6,649,500	貸付株式数	1,300株
SRAホールディングス	6,200	4,490.00	27,838,000		
朝日ネット	11,800	675.00	7,965,000		
e B A S E	15,400	518.00	7,977,200		
アバントグループ	15,400	1,529.00	23,546,600	貸付株式数	1,000株
アドソル日進	8,800	1,088.00	9,574,400		
フリービット	5,700	1,411.00	8,042,700		
コムチュア	14,500	1,769.00	25,650,500		
アステリア	8,600	607.00	5,220,200	貸付株式数	3,400株
アイル	6,100	2,687.00	16,390,700	貸付株式数	2,400株
王子ホールディングス	415,200	688.00	285,657,600		
日本製紙	57,100	1,021.00	58,299,100		
北越コーポレーション	61,600	998.00	61,476,800	貸付株式数	24,500株
大王製紙	55,300	797.00	44,074,100		
マークライنز	6,500	1,900.00	12,350,000		
メディカル・データ・ビジ	13,100	399.00	5,226,900	貸付株式数	5,000株
g u m i	20,300	806.00	16,361,800	貸付株式数	8,000株
テラスカイ	4,200	3,010.00	12,642,000	貸付株式数	1,600株
デジタル・インフォメーション	6,300	2,454.00	15,460,200		
ネオジャパン	2,900	1,907.00	5,530,300		
P R T I M E S	2,200	2,250.00	4,950,000	貸付株式数	800株
ラクス	51,900	2,305.50	119,655,450		
ダブルスタンダード	3,900	1,641.00	6,399,900		
オープンドア	7,600	480.00	3,648,000	貸付株式数	3,000株

アカツキ	5,300	3,035.00	16,085,500	
UBICOMホールディングス	3,500	968.00	3,388,000	
カナミックネットワーク	13,800	412.00	5,685,600	
レンゴー	99,900	729.10	72,837,090	
トーモク	6,300	2,740.00	17,262,000	貸付株式数 2,500株
ザ・パック	8,100	3,200.00	25,920,000	貸付株式数 100株
チェンジホールディングス	27,200	1,180.00	32,096,000	
オークネット	10,100	1,588.00	16,038,800	
オロ	4,600	2,717.00	12,498,200	貸付株式数 1,600株
ユーザーローカル	5,300	1,873.00	9,926,900	貸付株式数 2,000株
PKSHA TECHNOLOGY	13,100	3,400.00	44,540,000	貸付株式数 5,200株
マネーフォワード	27,000	4,637.00	125,199,000	貸付株式数 10,400株
レゾナック・ホールディング グ	98,400	3,092.00	304,252,800	貸付株式数 1,000株
住友化学	881,700	339.10	298,984,470	
住友精化	5,200	4,350.00	22,620,000	貸付株式数 2,000株
日産化学	56,000	4,226.00	236,656,000	
ラサ工業	3,900	3,630.00	14,157,000	
クレハ	22,700	3,070.00	69,689,000	貸付株式数 3,200株
多木化学	4,300	2,873.00	12,353,900	貸付株式数 800株
テイカ	7,800	1,357.00	10,584,600	貸付株式数 3,100株
石原産業	18,200	1,847.00	33,615,400	
日本曹達	23,200	2,911.00	67,535,200	
東ソー	146,400	2,064.00	302,169,600	
トクヤマ	35,400	2,893.50	102,429,900	
セントラル硝子	13,800	2,907.00	40,116,600	
東亜合成	50,900	1,412.00	71,870,800	貸付株式数 20,200株
大阪ソーダ	38,300	1,715.00	65,684,500	貸付株式数 14,000株
関東電化	23,500	832.00	19,552,000	
SUN ASTERISK	7,800	511.00	3,985,800	貸付株式数 3,100株
デンカ	39,900	1,902.50	75,909,750	
イビデン	63,400	5,962.00	377,990,800	
信越化学	974,900	4,434.00	4,322,706,600	
日本カ・バイド	5,800	1,695.00	9,831,000	
プラスアルファ・コンサル ティン	13,900	2,146.00	29,829,400	貸付株式数 4,900株
電算システムHD	4,900	2,673.00	13,097,700	
堺化学	7,700	2,575.00	19,827,500	
第一稀元素化学工	12,000	634.00	7,608,000	貸付株式数 4,700株
エア・ウォーター	103,400	2,091.00	216,209,400	

日本酸素HLDGS	106,400	5,250.00	558,600,000	
日本化学工業	4,000	1,993.00	7,972,000	貸付株式数 900株
日本パ - カライジング	48,800	1,241.00	60,560,800	
高圧ガス	15,900	1,052.00	16,726,800	貸付株式数 5,900株
四国化成ホールディング	12,400	1,911.00	23,696,400	
戸田工業	2,500	967.00	2,417,500	貸付株式数 600株
ステラ ケミファ	5,800	3,720.00	21,576,000	
保土谷化学	6,900	1,445.00	9,970,500	
日本触媒	70,200	1,627.00	114,215,400	
大日精化	7,400	3,065.00	22,681,000	
カネカ	27,000	3,856.00	104,112,000	
協和キリン	129,100	2,496.00	322,233,600	
APPIER GROUP	33,500	1,498.00	50,183,000	貸付株式数 1,600株
三菱瓦斯化学	86,600	2,218.50	192,122,100	
三井化学	98,600	3,201.00	315,618,600	
東京応化工業	52,300	3,809.00	199,210,700	
大阪有機化学	9,200	2,473.00	22,751,600	
三菱ケミカルグループ	801,400	747.10	598,725,940	
K H ネオケム	19,800	2,486.00	49,222,800	貸付株式数 7,800株
ビジョナル	13,000	10,580.00	137,540,000	貸付株式数 4,600株
ダイセル	124,700	1,192.50	148,704,750	
住友ベ - クライト	34,500	3,905.00	134,722,500	
積水化学	218,300	2,457.50	536,472,250	
日本ゼオン	79,300	1,417.00	112,368,100	
アイカ工業	27,700	3,638.00	100,772,600	
U B E	56,500	2,231.50	126,079,750	
積水樹脂	14,300	1,907.00	27,270,100	
旭有機材	7,300	3,915.00	28,579,500	貸付株式数 2,900株
ニチバン	6,800	1,963.00	13,348,400	貸付株式数 2,600株
リケンテクノス	19,600	1,103.00	21,618,800	
大倉工業	5,100	4,310.00	21,981,000	貸付株式数 2,000株
積水化成品	15,400	328.00	5,051,200	
群栄化学	2,600	2,839.00	7,381,400	
ダイキョーニシカワ	24,200	646.00	15,633,200	
森六	6,100	2,381.00	14,524,100	貸付株式数 2,400株
恵和	7,100	1,046.00	7,426,600	貸付株式数 2,800株
日本化薬	74,300	1,289.50	95,809,850	
カーリット	10,800	1,271.00	13,726,800	貸付株式数 4,200株
CLホールディングス	2,700	848.00	2,289,600	貸付株式数 900株
プレステージ・インター	52,700	606.00	31,936,200	

ハイマックス	3,400	1,202.00	4,086,800	
アミューズ	6,900	1,622.00	11,191,800	貸付株式数 1,400株
野村総合研究所	237,900	5,883.00	1,399,565,700	
ドリームインキュベータ	2,700	2,364.00	6,382,800	貸付株式数 1,000株
クイック	7,700	2,208.00	17,001,600	
日本システム技術	10,200	1,989.00	20,287,800	貸付株式数 4,000株
電通グループ	119,700	3,071.00	367,598,700	
インテージホールディングス	8,300	1,741.00	14,450,300	
テイクアンドギヴニーズ	5,400	839.00	4,530,600	貸付株式数 800株
東邦システムサイエンス	5,100	1,220.00	6,222,000	
ぴあ	3,800	2,904.00	11,035,200	貸付株式数 1,500株
イオンファンタジー	4,900	2,601.00	12,744,900	貸付株式数 1,900株
ソースネクスト	56,900	161.00	9,160,900	貸付株式数 22,500株
シーティーエス	15,500	832.00	12,896,000	
メディカルシステムネットワーク	11,200	457.00	5,118,400	
日本精化	7,300	2,334.00	17,038,200	
扶桑化学工業	10,200	3,795.00	38,709,000	
トリケミカル	12,000	2,962.00	35,544,000	貸付株式数 1,900株
シンプレクスHD	21,600	3,785.00	81,756,000	貸付株式数 7,100株
HEROZ	4,300	1,272.00	5,469,600	貸付株式数 1,700株 (100株)
ラクスル	21,800	1,134.00	24,721,200	
メルカリ	60,500	2,680.50	162,170,250	貸付株式数 23,300株
I P S	3,200	2,360.00	7,552,000	貸付株式数 1,200株
システムサポートホールディング	3,800	2,551.00	9,693,800	
A D E K A	38,200	2,662.50	101,707,500	
日油	125,800	2,702.00	339,911,600	
ハリマ化成グループ	8,500	790.00	6,715,000	貸付株式数 3,300株
ボードルア	3,000	3,335.00	10,005,000	
イーソル	7,300	507.00	3,701,100	貸付株式数 600株
ウイングアーク1ST	11,400	4,005.00	45,657,000	貸付株式数 4,400株
ヒト・コミュニケーションズHD	4,400	942.00	4,144,800	貸付株式数 1,700株
サーバーワークス	1,900	2,384.00	4,529,600	貸付株式数 700株
S a n s a n	31,000	2,034.00	63,054,000	
ギフトィ	9,700	1,838.00	17,828,600	貸付株式数 3,800株
花王	267,000	6,686.00	1,785,162,000	

第一工業製薬	3,900	3,640.00	14,196,000	
石原ケミカル	4,700	1,865.00	8,765,500	
三洋化成	6,700	3,665.00	24,555,500	
メドレー	12,100	3,070.00	37,147,000	貸付株式数 4,800株
ベース	5,400	3,435.00	18,549,000	貸付株式数 2,100株
J M D C	13,400	3,830.00	51,322,000	
武田薬品	976,700	4,336.00	4,234,971,200	
アステラス製薬	962,900	1,385.50	1,334,097,950	
住友ファーマ	97,700	1,047.00	102,291,900	
塩野義製薬	364,100	2,508.50	913,344,850	
日本新薬	28,800	3,567.00	102,729,600	
中外製薬	343,600	7,462.00	2,563,943,200	
科研製薬	18,800	3,867.00	72,699,600	
エーザイ	143,200	4,030.00	577,096,000	
理研ビタミン	8,500	2,643.00	22,465,500	
ロート製薬	116,000	2,070.00	240,120,000	
小野薬品	224,500	1,561.50	350,556,750	
久光製薬	24,400	4,298.00	104,871,200	
持田製薬	13,400	2,957.00	39,623,800	貸付株式数 4,800株
参天製薬	196,000	1,672.50	327,810,000	
扶桑薬品	4,300	2,135.00	9,180,500	
ツムラ	37,700	3,376.00	127,275,200	
テルモ	727,200	2,596.50	1,888,174,800	
HUグループHD	32,900	3,130.00	102,977,000	
キッセイ薬品工業	17,600	4,200.00	73,920,000	
生化学工業	20,900	628.00	13,125,200	貸付株式数 8,200株
栄研化学	17,400	2,200.00	38,280,000	貸付株式数 4,500株
鳥居薬品	5,800	6,340.00	36,772,000	
J C R ファーマ	37,200	554.00	20,608,800	
東和薬品	14,800	2,992.00	44,281,600	
富士製薬工業	8,100	1,319.00	10,683,900	貸付株式数 3,200株
ゼリア新薬工業	17,400	2,021.00	35,165,400	貸付株式数 6,900株
ネクセラファーマ	51,500	920.00	47,380,000	貸付株式数 20,500株
第一三共	1,015,400	3,495.00	3,548,823,000	
杏林製薬	23,800	1,484.00	35,319,200	貸付株式数 9,400株
大幸薬品	24,900	248.00	6,175,200	貸付株式数 9,800株
ダイト	15,100	1,047.00	15,809,700	
大塚ホールディングス	271,100	7,213.00	1,955,444,300	
ペプチドリーム	53,200	1,660.50	88,338,600	
大日本塗料	12,200	1,149.00	14,017,800	

日本ペイントHOLD	485,100	1,109.50	538,218,450	
関西ペイント	87,400	1,951.50	170,561,100	貸付株式数 33,800株
中国塗料	24,800	2,252.00	55,849,600	
藤倉化成	13,900	491.00	6,824,900	
太陽ホールディングス	19,100	6,130.00	117,083,000	貸付株式数 7,000株
D I C	38,900	2,851.50	110,923,350	
サカタインクス	24,400	1,920.00	46,848,000	
ARTIENCE	19,600	3,005.00	58,898,000	
アルプス技研	9,300	2,692.00	25,035,600	
サニックスホールディングス	16,000	245.00	3,920,000	貸付株式数 500株
日本空調サービス	12,100	1,085.00	13,128,500	
オリエンタルランド	663,200	3,184.00	2,111,628,800	
フォーカスシステムズ	7,300	1,450.00	10,585,000	貸付株式数 2,700株
ダスキン	23,600	3,943.00	93,054,800	
パーク24	84,000	1,812.00	152,208,000	
明光ネットワークジャパン	14,800	727.00	10,759,600	貸付株式数 5,800株
ファルコホールディングス	4,500	2,296.00	10,332,000	
クレスコ	17,200	1,719.00	29,566,800	
フジ・メディア・HD	105,400	3,021.00	318,413,400	貸付株式数 39,000株
ラウンドワン	106,300	1,247.00	132,556,100	
リゾートトラスト	88,800	1,624.50	144,255,600	
オービック	203,800	5,464.00	1,113,563,200	
ジャストシステム	15,800	3,515.00	55,537,000	
T D Cソフト	18,500	1,378.00	25,493,000	貸付株式数 7,300株
L I N Eヤフー	1,757,000	521.40	916,099,800	
ビー・エム・エル	13,800	3,190.00	44,022,000	
トレンドマイクロ	57,700	10,755.00	620,563,500	
IDホールディングス	7,000	2,241.00	15,687,000	
リソー教育	70,300	224.00	15,747,200	
日本オラクル	21,000	17,230.00	361,830,000	
早稲田アカデミー	6,200	2,329.00	14,439,800	貸付株式数 2,400株 (900株)
アルファシステムズ	3,500	3,520.00	12,320,000	
フューチャー	27,300	2,288.00	62,462,400	貸付株式数 1,600株
CAC HOLDINGS	6,700	2,043.00	13,688,100	
ユー・エス・エス	231,400	1,557.00	360,289,800	
オービックビジネスC	18,500	8,432.00	155,992,000	
アイティフォー	12,600	1,524.00	19,202,400	
東京個別指導学院	13,200	311.00	4,105,200	貸付株式数 400株

東計電算	3,100	4,000.00	12,400,000	貸付株式数	1,200株
サイバーエージェント	228,000	1,508.00	343,824,000		
楽天グループ	795,100	808.40	642,758,840	貸付株式数	297,500株
クリーク・アンド・リバー社	5,700	1,463.00	8,339,100	貸付株式数	2,200株
SBIグローバルアセット	22,000	637.00	14,014,000		
テー・オー・ダブリュー	20,000	318.00	6,360,000	貸付株式数	8,000株
大塚商会	124,400	2,972.00	369,716,800		
サイボウズ	15,100	3,535.00	53,378,500		
GMOインターネット	2,700	2,542.00	6,863,400	貸付株式数	1,000株
山田コンサルティングGP	5,700	1,593.00	9,080,100	貸付株式数	2,200株
セントラルスポーツ	4,200	2,393.00	10,050,600	貸付株式数	1,600株
パラカ	3,000	1,818.00	5,454,000		
電通総研	10,700	6,690.00	71,583,000		
A C C E S S	11,400	833.00	9,496,200	貸付株式数	4,500株
デジタルガレージ	17,600	4,830.00	85,008,000		
イーエムシステムズ	17,300	745.00	12,888,500	貸付株式数	6,800株
ウェザーニューズ	8,700	3,850.00	33,495,000		
C I J	30,100	503.00	15,140,300	貸付株式数	10,600株
ビジネスエンジニアリング	2,600	4,585.00	11,921,000	貸付株式数	1,000株
WOWOW	8,300	1,003.00	8,324,900	貸付株式数	2,300株
スカラ	10,100	405.00	4,090,500	貸付株式数	3,400株
フルキャストホールディングス	8,600	1,703.00	14,645,800	貸付株式数	3,400株
エン・ジャパン	18,300	1,612.00	29,499,600	貸付株式数	7,300株
セルソース	7,300	716.00	5,226,800		
あすか製薬HD	9,400	2,330.00	21,902,000	貸付株式数	1,700株
サワイグループHD	56,700	1,816.00	102,967,200		
富士フイルムHLDGS	661,800	3,106.00	2,055,550,800		
コニカミノルタ	246,900	446.30	110,191,470		
資生堂	229,200	2,420.00	554,664,000		
ライオン	139,700	1,531.00	213,880,700		
高砂香料	7,400	7,180.00	53,132,000		
マンダム	21,700	1,349.00	29,273,300		
ミルボン	17,600	2,469.00	43,454,400		
コーセー	22,300	5,731.00	127,801,300	貸付株式数	8,900株
コタ	11,100	1,476.00	16,383,600	貸付株式数	4,400株
ポーラ・オルビスHD	56,300	1,331.50	74,963,450	貸付株式数	18,200株
ノエビアホールディングス	9,800	4,260.00	41,748,000		
新日本製薬	6,300	2,254.00	14,200,200	貸付株式数	2,500株

I - n e	3,600	1,650.00	5,940,000	貸付株式数	1,400株
アクシージア	6,900	490.00	3,381,000	貸付株式数	2,700株
エステー	7,500	1,500.00	11,250,000		
コニシ	34,600	1,126.00	38,959,600	貸付株式数	13,300株
長谷川香料	21,000	2,962.00	62,202,000	貸付株式数	6,700株
小林製薬	28,800	5,504.00	158,515,200	貸付株式数	11,300株
荒川化学工業	10,100	1,036.00	10,463,600		
メック	9,000	2,580.00	23,220,000		
日本高純度化学	2,700	3,230.00	8,721,000		
タカラバイオ	34,500	786.00	27,117,000		
J C U	11,900	3,115.00	37,068,500		
O A T アグリオ	4,500	2,027.00	9,121,500		
デクセリアルズ	93,900	2,111.00	198,222,900		
アース製薬	10,000	4,880.00	48,800,000	貸付株式数	4,000株
北興化学	9,300	1,339.00	12,452,700		
大成ラミックグループ	3,200	2,459.00	7,868,800		
クミアイ化学	43,600	778.00	33,920,800		
日本農薬	16,800	875.00	14,700,000		
ニチレキグループ	11,700	2,432.00	28,454,400	貸付株式数	4,600株
ユシロ	5,700	2,002.00	11,411,400		
J X 金属	285,000	766.30	218,395,500		
富士石油	28,800	303.00	8,726,400	貸付株式数	11,100株
出光興産	474,700	883.00	419,160,100		
ENEOSホールディングス	1,661,700	726.30	1,206,892,710		
コスモエネルギーHLDGS	36,200	6,507.00	235,553,400		
A N Y C O L O R	15,000	5,080.00	76,200,000		
テスホールディングス	26,000	326.00	8,476,000	貸付株式数	10,300株
インフロニアHD	112,500	1,194.50	134,381,250		
横浜ゴム	55,500	3,420.00	189,810,000		
TOYO TIRE	63,100	2,950.50	186,176,550		
ブリヂストン	321,300	5,959.00	1,914,626,700		
住友ゴム	107,700	1,611.00	173,504,700		
藤倉コンポジット	10,600	1,434.00	15,200,400	貸付株式数	4,200株
オカモト	5,900	4,930.00	29,087,000		
アキレス	6,000	1,130.00	6,780,000	貸付株式数	2,100株
フコク	6,500	1,615.00	10,497,500	貸付株式数	2,200株
ニッタ	10,800	3,715.00	40,122,000		
住友理工	21,300	1,624.00	34,591,200		
三ツ星ベルト	15,300	3,420.00	52,326,000	貸付株式数	6,100株

バンドー化学	16,300	1,642.00	26,764,600	貸付株式数	6,200株
A G C	106,800	4,222.00	450,909,600		
日本板硝子	56,200	400.00	22,480,000	貸付株式数	22,200株
有沢製作所	16,500	1,409.00	23,248,500		
日本電気硝子	36,600	3,414.00	124,952,400		
オハラ	5,200	1,010.00	5,252,000	貸付株式数	2,000株
住友大阪セメント	19,000	3,816.00	72,504,000		
太平洋セメント	67,700	3,665.00	248,120,500		
日本ヒユ - ム	9,600	2,164.00	20,774,400	貸付株式数	3,800株
日本コンクリ - ト	21,300	291.00	6,198,300	貸付株式数	8,400株
三谷セキサン	3,900	7,640.00	29,796,000	貸付株式数	1,500株
アジアパイルHD	15,600	924.00	14,414,400		
東海カーボン	101,300	1,000.50	101,350,650		
日本カーボン	6,300	4,200.00	26,460,000	貸付株式数	2,500株
東洋炭素	7,700	4,320.00	33,264,000	貸付株式数	3,000株
ノリタケ	11,900	3,635.00	43,256,500	貸付株式数	2,500株
T O T O	79,700	3,628.00	289,151,600		
日本碍子	121,900	1,759.50	214,483,050		
日本特殊陶業	89,700	4,608.00	413,337,600		
M A R U W A	4,600	37,590.00	172,914,000		
品川リフラクトリーズ	13,500	1,644.00	22,194,000	貸付株式数	5,300株
黒崎播磨	7,500	3,175.00	23,812,500	貸付株式数	2,900株
ヨータイ	5,600	1,753.00	9,816,800		
フジインコーポレーテッド	29,500	1,846.00	54,457,000		
ニチアス	27,800	5,080.00	141,224,000		
日本製鉄	571,800	2,872.50	1,642,495,500		
神戸製鋼所	227,100	1,601.00	363,587,100		
中山製鋼所	23,200	625.00	14,500,000	貸付株式数	9,200株
合同製鐵	6,300	3,760.00	23,688,000	貸付株式数	2,300株
J F E ホールディングス	340,200	1,692.00	575,618,400		
東京製鐵	31,500	1,495.00	47,092,500	貸付株式数	12,200株
共英製鋼	11,000	1,950.00	21,450,000		
大和工業	21,300	8,775.00	186,907,500	貸付株式数	6,300株
東京鐵鋼	5,000	5,440.00	27,200,000	貸付株式数	1,900株
大阪製鐵	5,200	2,908.00	15,121,600	貸付株式数	2,000株
淀川製鋼所	10,400	5,570.00	57,928,000		
中部鋼鈹	9,200	2,042.00	18,786,400		
丸一鋼管	34,400	3,427.00	117,888,800		
モリ工業	14,300	859.00	12,283,700		

大同特殊鋼	71,100	1,001.50	71,206,650	
日本冶金工	7,600	3,825.00	29,070,000	
愛知製鋼	6,300	8,210.00	51,723,000	
大平洋金属	10,400	1,742.00	18,116,800	貸付株式数 4,000株
新日本電工	67,400	254.00	17,119,600	
栗本鉄工所	5,200	5,700.00	29,640,000	
日本製鋼所	33,500	7,870.00	263,645,000	
三菱製鋼	8,400	1,573.00	13,213,200	
日本精線	9,000	1,112.00	10,008,000	貸付株式数 1,800株
エンビプロHD	11,200	496.00	5,555,200	貸付株式数 4,400株
大紀アルミニウム	16,100	960.00	15,456,000	
日本軽金属HD	33,000	1,583.00	52,239,000	
三井金属	28,200	4,751.00	133,978,200	
東邦亜鉛	8,900	727.00	6,470,300	貸付株式数 3,100株
三菱マテリアル	80,700	2,231.00	180,041,700	
住友鉱山	142,800	3,380.00	482,664,000	
DOWAホールディングス	30,400	4,607.00	140,052,800	
古河機金	13,400	2,223.00	29,788,200	貸付株式数 5,300株
大阪チタニウム	19,600	1,495.00	29,302,000	貸付株式数 7,500株
東邦チタニウム	23,300	1,287.00	29,987,100	貸付株式数 9,300株
UACJ	15,200	4,850.00	73,720,000	
CKサンエツ	2,700	3,580.00	9,666,000	貸付株式数 900株
古河電工	37,600	6,927.00	260,455,200	
住友電工	389,900	2,866.00	1,117,453,400	
フジクラ	121,100	6,855.00	830,140,500	
SWCC	15,100	6,780.00	102,378,000	
平河ヒューテック	7,600	1,506.00	11,445,600	
いよぎんホールディング	141,100	1,538.00	217,011,800	
しずおかフィナンシャル	237,400	1,706.00	405,004,400	
ちゅうぎんフィナンシャ	90,700	1,747.50	158,498,250	
楽天銀行	50,000	7,400.00	370,000,000	貸付株式数 10,000株
京都フィナンシャルG	135,700	2,453.00	332,872,100	
リョービ	12,000	2,080.00	24,960,000	
AREホールディングス	45,700	1,848.00	84,453,600	
東洋製罐グループHD	66,800	2,855.50	190,747,400	
ホッカンホールディングス	6,100	1,902.00	11,602,200	
コロナ	6,300	893.00	5,625,900	
横河ブリッジHLDGS	19,400	2,560.00	49,664,000	
三和ホールディングス	111,500	5,035.00	561,402,500	
文化シャツタ -	29,500	2,278.00	67,201,000	

三協立山	14,200	615.00	8,733,000	
アルインコ	8,600	1,015.00	8,729,000	貸付株式数 1,100株
L I X I L	164,600	1,609.00	264,841,400	
ノーリツ	15,900	1,875.00	29,812,500	
長府製作所	12,600	1,796.00	22,629,600	
リンナイ	58,900	3,639.00	214,337,100	
ユニプレス	18,400	948.00	17,443,200	
日東精工	16,400	570.00	9,348,000	
岡 部	20,200	838.00	16,927,600	貸付株式数 8,000株
ジーテクト	12,600	1,694.00	21,344,400	
東 プ レ	19,900	1,823.00	36,277,700	貸付株式数 5,400株
高周波熱錬	15,500	1,097.00	17,003,500	貸付株式数 2,600株
東京製綱	6,700	1,233.00	8,261,100	貸付株式数 2,600株
サンコール	12,400	292.00	3,620,800	
パイオラックス	15,200	1,801.00	27,375,200	貸付株式数 5,700株
エイチワン	11,600	1,237.00	14,349,200	貸付株式数 4,600株
日本発条	94,600	1,600.00	151,360,000	
中央発條	7,300	1,866.00	13,621,800	貸付株式数 2,900株
三浦工業	51,300	2,846.50	146,025,450	
タ ク マ	36,300	1,996.00	72,454,800	
テクノプロ・ホールディング グ	68,400	4,141.00	283,244,400	
アイ・アールジャパンHD	5,800	628.00	3,642,400	貸付株式数 500株
K e e P e r 技研	6,900	3,780.00	26,082,000	貸付株式数 2,700株
G u n o s y	8,900	624.00	5,553,600	
イー・ガーディアン	3,400	2,014.00	6,847,600	
ジャパンマテリアル	34,400	1,452.00	49,948,800	
ベクトル	15,400	942.00	14,506,800	
チャームケアコーポレー ション	9,400	1,247.00	11,721,800	
キャリアリンク	4,100	2,140.00	8,774,000	貸付株式数 1,500株
I B J	8,600	835.00	7,181,000	貸付株式数 3,400株
アサンテ	5,600	1,631.00	9,133,600	貸付株式数 2,200株
バリューHR	10,100	1,590.00	16,059,000	貸付株式数 4,000株 (700株)
M&Aキャピタルパートナー	9,100	3,010.00	27,391,000	
ライドオンエクスプレスHD	4,500	1,004.00	4,518,000	
シグマクシス・ホールディ ンク	32,800	1,282.00	42,049,600	
ウィルグループ	9,500	919.00	8,730,500	貸付株式数 3,700株

メドピア	8,900	733.00	6,523,700	
リクルートホールディングス	832,100	7,939.00	6,606,041,900	
エラン	14,900	822.00	12,247,800	貸付株式数 5,900株
ツガミ	23,600	1,841.00	43,447,600	
オークマ	19,300	3,765.00	72,664,500	
芝浦機械	14,200	3,150.00	44,730,000	貸付株式数 5,600株
アマダ	147,700	1,537.00	227,014,900	
アイダエンジニア	24,800	919.00	22,791,200	
F U J I	48,000	2,476.50	118,872,000	
牧野フライス	12,200	11,660.00	142,252,000	
オーエスジー	48,700	1,670.00	81,329,000	貸付株式数 19,400株
旭ダイヤモンド	27,600	703.00	19,402,800	
DMG森精機	69,700	3,110.00	216,767,000	
ソデイツク	29,200	890.00	25,988,000	
ディスコ	53,300	34,550.00	1,841,515,000	
日東工器	3,900	1,777.00	6,930,300	
日進工具	9,200	684.00	6,292,800	
富士ダイス	8,200	703.00	5,764,600	貸付株式数 3,100株
日本郵政	1,116,900	1,337.00	1,493,295,300	
ベルシステム24HLDGS	12,200	1,283.00	15,652,600	
鎌倉新書	9,600	538.00	5,164,800	貸付株式数 3,800株
エアトリ	9,200	881.00	8,105,200	貸付株式数 3,500株
アトラエ	8,700	651.00	5,663,700	
ストライク	5,500	3,510.00	19,305,000	貸付株式数 2,200株
ソラスト	31,000	425.00	13,175,000	
セラク	3,400	1,556.00	5,290,400	貸付株式数 200株
インソース	24,400	1,020.00	24,888,000	
豊田自動織機	93,400	16,400.00	1,531,760,000	
リケンN P R	13,900	2,370.00	32,943,000	
島精機製作所	17,600	786.00	13,833,600	貸付株式数 7,000株
オプトラン	18,200	1,548.00	28,173,600	貸付株式数 6,700株
イワキポンプ	7,400	2,431.00	17,989,400	貸付株式数 2,900株
フリーー	10,400	955.00	9,932,000	
ヤマシンフィルタ	23,400	557.00	13,033,800	貸付株式数 9,100株
日阪製作所	11,800	1,400.00	16,520,000	貸付株式数 3,900株
やまびこ	18,100	2,050.00	37,105,000	貸付株式数 7,200株
野村マイクロ・サイエンス	18,300	2,329.00	42,620,700	貸付株式数 5,400株 (100株)

平田機工	15,800	1,841.00	29,087,800	貸付株式数	6,100株
PEGASUS	12,200	510.00	6,222,000		
マルマエ	4,300	1,328.00	5,710,400	貸付株式数	1,800株
タツモ	7,900	1,952.00	15,420,800	貸付株式数	3,000株
ナプテスコ	69,400	2,333.50	161,944,900		
三井海洋開発	14,000	5,830.00	81,620,000	貸付株式数	5,500株
レオン自動機	11,600	1,210.00	14,036,000		
SMC	33,100	52,070.00	1,723,517,000		
ホソカワミクロン	8,400	4,245.00	35,658,000		
ユニオンツール	4,900	4,720.00	23,128,000	貸付株式数	1,900株
瑞光	9,400	1,024.00	9,625,600	貸付株式数	3,700株
オイレス工業	15,000	2,037.00	30,555,000		
日精エーエスビー	4,400	5,970.00	26,268,000		
サトー	13,800	2,018.00	27,848,400		
技研製作所	10,400	1,467.00	15,256,800	貸付株式数	4,100株
日本エアテック	5,200	1,040.00	5,408,000	貸付株式数	1,800株
日精樹脂工業	7,300	837.00	6,110,100	貸付株式数	2,800株
ワイエイシーホールディングス	11,200	804.00	9,004,800	貸付株式数	4,300株
小松製作所	544,900	4,468.00	2,434,613,200		
住友重機械	65,400	2,891.50	189,104,100		
日立建機	44,000	4,358.00	191,752,000		
日工	16,400	697.00	11,430,800		
巴工業	12,900	1,392.00	17,956,800	貸付株式数	5,100株
井関農機	10,300	1,262.00	12,998,600	貸付株式数	4,100株
TOWA	33,800	1,610.00	54,418,000	貸付株式数	12,600株
北川鉄工所	4,300	1,438.00	6,183,400		
ローツェ	57,800	1,782.00	102,999,600	貸付株式数	14,500株
クボタ	565,300	1,574.50	890,064,850		
荏原実業	5,300	3,525.00	18,682,500		
東洋エンジニア	15,800	682.00	10,775,600		
三菱化工機	11,700	1,883.00	22,031,100		
月島ホールディングス	14,400	2,119.00	30,513,600		
帝国電機製作所	6,900	3,210.00	22,149,000	貸付株式数	2,700株
新東工業	24,600	836.00	20,565,600		
渋谷工業	10,400	3,255.00	33,852,000		
アイチコーポレーション	18,300	1,371.00	25,089,300		
小森コーポレーション	26,300	1,466.00	38,555,800		
鶴見製作所	8,400	3,625.00	30,450,000	貸付株式数	3,300株
酒井重工業	4,300	1,968.00	8,462,400		

荏原製作所	226,900	2,229.00	505,760,100		
西島製作所	9,500	1,824.00	17,328,000	貸付株式数	3,800株
A I R M A N	11,100	1,833.00	20,346,300	貸付株式数	4,400株
ダイキン工業	144,000	16,275.00	2,343,600,000		
オルガノ	17,100	7,980.00	136,458,000	貸付株式数	600株
ト - ヨ - カネツ	3,900	3,870.00	15,093,000		
栗田工業	61,800	5,323.00	328,961,400		
椿本チエイン	47,800	1,796.00	85,848,800		
日 機 装	28,300	1,158.00	32,771,400		
木村化工機	8,400	882.00	7,408,800		
レイズネクスト	15,500	1,734.00	26,877,000		
アネスト岩田	18,800	1,371.00	25,774,800		
ダイフク	186,600	3,657.00	682,396,200	貸付株式数	7,100株
サムコ	3,000	2,647.00	7,941,000	貸付株式数	1,200株
タダノ	63,600	972.50	61,851,000		
フジテック	35,500	5,838.00	207,249,000		
C K D	30,600	2,347.00	71,818,200		
平和	36,800	2,045.00	75,256,000		
理想科学工業	17,700	1,065.00	18,850,500	貸付株式数	7,000株
S A N K Y O	127,700	2,543.50	324,804,950		
日本金銭機械	13,400	941.00	12,609,400	貸付株式数	5,200株
マースグループHLDGS	7,400	2,814.00	20,823,600	貸付株式数	2,900株
ガリレイ	16,300	3,005.00	48,981,500		
ダイコク電機	4,800	2,121.00	10,180,800	貸付株式数	600株
竹内製作所	20,100	4,510.00	90,651,000	貸付株式数	300株
ア マ ノ	31,400	4,347.00	136,495,800		
J U K I	17,000	368.00	6,256,000		
ジャノメ	8,900	1,133.00	10,083,700		
ブラザー工業	147,700	2,405.50	355,292,350		
マックス	13,300	4,695.00	62,443,500	貸付株式数	5,200株
モリタホールディングス	17,300	2,077.00	35,932,100		
グローリー	28,900	3,274.00	94,618,600		
新晃工業	31,700	1,229.00	38,959,300	貸付株式数	3,100株
大和冷機工業	16,900	1,566.00	26,465,400	貸付株式数	6,200株
セガサミーホールディングス	98,700	3,110.00	306,957,000		
T P R	14,000	1,885.00	26,390,000	貸付株式数	1,000株
ツバキ・ナカシマ	27,200	344.00	9,356,800	貸付株式数	10,800株
ホシザキ	71,200	5,170.00	368,104,000		
大豊工業	9,500	582.00	5,529,000	貸付株式数	2,400株

日本精工	204,600	640.60	131,066,760	
N T N	261,500	214.00	55,961,000	
ジェイテクト	91,300	1,083.00	98,877,900	
不二越	8,200	3,005.00	24,641,000	貸付株式数 3,100株
ミネベアミツミ	192,300	2,010.00	386,523,000	
日本トムソン	30,100	528.00	15,892,800	
T H K	63,800	3,864.00	246,523,200	貸付株式数 25,200株
Y U S H I N	10,200	598.00	6,099,600	
前澤給装工業	7,900	1,257.00	9,930,300	
イーグル工業	12,200	1,880.00	22,936,000	
P I L L A R	10,300	3,655.00	37,646,500	貸付株式数 4,000株
キッツ	35,800	1,168.00	41,814,400	
日立	2,812,000	4,014.00	11,287,368,000	
三菱電機	1,124,400	2,955.50	3,323,164,200	
富士電機	67,200	6,461.00	434,179,200	
安川電機	120,100	3,236.00	388,643,600	
シンフォニアテクノロジー	11,000	8,790.00	96,690,000	貸付株式数 3,100株
明電舎	18,600	4,870.00	90,582,000	
山洋電気	4,800	10,140.00	48,672,000	
デンヨー	8,400	2,736.00	22,982,400	貸付株式数 3,300株
PHCホールディングス	20,700	904.00	18,712,800	貸付株式数 8,200株
KOKUSAI ELECTRIC	78,000	3,155.00	246,090,000	貸付株式数 24,200株
ソシオネクスト	110,400	2,492.50	275,172,000	
ベイカレント	82,700	7,545.00	623,971,500	
ORCHESTRA HLDGS	2,500	775.00	1,937,500	
アイモバイル	16,700	625.00	10,437,500	
M S - J a p a n	6,100	928.00	5,660,800	
ジャパンエレベーターSHD	43,700	4,015.00	175,455,500	
エル・ティー・エス	1,500	2,135.00	3,202,500	貸付株式数 500株
ミダックホールディングス	6,800	1,975.00	13,430,000	貸付株式数 2,600株
キュービーネットHLDGS	6,500	1,150.00	7,475,000	貸付株式数 2,500株
オープングループ	17,900	334.00	5,978,600	貸付株式数 7,000株
三桜工業	15,200	600.00	9,120,000	貸付株式数 5,800株
マキタ	137,500	4,295.00	590,562,500	
東芝テック	16,500	2,756.00	45,474,000	
芝浦メカトロニクス	8,000	9,120.00	72,960,000	
マブチモーター	48,000	2,115.00	101,520,000	
ニデック	488,100	2,887.50	1,409,388,750	
ユーエムシーエレクトロニクス	6,900	315.00	2,173,500	貸付株式数 2,200株

トレックス・セミコンダクター	5,200	1,200.00	6,240,000	
東光高岳	6,000	2,173.00	13,038,000	
ダブル・スコープ	33,900	248.00	8,407,200	貸付株式数 12,200株
宮越ホールディングス	4,900	1,144.00	5,605,600	貸付株式数 1,800株
ダイヘン	10,300	6,190.00	63,757,000	
ヤーマン	21,500	829.00	17,823,500	貸付株式数 8,200株 (200株)
JVCケンウッド	87,300	1,090.00	95,157,000	
ミマキエンジニアリング	9,200	1,774.00	16,320,800	
大崎電気	23,700	953.00	22,586,100	
オムロン	101,300	3,818.00	386,763,400	
日東工業	14,900	2,949.00	43,940,100	貸付株式数 3,000株
I D E C	16,300	2,247.00	36,626,100	
ジーエス・ユアサ コーポ	49,300	2,491.50	122,830,950	
B U F F A L O	2,500	2,274.00	5,685,000	
テクノメディカ	2,200	1,859.00	4,089,800	貸付株式数 800株
ダイヤモンドエレクトリク HD	4,500	584.00	2,628,000	貸付株式数 1,100株
日本電気	781,700	4,036.00	3,154,941,200	
富士通	1,017,200	3,464.00	3,523,580,800	
沖電気	53,500	1,580.00	84,530,000	
電気興業	4,500	2,026.00	9,117,000	
サンケン電気	11,300	7,704.00	87,055,200	貸付株式数 4,500株
アイホン	6,700	2,673.00	17,909,100	
ルネサスエレクトロニクス	842,200	1,865.50	1,571,124,100	
セイコーエプソン	137,600	1,836.00	252,633,600	
ワコム	77,700	619.00	48,096,300	
アルバック	24,200	4,995.00	120,879,000	
アクセル	5,500	922.00	5,071,000	
E I Z O	14,400	2,073.00	29,851,200	
ジャパンディスプレイ	61,700	16.00	987,200	
日本信号	25,200	1,076.00	27,115,200	
京三製作所	25,700	482.00	12,387,400	貸付株式数 10,200株
能美防災	14,900	3,785.00	56,396,500	
ホーチキ	6,500	2,995.00	19,467,500	
エレコム	26,400	1,813.00	47,863,200	
パナソニック ホールディン ク	1,305,900	1,503.50	1,963,420,650	
シャープ	159,700	673.40	107,541,980	貸付株式数 61,600株

アンリツ	77,900	1,738.50	135,429,150	
富士通ゼネラル	30,700	2,794.00	85,775,800	
ソニーグループ	3,775,500	3,736.00	14,105,268,000	
T D K	954,700	1,511.50	1,443,029,050	
帝国通信工業	4,800	2,217.00	10,641,600	貸付株式数 200株
タムラ製作所	44,000	490.00	21,560,000	貸付株式数 17,500株
アルプスアルパイン	89,700	1,372.50	123,113,250	
日本電波工業	10,400	709.00	7,373,600	貸付株式数 4,100株
鈴木	5,900	1,751.00	10,330,900	貸付株式数 2,200株
メイコー	11,000	6,310.00	69,410,000	
日本トリム	2,500	3,995.00	9,987,500	
フオスタ - 電機	11,300	1,429.00	16,147,700	
S M K	2,700	2,136.00	5,767,200	貸付株式数 1,000株
ヨコオ	9,800	1,207.00	11,828,600	
ホシデン	27,100	2,151.00	58,292,100	
ヒロセ電機	16,100	16,750.00	269,675,000	
日本航空電子	28,800	2,407.00	69,321,600	
T O A	11,200	1,006.00	11,267,200	
マクセル	21,100	1,765.00	37,241,500	
古野電気	13,100	3,120.00	40,872,000	
スミダコーポレーション	14,900	973.00	14,497,700	
アイコム	4,300	2,848.00	12,246,400	
リオン	4,500	2,465.00	11,092,500	
横河電機	120,900	3,709.00	448,418,100	
新電元工業	4,200	2,053.00	8,622,600	貸付株式数 1,600株
アズビル	298,300	1,280.00	381,824,000	
日本光電工業	98,000	1,698.50	166,453,000	
チノー	4,500	2,318.00	10,431,000	貸付株式数 1,800株
日本電子材料	6,700	2,143.00	14,358,100	
堀場製作所	20,700	10,070.00	208,449,000	
アドバンテスト	344,900	9,323.00	3,215,502,700	
エスペック	9,700	2,872.00	27,858,400	
キーエンス	109,500	57,880.00	6,337,860,000	
日置電機	5,700	5,530.00	31,521,000	貸付株式数 2,200株
シスメックス	283,400	2,478.50	702,406,900	
日本マイクロニクス	18,000	4,575.00	82,350,000	
メガチップス	8,500	4,810.00	40,885,000	
OBARA GROUP	6,000	3,445.00	20,670,000	貸付株式数 1,800株
IMAGICA GROUP	10,900	793.00	8,643,700	
デンソー	1,072,300	1,898.00	2,035,225,400	

コーセル	13,500	1,121.00	15,133,500	
イリソ電子工業	11,000	2,557.00	28,127,000	
オプテックスグループ	20,100	1,553.00	31,215,300	
千代田インテグレ	3,800	2,708.00	10,290,400	貸付株式数 1,500株
レーザーテック	42,400	14,820.00	628,368,000	
スタンレー電気	62,200	2,812.50	174,937,500	
ウシオ電機	41,600	1,717.50	71,448,000	
日本セラミック	10,000	2,830.00	28,300,000	
古河電池	8,100	1,382.00	11,194,200	貸付株式数 2,400株
山一電機	8,900	2,488.00	22,143,200	
図研	10,000	5,520.00	55,200,000	
日本電子	25,300	4,208.00	106,462,400	
カシオ	87,600	1,075.50	94,213,800	
ファナック	529,600	3,850.00	2,038,960,000	
日本シイエムケイ	32,100	319.00	10,239,900	貸付株式数 12,700株
エンプラス	3,200	3,700.00	11,840,000	貸付株式数 1,200株
大真空	11,800	535.00	6,313,000	貸付株式数 5,100株
ローム	198,300	1,650.00	327,195,000	
浜松ホトニクス	182,900	1,604.50	293,463,050	
三井ハイテック	48,500	676.00	32,786,000	貸付株式数 19,300株
京セラ	680,000	1,707.00	1,160,760,000	
太陽誘電	48,000	2,333.00	111,984,000	貸付株式数 2,800株
村田製作所	964,100	2,084.00	2,009,184,400	
双葉電子工業	20,800	736.00	15,308,800	貸付株式数 8,000株
日東電工	347,100	2,597.00	901,418,700	
東海理化電機	30,900	2,155.00	66,589,500	
ニチコン	25,800	1,141.00	29,437,800	貸付株式数 10,200株
日本ケミコン	13,500	1,108.00	14,958,000	貸付株式数 500株
K O A	16,900	810.00	13,689,000	貸付株式数 6,700株
三井E & S	59,100	2,493.00	147,336,300	
カナデビア	90,600	958.00	86,794,800	
三菱重工業	1,933,100	3,582.00	6,924,364,200	
川崎重工業	82,500	10,670.00	880,275,000	
I H I	88,600	15,855.00	1,404,753,000	
名村造船所	31,200	2,739.00	85,456,800	貸付株式数 12,000株
マネジメントソリューションズ	5,500	1,824.00	10,032,000	貸付株式数 2,200株
プロレド・パートナーズ	2,700	569.00	1,536,300	貸付株式数 1,000株
フロンティア・マネジメント	3,400	736.00	2,502,400	貸付株式数 1,300株

アンビスホールディングス	24,100	483.00	11,640,300	貸付株式数	9,300株
カーブスホールディングス	30,700	677.00	20,783,900		
フォーラムエンジニアリング	13,100	1,147.00	15,025,700		
FAST FITNESS JAP	3,800	1,530.00	5,814,000		
MACBEE PLANET	4,200	2,848.00	11,961,600		
日本車輛	4,200	2,038.00	8,559,600		
三菱ロジスネクスト	17,500	2,044.00	35,770,000	貸付株式数	6,900株
フルサト・マルカHD	9,300	2,269.00	21,101,700		
ヤマエグループHD	12,500	2,280.00	28,500,000	貸付株式数	5,000株
F P G	34,600	2,331.00	80,652,600		
全国保証	56,400	3,179.00	179,295,600		
めぶきフィナンシャルG	525,200	739.50	388,385,400		
ジャパンインベストメントA	17,500	1,721.00	30,117,500	貸付株式数	6,300株
東京きらぼしFG	13,800	5,820.00	80,316,000		
九州フィナンシャルG	189,700	724.70	137,475,590		
かんぽ生命保険	125,500	3,263.00	409,506,500		
ゆうちょ銀行	885,100	1,524.00	1,348,892,400		
富山第一銀行	34,200	999.00	34,165,800	貸付株式数	13,600株
コンコルディア・フィナンシャル	562,200	937.70	527,174,940		
ジェイリース	8,100	1,316.00	10,659,600		
西日本フィナンシャルHD	65,900	2,143.00	141,223,700		
S B I アルヒ	11,000	796.00	8,756,000	貸付株式数	4,300株
プレミアグループ	18,300	2,055.00	37,606,500		
日産自動車	1,368,100	358.50	490,463,850	貸付株式数	546,000株
いすゞ自動車	321,200	1,803.50	579,284,200		
トヨタ自動車	5,818,200	2,554.50	14,862,591,900		
日野自動車	164,600	384.40	63,272,240		
三菱自動車工業	418,400	407.60	170,539,840	貸付株式数	167,000株
武蔵精密工業	26,800	2,670.00	71,556,000		
日産車体	16,600	1,089.00	18,077,400		
新明和工業	31,500	1,485.00	46,777,500		
極東開発工業	14,800	2,669.00	39,501,200		
トピー工業	8,900	2,208.00	19,651,200		
ティラド	2,400	4,600.00	11,040,000		
タチエス	20,200	1,719.00	34,723,800	貸付株式数	7,600株
N O K	42,500	2,037.50	86,593,750		
フタバ産業	33,000	705.00	23,265,000		
カヤバ	18,600	2,961.00	55,074,600		

市光工業	19,700	354.00	6,973,800	
大同メタル工業	21,400	645.00	13,803,000	貸付株式数 2,800株
プレス工業	40,900	536.00	21,922,400	
太平洋工業	25,100	1,308.00	32,830,800	
アイシン	231,800	1,779.00	412,372,200	
マ ッ ダ	336,200	850.70	286,005,340	
本田技研	2,593,200	1,434.50	3,719,945,400	
スズキ	884,500	1,702.00	1,505,419,000	
SUBARU	330,000	2,499.00	824,670,000	
ヤマハ発動機	462,100	1,084.50	501,147,450	
小糸製作所	113,400	1,750.50	198,506,700	
エクセディ	17,900	4,085.00	73,121,500	
ミツバ	20,500	780.00	15,990,000	
豊田合成	31,300	2,661.00	83,289,300	
愛三工業	20,800	1,694.00	35,235,200	
ヨ ロ ズ	11,300	877.00	9,910,100	貸付株式数 4,400株
エフ・シー・シー	19,200	2,707.00	51,974,400	
シマノ	47,400	20,390.00	966,486,000	
テイ・エス テック	44,500	1,677.50	74,648,750	
3 3 F G	9,600	2,834.00	27,206,400	
第四北越フィナンシャルG	33,800	3,305.00	111,709,000	
ひろぎんHLDGS	151,600	1,231.50	186,695,400	
おきなわF G	8,500	2,928.00	24,888,000	
ダイレクトマーケティングミクス	13,500	245.00	3,307,500	
ポピンズ	2,100	1,283.00	2,694,300	
LITALICO	10,200	1,250.00	12,750,000	貸付株式数 500株
十六F G	15,100	4,815.00	72,706,500	
北國F H D	10,500	4,800.00	50,400,000	貸付株式数 4,000株
ネットプロH D	36,600	566.00	20,715,600	
プロクレアホールディングス	12,300	1,440.00	17,712,000	貸付株式数 4,900株
F P パートナー	4,700	2,198.00	10,330,600	貸付株式数 1,800株
あいちフィナンシャルグル	20,100	2,505.00	50,350,500	貸付株式数 4,200株
ジャムコ	6,200	1,792.00	11,110,400	
小 野 建	12,300	1,410.00	17,343,000	貸付株式数 2,700株
ノ ジ マ	37,800	3,020.00	114,156,000	
佐鳥電機	7,300	1,569.00	11,453,700	
カップパ・クリエイト	18,200	1,488.00	27,081,600	貸付株式数 7,200株
伯東	6,100	3,600.00	21,960,000	

コンドーテック	8,900	1,470.00	13,083,000	貸付株式数	3,500株
ナガイレーベン	14,600	1,873.00	27,345,800	貸付株式数	5,800株
三菱食品	10,600	6,330.00	67,098,000		
良品計画	126,400	6,495.00	820,968,000		
松田産業	8,800	3,350.00	29,480,000		
第一興商	44,800	1,613.00	72,262,400		
メディパルHD	125,600	2,377.50	298,614,000		
アドヴァングループ	9,300	806.00	7,495,800	貸付株式数	3,600株
S P K	4,700	2,162.00	10,161,400		
萩原電気HLDGS	5,000	3,280.00	16,400,000		
アルビス	3,800	2,988.00	11,354,400		
アズワン	35,900	2,426.00	87,093,400	貸付株式数	13,800株
スズデン	6,600	1,732.00	11,431,200	貸付株式数	2,600株
シモジマ	7,700	1,205.00	9,278,500		
ドウシシャ	10,700	2,382.00	25,487,400		
高速	6,900	2,712.00	18,712,800	貸付株式数	2,700株
G-7ホールディングス	12,600	1,336.00	16,833,600		
たけびし	4,900	1,809.00	8,864,100		
イオン北海道	28,500	904.00	25,764,000	貸付株式数	1,100株
コジマ	19,100	1,095.00	20,914,500	貸付株式数	7,600株
コーナン商事	12,800	3,700.00	47,360,000	貸付株式数	4,900株
エコス	4,300	2,452.00	10,543,600	貸付株式数	1,400株
ワタミ	14,000	1,017.00	14,238,000	貸付株式数	5,400株
リックス	2,700	3,010.00	8,127,000		
システムソフト	37,700	70.00	2,639,000	貸付株式数	14,700株
パンパシフィックHD	234,000	4,665.00	1,091,610,000		
丸文	10,300	997.00	10,269,100		
西松屋チェーン	25,600	2,068.00	52,940,800	貸付株式数	10,200株
ゼンショーホールディングス	65,800	7,880.00	518,504,000		
ハピネット	8,900	5,190.00	46,191,000		
幸楽苑	10,100	1,042.00	10,524,200	貸付株式数	3,500株
橋本総業HLDGS	4,600	1,308.00	6,016,800	貸付株式数	100株
日本ライフライン	31,000	1,479.00	45,849,000		
サイゼリヤ	15,000	5,120.00	76,800,000	貸付株式数	4,300株
タカショー	9,300	412.00	3,831,600	貸付株式数	3,700株
V Tホールディングス	45,200	469.00	21,198,800		
アルゴグラフィックス	10,100	5,190.00	52,419,000		
魚力	4,000	2,441.00	9,764,000	貸付株式数	1,300株
I D O M	39,400	1,050.00	41,370,000	貸付株式数	15,200株

日本エム・ディ・エム	8,600	553.00	4,755,800	
フジ・コーポレーション	5,200	2,821.00	14,669,200	貸付株式数 1,900株
ユナイテッドアローズ	12,400	2,014.00	24,973,600	
進和	7,100	2,979.00	21,150,900	貸付株式数 2,300株
ダイトロン	4,800	3,755.00	18,024,000	
ハイデイ日高	18,700	3,170.00	59,279,000	貸付株式数 7,400株
シークス	16,500	1,128.00	18,612,000	
コロワイド	65,400	1,849.00	120,924,600	貸付株式数 26,000株
オーハシテクニカ	5,400	2,069.00	11,172,600	
壱番屋	45,700	895.00	40,901,500	貸付株式数 18,200株
白銅	3,200	2,246.00	7,187,200	貸付株式数 1,000株
スギホールディングス	62,200	3,158.00	196,427,600	
薬王堂ホールディングス	5,700	2,250.00	12,825,000	
ダブルエー	3,100	1,368.00	4,240,800	貸付株式数 800株
島津製作所	157,500	3,585.00	564,637,500	
J M S	10,100	430.00	4,343,000	
長野計器	7,200	1,935.00	13,932,000	貸付株式数 2,800株
ブイ・テクノロジー	5,400	3,100.00	16,740,000	
スター精密	18,600	1,669.00	31,043,400	
東京計器	7,700	4,470.00	34,419,000	貸付株式数 2,200株
愛知時計	5,200	2,190.00	11,388,000	
インターアクション	6,600	1,143.00	7,543,800	
東京精密	22,400	8,223.00	184,195,200	
マニー	43,800	1,181.50	51,749,700	貸付株式数 7,100株
ニコン	163,800	1,427.00	233,742,600	
トプコン	62,100	3,265.00	202,756,500	
オリンパス	606,100	1,909.00	1,157,044,900	
理研計器	15,500	3,030.00	46,965,000	貸付株式数 6,100株
SCREENホールディングス	45,700	10,390.00	474,823,000	
キャノン電子	10,400	2,575.00	26,780,000	貸付株式数 900株
タムロン	15,100	3,420.00	51,642,000	
HOYA	212,300	16,480.00	3,498,704,000	
ノーリツ鋼機	10,400	4,420.00	45,968,000	
A&Dホロンホールディングス	13,700	1,900.00	26,030,000	
朝日インテック	133,400	2,291.50	305,686,100	
キャノン	545,900	4,226.00	2,306,973,400	
リコー	279,800	1,276.00	357,024,800	
シチズン時計	100,700	849.00	85,494,300	
メニコン	40,800	1,006.00	41,044,800	貸付株式数 8,200株
パラマウントベッドHD	23,600	2,562.00	60,463,200	

トランザクション	6,000	2,530.00	15,180,000	貸付株式数	2,700株
ニホンフラッシュ	9,200	842.00	7,746,400		
前田工織	22,300	1,955.00	43,596,500	貸付株式数	8,800株
アートネイチャー	11,300	729.00	8,237,700	貸付株式数	4,400株
フルヤ金属	9,400	2,484.00	23,349,600	貸付株式数	3,100株
バンダイナムコHLDGS	292,600	4,817.00	1,409,454,200		
SHOEI	28,600	1,613.00	46,131,800		
フランスベッドHLDGS	14,200	1,264.00	17,948,800	貸付株式数	4,100株
マーベラス	20,400	504.00	10,281,600		
パイロットコーポレーション	16,700	4,021.00	67,150,700		
萩原工業	7,300	1,490.00	10,877,000	貸付株式数	2,900株
エイベックス	20,600	1,254.00	25,832,400		
フジシールインターナショナル	24,600	2,567.00	63,148,200		
タカラトミー	46,000	3,155.00	145,130,000		
広済堂ホールディングス	41,400	444.00	18,381,600	貸付株式数	16,500株
レック	14,100	1,170.00	16,497,000	貸付株式数	5,600株
三光合成	13,800	606.00	8,362,800		
プロネクサス	11,300	1,084.00	12,249,200	貸付株式数	4,200株
TOPPANホールディングス	143,500	3,613.00	518,465,500		
大日本印刷	214,700	2,119.00	454,949,300		
共同印刷	12,300	1,313.00	16,149,900		
NISSHA	18,700	1,263.00	23,618,100		
ZACROS	8,700	3,690.00	32,103,000	貸付株式数	2,800株
TAKARA & COMPANY	5,900	3,310.00	19,529,000	貸付株式数	2,000株
前澤化成工業	7,700	1,844.00	14,198,800	貸付株式数	3,000株
未来工業	5,200	3,365.00	17,498,000	貸付株式数	2,000株
アシックス	390,800	3,400.00	1,328,720,000		
ツツミ	2,600	2,190.00	5,694,000		
ジェイエスピー	9,000	1,812.00	16,308,000	貸付株式数	3,400株
ニチハ	13,700	2,969.00	40,675,300	貸付株式数	5,300株
ローランド	7,600	3,180.00	24,168,000	貸付株式数	3,000株
エフピコ	24,200	2,684.00	64,952,800		
小松ウオール工業	7,300	2,237.00	16,330,100		
ヤマハ	185,300	988.90	183,243,170		
河合楽器	3,300	2,582.00	8,520,600	貸付株式数	1,300株
クリナップ	10,700	668.00	7,147,600	貸付株式数	4,200株
ピジョン	69,700	1,781.50	124,170,550		
天馬	2,700	3,560.00	9,612,000		

キングジム	9,700	879.00	8,526,300	貸付株式数	3,800株 (200株)
象印マホービン	32,700	1,309.00	42,804,300	貸付株式数	13,000株
リンテック	20,800	2,821.00	58,676,800		
信越ポリマー	23,700	1,706.00	40,432,200		
イトーキ	21,800	2,044.00	44,559,200	貸付株式数	8,600株
任天堂	691,000	11,945.00	8,253,995,000		
三菱鉛筆	15,000	2,016.00	30,240,000	貸付株式数	4,700株
松風	11,000	2,044.00	22,484,000		
タカラスタンダード	24,800	2,408.00	59,718,400		
コクヨ	52,100	3,225.00	168,022,500		
ナカバヤシ	11,800	509.00	6,006,200		
ニフコ	41,000	3,262.00	133,742,000		
立川ブラインド	5,100	1,570.00	8,007,000	貸付株式数	1,800株
グロープライド	10,800	2,039.00	22,021,200	貸付株式数	4,300株
オカムラ	32,900	2,195.00	72,215,500		
バルカー	8,400	2,989.00	25,107,600	貸付株式数	3,300株
伊藤忠	778,400	7,461.00	5,807,642,400		
丸紅	951,600	2,923.00	2,781,526,800		
スクロール	16,900	1,030.00	17,407,000		
ヨンドシーホールディングス	11,000	1,719.00	18,909,000	貸付株式数	4,400株
三陽商会	5,700	2,848.00	16,233,600		
長瀬産業	51,700	2,713.50	140,287,950		
蝶理	6,200	3,810.00	23,622,000	貸付株式数	2,400株
豊田通商	347,800	2,999.50	1,043,226,100		
オンワ - ドホールディングス	71,100	566.00	40,242,600		
三共生興	15,100	641.00	9,679,100		
兼松	48,400	2,667.00	129,082,800		
美津濃	32,600	2,606.00	84,955,600		
ルックホールディングス	3,500	2,279.00	7,976,500	貸付株式数	1,400株
三井物産	1,664,700	2,971.50	4,946,656,050		
日本紙パルプ	55,300	606.00	33,511,800		
東京エレクトロン	231,600	24,015.00	5,561,874,000		
カメイ	10,800	2,316.00	25,012,800		
スターゼン	24,000	1,088.00	26,112,000		
セイコーグループ	16,900	4,205.00	71,064,500		
山善	39,000	1,322.00	51,558,000	貸付株式数	15,400株
椿本興業	6,400	2,309.00	14,777,600	貸付株式数	1,300株

住友商事	694,000	3,622.00	2,513,668,000	
B I P R O G Y	37,100	6,046.00	224,306,600	
内田洋行	4,300	9,250.00	39,775,000	
三菱商事	2,140,200	2,889.00	6,183,037,800	
第一実業	10,700	2,299.00	24,599,300	
キャノンマーケティングJPN	22,700	5,415.00	122,920,500	
西華産業	5,500	4,500.00	24,750,000	
佐藤商事	8,000	1,486.00	11,888,000	
東京産業	11,700	768.00	8,985,600	貸付株式数 3,000株
ユアサ商事	10,000	4,475.00	44,750,000	
神鋼商事	7,600	1,976.00	15,017,600	
阪和興業	19,100	5,230.00	99,893,000	
正栄食品	7,700	3,970.00	30,569,000	貸付株式数 3,000株 (1,100株)
カナデン	8,300	1,887.00	15,662,100	
R Y O D E N	8,800	2,775.00	24,420,000	貸付株式数 3,400株
ニプロ	91,200	1,258.50	114,775,200	
岩谷産業	115,000	1,550.50	178,307,500	
極東貿易	6,600	1,496.00	9,873,600	貸付株式数 2,600株
アステナホールディングス	21,800	464.00	10,115,200	貸付株式数 8,600株
三愛オブリ	27,000	1,774.00	47,898,000	
稲畑産業	31,400	3,230.00	101,422,000	
G S I クレオス	6,200	2,036.00	12,623,200	
明和産業	16,500	687.00	11,335,500	
ゴ - ルドウイン	19,400	8,188.00	158,847,200	
ユニ・チャ - ム	686,100	1,133.50	777,694,350	
ワ キ タ	17,000	1,629.00	27,693,000	貸付株式数 6,800株
東邦ホールディングス	29,900	4,624.00	138,257,600	貸付株式数 11,800株
サンゲツ	29,100	2,925.00	85,117,500	
ミツウロコグループ	14,000	1,824.00	25,536,000	貸付株式数 5,700株
シナネンホールディングス	2,900	6,240.00	18,096,000	貸付株式数 1,100株
伊藤忠エネクス	28,700	1,738.00	49,880,600	
サンリオ	94,100	6,765.00	636,586,500	
サンワ テクノス	5,300	2,325.00	12,322,500	
新光商事	15,600	961.00	14,991,600	貸付株式数 4,900株
トーホー	5,000	2,940.00	14,700,000	
三信電気	4,700	2,265.00	10,645,500	
東陽テクニカ	10,700	1,454.00	15,557,800	貸付株式数 4,200株
モスフード サービス	17,000	3,715.00	63,155,000	
加賀電子	23,500	2,699.00	63,426,500	

都築電気	6,200	2,691.00	16,684,200	貸付株式数	2,400株
ソーダニツカ	11,300	1,062.00	12,000,600		
立花エレテック	6,900	2,536.00	17,498,400		
木曽路	17,500	2,364.00	41,370,000	貸付株式数	6,700株
SRSホールディングス	19,100	1,209.00	23,091,900	貸付株式数	7,600株
千趣会	23,400	264.00	6,177,600	貸付株式数	9,300株 (400株)
リテールパートナーズ	17,200	1,310.00	22,532,000	貸付株式数	800株
上新電機	11,500	2,325.00	26,737,500		
日本瓦斯	55,400	2,623.00	145,314,200		
ロイヤルホールディングス	20,400	2,530.00	51,612,000	貸付株式数	8,100株
チヨダ	10,200	1,185.00	12,087,000	貸付株式数	4,000株
ライフコーポレーション	24,300	2,148.00	52,196,400		
リンガーハット	14,900	2,194.00	32,690,600	貸付株式数	5,900株
MrMaxHD	14,600	656.00	9,577,600		
AOKIホールディングス	24,800	1,606.00	39,828,800		
オークワ	17,200	932.00	16,030,400	貸付株式数	4,700株
コメリ	15,600	2,824.00	44,054,400		
青山商事	24,800	2,129.00	52,799,200		
しまむら	27,200	9,755.00	265,336,000	貸付株式数	10,500株
高島屋	155,000	1,093.50	169,492,500	貸付株式数	61,800株
松屋	19,600	1,010.00	19,796,000		
エイチ・ツー・オーリテイ リング	56,400	1,951.00	110,036,400		
近鉄百貨店	6,600	1,756.00	11,589,600	貸付株式数	2,600株
丸井グループ	76,900	3,043.00	234,006,700		
クレディセゾン	68,300	4,023.00	274,770,900		
アクシアルリテイリング	31,600	1,120.00	35,392,000		
イオン	428,200	4,483.00	1,919,620,600		
イズミ	17,600	3,287.00	57,851,200	貸付株式数	6,800株
フォーバル	4,500	1,284.00	5,778,000	貸付株式数	1,000株
平和堂	19,000	2,875.00	54,625,000	貸付株式数	7,500株
フジ	21,300	2,006.00	42,727,800	貸付株式数	8,400株
ヤオコー	13,700	9,319.00	127,670,300		
ゼビオホールディングス	15,700	1,117.00	17,536,900		
ケースホールディングス	71,600	1,415.00	101,314,000		
PALTA C	18,100	4,067.00	73,612,700		
三谷産業	20,200	334.00	6,746,800		
あおぞら銀行	74,400	2,112.50	157,170,000	貸付株式数	29,400株
三菱UFJフィナンシャルG	6,914,700	1,953.00	13,504,409,100		

りそなホールディングス	1,322,000	1,321.00	1,746,362,000	
三井住友トラストグループ	379,500	3,806.00	1,444,377,000	
三井住友フィナンシャルG	2,225,800	3,605.00	8,024,009,000	
千葉銀行	329,700	1,295.50	427,126,350	
群馬銀行	182,700	1,176.50	214,946,550	
武蔵野銀行	16,400	3,225.00	52,890,000	貸付株式数 2,300株
千葉興業銀行	25,500	1,158.00	29,529,000	貸付株式数 10,100株
筑波銀行	47,300	232.00	10,973,600	貸付株式数 18,900株
七十七銀行	34,500	4,889.00	168,670,500	
秋田銀行	7,200	2,920.00	21,024,000	
山形銀行	11,900	1,484.00	17,659,600	貸付株式数 4,700株
岩手銀行	6,800	3,030.00	20,604,000	
東邦銀行	124,000	327.00	40,548,000	貸付株式数 48,000株
ふくおかフィナンシャルG	93,900	3,996.00	375,224,400	
スルガ銀行	63,000	1,298.00	81,774,000	
八十二銀行	242,500	1,192.00	289,060,000	
山梨中央銀行	12,100	2,541.00	30,746,100	
大垣共立銀行	20,500	2,429.00	49,794,500	
福井銀行	9,600	1,796.00	17,241,600	貸付株式数 3,800株
清水銀行	4,300	1,370.00	5,891,000	貸付株式数 1,000株
滋賀銀行	16,300	5,930.00	96,659,000	
南都銀行	16,200	3,975.00	64,395,000	
百五銀行	101,400	699.00	70,878,600	
紀陽銀行	38,600	2,538.00	97,966,800	
ほくほくフィナンシャルG	60,600	2,794.50	169,346,700	
山陰合同銀行	67,500	1,221.00	82,417,500	
百十四銀行	10,500	4,055.00	42,577,500	
四国銀行	15,600	1,106.00	17,253,600	
阿波銀行	14,700	2,808.00	41,277,600	貸付株式数 2,600株
大分銀行	6,300	3,820.00	24,066,000	貸付株式数 2,400株
宮崎銀行	6,800	3,635.00	24,718,000	
佐賀銀行	6,200	2,255.00	13,981,000	貸付株式数 2,400株
琉球銀行	24,700	1,147.00	28,330,900	貸付株式数 9,000株
セブン銀行	386,200	264.00	101,956,800	
みずほフィナンシャルG	1,440,400	3,923.00	5,650,689,200	
山口フィナンシャルG	105,700	1,551.00	163,940,700	
芙蓉総合リース	29,700	3,856.00	114,523,200	
みずほリース	81,000	1,063.00	86,103,000	
東京センチュリー	80,600	1,586.50	127,871,900	
SBIホールディングス	173,600	4,535.00	787,276,000	

日本証券金融	39,600	1,710.00	67,716,000	
アイフル	178,500	408.00	72,828,000	
名古屋銀行	6,700	7,700.00	51,590,000	
北洋銀行	147,000	580.00	85,260,000	貸付株式数 55,600株
愛媛銀行	15,700	1,000.00	15,700,000	貸付株式数 4,400株
京葉銀行	48,400	981.00	47,480,400	
栃木銀行	49,400	398.00	19,661,200	
北日本銀行	3,700	2,793.00	10,334,100	貸付株式数 1,400株
東和銀行	19,800	715.00	14,157,000	
リコーリース	10,200	5,110.00	52,122,000	貸付株式数 1,500株
イオンフィナンシャルサー ビス	61,900	1,278.00	79,108,200	貸付株式数 23,900株
アコム	256,500	419.60	107,627,400	
ジャックス	12,900	3,860.00	49,794,000	
オリコ	35,200	866.00	30,483,200	貸付株式数 5,300株
オリックス	618,800	3,095.00	1,915,186,000	
三菱HCキャピタル	540,300	1,053.00	568,935,900	
ジャフコグループ	32,100	2,453.00	78,741,300	貸付株式数 1,900株
トモニホールディングス	103,000	536.00	55,208,000	
大和証券G本社	770,800	991.00	763,862,800	
野村ホールディングス	1,812,700	888.30	1,610,221,410	
岡三証券グループ	85,200	683.00	58,191,600	貸付株式数 34,000株
丸三証券	35,900	878.00	31,520,200	貸付株式数 10,300株
東洋証券	27,200	485.00	13,192,000	貸付株式数 11,800株
東海東京HD	128,000	485.00	62,080,000	貸付株式数 49,400株
水戸証券	29,600	556.00	16,457,600	
いちよし証券	21,700	783.00	16,991,100	貸付株式数 8,400株
松井証券	74,300	680.00	50,524,000	貸付株式数 8,400株
SOMPOホールディングス	527,000	4,424.00	2,331,448,000	
日本取引所グループ	641,300	1,574.00	1,009,406,200	
マネックスG	103,800	709.00	73,594,200	
極東証券	13,400	1,451.00	19,443,400	貸付株式数 5,300株
岩井コスモホールディング	12,300	2,116.00	26,026,800	
アイザワ証券グループ	12,900	1,226.00	15,815,400	貸付株式数 5,100株
フィデアホール	11,100	1,436.00	15,939,600	貸付株式数 4,300株
池田泉州HD	149,500	558.00	83,421,000	
アニコムホールディングス	33,700	704.00	23,724,800	貸付株式数 13,400株
MS&AD	790,000	3,256.00	2,572,240,000	
スパークス・グループ	11,900	1,539.00	18,314,100	

第一生命HLDGS	1,968,900	1,082.00	2,130,349,800	
東京海上HD	1,029,000	5,920.00	6,091,680,000	
イー・ギャランティ	17,700	1,468.00	25,983,600	貸付株式数 5,500株
NECキャピタルソリューション	5,200	3,725.00	19,370,000	
T&Dホールディングス	289,400	3,255.00	941,997,000	
アドバンスクリエイト	8,400	340.00	2,856,000	貸付株式数 3,400株
三井不動産	1,480,300	1,339.50	1,982,861,850	
三菱地所	614,300	2,675.50	1,643,559,650	
平和不動産	17,500	4,395.00	76,912,500	貸付株式数 6,700株
東京建物	94,200	2,611.50	246,003,300	
京阪神ビルディング	18,000	1,557.00	28,026,000	貸付株式数 3,500株
住友不動産	175,400	5,830.00	1,022,582,000	
テーオーシー	19,200	665.00	12,768,000	
スターツコーポレーション	17,700	4,210.00	74,517,000	
フジ住宅	13,600	670.00	9,112,000	
空港施設	15,200	792.00	12,038,400	
明和地所	8,600	928.00	7,980,800	貸付株式数 2,200株
ゴールドクレスト	7,300	3,415.00	24,929,500	貸付株式数 2,900株
リログループ	62,600	1,675.00	104,855,000	
エスリード	5,100	4,400.00	22,440,000	貸付株式数 2,000株
日神グループHLDGS	17,300	505.00	8,736,500	貸付株式数 6,800株
日本エスコン	28,200	971.00	27,382,200	
MIRARTHホールディング	63,200	381.00	24,079,200	貸付株式数 25,200株
イオンモール	65,200	2,909.00	189,666,800	
ランド	695,700	8.00	5,565,600	貸付株式数 275,000株
カチタス	29,000	2,300.00	66,700,000	
東祥	9,400	605.00	5,687,000	
トーセイ	17,900	2,552.00	45,680,800	貸付株式数 7,000株
サンフロンティア不動産	18,000	2,033.00	36,594,000	
グランディハウス	10,100	535.00	5,403,500	貸付株式数 3,900株
東武鉄道	115,300	2,466.00	284,329,800	
相鉄ホールディングス	36,200	2,204.50	79,802,900	
東急	306,900	1,710.00	524,799,000	
京浜急行	135,400	1,506.50	203,980,100	貸付株式数 20,200株
小田急電鉄	181,000	1,642.00	297,202,000	
京王電鉄	53,900	3,529.00	190,213,100	
京成電鉄	190,500	1,358.50	258,794,250	
富士急行	13,500	1,947.00	26,284,500	貸付株式数 5,300株
東日本旅客鉄道	603,600	3,042.00	1,836,151,200	

西日本旅客鉄道	269,900	3,211.00	866,648,900	
東海旅客鉄道	421,600	3,092.00	1,303,587,200	
東京地下鉄	244,000	1,708.50	416,874,000	貸付株式数 97,400株
西武ホールディングス	119,100	4,305.00	512,725,500	
鴻池運輸	18,600	2,838.00	52,786,800	
西日本鉄道	31,700	2,038.00	64,604,600	
ハマキョウレックス	37,400	1,347.00	50,377,800	
サカイ引越センター	13,900	2,690.00	37,391,000	貸付株式数 5,200株
近鉄グループHLDGS	117,100	2,677.00	313,476,700	
阪急阪神HLDGS	145,000	3,834.00	555,930,000	貸付株式数 1,000株
南海電鉄	48,700	2,160.00	105,192,000	
京阪ホールディングス	60,200	3,033.00	182,586,600	
神戸電鉄	3,000	2,308.00	6,924,000	貸付株式数 1,200株
名古屋鉄道	120,800	1,615.00	195,092,000	貸付株式数 47,900株
山陽電鉄	8,200	1,999.00	16,391,800	貸付株式数 3,200株
ヤマトホールディングス	132,800	2,002.00	265,865,600	
山九	25,000	7,566.00	189,150,000	
日新	7,400	8,080.00	59,792,000	
丸全昭和運輸	6,800	6,710.00	45,628,000	貸付株式数 2,500株
センコーグループHLDGS	71,900	1,850.00	133,015,000	
ニッコンホールディングス	62,100	3,235.00	200,893,500	貸付株式数 24,500株
福山通運	11,700	3,265.00	38,200,500	
セイノーホールディングス	53,800	2,207.50	118,763,500	
神奈川中央交通	3,100	3,600.00	11,160,000	
AZ-COM丸和ホールディ	33,900	1,070.00	36,273,000	貸付株式数 5,900株
日本郵船	226,400	5,146.00	1,165,054,400	
商船三井	207,900	4,993.00	1,038,044,700	
川崎汽船	235,400	2,095.50	493,280,700	
NSユナイテッド海運	6,900	4,020.00	27,738,000	
飯野海運	40,100	1,048.00	42,024,800	
九州旅客鉄道	83,700	3,753.00	314,126,100	
SGホールディングス	183,500	1,655.00	303,692,500	
NIPPON EXPRESS	117,500	2,786.00	327,355,000	
日本航空	250,500	2,783.00	697,141,500	
ANAホールディングス	297,300	2,750.00	817,575,000	
ビーウィズ	2,900	1,452.00	4,210,800	貸付株式数 1,100株
サンウェルズ	5,700	624.00	3,556,800	貸付株式数 2,200株
TREホールディングス	25,800	1,411.00	36,403,800	
人・夢・技術グループ	4,600	1,620.00	7,452,000	貸付株式数 1,800株
シルバーライフ	3,100	729.00	2,259,900	貸付株式数 500株

GENKY DRUGSTORES	10,100	3,625.00	36,612,500	貸付株式数	4,000株
コア商事HLDGS	10,300	704.00	7,251,200	貸付株式数	4,100株
KPPグループホールディン	22,000	695.00	15,290,000		
ブックオフGHD	8,400	1,377.00	11,566,800	貸付株式数	3,200株
ギフトホールディングス	5,700	3,625.00	20,662,500	貸付株式数	2,200株
三菱倉庫	108,600	1,183.00	128,473,800		
三井倉庫HOLD	33,700	4,005.00	134,968,500		
住友倉庫	31,800	2,993.00	95,177,400		
渋沢倉庫	5,000	3,975.00	19,875,000	貸付株式数	1,900株
ヤマタネ	9,300	2,290.00	21,297,000		
乾汽船	13,900	1,212.00	16,846,800	貸付株式数	5,500株
日本トランスシティ	22,000	1,021.00	22,462,000		
中央倉庫	6,400	1,372.00	8,780,800		
安田倉庫	7,500	1,850.00	13,875,000	貸付株式数	2,900株
NISSOH D	9,800	623.00	6,105,400	貸付株式数	3,700株
大栄環境	24,500	3,195.00	78,277,500	貸付株式数	9,800株
GENOVA	5,100	738.00	3,763,800	貸付株式数	2,000株
日本管財ホールディング	11,800	2,715.00	32,037,000	貸付株式数	4,400株
上組	48,000	4,052.00	194,496,000		
キューソー流通システム	7,300	2,898.00	21,155,400	貸付株式数	2,000株
エーアイティー	6,900	1,754.00	12,102,600		
日本コンセプト	4,000	1,968.00	7,872,000		
TBSホールディングス	54,200	4,607.00	249,699,400		
日本テレビHLDS	97,200	3,274.00	318,232,800	貸付株式数	11,000株
朝日放送グループHD	13,700	675.00	9,247,500	貸付株式数	5,400株
テレビ朝日HD	26,700	2,628.00	70,167,600		
スカパーJSATHD	85,300	1,352.00	115,325,600		
テレビ東京HD	6,800	3,475.00	23,630,000	貸付株式数	2,700株
ビジョン	16,700	1,216.00	20,307,200	貸付株式数	6,600株
U-NEXT HOLDINGS	36,900	2,177.00	80,331,300	貸付株式数	14,200株
日本通信	88,300	156.00	13,774,800	貸付株式数	35,200株
日本電信電話	32,651,300	155.00	5,060,951,500		
KDDI	1,614,700	2,438.00	3,936,638,600		
ソフトバンク	17,597,200	220.80	3,885,461,760		
光通信	12,700	41,510.00	527,177,000	貸付株式数	5,000株
エムティーアイ	7,400	829.00	6,134,600	貸付株式数	2,000株
GMOインターネットグループ	35,400	3,501.00	123,935,400		
ファイバーゲート	4,200	751.00	3,154,200	貸付株式数	1,600株
KADOKAWA	56,200	3,829.00	215,189,800		

学研ホールディングス	20,100	918.00	18,451,800	
ゼンリン	18,800	1,073.00	20,172,400	貸付株式数 7,400株
東京電力HD	920,800	424.70	391,063,760	貸付株式数 255,600株
中部電力	403,300	1,717.00	692,466,100	
関西電力	533,900	1,642.00	876,663,800	
中国電力	190,100	699.10	132,898,910	貸付株式数 16,300株
北陸電力	111,900	687.10	76,886,490	
東北電力	288,100	995.30	286,745,930	
四国電力	101,900	1,171.50	119,375,850	
九州電力	252,300	1,203.50	303,643,050	
北海道電力	114,600	702.90	80,552,340	貸付株式数 45,700株
沖縄電力	28,000	878.00	24,584,000	貸付株式数 11,100株
電源開発	82,400	2,371.50	195,411,600	
エフオン	7,900	335.00	2,646,500	
イーレックス	21,300	765.00	16,294,500	貸付株式数 8,500株
レノバ	29,900	635.00	18,986,500	貸付株式数 300株
東京瓦斯	206,900	4,698.00	972,016,200	
大阪瓦斯	215,000	3,651.00	784,965,000	
東邦瓦斯	40,200	4,061.00	163,252,200	
北海道瓦斯	32,700	565.00	18,475,500	貸付株式数 5,000株
広島ガス	23,200	353.00	8,189,600	貸付株式数 6,000株
西部ガスHLDGS	11,400	1,795.00	20,463,000	貸付株式数 4,500株
静岡ガス	24,900	1,066.00	26,543,400	
メタウォーター	14,500	2,207.00	32,001,500	
M&A総研ホールディング	14,600	1,323.00	19,315,800	貸付株式数 1,200株
アイネット	6,300	1,863.00	11,736,900	貸付株式数 2,400株
松竹	6,300	13,610.00	85,743,000	貸付株式数 300株
東宝	64,800	7,965.00	516,132,000	
エイチ・アイ・エス	36,000	1,400.00	50,400,000	
東映	18,100	4,965.00	89,866,500	
ラックランド	4,700	1,018.00	4,784,600	貸付株式数 1,800株
NTTデータグループ	283,200	3,994.00	1,131,100,800	
共立メンテナンス	35,300	3,317.00	117,090,100	貸付株式数 14,100株 (1,300株)
イチネンホールディングス	10,900	1,616.00	17,614,400	
建設技術研究所	11,600	2,792.00	32,387,200	貸付株式数 2,400株
スペース	8,200	1,172.00	9,610,400	
アインホールディングス	11,600	5,502.00	63,823,200	
燦ホールディングス	9,400	1,491.00	14,015,400	

ピー・シー・エー	7,200	1,805.00	12,996,000	
スバル興業	4,400	2,870.00	12,628,000	貸付株式数 1,000株
タナベコンサルティンググループ	9,400	755.00	7,097,000	
ビジネスB太田昭和	4,700	2,577.00	12,111,900	
ナガワ	3,000	6,100.00	18,300,000	貸付株式数 1,200株
東京都競馬	8,200	4,480.00	36,736,000	貸付株式数 2,700株
カナモト	17,400	3,105.00	54,027,000	
D T S	18,700	5,050.00	94,435,000	
スクウェア・エニックス・HD	55,200	9,589.00	529,312,800	
シーイーシー	13,300	2,149.00	28,581,700	
カプコン	218,200	4,625.00	1,009,175,000	
ニシオホールディングス	9,300	3,900.00	36,270,000	
アイ・エス・ビー	5,100	1,363.00	6,951,300	貸付株式数 1,200株
日本空港ビルデング	38,100	4,325.00	164,782,500	
トランス・コスモス	14,400	3,470.00	49,968,000	
乃村工藝社	49,100	921.00	45,221,100	
S C S K	89,600	4,363.00	390,924,800	
藤田観光	5,000	9,800.00	49,000,000	貸付株式数 2,000株
KNT-CTホールディングス	6,700	1,004.00	6,726,800	貸付株式数 900株
トーカイ	10,000	2,155.00	21,550,000	貸付株式数 2,200株
セコム	229,200	5,415.00	1,241,118,000	
N S W	4,900	2,682.00	13,141,800	
セントラル警備保障	6,100	2,302.00	14,042,200	貸付株式数 2,200株
アイネス	8,600	1,639.00	14,095,400	
丹青社	23,800	1,280.00	30,464,000	
メイテックグループホールデ	41,500	3,208.00	133,132,000	
T K C	17,100	4,270.00	73,017,000	
応用地質	10,200	2,879.00	29,365,800	
船井総研ホールディン	22,500	2,405.00	54,112,500	
N S D	42,200	3,517.00	148,417,400	
コナミグループ	41,100	20,815.00	855,496,500	
学 究 社	4,500	2,276.00	10,242,000	
イオンディライト	5,900	5,400.00	31,860,000	
ナック	11,400	550.00	6,270,000	貸付株式数 4,500株
福井コンピュータHLDS	7,600	3,020.00	22,952,000	貸付株式数 3,000株
ダイセキ	27,100	3,500.00	94,850,000	
ステップ	4,100	2,226.00	9,126,600	

泉州電業	7,600	4,070.00	30,932,000	
GENKI GLOBAL DIN	6,500	4,130.00	26,845,000	
トラスコ中山	24,300	2,058.00	50,009,400	
ヤマダホールディングス	356,200	438.10	156,051,220	
オートバックスセブン	40,300	1,438.00	57,951,400	
モリト	9,200	1,355.00	12,466,000	貸付株式数 3,600株
アークランズ	34,400	1,698.00	58,411,200	貸付株式数 13,300株
ニトリホールディングス	42,200	14,305.00	603,671,000	
グルメ杵屋	9,400	967.00	9,089,800	貸付株式数 3,700株
ケーユーホールディングス	6,800	1,127.00	7,663,600	
吉野家ホールディングス	45,300	3,114.00	141,064,200	貸付株式数 18,000株 (4,400株)
加藤産業	14,300	5,480.00	78,364,000	
イノテック	7,800	1,350.00	10,530,000	
イエローハット	39,300	1,520.00	59,736,000	
松屋フーズHLDGS	5,500	5,650.00	31,075,000	
JBCCホールディングス	29,100	1,367.00	39,779,700	
JKホールディングス	8,900	1,211.00	10,777,900	
サガミホールディングス	18,600	1,774.00	32,996,400	貸付株式数 7,400株 (5,400株)
日伝	6,400	2,724.00	17,433,600	貸付株式数 2,500株
ミロク情報サービス	9,300	1,770.00	16,461,000	貸付株式数 3,700株
杉本商事	10,300	1,772.00	18,251,600	貸付株式数 4,000株
因幡電機産業	32,600	3,846.00	125,379,600	
王将フードサービス	22,900	3,610.00	82,669,000	
ミニストップ	9,600	1,818.00	17,452,800	貸付株式数 3,700株 (1,200株)
アークス	19,500	2,946.00	57,447,000	
パローホールディングス	22,100	2,436.00	53,835,600	
東テック	11,600	2,810.00	32,596,000	
ミスミグループ本社	175,000	1,910.00	334,250,000	
ベルク	5,800	7,360.00	42,688,000	
大庄	7,800	1,140.00	8,892,000	貸付株式数 3,000株 (300株)
ファーストリテイリング	78,100	46,900.00	3,662,890,000	
ソフトバンクグループ	541,500	8,499.00	4,602,208,500	
スズケン	35,400	5,406.00	191,372,400	
サンドラッグ	39,100	4,398.00	171,961,800	
サクスパーホールディング グ	11,000	808.00	8,888,000	貸付株式数 3,300株

ジェコス	6,900	1,233.00	8,507,700	貸付株式数	2,700株
ペルーナ	27,900	873.00	24,356,700	貸付株式数	11,100株
合計			431,296,451,840		

(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。

【ダイワファンドラップ 日経225インデックス】

(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6月18日から2025年6月16日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 日経225インデックス

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	52,958,401	51,520,975
親投資信託受益証券	24,043,252,557	25,371,148,300
未収入金	-	57,900,000
流動資産合計	24,096,210,958	25,480,569,275
資産合計	24,096,210,958	25,480,569,275
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	8,504,241	63,260,458
未払受託者報酬	2,555,039	2,657,715
未払委託者報酬	37,048,606	38,537,532
その他未払費用	638,674	664,345
流動負債合計	48,746,560	105,120,050
負債合計	48,746,560	105,120,050
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,929,599,405	1,960,039,766
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	14,756,864,993	15,768,409,459
（分配準備積立金）	6,746,137,868	6,199,762,914
元本等合計	24,047,464,398	25,375,449,225
純資産合計	24,047,464,398	25,375,449,225
負債純資産合計	24,096,210,958	25,480,569,275

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期		第9期	
	自	2023年6月16日 至 2024年6月17日	自	2024年6月18日 至 2025年6月16日
<b>営業収益</b>				
受取利息		8,532		112,914
有価証券売買等損益		3,272,949,031		667,995,743
営業収益合計		3,272,957,563		668,108,657
<b>営業費用</b>				
支払利息		8,811		-
受託者報酬		4,679,796		5,335,710
委託者報酬		67,858,116		77,369,083
その他費用		1,169,784		1,333,759
営業費用合計		73,716,507		84,038,552
営業利益又は営業損失（ ）		3,199,241,056		584,070,105
経常利益又は経常損失（ ）		3,199,241,056		584,070,105
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,199,241,056		584,070,105
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（ ）		454,146,697		37,138,836
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		10,691,700,507		14,756,864,993
剰余金増加額又は欠損金減少額		5,087,728,958		3,088,739,120
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		5,087,728,958		3,088,739,120
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,767,658,831		2,624,125,923
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,767,658,831		2,624,125,923
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		14,756,864,993		15,768,409,459

## (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6月18日 至2025年6月16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6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2024年6月17日としており、2025年6月15日が休日のため、当計算期間末日を2025年6月16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	第9期
	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1. 1 期首元本額	8,607,441,935円	9,290,599,405円
期中追加設定元本額	3,716,226,558円	1,965,081,837円
期中一部解約元本額	3,033,069,088円	1,648,641,476円
2. 計算期間末日における受益権の総数	9,290,599,405口	9,607,039,766口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第8期	第9期
	自2023年6月16日 至2024年6月17日	自2024年6月18日 至2025年6月16日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (1,373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 (2,745,084,545円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (8,010,727,125円)及び分配準備積立金(4,001,051,950円)より分配対象額は14,756,864,993円(1万口当たり15,883.65円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (96,062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 (546,835,207円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (9,568,646,545円)及び分配準備積立金(5,652,831,645円)より分配対象額は15,768,409,459円(1万口当たり16,413.39円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	--	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第9期
	2025年6月16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	第9期
	2024年6月17日現在	2025年6月16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	2,910,197,942	630,460,911
合計	2,910,197,942	630,460,911

## (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	第9期
2024年6月17日現在	2025年6月16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6月18日
至2025年6月16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	第9期
	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	2,5884円	2,6413円
(1万口当たり純資産額)	(25,884円)	(26,413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	ストックインデックス225・マザーファンド	4,717,142,010	25,371,148,300	
親投資信託受益証券 合計			25,371,148,300	
合計			25,371,148,300	

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、「ストックインデックス225・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

## 「ストックインデックス225・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6月17日現在 金額(円)	2025年6月16日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		

コール・ローン		8,530,980,552	9,495,893,684
株式	2 3	320,521,492,500	381,245,909,230
派生商品評価勘定		-	1,157,800
未収配当金		1,489,316,400	2,001,730,100
前払金		77,380,000	107,200,000
その他未収収益	4	66,238	12,645,563
流動資産合計		330,619,235,690	392,864,536,377
資産合計		330,619,235,690	392,864,536,377
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		252,998,800	14,488,000
未払金		13,699,800	-
未払解約金		932,694,000	811,101,000
未払利息		-	682,337
受入担保金		708,094,558	4,508,265,509
流動負債合計		1,907,487,158	5,334,536,846
負債合計		1,907,487,158	5,334,536,846
純資産の部			
元本等			
元本	1	62,582,339,693	72,051,623,995
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		266,129,408,839	315,478,375,536
元本等合計		328,711,748,532	387,529,999,531
純資産合計		328,711,748,532	387,529,999,531
負債純資産合計		330,619,235,690	392,864,536,377

## 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6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1. 1 期首	2023年6月16日	2024年6月18日
期首元本額	56,240,375,491円	62,582,339,693円
期中追加設定元本額	24,015,857,414円	26,408,350,814円
期中一部解約元本額	17,673,893,212円	16,939,066,512円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ストック インデックス ファン ド 2 2 5	23,368,091,905円	25,666,912,776円
適格機関投資家専用・ダイワ・ ストックインデックスファンド 2 2 5 V A	187,814,147円	158,940,517円
大和 スtock インデックス 2 2 5 ファンド	7,615,504,332円	8,508,877,888円
D - I ' s 日経 2 2 5 インデッ クス	44,597,896円	20,260,477円
i F r e e 日経 2 2 5 インデッ クス	14,577,741,227円	21,238,515,348円

	D C ・ ダイワ ・ ストックイン デックス2 2 5 ( 確定拠出年金 専用ファンド )	5,589,483,405円	5,526,738,710円
	ダイワ ・ ノーロード 日経2 2 5 ファンド	433,048,723円	466,535,909円
	ダイワファンドラップ 日経2 2 5 インデックス	4,577,487,398円	4,717,142,010円
	ダイワ日経2 2 5 インデックス ( ダイワSMA専用 )	657,522,498円	894,486,416円
	ダイワ ・ インデックスセレクト 日経2 2 5	5,531,048,162円	4,853,213,944円
	計	62,582,339,693円	72,051,623,995円
2.	期末日における受益権の総数	62,582,339,693口	72,051,623,995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 679,445,020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 4,442,472,220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 5,008,330,000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 5,243,094,000円
5.	4 その他未収収益	該当事項はありません。	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)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2 条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定 する「運用の基本方針」に従っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年6月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2024年6月17日現在	2025年6月16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	38,890,746,083	13,072,573,499
合計	38,890,746,083	13,072,573,499

（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6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株値指数								
先物取引								
買建	8,460,880,000	-	8,208,000,000	252,880,000	6,304,280,000	-	6,291,040,000	13,240,000
合計	8,460,880,000	-	8,208,000,000	252,880,000	6,304,280,000	-	6,291,040,000	13,240,000

（注） 1. 時価の算定方法

株値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. 株値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6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	5.2525円	5.3785円
（1万口当たり純資産額）	(52,525円)	(53,785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	
ニッセイ	331,000	842.00	278,702,000	
I N P E X	132,400	2,114.00	279,893,600	
コムシスホールディングス	331,000	3,277.00	1,084,687,000	
大成建設	66,200	8,022.00	531,056,400	
大 林 組	331,000	2,207.00	730,517,000	
清水建設	331,000	1,601.00	529,931,000	
長谷工コーポレーション	66,200	2,141.50	141,767,300	
鹿島建設	165,500	3,654.00	604,737,000	
大和ハウス	331,000	4,856.00	1,607,336,000	
積水ハウス	331,000	3,024.00	1,000,944,000	
日揮ホールディングス	331,000	1,259.50	416,894,500	
日清製粉G本社	331,000	1,732.00	573,292,000	貸付株式数 5,700株
明治ホールディングス	132,400	3,208.00	424,739,200	
日本ハム	165,500	5,125.00	848,187,500	
エムスリー	794,400	2,013.00	1,599,127,200	
ディー・エヌ・エー	99,300	2,672.00	265,329,600	貸付株式数 37,300株
サッポロホールディングス	66,200	7,335.00	485,577,000	
アサヒグループホールディングン	993,000	1,923.50	1,910,035,500	
キリンHD	331,000	2,057.50	681,032,500	貸付株式数 29,600株
双日	33,100	3,515.00	116,346,500	
キッコーマン	1,655,000	1,283.50	2,124,192,500	
味の素	662,000	3,698.00	2,448,076,000	
ニチレイ	331,000	1,884.00	623,604,000	
日本たばこ産業	331,000	4,360.00	1,443,160,000	
J. フロント リテイリング	165,500	2,014.50	333,399,750	
Z O Z O	993,000	1,530.00	1,519,290,000	
三越伊勢丹HD	331,000	2,300.50	761,465,500	
東急不動産HD	331,000	1,036.50	343,081,500	
セブン&アイ・HLDGS	993,000	2,221.00	2,205,453,000	
帝 人	66,200	1,114.50	73,779,900	
東 レ	331,000	980.00	324,380,000	
ク ラ レ	331,000	1,799.00	595,469,000	
旭 化 成	331,000	954.30	315,873,300	
S U M C O	33,100	1,014.50	33,579,950	貸付株式数 12,400株
ネクソン	662,000	2,722.50	1,802,295,000	
王子ホールディングス	331,000	688.00	227,728,000	
レゾナック・ホールディング	33,100	3,092.00	102,345,200	

住友化学	331,000	339.10	112,242,100	
日産化学	331,000	4,226.00	1,398,806,000	
東ソー	165,500	2,064.00	341,592,000	
トクヤマ	66,200	2,893.50	191,549,700	
デンカ	66,200	1,902.50	125,945,500	貸付株式数 23,200株
信越化学	1,655,000	4,434.00	7,338,270,000	
協和キリン	331,000	2,496.00	826,176,000	
三井化学	66,200	3,201.00	211,906,200	
三菱ケミカルグループ	165,500	747.10	123,645,050	
UBE	33,100	2,231.50	73,862,650	
野村総合研究所	331,000	5,883.00	1,947,273,000	
電通グループ	331,000	3,071.00	1,016,501,000	貸付株式数 124,400株
メルカリ	331,000	2,680.50	887,245,500	
花王	331,000	6,686.00	2,213,066,000	
武田薬品	331,000	4,336.00	1,435,216,000	
アステラス製薬	1,655,000	1,385.50	2,293,002,500	
住友ファーマ	331,000	1,047.00	346,557,000	貸付株式数 16,100株
塩野義製薬	993,000	2,508.50	2,490,940,500	
中外製薬	993,000	7,462.00	7,409,766,000	
エーザイ	331,000	4,030.00	1,333,930,000	
テルモ	2,648,000	2,596.50	6,875,532,000	
第一三共	993,000	3,495.00	3,470,535,000	
大塚ホールディングス	331,000	7,213.00	2,387,503,000	貸付株式数 66,000株
オリエンタルランド	331,000	3,184.00	1,053,904,000	
LINEヤフー	132,400	521.40	69,033,360	
トレンドマイクロ	331,000	10,755.00	3,559,905,000	
サイバーエージェント	264,800	1,508.00	399,318,400	
楽天グループ	331,000	808.40	267,580,400	
富士フイルムHLDGS	993,000	3,106.00	3,084,258,000	
コニカミノルタ	331,000	446.30	147,725,300	
資生堂	331,000	2,420.00	801,020,000	貸付株式数 22,600株
出光興産	662,000	883.00	584,546,000	
ENEOSホールディングス	331,000	726.30	240,405,300	
横浜ゴム	165,500	3,420.00	566,010,000	
ブリヂストン	331,000	5,959.00	1,972,429,000	
AGC	66,200	4,222.00	279,496,400	貸付株式数 1,300株
日本電気硝子	99,300	3,414.00	339,010,200	
太平洋セメント	33,100	3,665.00	121,311,500	
東海カーボン	331,000	1,000.50	331,165,500	貸付株式数 124,400株
TOTO	165,500	3,628.00	600,434,000	

日本碍子	331,000	1,759.50	582,394,500	
日本製鉄	33,100	2,872.50	95,079,750	
神戸製鋼所	33,100	1,601.00	52,993,100	
J F Eホールディングス	33,100	1,692.00	56,005,200	貸付株式数 6,400株
日本製鋼所	66,200	7,870.00	520,994,000	
三井金属	33,100	4,751.00	157,258,100	
三菱マテリアル	33,100	2,231.00	73,846,100	貸付株式数 12,400株
住友鉱山	165,500	3,380.00	559,390,000	
DOWAホールディングス	66,200	4,607.00	304,983,400	
古河電工	33,100	6,927.00	229,283,700	貸付株式数 5,400株
住友電工	331,000	2,866.00	948,646,000	
フジクラ	331,000	6,855.00	2,269,005,000	
しずおかフィナンシャルク	331,000	1,706.00	564,686,000	
リクルートホールディングス	993,000	7,939.00	7,883,427,000	
オークマ	132,400	3,765.00	498,486,000	
アマダ	331,000	1,537.00	508,747,000	
ディスコ	66,200	34,550.00	2,287,210,000	
日本郵政	331,000	1,337.00	442,547,000	
S M C	33,100	52,070.00	1,723,517,000	
小松製作所	331,000	4,468.00	1,478,908,000	
住友重機械	66,200	2,891.50	191,417,300	貸付株式数 24,800株
日立建機	331,000	4,358.00	1,442,498,000	
クボタ	331,000	1,574.50	521,159,500	
荏原製作所	331,000	2,229.00	737,799,000	
ダイキン工業	331,000	16,275.00	5,387,025,000	
日本精工	331,000	640.60	212,038,600	
N T N	331,000	214.00	70,834,000	
ジェイテクト	331,000	1,083.00	358,473,000	
ミネベアミツミ	331,000	2,010.00	665,310,000	
日立	331,000	4,014.00	1,328,634,000	
三菱電機	331,000	2,955.50	978,270,500	
富士電機	66,200	6,461.00	427,718,200	
安川電機	331,000	3,236.00	1,071,116,000	
ソシオネクスト	331,000	2,492.50	825,017,500	貸付株式数 60,000株
ベイカレント	165,500	7,545.00	1,248,697,500	
ニデック	529,600	2,887.50	1,529,220,000	
オムロン	331,000	3,818.00	1,263,758,000	
ジーエス・ユアサ コーポ	66,200	2,491.50	164,937,300	
日本電気	165,500	4,036.00	667,958,000	

富士通	331,000	3,464.00	1,146,584,000	
ルネサスエレクトロニクス	331,000	1,865.50	617,480,500	
セイコーエプソン	662,000	1,836.00	1,215,432,000	
パナソニック ホールディング	331,000	1,503.50	497,658,500	
シャープ	331,000	673.40	222,895,400	貸付株式数 5,700株
ソニーグループ	1,655,000	3,736.00	6,183,080,000	
T D K	4,965,000	1,511.50	7,504,597,500	
アルプスアルパイン	331,000	1,372.50	454,297,500	
横河電機	331,000	3,709.00	1,227,679,000	
アドバンテスト	2,648,000	9,323.00	24,687,304,000	貸付株式数 172,500株
キーエンス	33,100	57,880.00	1,915,828,000	
デンソー	1,324,000	1,898.00	2,512,952,000	
レーザーテック	132,400	14,820.00	1,962,168,000	
カシオ	331,000	1,075.50	355,990,500	貸付株式数 10,000株
ファナック	1,655,000	3,850.00	6,371,750,000	
京セラ	2,648,000	1,707.00	4,520,136,000	
太陽誘電	331,000	2,333.00	772,223,000	貸付株式数 47,600株
村田製作所	794,400	2,084.00	1,655,529,600	
日東電工	1,655,000	2,597.00	4,298,035,000	
カナデビア	66,200	958.00	63,419,600	
三菱重工業	331,000	3,582.00	1,185,642,000	
川崎重工業	33,100	10,670.00	353,177,000	
I H I	33,100	15,855.00	524,800,500	
コンコルディア・フィナンシャル	331,000	937.70	310,378,700	
日産自動車	331,000	358.50	118,663,500	貸付株式数 124,400株
いすゞ自動車	165,500	1,803.50	298,479,250	
トヨタ自動車	1,655,000	2,554.50	4,227,697,500	
日野自動車	331,000	384.40	127,236,400	
三菱自動車工業	33,100	407.60	13,491,560	貸付株式数 12,400株
マツダ	66,200	850.70	56,316,340	
本田技研	1,986,000	1,434.50	2,848,917,000	
スズキ	1,324,000	1,702.00	2,253,448,000	
SUBARU	331,000	2,499.00	827,169,000	
ヤマハ発動機	993,000	1,084.50	1,076,908,500	貸付株式数 373,200株
良品計画	331,000	6,495.00	2,149,845,000	
ニコン	331,000	1,427.00	472,337,000	
オリンパス	1,324,000	1,909.00	2,527,516,000	貸付株式数 30,900株

SCREENホールディングス	132,400	10,390.00	1,375,636,000	
HOYA	165,500	16,480.00	2,727,440,000	
キヤノン	496,500	4,226.00	2,098,209,000	
リコー	331,000	1,276.00	422,356,000	
シチズン時計	331,000	849.00	281,019,000	貸付株式数 115,000株
バンダイナムコHLDGS	993,000	4,817.00	4,783,281,000	
TOPPANホールディングス	165,500	3,613.00	597,951,500	
大日本印刷	331,000	2,119.00	701,389,000	
ヤマハ	993,000	988.90	981,977,700	
任天堂	331,000	11,945.00	3,953,795,000	
伊藤忠	331,000	7,461.00	2,469,591,000	
丸紅	331,000	2,923.00	967,513,000	
豊田通商	993,000	2,999.50	2,978,503,500	
三井物産	662,000	2,971.50	1,967,133,000	
東京エレクトロン	993,000	24,015.00	23,846,895,000	
住友商事	331,000	3,622.00	1,198,882,000	
三菱商事	993,000	2,889.00	2,868,777,000	
高島屋	331,000	1,093.50	361,948,500	貸付株式数 124,400株
丸井グループ	331,000	3,043.00	1,007,233,000	
クレディセゾン	331,000	4,023.00	1,331,613,000	
イオン	331,000	4,483.00	1,483,873,000	
あおぞら銀行	33,100	2,112.50	69,923,750	
三菱UFJフィナンシャルG	331,000	1,953.00	646,443,000	
りそなホールディングス	33,100	1,321.00	43,725,100	
三井住友トラストグルー	66,200	3,806.00	251,957,200	
三井住友フィナンシャルG	99,300	3,605.00	357,976,500	
千葉銀行	331,000	1,295.50	428,810,500	
ふくおかフィナンシャルG	66,200	3,996.00	264,535,200	
みずほフィナンシャルG	33,100	3,923.00	129,851,300	
オリックス	331,000	3,095.00	1,024,445,000	
大和証券G本社	331,000	991.00	328,021,000	
野村ホールディングス	331,000	888.30	294,027,300	
SOMPOホールディングス	198,600	4,424.00	878,606,400	
日本取引所グループ	662,000	1,574.00	1,041,988,000	
MS&AD	297,900	3,256.00	969,962,400	
第一生命HLDGS	132,400	1,082.00	143,256,800	
東京海上HD	496,500	5,920.00	2,939,280,000	
T&Dホールディングス	66,200	3,255.00	215,481,000	
三井不動産	993,000	1,339.50	1,330,123,500	
三菱地所	331,000	2,675.50	885,590,500	

東京建物	165,500	2,611.50	432,203,250	
住友不動産	331,000	5,830.00	1,929,730,000	
東武鉄道	66,200	2,466.00	163,249,200	
東急	165,500	1,710.00	283,005,000	
小田急電鉄	165,500	1,642.00	271,751,000	
京王電鉄	66,200	3,529.00	233,619,800	貸付株式数 12,200株
京成電鉄	496,500	1,358.50	674,495,250	
東日本旅客鉄道	99,300	3,042.00	302,070,600	
西日本旅客鉄道	66,200	3,211.00	212,568,200	
東海旅客鉄道	165,500	3,092.00	511,726,000	
ヤマトホールディングス	331,000	2,002.00	662,662,000	
日本郵船	99,300	5,146.00	510,997,800	
商船三井	99,300	4,993.00	495,804,900	貸付株式数 37,300株
川崎汽船	297,900	2,095.50	624,249,450	
NIPPON EXPRESS	99,300	2,786.00	276,649,800	
日本航空	331,000	2,783.00	921,173,000	
ANAホールディングス	33,100	2,750.00	91,025,000	
日本電信電話	3,310,000	155.00	513,050,000	
KDDI	3,972,000	2,438.00	9,683,736,000	
ソフトバンク	3,310,000	220.80	730,848,000	
東京電力HD	33,100	424.70	14,057,570	
中部電力	33,100	1,717.00	56,832,700	
関西電力	33,100	1,642.00	54,350,200	
東京瓦斯	66,200	4,698.00	311,007,600	貸付株式数 24,800株
大阪瓦斯	66,200	3,651.00	241,696,200	
東宝	33,100	7,965.00	263,641,500	貸付株式数 4,000株
NTTデータグループ	1,655,000	3,994.00	6,610,070,000	
セコム	662,000	5,415.00	3,584,730,000	
コナミグループ	331,000	20,815.00	6,889,765,000	
ニトリホールディングス	165,500	14,305.00	2,367,477,500	
ファーストリテイリング	794,400	46,900.00	37,257,360,000	
ソフトバンクグループ	1,986,000	8,499.00	16,879,014,000	
合計			381,245,909,230	

（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。

武田薬品	50,000株
ダイキン工業	26,000株
アドバンテスト	100,000株
ファーストリテイリング	50,000株

ソフトバンクグループ

156,000株

## (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。

【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)】

(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6月18日から2025年6月16日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	310,011,123	319,000,045
親投資信託受益証券	84,152,954,272	93,148,628,870
未収入金	-	24,890,000
流動資産合計	84,462,965,395	93,492,518,915
資産合計	84,462,965,395	93,492,518,915
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	117,815,199	125,817,834
未払受託者報酬	8,796,710	10,025,462
未払委託者報酬	169,338,022	192,990,998
その他未払費用	1,124,215	1,102,560
流動負債合計	297,074,146	329,936,854
負債合計	297,074,146	329,936,854
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 42,039,157,358	1 43,753,805,701
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	42,126,733,891	49,408,776,360
（分配準備積立金）	17,883,607,423	18,951,680,093
元本等合計	84,165,891,249	93,162,582,061
純資産合計	84,165,891,249	93,162,582,061
負債純資産合計	84,462,965,395	93,492,518,915

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期		第9期	
	自 2023年6月16日 至 2024年6月17日		自 2024年6月18日 至 2025年6月16日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		39,933		622,520
有価証券売買等損益		11,099,218,781		5,882,538,598
営業収益合計		11,099,258,714		5,883,161,118
<b>営業費用</b>				
支払利息		28,613		-
受託者報酬		16,437,526		19,972,473
委託者報酬		316,424,628		384,471,965
その他費用		2,212,891		2,194,005
営業費用合計		335,103,658		406,638,443
営業利益又は営業損失（ ）		10,764,155,056		5,476,522,675
経常利益又は経常損失（ ）		10,764,155,056		5,476,522,675
当期純利益又は当期純損失（ ）		10,764,155,056		5,476,522,675
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（ ）		908,384,730		640,320,636
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		29,120,071,287		42,126,733,891
剰余金増加額又は欠損金減少額		11,179,628,263		12,974,208,672
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		11,179,628,263		12,974,208,672
剰余金減少額又は欠損金増加額		8,028,735,985		10,528,368,242
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		8,028,735,985		10,528,368,242
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		42,126,733,891		49,408,776,360

## (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6月18日 至2025年6月16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6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2024年6月17日としており、2025年6月15日が休日のため、当計算期間末日を2025年6月16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	第9期
	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1. 1 期首元本額	39,176,810,504円	42,039,157,358円
期中追加設定元本額	13,600,258,382円	12,127,063,344円
期中一部解約元本額	10,737,911,528円	10,412,415,001円
2. 計算期間末日における受益権の総数	42,039,157,358口	43,753,805,701口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第8期	第9期
	自2023年6月16日 至2024年6月17日	自2024年6月18日 至2025年6月16日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(15,610円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(9,809,962,827円)、投資信託約款に規定される収益調整金(24,243,126,468円)及び分配準備積立金(8,073,628,986円)より分配対象額は42,126,733,891円(1万口当たり10,020.83円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(577,797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(4,835,624,242円)、投資信託約款に規定される収益調整金(30,457,096,267円)及び分配準備積立金(14,115,478,054円)より分配対象額は49,408,776,360円(1万口当たり11,292.45円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第9期
	2025年6月16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	第9期
	2024年6月17日現在	2025年6月16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	10,489,724,984	5,449,141,104
合計	10,489,724,984	5,449,141,104

## (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	第9期
2024年6月17日現在	2025年6月16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6月18日
至2025年6月16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	第9期
	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	2.0021円	2.1292円
(1万口当たり純資産額)	(20,021円)	(21,292円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	27,763,294,349	93,148,628,870	
親投資信託受益証券 合計			93,148,628,870	
合計			93,148,628,870	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」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6月17日現在 金額 (円)	2025年6月16日現在 金額 (円)
資産の部		
流動資産		

預金		636,043,580	1,317,930,736
コール・ローン		5,225,800,578	4,032,670,944
株式		111,112,073,954	132,137,357,958
投資証券		2,152,155,033	2,470,068,827
派生商品評価勘定		345,743,523	286,869,439
未収入金		1,130,438	3,845,546
未収配当金		137,851,894	140,409,863
差入委託証拠金		1,810,735,932	2,503,539,813
流動資産合計		121,421,534,932	142,892,693,126
資産合計		121,421,534,932	142,892,693,126
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		458,372,784	1,234,407,518
未払解約金		7,080,100	88,200,070
流動負債合計		465,452,884	1,322,607,588
負債合計		465,452,884	1,322,607,588
純資産の部			
元本等			
元本	1	38,512,369,700	42,195,690,404
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		82,443,712,348	99,374,395,134
元本等合計		120,956,082,048	141,570,085,538
純資産合計		120,956,082,048	141,570,085,538
負債純資産合計		121,421,534,932	142,892,693,126

## 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6月18日 至2025年6月16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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

#### (2)新株予約権証券

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、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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

#### (3)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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

## 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法

### (1)先物取引

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1. 1 期首	2023年6月16日	2024年6月18日
期首元本額	34,080,983,566円	38,512,369,700円
期中追加設定元本額	13,674,132,324円	15,192,083,833円
期中一部解約元本額	9,242,746,190円	11,508,763,129円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国株式	26,794,330,650円	27,763,294,349円
インデックス（為替ヘッジあり）		

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(為替ヘッジあり)	982,447,980円	1,180,553,479円
i F r e e 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)	3,431,057,533円	3,929,629,899円
ダイワ先進国株式インデックス(為替ヘッジあり)(投資一任専用)	883,016円	621,682円
ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)	7,303,650,521円	9,095,282,929円
外国株式インデックス為替ヘッジ型ファンドVA(適格機関投資家専用)	-円	226,308,066円
計	38,512,369,700円	42,195,690,404円
2. 期末日における受益権の総数	38,512,369,700口	42,195,690,404口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所(外国の取引所)における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産について為替変動リスクを回避すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	---

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年6月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2024年6月17日現在	2025年6月16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	12,071,986,049	2,906,142,354
新株予約権証券	0	0
投資証券	57,929,406	84,095,059
合計	12,014,056,643	2,990,237,413

(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6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株値指数 先物取引								
買建	7,770,809,548	-	7,922,332,463	151,522,915	7,028,050,976	-	7,298,509,513	270,458,537
合計	7,770,809,548	-	7,922,332,463	151,522,915	7,028,050,976	-	7,298,509,513	270,458,537

## (注) 1. 時価の算定方法

株値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. 株値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6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売建	112,992,750,187	-	113,256,902,363	264,152,176	135,923,571,413	-	137,141,568,029	1,217,996,616
アメリカ・ドル	84,682,068,669	-	85,049,813,019	367,744,350	103,712,228,720	-	104,418,262,215	706,033,495
イギリス・ ポンド	4,890,336,769	-	4,886,729,590	3,607,179	5,429,552,602	-	5,489,671,105	60,118,503
イスラエル・ シェケル	138,042,327	-	137,790,205	252,122	209,420,539	-	204,897,117	4,523,422

オーストラリア・ドル	2,317,050,365	-	2,309,052,569	7,997,796	2,463,090,235	-	2,493,700,312	30,610,077
カナダ・ドル	3,623,736,477	-	3,605,522,946	18,213,531	4,354,200,481	-	4,420,364,928	66,164,447
シンガポール・ドル	397,697,254	-	398,459,686	762,432	514,808,339	-	520,170,570	5,362,231
スイス・フラン	2,986,745,016	-	3,030,306,200	43,561,184	3,514,319,718	-	3,572,142,987	57,823,269
スウェーデン・クローナ	1,069,774,556	-	1,073,037,607	3,263,051	1,176,599,002	-	1,189,730,456	13,131,454
デンマーク・クローネ	1,228,248,419	-	1,215,682,884	12,565,535	888,262,439	-	905,968,489	17,706,050
ニュージーランド・ドル	72,556,398	-	72,638,907	82,509	72,083,475	-	72,881,744	798,269
ノルウェー・クローネ	215,030,616	-	212,387,663	2,642,953	240,799,415	-	248,856,824	8,057,409
ユーロ	10,763,769,137	-	10,654,821,327	108,947,810	12,642,252,280	-	12,895,869,086	253,616,806
香港・ドル	607,694,184	-	610,659,760	2,965,576	705,954,168	-	709,052,196	3,098,028
合計	112,992,750,187	-	113,256,902,363	264,152,176	135,923,571,413	-	137,141,568,029	1,217,996,616

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	3.1407円	3.3551円
(1万口当たり純資産額)	(31,407円)	(33,551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	1,566	237.180	371,423.880	
	PALO ALTO NETWORKS INC	8,948	196.270	1,756,223.960	
	FIRST SOLAR INC	1,358	175.200	237,921.600	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	2,316	158.190	366,368.040	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,694	103.300	174,990.200	
	SYNCHRONY FINANCIAL	5,506	59.840	329,479.040	
	ABBOTT LABORATORIES	23,362	135.620	3,168,354.440	
	HOWMET AEROSPACE INC	5,151	171.200	881,851.200	
	VERISK ANALYTICS INC	1,935	310.410	600,643.350	
	LAS VEGAS SANDS CORP	5,059	40.330	204,029.470	
	AMPHENOL CORP-CL A	16,330	92.490	1,510,361.700	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	719	673.010	483,894.190	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	7,323	79.350	581,080.050	
	AFLAC INC	7,141	102.180	729,667.380	
	DARDEN RESTAURANTS INC	1,570	217.500	341,475.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	2,195	138.170	303,283.150	
	ADOBE INC	5,794	391.680	2,269,393.920	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,424	99.930	242,230.320	
	LULULEMON ATHLETICA INC	1,473	239.110	352,209.030	
	GARMIN LTD	2,084	201.320	419,550.880	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	3,040	280.370	852,324.800	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	8,761	224.290	1,965,004.690	
	WR BERKLEY CORP	4,068	73.290	298,143.720	
	AUTOZONE INC	239	3,642.600	870,581.400	
	DOLLAR TREE INC	2,880	95.190	274,147.200	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	15,765	16.990	267,847.350	
	DR HORTON INC	3,856	123.080	474,596.480	
	AUTODESK INC	2,859	292.160	835,285.440	
	MOODY'S CORP	2,230	471.880	1,052,292.400	
	DEVON ENERGY CORP	8,416	35.110	295,485.760	
ATMOS ENERGY CORP	2,083	152.990	318,678.170		
ALLIANT ENERGY CORP	3,469	61.080	211,886.520		

CITIGROUP INC	25,536	76.360	1,949,928.960	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	5,469	306.820	1,677,998.580	
AMERICAN ELECTRIC POWER	7,235	102.900	744,481.500	
DOMINO'S PIZZA INC	507	452.150	229,240.050	
HESS CORP	3,730	142.260	530,629.800	
DAVITA INC	609	136.120	82,897.080	
DANAHER CORP	8,849	200.670	1,775,728.830	
FORTIVE CORP	4,657	69.430	323,335.510	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	7,835	178.440	1,398,077.400	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	6,706	52.000	348,712.000	
APPLE INC	204,063	196.450	40,088,176.350	
BOEING CO/THE	10,142	200.320	2,031,645.440	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,113	146.360	309,258.680	
BECTON DICKINSON AND CO	3,877	172.210	667,658.170	
LEIDOS HOLDINGS INC	1,682	149.160	250,887.120	
NISOURCE INC	6,611	39.520	261,266.720	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,604	93.540	150,038.160	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	9,684	88.600	858,002.400	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	56,867	43.010	2,445,849.670	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	18,159	487.540	8,853,238.860	
ANSYS INC	1,167	338.010	394,457.670	
TRUIST FINANCIAL CORP	17,886	38.970	697,017.420	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	9,832	136.410	1,341,183.120	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	27,375	49.750	1,361,906.250	
JPMORGAN CHASE & CO	37,969	264.950	10,059,886.550	
T ROWE PRICE GROUP INC	3,055	91.580	279,776.900	
LKQ CORP	3,687	38.120	140,548.440	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2,398	26.440	63,403.120	
CADENCE DESIGN SYS INC	3,728	300.000	1,118,400.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,252	501.680	628,103.360	
DOLLAR GENERAL CORP	2,977	111.680	332,471.360	
SERVICENOW INC	2,830	988.660	2,797,907.800	
CATERPILLAR INC	6,518	357.050	2,327,251.900	
BROWN & BROWN INC	3,273	106.620	348,967.260	
ESSENTIAL UTILITIES INC	3,706	38.050	141,013.300	
CMS ENERGY CORP	4,033	70.530	284,447.490	
DELTA AIR LINES INC	2,319	47.040	109,085.760	
CORNING INC	10,970	49.600	544,112.000	
CISCO SYSTEMS INC	53,780	64.090	3,446,760.200	

MORGAN STANLEY	16,288	129.490	2,109,133.120	
DECKERS OUTDOOR CORP	2,100	101.480	213,108.000	
MSCI INC	1,080	542.730	586,148.400	
FAIR ISAAC CORP	349	1,784.570	622,814.930	
LENNOX INTERNATIONAL INC	370	538.090	199,093.300	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,998	79.160	237,321.680	
BROADCOM INC	60,680	248.700	15,091,116.000	
UNITED THERAPEUTICS CORP	600	283.350	170,010.000	
CNH INDUSTRIAL NV	11,900	12.570	149,583.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	800	176.740	141,392.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,705	307.990	525,122.950	
DTE ENERGY COMPANY	2,890	135.220	390,785.800	
CENTENE CORP	6,764	55.220	373,508.080	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,382	225.810	312,069.420	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	6,165	40.330	248,634.450	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,420	316.640	1,082,908.800	
GARTNER INC	1,023	404.970	414,284.310	
DOMINION ENERGY INC	11,328	55.510	628,817.280	
MONSTER BEVERAGE CORP	9,856	63.060	621,519.360	
DEERE & CO	3,509	509.590	1,788,151.310	
QUANTA SERVICES INC	2,026	358.260	725,834.760	
POOL CORP	480	288.900	138,672.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	3,394	74.620	253,260.280	
BURLINGTON STORES INC	866	228.830	198,166.780	
NASDAQ INC	5,841	85.590	499,931.190	
TARGA RESOURCES CORP	2,831	174.810	494,887.110	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	874	123.870	108,262.380	
CONSOLIDATED EDISON INC	4,676	103.960	486,116.960	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,128	139.850	157,750.800	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	994	221.910	220,578.540	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	2,106	282.550	595,050.300	
MOLINA HEALTHCARE INC	783	298.140	233,443.620	
CARLISLE COS INC	600	356.940	214,164.000	
IDEX CORP	960	177.820	170,707.200	
COLGATE-PALMOLIVE CO	10,481	90.260	946,015.060	
ROLLINS INC	3,960	56.880	225,244.800	
AECOM	1,900	111.990	212,781.000	
WATSCO INC	500	431.990	215,995.000	
GRACO INC	2,400	83.540	200,496.000	

AMETEK INC	3,065	176.960	542,382.400	
CHURCH & DWIGHT CO INC	3,347	97.090	324,960.230	
HEICO CORP	635	305.500	193,992.500	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	521	419.900	218,767.900	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3,506	60.100	210,710.600	
TYLER TECHNOLOGIES INC	614	579.720	355,948.080	
COSTCO WHOLESALE CORP	6,020	990.210	5,961,064.200	
RPM INTERNATIONAL INC	1,836	108.080	198,434.880	
RELIANCE INC	700	310.120	217,084.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	18,400	50.240	924,416.000	
CUMMINS INC	1,895	319.530	605,509.350	
CDW CORP/DE	1,787	170.420	304,540.540	
COSTAR GROUP INC	5,663	81.160	459,609.080	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,556	160.180	409,420.080	
INTERACTIVE BROKERS GRO-CL A	1,500	202.160	303,240.000	
MERCADOLIBRE INC	609	2,371.980	1,444,535.820	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	990	179.100	177,309.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,287	243.880	801,633.560	
DEXCOM INC	5,335	81.990	437,416.650	
NORDSON CORP	672	214.360	144,049.920	
COPART INC	11,736	48.590	570,252.240	
DIAMONDBACK ENERGY INC	2,550	154.910	395,020.500	
ALIGN TECHNOLOGY INC	962	177.850	171,091.700	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	1,138	374.080	425,703.040	
TRANSDIGM GROUP INC	760	1,439.610	1,094,103.600	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	1,526	124.390	189,819.140	
KINDER MORGAN INC	27,043	27.640	747,468.520	
HCA HEALTHCARE INC	2,545	371.180	944,653.100	
COTERRA ENERGY INC	10,277	26.700	274,395.900	
T-MOBILE US INC	6,216	228.000	1,417,248.000	
ZILLOW GROUP INC - C	2,086	70.370	146,791.820	
EMCOR GROUP INC	600	477.920	286,752.000	
COCA-COLA CO/THE	55,333	71.020	3,929,749.660	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	2,875	92.850	266,943.750	
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,925	114.260	219,950.500	
CSX CORP	26,131	32.120	839,327.720	
EXPEDIA GROUP INC	1,696	165.630	280,908.480	
AMAZON.COM INC	129,785	212.100	27,527,398.500	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,044	75.150	604,506.600	

EXXON MOBIL CORP	58,729	112.120	6,584,695.480	
EVEREST GROUP LTD	596	334.610	199,427.560	
EOG RESOURCES INC	7,552	125.280	946,114.560	
EQT CORP	7,703	56.840	437,838.520	
AKAMA I TECHNOLOGIES INC	2,010	77.030	154,830.300	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	134	1,818.680	243,703.120	
CENCORA INC	2,362	295.540	698,065.480	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	4,015	117.080	470,076.200	
FORD MOTOR CO	52,678	10.430	549,431.540	
ENTEGRIS INC	2,093	75.340	157,686.620	
MICROSTRATEGY INC-CL A	3,400	382.870	1,301,758.000	
AERCAP HOLDINGS NV	2,701	115.840	312,883.840	
FORTINET INC	8,769	100.830	884,178.270	
MARKEL CORP	170	1,928.770	327,890.900	
NEXTERA ENERGY INC	27,793	74.780	2,078,360.540	
FREEPORT-MCMORAN INC	19,350	40.940	792,189.000	
INSULET CORP	909	304.630	276,908.670	
US BANCORP	21,120	42.990	907,948.800	
UNITED RENTALS INC	896	694.840	622,576.640	
F5 NETWORKS INC	759	286.610	217,536.990	
SUPER MICRO COMPUTER INC	7,400	41.560	307,544.000	
FASTENAL CO	15,484	42.170	652,960.280	
FISERV INC	7,703	163.020	1,255,743.060	
GENERAL ELECTRIC CO	14,612	236.600	3,457,199.200	
AXON ENTERPRISE INC	1,000	780.630	780,630.000	
GENERAL MOTORS CO	13,042	48.650	634,493.300	
GENERAL DYNAMICS CORP	3,162	283.000	894,846.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	4,189	613.540	2,570,119.060	
ALPHABET INC-CL A	79,168	174.670	13,828,274.560	
ALPHABET INC-CL C	67,340	175.880	11,843,759.200	
OWENS CORNING	1,183	134.490	159,101.670	
GENERAL MILLS INC	7,435	53.560	398,218.600	
FIRSTENERGY CORP	7,703	40.340	310,739.020	
GENUINE PARTS CO	1,854	119.680	221,886.720	
FIFTH THIRD BANCORP	9,420	37.980	357,771.600	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,613	256.990	671,514.870	
HALLIBURTON CO	11,933	23.190	276,726.270	
HOME DEPOT INC	13,454	354.660	4,771,595.640	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	20,448	15.510	317,148.480	

HERSHEY CO/THE	2,015	169.120	340,776.800	
HUMANA INC	1,608	235.260	378,298.080	
NXP SEMICONDUCTORS NV	3,409	210.900	718,958.100	
HP INC	12,705	23.840	302,887.200	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	18,538	17.650	327,195.700	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	5,063	90.990	460,682.370	
KRAFT HEINZ CO/THE	12,698	26.080	331,163.840	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	12,533	277.220	3,474,398.260	
HUBBELL INC	739	382.030	282,320.170	
INTERNATIONAL PAPER CO	6,724	45.890	308,564.360	
ZOETIS INC	6,098	164.330	1,002,084.340	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	3,032	421.390	1,277,654.480	
CHENIERE ENERGY INC	2,978	238.340	709,776.520	
HYATT HOTELS CORP - CL A	600	130.560	78,336.000	
ALLEGION PLC	1,242	135.300	168,042.600	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	1,600	111.290	178,064.000	
WASTE CONNECTIONS INC	3,542	190.670	675,353.140	
JUNIPER NETWORKS INC	3,998	35.770	143,008.460	
JM SMUCKER CO/THE	1,425	95.720	136,401.000	
JOHNSON & JOHNSON	32,694	157.100	5,136,227.400	
ABBVIE INC	23,859	191.080	4,558,977.720	
HOLOGIC INC	3,173	64.750	205,451.750	
KIMBERLY-CLARK CORP	4,477	130.840	585,770.680	
KROGER CO	8,492	65.560	556,735.520	
KLA CORP	1,798	867.670	1,560,070.660	
LOCKHEED MARTIN CORP	2,941	486.450	1,430,649.450	
CORPAY INC	940	323.250	303,855.000	
LOWE'S COS INC	7,553	217.270	1,641,040.310	
ELI LILLY & CO	10,965	819.360	8,984,282.400	
LAM RESEARCH CORP	17,390	89.520	1,556,752.800	
LOEWS CORP	2,628	88.660	232,998.480	
MCDONALD'S CORP	9,709	301.910	2,931,244.190	
3M CO	7,408	142.320	1,054,306.560	
META PLATFORMS INC CLASS A	29,767	682.870	20,326,991.290	
S&P GLOBAL INC	4,306	501.490	2,159,415.940	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	755	542.470	409,564.850	
PHILLIPS 66	5,633	122.150	688,070.950	
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	2,189	196.820	430,838.980	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,388	74.010	250,745.880	

METLIFE INC	8,021	77.350	620,424.350	
MARVELL TECHNOLOGY INC	11,668	67.190	783,972.920	
ARISTA NETWORKS INC	14,540	92.350	1,342,769.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,261	408.100	922,714.100	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	282	1,155.420	325,828.440	
BAKER HUGHES CO	13,417	39.040	523,799.680	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,500	317.850	476,775.000	
MERCK & CO. INC.	34,171	81.710	2,792,112.410	
DUPONT DE NEMOURS INC	5,719	66.870	382,429.530	
MASCO CORP	2,987	61.880	184,835.560	
M & T BANK CORP	2,243	178.030	399,321.290	
MARSH & MCLENNAN COS	6,554	217.380	1,424,708.520	
HEICO CORP-CLASS A	1,047	238.790	250,013.130	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	3,209	254.990	818,262.910	
WORKDAY INC-CLASS A	2,900	244.540	709,166.000	
BLOCK INC CLASS A	7,470	61.570	459,927.900	
TRANSUNION	2,657	83.980	223,134.860	
VISTRA CORP	4,557	173.750	791,778.750	
NETAPP INC	2,697	100.490	271,021.530	
NIKE INC -CL B	15,953	60.530	965,635.090	
NORFOLK SOUTHERN CORP	3,119	248.600	775,383.400	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	7,272	65.730	477,988.560	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,596	145.620	378,029.520	
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,853	516.720	957,482.160	
NEWMONT CORP	15,404	57.900	891,891.600	
MCKESSON CORP	1,656	728.200	1,205,899.200	
XYLEM INC	3,266	125.500	409,883.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	21,045	184.330	3,879,224.850	
NUCOR CORP	3,279	121.920	399,775.680	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	2,150	710.850	1,528,327.500	
GODADDY INC - CLASS A	1,930	175.740	339,178.200	
EVERGY INC	3,223	67.985	219,115.650	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	9,524	46.450	442,389.800	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	269	356.760	95,968.440	
OKTA INC	2,295	97.480	223,716.600	
WIX.COM LTD	685	149.100	102,133.500	
EQUITABLE HOLDINGS INC	4,393	51.610	226,722.730	
KKR & CO INC	8,354	121.330	1,013,590.820	
PAYCHEX INC	4,423	153.220	677,692.060	

O'REILLY AUTOMOTIVE INC	12,285	89.910	1,104,544.350	
ALTRIA GROUP INC	22,902	59.810	1,369,768.620	
P G & E CORP	29,748	13.640	405,762.720	
PFIZER INC	76,611	24.540	1,880,033.940	
CIGNA CORP	3,753	317.400	1,191,202.200	
DELL TECHNOLOGIES -C	4,376	109.560	479,434.560	
XCEL ENERGY INC	7,820	67.620	528,788.400	
STERIS PLC	1,293	241.340	312,052.620	
SEA LTD-ADR	5,247	154.380	810,031.860	
FOX CORP - CLASS B	1,930	49.300	95,149.000	
FOX CORP - CLASS A	2,995	53.690	160,801.550	
STRYKER CORP	4,646	377.300	1,752,935.800	
DOW INC	9,760	29.900	291,824.000	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	1,567	137.260	215,086.420	
ZOOM COMMUNICATIONS INC CLASS A	3,413	76.630	261,538.190	
PARKER HANNIFIN CORP	1,726	654.090	1,128,959.340	
UBER TECHNOLOGIES INC	25,624	83.930	2,150,622.320	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	31,848	160.280	5,104,597.440	
EXELON CORP	13,553	43.250	586,167.250	
INGERSOLL-RAND INC	5,426	80.500	436,793.000	
NVR INC	39	7,225.670	281,801.130	
CONOCOPHILLIPS	17,502	96.960	1,696,993.920	
TWILIO INC - A	1,953	113.390	221,450.670	
DOCUSIGN INC	2,833	74.060	209,811.980	
PAYCOM SOFTWARE INC	700	245.000	171,500.000	
PURE STORAGE INC - CLASS A	4,200	51.650	216,930.000	
PEPSICO INC	18,450	130.850	2,414,182.500	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	700	386.690	270,683.000	
MONGODB INC	996	205.630	204,807.480	
SNAP INC - A	15,010	7.940	119,179.400	
CORTEVA INC	9,349	72.430	677,148.070	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,796	102.970	493,844.120	
AMCOR PLC	30,845	9.100	280,689.500	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	3,301	480.620	1,586,526.620	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,590	141.440	366,329.600	
ACCENTURE PLC-CL A	8,398	311.710	2,617,740.580	
PENTAIR PLC	2,222	96.620	214,689.640	
QUALCOMM INC	14,951	154.720	2,313,218.720	

PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,095	75.900	234,910.500	
DATADOG INC - CLASS A	3,790	120.450	456,505.500	
PINTEREST INC- CLASS A	8,296	33.840	280,736.640	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,482	529.240	784,333.680	
REPUBLIC SERVICES INC	3,018	251.260	758,302.680	
BOOKING HOLDINGS INC	446	5,298.380	2,363,077.480	
ROSS STORES INC	4,501	131.845	593,434.340	
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,198	188.560	225,894.880	
RESMED INC	1,997	249.340	497,931.980	
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,527	180.210	275,180.670	
HUBSPOT INC	676	554.590	374,902.840	
REVVITY INC	1,576	93.530	147,403.280	
CARRIER GLOBAL CORP	10,928	71.240	778,510.720	
OTIS WORLDWIDE CORP	5,359	95.820	513,499.380	
AVANTOR INC	9,380	13.070	122,596.600	
CARLYLE GROUP INC/THE	3,173	46.190	146,560.870	
DYNATRACE INC	4,205	53.030	222,991.150	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	6,072	67.960	412,653.120	
REGIONS FINANCIAL CORP	12,697	21.510	273,112.470	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	5,330	34.840	185,697.200	
CHEVRON CORP	22,458	145.910	3,276,846.780	
ZSCALER INC	1,318	301.950	397,970.100	
EDISON INTERNATIONAL	5,211	48.320	251,795.520	
TESLA INC	39,346	325.310	12,799,647.260	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	4,256	208.180	886,014.080	
GEN DIGITAL INC	7,505	29.780	223,498.900	
SYNOPSIS INC	2,063	478.860	987,888.180	
CARVANA CO	1,600	297.030	475,248.000	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	4,052	171.970	696,822.440	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,296	388.720	503,781.120	
DOORDASH INC - A	4,738	218.960	1,037,432.480	
ROBLOX CORP -CLASS A	7,270	97.170	706,425.900	
AIRBNB INC-CLASS A	5,797	135.540	785,725.380	
CBRE GROUP INC - A	4,073	132.970	541,586.810	
SOUTHERN CO/THE	14,774	90.350	1,334,830.900	
SYSCO CORP	6,574	74.290	488,382.460	
TRAVELERS COS INC/THE	3,061	263.470	806,481.670	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	900	111.500	100,350.000	
STEEL DYNAMICS INC	2,027	133.480	270,563.960	

SCHLUMBERGER LTD	19,064	36.300	692,023.200	
AT&T INC	96,923	28.190	2,732,259.370	
ON SEMICONDUCTOR CORP	5,983	51.020	305,252.660	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,229	335.880	1,084,556.520	
SEMPRA ENERGY	8,578	74.080	635,458.240	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	2,096	49.340	103,416.640	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	29,148	137.400	4,004,935.200	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	3,038	127.270	386,646.260	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	2,564	242.710	622,308.440	
TEXAS INSTRUMENTS INC	12,328	195.000	2,403,960.000	
SALESFORCE.COM INC	13,074	258.400	3,378,321.600	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	5,386	132.110	711,544.460	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	8,892	101.970	906,717.240	
TERADYNE INC	2,346	83.080	194,905.680	
UNION PACIFIC CORP	8,209	223.370	1,833,644.330	
MARATHON PETROLEUM CORP	4,250	166.150	706,137.500	
RTX CORP	17,971	145.690	2,618,194.990	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	9,924	100.000	992,400.000	
IQVIA HOLDINGS INC	2,453	156.890	384,851.170	
AMEREN CORPORATION	3,619	95.700	346,338.300	
UNITEDHEALTH GROUP INC	12,369	313.530	3,878,052.570	
APPROVIN CORP CLASS A	3,200	364.490	1,166,368.000	
TOAST INC CLASS A	5,672	41.540	235,614.880	
VERISIGN INC	1,216	279.900	340,358.400	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	9,997	13.420	134,159.740	
ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	10,000	72.600	726,000.000	
VALERO ENERGY CORP	4,288	134.110	575,063.680	
ULTA BEAUTY INC	613	459.170	281,471.210	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	3,608	55.270	199,414.160	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	767	171.070	131,210.690	
ELEVANCE HEALTH INC	3,136	384.550	1,205,948.800	
WALT DISNEY CO/THE	24,475	117.940	2,886,581.500	
WELLS FARGO & CO	44,405	72.360	3,213,145.800	
WASTE MANAGEMENT INC	5,444	236.500	1,287,506.000	
WILLIAMS COS INC	16,502	59.780	986,489.560	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,190	51.540	370,572.600	

WALMART INC	59,667	94.440	5,634,951.480	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,839	91.280	259,143.920	
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	32,500	4.570	148,525.000	
WABTEC CORP	2,269	201.700	457,657.300	
TJX COMPANIES INC	15,165	123.910	1,879,095.150	
WATERS CORP	759	342.300	259,805.700	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	1,200	74.000	88,800.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	697	283.610	197,676.170	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,354	296.330	401,230.820	
WILLIAMS-SONOMA INC	1,700	153.960	261,732.000	
WESTERN DIGITAL CORP	4,944	55.700	275,380.800	
WEC ENERGY GROUP INC	4,320	105.110	454,075.200	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	6,686	81.000	541,566.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	23,360	352.850	8,242,576.000	
PPL CORP	10,376	33.890	351,642.640	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	4,220	296.890	1,252,875.800	
PULTEGROUP INC	2,862	101.610	290,807.820	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	32,748	10.030	328,462.440	
PPG INDUSTRIES INC	3,058	106.300	325,065.400	
NORTHERN TRUST CORP	2,767	107.750	298,144.250	
NVIDIA CORP	331,410	141.970	47,050,277.700	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	5,363	173.370	929,783.310	
DRAFTKINGS INC CLASS A	6,100	36.500	222,650.000	
TYSON FOODS INC-CL A	3,933	54.810	215,567.730	
NETFLIX INC	5,803	1,212.150	7,034,106.450	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	5,197	402.760	2,093,143.720	
NRG ENERGY INC	2,711	152.040	412,180.440	
TEXTRON INC	2,488	77.380	192,521.440	
NEWS CORP - CLASS A	5,349	27.420	146,669.580	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	297	1,119.580	332,515.260	
OMNICOM GROUP	2,711	69.480	188,360.280	
JACOBS SOLUTIONS INC	1,845	125.890	232,267.050	
ORACLE CORP	22,720	215.220	4,889,798.400	
MASTERCARD INC - A	11,098	562.030	6,237,408.940	
ONEOK INC	8,425	83.750	705,593.750	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,466	560.750	822,059.500	
U HAUL NON VOTING SERIES N	1,437	55.100	79,178.700	

ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	2,528	166.560	421,063.680	
EXPAND ENERGY CORP	2,913	116.460	339,247.980	
YUM! BRANDS INC	3,818	144.000	549,792.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2,374	230.230	546,566.020	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	2,476	50.590	125,260.840	
BANK OF AMERICA CORP	98,449	44.090	4,340,616.410	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	604	487.470	294,431.880	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,586	56.220	145,384.920	
AMERICAN EXPRESS CO	7,608	287.790	2,189,506.320	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	6,247	72.250	451,345.750	
LINDE PLC	6,417	465.980	2,990,193.660	
ANALOG DEVICES INC	6,680	225.030	1,503,200.400	
ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	5,300	21.220	112,466.000	
MONDAYCOM LTD	511	279.950	143,054.450	
ADVANCED MICRO DEVICES	21,927	116.160	2,547,040.320	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	3,700	32.050	118,585.000	
NATERA INC	1,700	165.340	281,078.000	
LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER	2,969	96.720	287,161.680	
KENVUE INC	25,896	21.450	555,469.200	
VERALTO CORP	3,332	97.320	324,270.240	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	8,428	84.610	713,093.080	
BUNGE GLOBAL LTD	1,884	81.410	153,376.440	
VERTIV HOLDINGS CLASS A	4,800	110.970	532,656.000	
NUTANIX INC CLASS A	3,400	72.130	245,242.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,483	258.080	898,892.640	
AVERY DENNISON CORP	1,070	174.640	186,864.800	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	6,682	78.950	527,543.900	
EMERSON ELECTRIC CO	7,670	125.540	962,891.800	
AON PLC-CLASS A	2,641	353.000	932,273.000	
AMGEN INC	7,304	295.220	2,156,286.880	
SAMSARA INC CLASS A	3,700	39.210	145,077.000	
EATON CORP PLC	5,336	323.660	1,727,049.760	
COOPER INC	2,692	69.700	187,632.400	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2,151	164.880	354,656.880	
APPLIED MATERIALS INC	10,998	170.590	1,876,148.820	
CME GROUP INC	4,937	269.500	1,330,521.500	
ECOLAB INC	3,424	264.210	904,655.040	

EQUIFAX INC	1,676	264.290	442,950.040	
GILEAD SCIENCES INC	16,793	109.980	1,846,894.140	
KEURIG DR PEPPER INC	17,446	33.020	576,066.920	
HORMEL FOODS CORP	4,080	30.580	124,766.400	
STATE STREET CORP	3,952	96.140	379,945.280	
SOLVENTUM CORP	1,977	73.800	145,902.600	
GE VERNOVA	3,703	478.450	1,771,700.350	
SCHWAB (CHARLES) CORP	23,296	87.360	2,035,138.560	
CRH PUBLIC LIMITED PLC	9,200	90.040	828,368.000	
LABCORP HOLDINGS	1,071	261.120	279,659.520	
BAXTER INTERNATIONAL INC	7,128	30.620	218,259.360	
SMURFIT WESTROCK PLC	7,040	41.980	295,539.200	
FERGUSON ENTERPRISES LTD	2,671	212.850	568,522.350	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,400	264.610	635,064.000	
THE CAMPBELL S COMPANY	2,616	32.790	85,778.640	
CROWN HOLDINGS INC	1,592	99.850	158,961.200	
REDDIT INC CLASS A	1,000	118.180	118,180.000	
TE CONNECTIVITY LTD	4,011	162.620	652,268.820	
BLACKROCK INC	2,002	971.820	1,945,583.640	
CARDINAL HEALTH INC	3,273	161.410	528,294.930	
APTIV HOLDINGS LTD	3,176	67.250	213,586.000	
FEDEX CORP	3,102	224.380	696,026.760	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	8,702	192.830	1,678,006.660	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,494	76.090	265,858.460	
INTEL CORP	58,341	20.140	1,174,987.740	
HARTFORD INSURANCE GROUP INC	3,928	125.230	491,903.440	
ILLINOIS TOOL WORKS	3,843	241.480	928,007.640	
ILLUMINA INC	2,093	86.930	181,944.490	
INTUITIVE SURGICAL INC	4,876	512.180	2,497,389.680	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,239	218.930	271,254.270	
SNAP-ON INC	723	310.000	224,130.000	
DUKE ENERGY CORP	10,407	116.860	1,216,162.020	
TARGET CORP	6,169	95.370	588,337.530	
DOVER CORP	1,884	176.540	332,601.360	
WW GRAINGER INC	616	1,064.230	655,565.680	
JABIL INC	1,500	175.840	263,760.000	
CINTAS CORP	4,896	221.980	1,086,814.080	
CONAGRA BRANDS INC	6,499	21.570	140,183.430	
CLOROX COMPANY	1,727	123.070	212,541.890	

ENERGY CORP	5,846	82.070	479,781.220	
MICROSOFT CORP	95,866	474.960	45,532,515.360	
INCYTE CORP	2,169	67.750	146,949.750	
CVS HEALTH CORP	16,964	67.460	1,144,391.440	
MEDTRONIC PLC	17,289	87.270	1,508,811.030	
MICRON TECHNOLOGY INC	15,126	115.600	1,748,565.600	
CENTERPOINT ENERGY INC	8,772	36.370	319,037.640	
KELLOGG CO	3,742	79.880	298,910.960	
KEYCORP	12,665	15.650	198,207.250	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	18,105	66.930	1,211,767.650	
CHUBB LTD	5,158	286.790	1,479,262.820	
ALLSTATE CORP	3,564	198.920	708,950.880	
EBAY INC	6,502	77.360	502,994.720	
PAYPAL HOLDINGS INC	12,910	70.830	914,415.300	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	3,231	67.310	217,478.610	
TRIMBLE INC	3,299	71.080	234,492.920	
LENNAR CORP-A	3,158	108.610	342,990.380	
PROGRESSIVE CORP	7,896	267.850	2,114,943.600	
PACCAR INC	7,117	91.880	653,909.960	
BIOGEN INC	2,019	130.650	263,782.350	
IDEXX LABORATORIES INC	1,058	522.700	553,016.600	
STARBUCKS CORP	15,262	93.260	1,423,334.120	
PTC INC	1,584	169.340	268,234.560	
EVERSOURCE ENERGY	4,918	65.210	320,702.780	
INTUIT INC	3,820	753.980	2,880,203.600	
BEST BUY CO INC	2,816	69.600	195,993.600	
BALL CORP	3,950	54.370	214,761.500	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	19,874	99.740	1,982,232.760	
ELECTRONIC ARTS INC	3,380	148.480	501,862.400	
VULCAN MATERIALS CO	1,756	260.770	457,912.120	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3,484	455.450	1,586,787.800	
CARNIVAL CORP	13,974	22.410	313,157.340	
COMCAST CORP-CLASS A	51,635	35.010	1,807,741.350	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,300	45.440	104,512.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	16,900	5.610	94,809.000	
アメリカ・ドル 小計			697,112,995.170 (100,677,058,763)	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	80,634	26.310	2,121,480.540

HALEON PLC	121,978	3.961	483,154.850	
WISE PLC CLASS A	9,413	10.270	96,671.510	
BP PLC	217,238	3.863	839,299.010	
UNILEVER PLC	33,390	46.350	1,547,626.500	
BARCLAYS PLC	194,304	3.193	620,412.670	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	114,603	8.700	997,046.100	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	28,299	3.743	105,923.150	
PRUDENTIAL PLC	35,700	8.876	316,873.200	
NATWEST GROUP PLC	103,178	5.134	529,715.850	
BAE SYSTEMS PLC	40,558	19.390	786,419.620	
AVIVA PLC	36,078	6.058	218,560.520	
GSK	55,856	15.115	844,263.440	
INFORMA PLC	17,922	7.762	139,110.560	
MELROSE INDUSTRIES PLC	18,157	4.725	85,791.820	
AUTO TRADER GROUP PLC	12,347	8.158	100,726.820	
DCC PLC	1,276	46.860	59,793.360	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	948	59.450	56,358.600	
HALMA PLC	5,319	31.120	165,527.280	
ENTAIN PLC	8,273	7.514	62,163.320	
JD SPORTS FASHION PLC	33,388	0.760	25,401.590	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	9,871	6.520	64,358.920	
M&G PLC	31,263	2.548	79,658.120	
RELX PLC	25,059	38.950	976,048.050	
DIAGEO PLC	29,984	19.500	584,688.000	
RIO TINTO PLC	15,195	42.885	651,637.570	
STANDARD CHARTERED PLC	27,745	11.455	317,818.970	
TESCO PLC	90,826	3.982	361,669.130	
SMITH & NEPHEW PLC	11,184	10.940	122,352.960	
GLENCORE PLC	139,899	2.917	408,085.380	
SMITHS GROUP PLC	4,766	22.340	106,472.440	
PEARSON PLC	8,299	10.660	88,467.340	
SAINSBURY (J) PLC	22,135	2.868	63,483.180	
NEXT PLC	1,583	127.700	202,149.100	
WHITBREAD PLC	2,465	27.780	68,477.700	
BUNZL PLC	4,444	22.840	101,500.960	
VODAFONE GROUP PLC	273,689	0.737	201,708.790	
CRODA INTERNATIONAL PLC	1,704	30.710	52,329.840	
KINGFISHER PLC	24,703	2.740	67,686.220	
WPP PLC	14,867	5.510	81,917.170	

UNITED UTILITIES GROUP PLC	9,399	11.655	109,545.340		
SEVERN TRENT PLC	3,938	27.050	106,522.900		
RENTOKIL INITIAL PLC	36,742	3.483	127,972.380		
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	9,243	50.960	471,023.280		
SCHRODERS PLC	10,596	3.558	37,700.560		
SSE PLC	14,868	18.150	269,854.200		
BARRATT REDROW PLC	19,293	4.745	91,545.280		
ASTRAZENECA PLC	20,894	109.860	2,295,414.840		
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	83,379	2.529	210,865.490		
3I GROUP PLC	13,116	41.230	540,772.680		
ASHTED GROUP PLC	5,884	42.670	251,070.280		
SAGE GROUP PLC/THE	14,189	12.620	179,065.180		
NATIONAL GRID PLC	65,922	10.630	700,750.860		
LLOYDS BANKING GROUP PLC	816,813	0.765	624,861.940		
IMPERIAL BRANDS PLC	10,684	29.090	310,797.560		
CENTRICA PLC	72,294	1.660	120,008.040		
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	26,781	35.880	960,902.280		
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,460	20.480	91,340.800		
HSBC HOLDINGS PLC	240,839	8.665	2,086,869.930		
ANGLO AMERICAN PLC	13,335	21.135	281,835.220		
MONDI PLC	5,778	11.725	67,747.050		
COMPASS GROUP PLC	22,873	25.540	584,176.420		
BT GROUP PLC	87,192	1.840	160,476.870		
COCA-COLA HBC AG-DI	3,014	39.460	118,932.440		
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	2,135	82.480	176,094.800		
INTERTEK GROUP PLC	2,128	47.620	101,335.360		
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	6,445	110.450	711,850.250		
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2,039	21.280	43,389.920		
ADMIRAL GROUP PLC	3,793	33.000	125,169.000		
ANTOFAGASTA PLC	5,200	17.910	93,132.000		
EXPERIAN PLC	12,394	37.480	464,527.120		
イギリス・ボンド 小計			27,318,380.420 (5,344,294,761)		
イスラエル・ シュケル	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	17,851	28.500	508,753.500	
	AZRIELI GROUP LTD	530	260.000	137,800.000	
	ICL GROUP LTD	8,294	23.690	196,484.860	
	ELBIT SYSTEMS LTD	385	1,616.900	622,506.500	
	BANK HAPOALIM BM	18,333	56.900	1,043,147.700	

	BANK LEUMI LE-ISRAEL	21,975	56.350	1,238,291.250	
	NICE LTD	907	594.600	539,302.200	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	2,264	189.000	427,896.000	
イスラエル・シュケル 小計				4,714,182.010 (188,075,592)	
オーストラリア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	29,120	5.290	154,044.800	
	TELSTRA GROUP LTD	53,342	4.890	260,842.380	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	39,320	29.630	1,165,051.600	
	SGH LTD	2,833	53.680	152,075.440	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	36,006	4.900	176,429.400	
	BHP GROUP LTD	67,914	37.340	2,535,908.760	
	SOUTH32 LTD	62,620	2.940	184,102.800	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	25,090	25.210	632,518.900	
	FORTECUE METALS GROUP LTD	22,377	15.730	351,990.210	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	40,582	38.870	1,577,422.340	
	WESTPAC BANKING CORP	45,298	33.360	1,511,141.280	
	SANTOS LTD	43,240	6.960	300,950.400	
	RIO TINTO LTD	4,906	106.380	521,900.280	
	ORIGIN ENERGY LTD	24,239	11.450	277,536.550	
	XERO LTD	1,921	188.700	362,492.700	
	PRO MEDICUS LTD	812	270.500	219,646.000	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,397	40.320	136,967.040	
	COLES GROUP LTD	17,681	22.220	392,871.820	
	WISETECH GLOBAL LTD	2,603	105.390	274,330.170	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	17,907	22.530	403,444.710	
	EVOLUTION MINING LTD	28,748	9.200	264,481.600	
	REECE LTD	3,155	16.530	52,152.150	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	22,389	179.350	4,015,467.150	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	19,894	23.280	463,132.320	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	16,144	32.200	519,836.800	
	QANTAS AIRWAYS LTD	11,139	10.190	113,506.410	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	5,798	40.210	233,137.580	
	MACQUARIE GROUP LTD	4,785	212.830	1,018,391.550	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	7,462	64.040	477,866.480	
	CSL LTD	6,390	238.860	1,526,315.400	
WESFARMERS LTD	14,974	84.770	1,269,345.980		
COCHLEAR LTD	905	272.850	246,929.250		
BLUESCOPE STEEL LTD	6,110	22.530	137,658.300		

	SUNCORP GROUP LTD	14,965	21.430	320,699.950	
	ASX LTD	2,592	72.770	188,619.840	
	COMPUTERSHARE LTD	6,955	40.650	282,720.750	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	31,872	8.980	286,210.560	
	SONIC HEALTHCARE LTD	5,915	26.890	159,054.350	
	BRAMBLES LTD	19,213	23.030	442,475.390	
	CARSALES.COM LTD	5,460	35.950	196,287.000	
	SIGMA HEALTHCARE LTD	66,293	3.250	215,452.250	
	REA GROUP LTD	733	232.410	170,356.530	
	オーストラリア・ドル 小計			24,191,765.170 (2,268,461,821)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	9,413	73.120	688,278.560	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	5,176	74.200	384,059.200	
	BROOKFIELD RENEWABLE SUBORDINATE V	1,532	43.870	67,208.840	
	CELESTICA INC	1,400	170.260	238,364.000	
	IMPERIAL OIL LTD	2,195	111.150	243,974.250	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	261	4,829.990	1,260,627.390	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	4,004	91.390	365,925.560	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	5,569	124.570	693,730.330	
	INTACT FINANCIAL CORP	2,231	309.500	690,494.500	
	BCE INC	668	31.010	20,714.680	
	FRANCO-NEVADA CORP	2,356	233.330	549,725.480	
	SUNCOR ENERGY INC	15,487	55.670	862,161.290	
	METRO INC/CN	2,550	104.340	266,067.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	4,789	135.420	648,526.380	
	BANK OF NOVA SCOTIA	15,303	73.780	1,129,055.340	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	11,580	92.610	1,072,423.800	
	TORONTO-DOMINION BANK	21,537	96.230	2,072,505.510	
	GREAT-WEST LIFECO INC	3,735	51.190	191,194.650	
	ROYAL BANK OF CANADA	17,390	173.550	3,018,034.500	
	TOURMALINE OIL CORP	4,356	66.630	290,240.280	
	TC ENERGY CORP	12,754	67.350	858,981.900	
	PEMBINA PIPELINE CORP	7,094	52.260	370,732.440	
	BARRICK MINING CORP	21,152	29.320	620,176.640	
	CAE INC	3,752	36.410	136,610.320	
	THOMSON REUTERS CORP	1,897	264.980	502,667.060	

EMPIRE CO LTD 'A'	1,800	51.840	93,312.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	631	103.350	65,213.850	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,860	77.630	144,391.800	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	5,400	32.380	174,852.000	
HYDRO ONE LTD	4,066	49.240	200,209.840	
LOBLAW COMPANIES LTD	1,861	222.310	413,718.910	
STANTEC INC	1,400	144.850	202,790.000	
WSP GLOBAL INC	1,557	271.520	422,756.640	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	974	121.550	118,389.700	
QUEBECOR INC -CL B	1,949	40.250	78,447.250	
EMERA INC	3,924	61.380	240,855.120	
TFI INTERNATIONAL INC	1,024	122.190	125,122.560	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	1,593	38.100	60,693.300	
WHITECAP RESOURCES INC	13,000	9.390	122,070.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	4,543	37.560	170,635.080	
IVANHOE MINES LTD-CL A	8,902	9.880	87,951.760	
AGNICO EAGLE MINES LTD	6,183	169.130	1,045,730.790	
ALAMOS GOLD INC-CLASS A	6,000	37.420	224,520.000	
KINROSS GOLD CORP	15,057	21.460	323,123.220	
BANK OF MONTREAL	9,035	145.290	1,312,695.150	
POWER CORP OF CANADA	6,872	52.290	359,336.880	
LUNDIN GOLD INC	1,600	73.870	118,192.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	14,861	143.180	2,127,797.980	
NUTRIEN LTD	5,974	85.420	510,299.080	
CAMECO CORP	5,402	90.530	489,043.060	
FIRSTSERVICE CORP	522	240.000	125,280.000	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	2,882	68.270	196,754.140	
TELUS CORP	600	21.920	13,152.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	6,174	52.450	323,826.300	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	623	177.990	110,887.770	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	26,018	45.900	1,194,226.200	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	244	2,355.550	574,754.200	
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,647	50.720	184,975.840	
WESTON (GEORGE) LTD	700	267.610	187,327.000	
PAN AMERICAN SILVER CORP	4,423	39.420	174,354.660	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	1,000	134.800	134,800.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	7,120	87.290	621,504.800	
ENBRIDGE INC	26,808	63.370	1,698,822.960	
BROOKFIELD CORP	16,842	78.520	1,322,433.840	

	MANULIFE FINANCIAL CORP	21,267	42.340	900,444.780	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	11,526	109.240	1,259,100.240	
	IA FINANCIAL CORP INC	1,209	142.260	171,992.340	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	1,864	62.920	117,282.880	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	6,599	141.090	931,052.910	
	CGI INC - CLASS A	2,606	147.080	383,290.480	
	IGM FINANCIAL INC	1,318	43.070	56,766.260	
	TMX GROUP LTD	3,490	55.980	195,370.200	
	OPEN TEXT CORP	3,610	38.410	138,660.100	
	SAPUTO INC	2,900	26.520	76,908.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	8,981	21.030	188,870.430	
	FORTIS INC	6,138	65.450	401,732.100	
	RB GLOBAL INC	2,396	144.440	346,078.240	
	LUNDIN MINING CORP	10,100	13.910	140,491.000	
	CENOVUS ENERGY INC	17,331	20.160	349,392.960	
	DOLLARAMA INC	3,434	193.740	665,303.160	
	ALTAGAS LTD	3,901	38.740	151,124.740	
	KEYERA CORP	2,970	42.580	126,462.600	
	ARC RESOURCES LTD	7,934	30.650	243,177.100	
カナダ・ドル 小計				40,181,228.100 (4,269,657,297)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	33,600	2.580	86,688.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	17,800	34.950	622,110.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	30,610	44.450	1,360,614.500	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	22,850	6.940	158,579.000	
	KEPPEL CORP LTD	21,000	7.220	151,620.000	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	35,600	2.250	80,100.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	47,700	16.060	766,062.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	81,200	0.705	57,246.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	104,700	3.950	413,565.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	24,100	7.800	187,980.000	
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	11,400	6.890	78,546.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	13,200	14.000	184,800.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	27,800	3.010	83,678.000	
シンガポール・ドル 小計				4,231,588.500 (476,265,286)	
スイス・フラン	SANDOZ GROUP AG	5,862	42.760	250,659.120	
	GALDERMA GROUP N AG	1,384	111.300	154,039.200	

AVOLTA AG	1,251	42.680	53,392.680	
UBS GROUP AG-REG	44,398	26.100	1,158,787.800	
ROCHE HOLDING AG-BR	442	286.400	126,588.800	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	89	596.000	53,044.000	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	9,484	269.700	2,557,834.800	
SIKA AG-REG	2,058	209.000	430,122.000	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	132,400.000	132,400.000	
ABB LTD-REG	21,349	47.620	1,016,639.380	
SWISS RE AG	4,072	136.400	555,420.800	
NESTLE SA-REG	35,367	84.250	2,979,669.750	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	307	1,014.500	311,451.500	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	550	296.800	163,240.000	
JULIUS BAER GROUP LTD	2,780	52.440	145,783.200	
SGS SA-REG	2,123	84.620	179,648.260	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	342	287.500	98,325.000	
TEMENOS AG - REG	793	59.700	47,342.100	
HELVETIA HOLDING AG-REG	539	185.500	99,984.500	
VAT GROUP AG	357	334.000	119,238.000	
BKW AG	250	172.500	43,125.000	
ALCON INC	6,745	70.900	478,220.500	
SIG GROUP N AG	4,054	15.720	63,728.880	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	377	134.100	50,555.700	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,976	561.200	1,108,931.200	
BALOISE HOLDING AG - REG	550	185.400	101,970.000	
NOVARTIS AG-REG	25,648	97.160	2,491,959.680	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	50	876.500	43,825.000	
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	7,257	150.400	1,091,452.800	
SWISSCOM AG-REG	364	556.500	202,566.000	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	357	89.500	31,951.500	
GEBERIT AG-REG	468	636.400	297,835.200	
GIVAUDAN-REG	125	4,124.000	515,500.000	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,569	104.950	164,666.550	
SONOVA HOLDING AG-REG	684	251.100	171,752.400	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	2,060	69.620	143,417.200	
LONZA GROUP AG-REG	975	568.800	554,580.000	
HOLCIM LTD	7,036	93.100	655,051.600	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	388	798.400	309,779.200	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	639	186.500	119,173.500	
SWISS PRIME SITE-REG	1,070	116.300	124,441.000	

	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	13	13,480.000	175,240.000	
スイス・フラン 小計				19,573,333.800 (3,480,334,483)	
スウェーデン・ クローナ	SAGAX CLASS B	3,211	202.000	648,622.000	
	ERICSSON LM-B SHS	39,125	79.700	3,118,262.500	
	VOLVO AB-B SHS	22,373	264.600	5,919,895.800	
	SKF AB-B SHARES	4,980	206.600	1,028,868.000	
	TELE2 AB-B SHS	8,442	139.900	1,181,035.800	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	22,350	163.000	3,643,050.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	20,544	125.750	2,583,408.000	
	SWEDBANK AB - A SHARES	11,958	247.000	2,953,626.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	8,285	131.100	1,086,163.500	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	8,820	123.300	1,087,506.000	
	SKANSKA AB-B SHS	5,222	228.800	1,194,793.600	
	SANDVIK AB	15,017	210.500	3,161,078.500	
	INVESTOR AB-B SHS	24,378	274.900	6,701,512.200	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	37,832	152.950	5,786,404.400	
	HOLMEN AB-B SHARES	1,114	377.400	420,423.600	
	SECURITAS AB-B SHS	7,595	137.500	1,044,312.500	
	TELIA CO AB	34,471	35.240	1,214,758.040	
	ALFA LAVAL AB	4,075	403.400	1,643,855.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	21,984	135.850	2,986,526.400	
	ASSA ABLOY AB-B	14,117	302.400	4,268,980.800	
	TRELLEBORG AB-B SHS	3,113	344.100	1,071,183.300	
	SAAB AB-B	4,511	460.000	2,075,060.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	1,710	341.000	583,110.000	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	11,089	63.460	703,707.940	
	INDUTRADE AB	4,193	256.400	1,075,085.200	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	2,616	285.000	745,560.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	948	466.600	442,336.800	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	2,048	244.200	500,121.600	
	LIFCO AB-B SHS	3,406	390.200	1,329,021.200	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	22,143	40.390	894,355.770	
BEIJER REF AB	5,166	144.050	744,162.300		
ESSITY AKTIEBOLAG-B	8,595	263.800	2,267,361.000		
BOLIDEN AB	3,947	293.200	1,157,260.400		
EPIROC AB-A	9,282	211.800	1,965,927.600		
EPIROC AB-B	6,023	183.900	1,107,629.700		

	EQT AB	5,390	275.200	1,483,328.000	
	EVOLUTION AB	2,238	669.000	1,497,222.000	
	HEXAGON AB-B SHS	29,242	92.240	2,697,282.080	
	ADDTECH AB-B SHARES	4,014	314.600	1,262,804.400	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,020	339.600	685,992.000	
スウェーデン・クローナ 小計				75,961,593.930 (1,153,856,612)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	45,426	516.200	23,448,901.200	
	DANSKE BANK A/S	9,729	256.000	2,490,624.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	39	12,490.000	487,110.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	14,244	108.050	1,539,064.200	
	CARLSBERG AS-B	1,379	932.400	1,285,779.600	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	4,970	485.500	2,412,935.000	
	COLOPLAST-B	1,779	637.000	1,133,223.000	
	DSV PANALPINA A/S	2,883	1,596.500	4,602,709.500	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	1,340	298.150	399,521.000	
	DEMANT A/S	1,352	281.600	380,723.200	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	70	12,630.000	884,100.000	
	TRYG A/S	5,039	164.800	830,427.200	
	PANDORA A/S	1,183	1,149.000	1,359,267.000	
	GENMAB A/S	887	1,481.000	1,313,647.000	
ORSTED A/S	2,730	273.500	746,655.000		
デンマーク・クローネ 小計				43,314,686.900 (967,216,959)	
ニュージーランド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	18,677	5.870	109,633.990	
	INFRATIL LTD	12,669	10.275	130,173.970	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	25,799	7.965	205,489.030	
	CONTACT ENERGY LTD	11,562	8.990	103,942.380	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	8,427	36.600	308,428.200	
ニュージーランド・ドル 小計				857,667.570 (74,599,926)	
ノルウェー・クローネ	DNB BANK	12,613	278.400	3,511,459.200	
	NORSK HYDRO ASA	20,547	55.240	1,135,016.280	
	ORKLA ASA	10,826	110.000	1,190,860.000	
	TELENOR ASA	9,088	152.500	1,385,920.000	
	EQUINOR ASA	11,801	273.300	3,225,213.300	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,541	388.400	986,924.400	

	MOWI ASA	7,143	188.400	1,345,741.200	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,886	249.000	718,614.000	
	AKER BP ASA	4,241	273.000	1,157,793.000	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	6,195	384.850	2,384,145.750	
	SALMAR ASA	1,013	454.400	460,307.200	
	ノルウェー・クローネ 小計			17,501,994.330 (254,829,038)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	14,794	27.910	412,900.540	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	6,373	38.130	243,002.490	
	EXOR NV	1,143	80.950	92,525.850	
	DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	1,527	41.390	63,202.530	
	DSM FIRMENICH AG	2,549	96.420	245,774.580	
	FERROVIAL	6,181	44.550	275,363.550	
	LOTUS BAKERIES NV	5	8,640.000	43,200.000	
	SYENQO SA	902	67.000	60,434.000	
	CVC CAPITAL PARTNERS PLC	2,933	15.770	46,253.410	
	COVESTRO V AG	2,578	60.400	155,711.200	
	BAYER AG-REG	12,776	27.480	351,084.480	
	EVONIK INDUSTRIES AG	3,091	18.650	57,647.150	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	24,075	23.880	574,911.000	
	COMMERZBANK AG	12,352	28.100	347,091.200	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	2,688	88.840	238,801.920	
	SIEMENS AG-REG	9,848	214.950	2,116,827.600	
	E.ON SE	29,204	15.485	452,223.940	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	3,778	75.300	284,483.400	
	GEA GROUP AG	2,139	59.000	126,201.000	
	CONTINENTAL AG	1,511	76.660	115,833.260	
	BASF SE	11,610	42.120	489,013.200	
	ALLIANZ SE-REG	4,987	341.600	1,703,559.200	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	2,323	67.420	156,616.660	
	RHEINMETALL AG	597	1,795.500	1,071,913.500	
	RWE AG	8,241	35.590	293,297.190	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	8,607	6.882	59,233.370	
	BRENNTAG SE	1,739	60.000	104,340.000	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	5,494	44.000	241,736.000	
	SAP SE	13,799	254.750	3,515,295.250	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,740	553.400	962,916.000	
	ZALANDO SE	3,091	28.500	88,093.500	

HEIDELBERG MATERIALS AG	1,776	176.000	312,576.000	
RATIONAL AG	58	708.500	41,093.000	
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	887	103.600	91,893.200	
SARTORIUS AG-VORZUG	359	205.600	73,810.400	
TALANX AG	804	110.400	88,761.600	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	2,057	33.860	69,650.020	
DELIVERY HERO SE	2,550	22.100	56,355.000	
NEMETSCHKE SE	794	123.800	98,297.200	
SCOUT24 AG	1,040	117.300	121,992.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	3,869	45.650	176,619.850	
KNORR-BREMSE AG	926	83.700	77,506.200	
SIEMENS ENERGY AG	9,018	84.820	764,906.760	
BEIERSDORF AG	1,290	115.450	148,930.500	
MERCK KGAA	1,772	114.800	203,425.600	
ADIDAS AG	2,228	200.000	445,600.000	
HENKEL AG & CO KGAA	1,311	61.700	80,888.700	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	45,403	30.730	1,395,234.190	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	2,759	49.880	137,618.920	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	9,392	50.820	477,301.440	
QIAGEN N.V.	2,946	40.680	119,843.280	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	16,987	35.420	601,679.540	
HANNOVER RUECK SE	827	268.600	222,132.200	
DHL GROUP	12,510	40.770	510,032.700	
DEUTSCHE BOERSE AG	2,449	267.900	656,087.100	
MTU AERO ENGINES AG	738	341.200	251,805.600	
SYMRISE AG	1,726	101.700	175,534.200	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	733	70.650	51,786.450	
VONOVIA SE	9,631	28.320	272,749.920	
LEG IMMOBILIEN SE	1,022	70.550	72,102.100	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	10,952	19.885	217,780.520	
NN GROUP NV	3,687	55.200	203,522.400	
ARCELORMITTAL	6,098	26.080	159,035.840	
HEINEKEN NV	3,754	78.100	293,187.400	
AEGON LTD	18,115	6.028	109,197.220	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	11,973	35.850	429,232.050	
AKZO NOBEL N.V.	2,289	58.080	132,945.120	
WOLTERS KLUWER	3,103	146.450	454,434.350	
ING GROEP NV	40,938	18.006	737,129.620	
KONINKLIJKE KPN NV	50,565	4.097	207,164.800	

ASML HOLDING NV	5,123	664.600	3,404,745.800
ABN AMRO BANK NV-CVA	6,323	22.760	143,911.480
IMCD NV	817	117.450	95,956.650
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	1,034	125.900	130,180.600
ASR NEDERLAND NV	2,047	54.360	111,274.920
ADYEN NV	337	1,656.200	558,139.400
PROSUS NV	17,795	46.680	830,670.600
JDE PEET'S NV	2,435	23.480	57,173.800
INPOST SA	2,468	13.970	34,477.960
ASM INTERNATIONAL NV	611	519.400	317,353.400
RANDSTAD NV	1,226	37.840	46,391.840
HEINEKEN HOLDING NV	1,735	67.550	117,199.250
TOTALENERGIES SE	28,069	54.800	1,538,181.200
MICHELIN (CGDE)	8,741	32.200	281,460.200
AIR LIQUIDE SA	7,522	182.800	1,375,021.600
KERING	1,022	172.580	176,376.760
SCHNEIDER ELECTRIC SE	7,113	220.450	1,568,060.850
BOUYGUES SA	2,624	37.820	99,239.680
BNP PARIBAS	13,238	75.280	996,556.640
THALES SA	1,205	250.600	301,973.000
DANONE	8,397	72.620	609,790.140
CARREFOUR SA	6,992	12.815	89,602.480
L'OREAL	3,128	371.050	1,160,644.400
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	5,842	95.800	559,663.600
LEGRAND SA	3,419	109.900	375,748.100
PERNOD RICARD SA	2,631	89.700	236,000.700
EURAZEO SE	603	58.950	35,546.850
REXEL SA	3,113	24.960	77,700.480
SOCIETE GENERALE SA	9,388	48.440	454,754.720
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	3,580	461.400	1,651,812.000
ACCOR SA	2,614	43.260	113,081.640
CAPGEMINI SE	2,006	150.400	301,702.400
PUBLICIS GROUPE	2,984	95.060	283,659.040
BUREAU VERITAS SA	4,257	29.200	124,304.400
EIFFAGE	945	118.200	111,699.000
SODEXO SA	1,085	55.500	60,217.500
IPSEN	460	103.300	47,518.000
AMUNDI SA	751	66.900	50,241.900
TELEPERFORMANCE	749	90.740	67,964.260

EURONEXT NV	1,079	142.000	153,218.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	1,852	60.320	111,712.640	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	369	199.050	73,449.450	
ESSILORLUXOTTICA	3,868	242.000	936,056.000	
DASSAULT AVIATION SA	274	304.200	83,350.800	
FDJ UNITED	1,287	31.840	40,978.080	
AXA SA	23,048	41.620	959,257.760	
EDENRED	3,410	25.420	86,682.200	
RENAULT SA	2,649	43.040	114,012.960	
HERMES INTERNATIONAL	412	2,295.000	945,540.000	
STMICROELECTRONICS NV	9,177	25.590	234,839.430	
DASSAULT SYSTEMES SE	8,724	31.680	276,376.320	
ORANGE	24,270	12.750	309,442.500	
ALSTOM	4,483	18.850	84,504.550	
SANOFI	14,787	86.800	1,283,511.600	
VINCI SA	6,433	124.650	801,873.450	
AIRBUS SE	7,729	161.580	1,248,851.820	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	9,171	30.200	276,964.200	
CREDIT AGRICOLE SA	13,873	15.845	219,817.680	
BIOMERIEUX	578	120.600	69,706.800	
ENGIE	23,807	19.875	473,164.120	
SAFRAN SA	4,684	253.200	1,185,988.800	
ARKEMA	650	60.250	39,162.500	
ADP	470	107.800	50,666.000	
GETLINK SE	4,114	16.430	67,593.020	
BOLLORE	8,529	5.230	44,606.670	
UCB SA	1,648	163.450	269,365.600	
KBC GROUP NV	2,994	84.180	252,034.920	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,067	72.000	76,824.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	13,189	61.960	817,190.440	
AGEAS	1,934	56.550	109,367.700	
D' IETEREN GROUP	296	176.900	52,362.400	
ELIA GROUP SA/NV	705	92.800	65,424.000	
SOFINA	210	253.600	53,256.000	
ARGENX SE	787	502.600	395,546.200	
PRYSMIAN SPA	3,856	55.800	215,164.800	
GENERALI	12,273	30.820	378,253.860	
MEDIOBANCA SPA	6,709	19.185	128,712.160	
TENARIS SA	5,705	15.550	88,712.750	

UNICREDIT SPA	18,162	56.150	1,019,796.300	
UNIPOL GRUPPO SPA	4,636	16.755	77,676.180	
TELECOM ITALIA SPA	143,071	0.375	53,651.620	
INTESA SANPAOLO	196,851	4.820	948,920.240	
POSTE ITALIANE SPA	6,337	18.670	118,311.790	
MONCLER SPA	3,226	50.700	163,558.200	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	1,602	54.350	87,068.700	
ENI SPA	27,790	14.002	389,115.580	
BPER BANCA	13,730	7.550	103,661.500	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	7,862	5.632	44,278.780	
BANCO BPM SPA	16,647	9.916	165,071.650	
DIASORIN SPA	277	93.320	25,849.640	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	4,568	10.140	46,319.520	
NEXI SPA	6,511	4.837	31,493.700	
BANCA MEDIOLANUM SPA	3,210	14.150	45,421.500	
LEONARDO SPA	5,263	48.610	255,834.430	
ENEL SPA	105,795	7.982	844,455.690	
SNAM SPA	27,553	5.256	144,818.560	
TERNA SPA	19,186	8.942	171,561.210	
FINECOBANK SPA	8,199	19.090	156,518.910	
STELLANTIS NV	26,415	8.483	224,078.440	
FERRARI NV	1,640	401.500	658,460.000	
TELEFONICA SA	54,478	4.594	250,271.930	
ENDESA SA	4,398	27.220	119,713.560	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	74,966	12.955	971,184.530	
IBERDROLA SA	75,788	16.205	1,228,144.540	
BANCO DE SABADELL SA	74,115	2.778	205,891.470	
BANKINTER SA	9,679	11.020	106,662.580	
REPSOL SA	15,621	12.255	191,435.350	
GRIFOLS SA	4,069	10.195	41,483.450	
BANCO SANTANDER SA	197,093	6.859	1,351,860.880	
AMADEUS IT GROUP SA	5,872	70.660	414,915.520	
CAIXABANK SA	51,415	7.300	375,329.500	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	17,844	3.726	66,486.740	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,317	56.350	130,562.950	
AENA SME SA	1,029	230.400	237,081.600	
CELLNEX TELECOM SA	6,891	32.970	227,196.270	
ACCIONA SA	291	145.200	42,253.200	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	14,189	45.720	648,721.080	

	RED ELECTRICA CORPORACION SA	5,772	17.730	102,337.560	
	UPM-KYMMENE OYJ	7,324	23.040	168,744.960	
	NOKIA OYJ	69,424	4.490	311,713.760	
	WARTSILA OYJ ABP	6,460	19.245	124,322.700	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	7,978	8.356	66,664.160	
	ELISA OYJ	2,022	45.540	92,081.880	
	SAMPO OYJ-A SHS	31,488	9.104	286,666.750	
	FORTUM OYJ	5,703	16.010	91,305.030	
	KESKO OYJ-B SHS	3,470	20.340	70,579.800	
	KONE OYJ-B	4,430	56.060	248,345.800	
	NESTE OYJ	5,676	10.395	59,002.020	
	ORION OYJ-CLASS B	1,543	63.300	97,671.900	
	METSO CORPORATION	8,549	10.795	92,286.450	
	NORDEA BANK ABP	41,005	12.420	509,282.100	
	VERBUND AG	876	68.300	59,830.800	
	OMV AG	2,041	44.540	90,906.140	
	ERSTE GROUP BANK AG	4,007	70.850	283,895.950	
	RYANAIR HOLDINGS PLC	12,206	23.280	284,155.680	
	AIB GROUP PLC	29,064	6.935	201,558.840	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	13,044	11.965	156,071.460	
	KINGSPAN GROUP PLC	2,010	76.100	152,961.000	
	JERONIMO MARTINS	3,591	21.560	77,421.960	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	42,031	3.609	151,689.870	
	GALP ENERGIA SGPS SA	5,978	15.780	94,332.840	
	EDP RENOVAVEIS SA	4,084	9.500	38,798.000	
	KERRY GROUP PLC-A	1,945	97.050	188,762.250	
	ユーロ 小計			73,885,376.330 (12,306,348,281)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	20,000	51.400	1,028,000.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	32,000	32.750	1,048,000.000	
	MTR CORP	24,000	28.000	672,000.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	20,500	86.550	1,774,275.000	
	SINO LAND CO	54,000	8.300	448,200.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	38,052	47.400	1,803,664.800	
	WHARF HOLDINGS LTD	14,000	23.100	323,400.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	5,000	68.700	343,500.000	
	CLP HOLDINGS LTD	24,000	66.100	1,586,400.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	18,565	25.700	477,120.500	
	HONG KONG & CHINA GAS	162,027	6.800	1,101,783.600	

HANG SENG BANK LTD	11,000	114.800	1,262,800.000	
WH GROUP LTD	129,000	7.520	970,080.000	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	17,000	413.600	7,031,200.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	28,052	33.450	938,339.400	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	8,500	51.500	437,750.000	
AIA GROUP LTD	152,000	69.150	10,510,800.000	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	17,000	26.000	442,000.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	26,000	20.950	544,700.000	
SANDS CHINA LTD	32,200	14.920	480,424.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	19,500	89.600	1,747,200.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	52,000	34.750	1,807,000.000	
香港・ドル 小計			36,778,637.300 (676,359,139)	
合計			132,137,357,958 [132,137,357,958]	

## (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
新株予約 権証券	カナダ・ドル	CONSTELLATION SOFTWARE IN- 28	261.000	0.000	
	カナダ・ドル 小計			0.000 (0)	
新株予約権証券 合計				0 [0]	
投資証券	アメリカ・ドル	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,860	383,494.800	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	4,392	689,104.800	
		BXP INC	2,058	148,381.800	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	1,465	333,770.950	
		EQUITY RESIDENTIAL	4,626	318,638.880	
		EQUINIX INC	1,286	1,147,935.040	
		AMERICAN TOWER CORP	6,257	1,344,003.600	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	4,767	173,518.800	
		KIMCO REALTY CORP	9,371	195,197.930	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	3,800	175,560.000	
		INVITATION HOMES INC	8,188	274,625.520	
		VICI PROPERTIES INC	14,188	455,718.560	
		VENTAS INC	5,894	376,390.840	
		WEYERHAEUSER CO	10,211	273,654.800	
CROWN CASTLE INTL CORP	5,883	578,828.370			

	IRON MOUNTAIN INC	3,972	403,515.480	
	SUN COMMUNITIES INC	1,787	220,891.070	
	PROLOGIS INC	12,536	1,344,862.080	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,237	161,310.070	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	1,545	179,405.400	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	908	258,289.680	
	WELLTOWER INC	8,755	1,334,262.000	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	9,752	169,489.760	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,626	243,656.100	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,366	147,543.760	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	7,913	151,771.340	
	REALTY INCOME CORP	11,786	679,345.040	
	PUBLIC STORAGE	2,101	619,689.950	
	REGENCY CENTERS CORP	2,261	158,835.250	
	UDR INC	4,280	176,464.400	
	WP CAREY INC	2,962	187,613.080	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	4,523	789,127.810	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	2,889	432,194.400	
アメリカ・ドル 小計			14,527,091.360 (2,098,002,534)	
イギリス・ポ ンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	9,796	60,343.360	
	SEGRO PLC	17,980	124,349.680	
イギリス・ポンド 小計			184,693.040 (36,131,499)	
オーストラ リア・ドル	TRANSURBAN GROUP	41,021	593,573.870	
	APA GROUP	16,458	138,247.200	
	SCENTRE GROUP	71,825	264,316.000	
	STOCKLAND	30,751	172,513.110	
	GOODMAN GROUP	26,815	911,173.700	
	VICINITY CENTRES	50,371	127,942.340	
オーストラリア・ドル 小計			2,207,766.220 (207,022,238)	
シンガポール・ ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	54,600	142,506.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	88,426	188,347.380	

シンガポール・ドル 小計			330,853.380 (37,237,548)	
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,592	131,881.280	
	GECINA SA	578	54,910.000	
	KLEPIERRE	2,896	96,320.960	
	COVIVIO	652	33,284.600	
ユーロ 小計			316,396.840 (52,699,058)	
香港・ドル	LINK REIT	36,600	1,539,030.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	51,000	580,380.000	
香港・ドル 小計			2,119,410.000 (38,975,950)	
投資証券 合計			2,470,068,827 [2,470,068,827]	
合計			2,470,068,827 [2,470,068,827]	

新株予約権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	組入株式 時価比率	組入 新株予約 権証券 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	株式 527銘柄	98%	-	2.0%	76.3%
	投資証券 33銘柄				
イギリス・ポンド	株式 71銘柄	99.3%	-	0.7%	4.0%
	投資証券 2銘柄				
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	100%	-	-	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 42銘柄	91.6%	-	8.4%	1.8%
	投資証券 6銘柄				
カナダ・ドル	株式 83銘柄	100%	0%	-	3.2%
	新株予約権証券 1銘柄				
シンガポール・ドル	株式 13銘柄	92.7%	-	7.3%	0.4%
	投資証券 2銘柄				

スイス・フラン	株式	42銘柄	100%	-%	-%	2.6%
スウェーデン・クローナ	株式	40銘柄	100%	-%	-%	0.9%
デンマーク・クローネ	株式	15銘柄	100%	-%	-%	0.7%
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	213銘柄 4銘柄	99.6%	-%	0.4%	9.2%
香港・ドル	株式 投資証券	22銘柄 2銘柄	94.6%	-%	5.4%	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。

【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）】

(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6月18日から2025年6月16日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	82,343,951	179,533,239
親投資信託受益証券	34,935,703,937	47,825,044,345
流動資産合計	35,018,047,888	48,004,577,584
資産合計	35,018,047,888	48,004,577,584
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	11,519,811	76,810,305
未払受託者報酬	3,283,928	4,778,715
未払委託者報酬	63,216,356	91,991,115
その他未払費用	820,896	1,153,010
流動負債合計	78,840,991	174,733,145
負債合計	78,840,991	174,733,145
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 9,619,339,885	1 12,709,688,633
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	25,319,867,012	35,120,155,806
（分配準備積立金）	10,948,399,392	10,387,838,059
元本等合計	34,939,206,897	47,829,844,439
純資産合計	34,939,206,897	47,829,844,439
負債純資産合計	35,018,047,888	48,004,577,584

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期		第9期	
	自	2023年6月16日 至 2024年6月17日	自	2024年6月18日 至 2025年6月16日
<b>営業収益</b>				
受取利息		15,287		274,605
有価証券売買等損益		8,409,173,797		1,798,938,908
営業収益合計		8,409,189,084		1,799,213,513
<b>営業費用</b>				
支払利息		7,504		-
受託者報酬		5,611,997		8,940,053
委託者報酬		108,032,418		172,097,681
その他費用		1,402,824		2,193,268
営業費用合計		115,054,743		183,231,002
営業利益又は営業損失（ ）		8,294,134,341		1,615,982,511
経常利益又は経常損失（ ）		8,294,134,341		1,615,982,511
当期純利益又は当期純損失（ ）		8,294,134,341		1,615,982,511
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（ ）		786,988,409		159,960,725
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		11,199,085,414		25,319,867,012
剰余金増加額又は欠損金減少額		10,610,671,958		14,165,662,796
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		10,610,671,958		14,165,662,796
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,997,036,292		5,821,395,788
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,997,036,292		5,821,395,788
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		25,319,867,012		35,120,155,806

## (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6月18日 至2025年6月16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6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2024年6月17日としており、2025年6月15日が休日のため、当計算期間末日を2025年6月16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	第9期
	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1. 1 期首元本額	6,711,991,187円	9,619,339,885円
期中追加設定元本額	5,219,463,826円	5,294,473,327円
期中一部解約元本額	2,312,115,128円	2,204,124,579円
2. 計算期間末日における受益権の総数	9,619,339,885口	12,709,688,633口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第8期	第9期
	自2023年6月16日 至2024年6月17日	自2024年6月18日 至2025年6月16日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (8,797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 (7,507,130,668円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (14,371,467,620円)及び分配準備積立金(3,441,259,927円)より分配対象額は 25,319,867,012円(1万口当たり26,321.83円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (237,774円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (1,455,784,012円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (24,732,317,747円)及び分配準備積立金(8,931,816,273円)より分配対象額は 35,120,155,806円(1万口当たり27,632.59円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	--	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第9期
	2025年6月16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	第9期
	2024年6月17日現在	2025年6月16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	7,924,732,483	1,678,241,720
合計	7,924,732,483	1,678,241,720

## (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	第9期
2024年6月17日現在	2025年6月16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6月18日
至2025年6月16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	第9期
	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	3.6322円	3.7633円
(1万口当たり純資産額)	(36,322円)	(37,633円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国株式インデックスマザーファンド	6,919,533,009	47,825,044,345	
親投資信託受益証券 合計			47,825,044,345	
合計			47,825,044,345	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

「外国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6月17日現在 金額(円)	2025年6月16日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		

預金		2,236,979,602	1,931,267,490
コール・ローン		11,966,362,644	6,016,732,896
株式		545,633,714,414	659,045,294,969
投資証券		10,592,747,681	12,370,196,711
派生商品評価勘定		569,796,005	915,727,801
未収入金		5,417,991	19,010,700
未収配当金		663,562,906	678,769,379
差入委託証拠金		11,832,320,065	11,917,877,863
流動資産合計		583,500,901,308	692,894,877,809
資産合計		583,500,901,308	692,894,877,809
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		237,964,360	107,927,544
未払解約金		82,052,800	142,631,200
流動負債合計		320,017,160	250,558,744
負債合計		320,017,160	250,558,744
純資産の部			
元本等			
元本	1	87,815,492,483	100,214,393,190
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		495,365,391,665	592,429,925,875
元本等合計		583,180,884,148	692,644,319,065
純資産合計		583,180,884,148	692,644,319,065
負債純資産合計		583,500,901,308	692,894,877,809

## 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6月18日 至2025年6月16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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

## (2)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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

## 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1. 1 期首	2023年6月16日	2024年6月18日
期首元本額	73,496,843,463円	87,815,492,483円
期中追加設定元本額	19,734,159,966円	22,464,610,843円
期中一部解約元本額	5,415,510,946円	10,065,710,136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V	231,333,447円	202,501,703円
A		
ダイワ国内重視バランスファン	1,404,824円	1,294,757円
ド30VA(一般投資家私募)		
ダイワ国内重視バランスファン	18,302,724円	13,002,845円
ド50VA(一般投資家私募)		
ダイワ国際分散バランスファン	3,622,837円	2,898,468円
ド30VA(一般投資家私募)		
ダイワ国際分散バランスファン	105,788,926円	79,141,486円
ド50VA(一般投資家私募)		
外国株式インデックスファンド	104,416,847円	132,624,384円
(FOFs用)(適格機関投資家専		
用)		
ダイワバランスファンド2023-01	80,511,800円	-円
(適格機関投資家専用)		
外国株式インデックスファンド	3,590,641,743円	9,833,826,354円
VA(適格機関投資家専用)		

ダイワファンドラップ 外国株式 インデックス エマージングプラ ス(為替ヘッジなし)	769,541,646円	801,703,799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)	5,260,608,935円	6,919,533,009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)	565,612,570円	630,101,185円
D - I ' s 外国株式インデック ス	16,220,910円	16,195,205円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2050	48,106,388円	46,218,358円
i F r e e 外国株式インデック ス(為替ヘッジなし)	8,593,037,781円	10,941,106,395円
i F r e e 8資産バランス	1,461,674,755円	1,662,950,033円
i F r e e 年金バランス	334,612,172円	384,329,560円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2060	16,396,142円	28,736,837円
D Cダイワ外国株式インデック ス	50,051,961,691円	51,421,990,357円
ダイワ・ライフ・バランス30	477,517,025円	448,451,441円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,037,795,264円	1,058,751,948円
ダイワ・ライフ・バランス70	1,023,255,355円	1,050,740,402円
大和D C 海外株式インデックス ファンド	1,358,344,119円	1,035,513,077円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2030	9,664,774円	8,244,466円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2040	11,406,458円	12,252,822円
ダイワつみたてインデックス外 国株式	2,496,704,868円	3,188,082,289円
ダイワつみたてインデックスバ ランス30	1,881,563円	1,936,492円
ダイワつみたてインデックスバ ランス50	2,480,657円	3,052,509円
ダイワつみたてインデックスバ ランス70	5,066,336円	47,820,292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)	15,003,878円	19,045,605円

ダイワ世界バランスファンド4 0VA	43,911,825円	37,716,041円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	29,814,954円	28,624,114円
ダイワ・バランスファンド35 VA	747,327,456円	581,067,180円
ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	42,849,718円	32,496,251円
ダイワバランスファンド2021-02 (適格機関投資家専用)	126,698,728円	105,554,382円
スタイル9(4資産分散・保守 型)	128,545円	549,705円
スタイル9(4資産分散・ balan ス型)	1,053,961円	3,716,390円
スタイル9(4資産分散・積極 型)	1,493,797円	5,558,711円
スタイル9(6資産分散・保守 型)	78,128円	208,338円
スタイル9(6資産分散・ balan ス型)	1,870,987円	6,948,523円
スタイル9(6資産分散・積極 型)	2,371,238円	7,743,551円
スタイル9(8資産分散・保守 型)	93,292円	294,819円
スタイル9(8資産分散・ balan ス型)	1,361,677円	5,369,709円
スタイル9(8資産分散・積極 型)	4,133,920円	14,734,328円
全世界株式インデックス・ファ ンド(オール・カンントリー)	-円	104,771,525円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,290,475,524円	1,108,583,684円
ダイワ・ノーロード 外国株式 ファンド	422,583,457円	404,953,530円
ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワS MA専用)	3,931,003,426円	4,227,306,361円
ダイワ投信倶楽部外国株式イン デックス	3,177,264,120円	3,352,711,410円
ダイワライフスタイル25	7,154,772円	6,398,214円
ダイワライフスタイル50	34,512,063円	31,141,882円
ダイワライフスタイル75	29,568,667円	27,721,857円

ダイワバランスファンド2023-08 （適格機関投資家専用）	80,244,732円	-円
ダイワバランスファンド2024-01 （適格機関投資家専用）	78,139,734円	64,513,249円
ダイワバランスファンド2024-05 （適格機関投資家専用）	68,441,327円	63,663,358円
計	87,815,492,483円	100,214,393,190円
2. 期末日における受益権の総数	87,815,492,483口	100,214,393,190口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年6月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2024年6月17日現在	2025年6月16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	73,225,509,726	5,816,042,911
投資証券	406,178,693	685,665,949
合計	73,631,688,419	5,130,376,962

(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6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)	(円)	(円)		(円)	(円)
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買建	26,529,692,703	-	26,834,236,108	304,543,405	20,056,087,739	-	20,776,975,256	720,887,517
合計	26,529,692,703	-	26,834,236,108	304,543,405	20,056,087,739	-	20,776,975,256	720,887,517

## (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6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	11,909,403,160	-	11,936,691,400	27,288,240	6,109,954,260	-	6,196,867,000	86,912,740
アメリカ・ドル	6,609,608,630	-	6,644,991,600	35,382,970	2,449,786,520	-	2,478,004,000	28,217,480
イギリス・ポンド	578,355,880	-	578,091,800	264,080	366,614,770	-	370,859,100	4,244,330
オーストラリア・ドル	698,436,580	-	696,371,200	2,065,380	508,265,450	-	514,657,000	6,391,550
カナダ・ドル	1,516,785,440	-	1,510,344,000	6,441,440	1,211,739,650	-	1,230,992,000	19,252,350
スイス・フラン	1,028,102,860	-	1,042,648,000	14,545,140	839,659,670	-	853,622,400	13,962,730
ユーロ	1,478,113,770	-	1,464,244,800	13,868,970	733,888,200	-	748,732,500	14,844,300
合計	11,909,403,160	-	11,936,691,400	27,288,240	6,109,954,260	-	6,196,867,000	86,912,740

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	6.6410円	6.9116円
(1万口当たり純資産額)	(66,410円)	(69,116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	8,000	237.180	1,897,440.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	44,900	196.270	8,812,523.000	
	FIRST SOLAR INC	7,000	175.200	1,226,400.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	11,800	158.190	1,866,642.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,600	103.300	888,380.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	26,400	59.840	1,579,776.000	
	ABBOTT LABORATORIES	117,566	135.620	15,944,300.920	
	HOWMET AEROSPACE INC	26,083	171.200	4,465,409.600	
	VERISK ANALYTICS INC	9,500	310.410	2,948,895.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	24,100	40.330	971,953.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	82,200	92.490	7,602,678.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,300	673.010	2,220,933.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	35,800	79.350	2,840,730.000	
	AFLAC INC	35,100	102.180	3,586,518.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	8,000	217.500	1,740,000.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	11,000	138.170	1,519,870.000	
	ADOBE INC	28,920	391.680	11,327,385.600	

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	11,300	99.930	1,129,209.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,500	239.110	1,793,325.000	
GARMIN LTD	10,500	201.320	2,113,860.000	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	15,100	280.370	4,233,587.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	44,000	224.290	9,868,760.000	
WR BERKLEY CORP	20,613	73.290	1,510,726.770	
AUTOZONE INC	1,220	3,642.600	4,443,972.000	
DOLLAR TREE INC	13,871	95.190	1,320,380.490	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,300	16.990	1,364,297.000	
DR HORTON INC	19,216	123.080	2,365,105.280	
AUTODESK INC	14,500	292.160	4,236,320.000	
MOODY'S CORP	11,000	471.880	5,190,680.000	
DEVON ENERGY CORP	41,500	35.110	1,457,065.000	
ATMOS ENERGY CORP	10,800	152.990	1,652,292.000	
ALLIANT ENERGY CORP	17,500	61.080	1,068,900.000	
CITIGROUP INC	127,573	76.360	9,741,474.280	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	27,600	306.820	8,468,232.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	36,200	102.900	3,724,980.000	
DOMINO'S PIZZA INC	2,230	452.150	1,008,294.500	
HESS CORP	20,000	142.260	2,845,200.000	
DAVITA INC	3,050	136.120	415,166.000	
DANAHER CORP	43,650	200.670	8,759,245.500	
FORTIVE CORP	23,100	69.430	1,603,833.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	39,000	178.440	6,959,160.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	32,600	52.000	1,695,200.000	
APPLE INC	1,018,800	196.450	200,143,260.000	
BOEING CO/THE	51,000	200.320	10,216,320.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,615	146.360	1,553,611.400	
BECTON DICKINSON AND CO	19,499	172.210	3,357,922.790	
LEIDOS HOLDINGS INC	8,300	149.160	1,238,028.000	
NISOURCE INC	31,900	39.520	1,260,688.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,100	93.540	757,674.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	48,671	88.600	4,312,250.600	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	286,004	43.010	12,301,032.040	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	90,850	487.540	44,293,009.000	
ANSYS INC	6,000	338.010	2,028,060.000	
TRUIST FINANCIAL CORP	88,717	38.970	3,457,301.490	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	49,500	136.410	6,752,295.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	137,900	49.750	6,860,525.000	

JPMORGAN CHASE & CO	189,470	264.950	50,200,076.500	
T ROWE PRICE GROUP INC	15,100	91.580	1,382,858.000	
LKQ CORP	17,300	38.120	659,476.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	12,412	26.440	328,173.280	
CADENCE DESIGN SYS INC	18,600	300.000	5,580,000.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,500	501.680	3,260,920.000	
DOLLAR GENERAL CORP	15,000	111.680	1,675,200.000	
SERVICENOW INC	14,100	988.660	13,940,106.000	
CATERPILLAR INC	32,400	357.050	11,568,420.000	
BROWN & BROWN INC	16,600	106.620	1,769,892.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	17,800	38.050	677,290.000	
CMS ENERGY CORP	20,300	70.530	1,431,759.000	
DELTA AIR LINES INC	11,100	47.040	522,144.000	
CORNING INC	55,200	49.600	2,737,920.000	
CISCO SYSTEMS INC	269,650	64.090	17,281,868.500	
MORGAN STANLEY	82,052	129.490	10,624,913.480	
DECKERS OUTDOOR CORP	10,300	101.480	1,045,244.000	
MSCI INC	5,300	542.730	2,876,469.000	
FAIR ISAAC CORP	1,700	1,784.570	3,033,769.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,200	538.090	1,183,798.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	15,100	79.160	1,195,316.000	
BROADCOM INC	302,720	248.700	75,286,464.000	
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,900	283.350	821,715.000	
CNH INDUSTRIAL NV	59,200	12.570	744,144.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	3,900	176.740	689,286.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	8,900	307.990	2,741,111.000	
DTE ENERGY COMPANY	14,100	135.220	1,906,602.000	
CENTENE CORP	33,507	55.220	1,850,256.540	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,100	225.810	1,603,251.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	29,700	40.330	1,197,801.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,400	316.640	5,509,536.000	
GARTNER INC	5,250	404.970	2,126,092.500	
DOMINION ENERGY INC	57,841	55.510	3,210,753.910	
MONSTER BEVERAGE CORP	49,500	63.060	3,121,470.000	
DEERE & CO	17,500	509.590	8,917,825.000	
QUANTA SERVICES INC	10,100	358.260	3,618,426.000	
POOL CORP	2,600	288.900	751,140.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	16,684	74.620	1,244,960.080	
BURLINGTON STORES INC	4,300	228.830	983,969.000	

NASDAQ INC	29,300	85.590	2,507,787.000	
TARGA RESOURCES CORP	14,800	174.810	2,587,188.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,600	123.870	569,802.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	24,500	103.960	2,547,020.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,400	139.850	755,190.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,900	221.910	1,087,359.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	10,500	282.550	2,966,775.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	3,800	298.140	1,132,932.000	
CARLISLE COS INC	3,000	356.940	1,070,820.000	
IDEX CORP	5,200	177.820	924,664.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	52,200	90.260	4,711,572.000	
ROLLINS INC	19,807	56.880	1,126,622.160	
AECOM	8,900	111.990	996,711.000	
WATSCO INC	2,400	431.990	1,036,776.000	
GRACO INC	11,300	83.540	944,002.000	
AMETEK INC	15,700	176.960	2,778,272.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	16,700	97.090	1,621,403.000	
HEICO CORP	3,000	305.500	916,500.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,600	419.900	1,091,740.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	17,300	60.100	1,039,730.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,000	579.720	1,739,160.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	30,160	990.210	29,864,733.600	
RPM INTERNATIONAL INC	8,600	108.080	929,488.000	
RELIANCE INC	3,600	310.120	1,116,432.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	91,900	50.240	4,617,056.000	
CUMMINS INC	9,400	319.530	3,003,582.000	
CDW CORP/DE	9,000	170.420	1,533,780.000	
COSTAR GROUP INC	28,700	81.160	2,329,292.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	13,000	160.180	2,082,340.000	
INTERACTIVE BROKERS GRO-CL A	7,400	202.160	1,495,984.000	
MERCADOLIBRE INC	3,090	2,371.980	7,329,418.200	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,000	179.100	895,500.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	16,316	243.880	3,979,146.080	
DEXCOM INC	26,600	81.990	2,180,934.000	
NORDSON CORP	3,690	214.360	790,988.400	
COPART INC	62,300	48.590	3,027,157.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	13,000	154.910	2,013,830.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,800	177.850	853,680.000	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	5,500	374.080	2,057,440.000	

TRANSDIGM GROUP INC	3,890	1,439.610	5,600,082.900	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,800	124.390	845,852.000	
KINDER MORGAN INC	135,581	27.640	3,747,458.840	
HCA HEALTHCARE INC	12,500	371.180	4,639,750.000	
COTERRA ENERGY INC	51,900	26.700	1,385,730.000	
T-MOBILE US INC	30,827	228.000	7,028,556.000	
ZILLOW GROUP INC - C	11,150	70.370	784,625.500	
EMCOR GROUP INC	3,100	477.920	1,481,552.000	
COCA-COLA CO/THE	277,050	71.020	19,676,091.000	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,400	92.850	1,429,890.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	9,350	114.260	1,068,331.000	
CSX CORP	128,100	32.120	4,114,572.000	
EXPEDIA GROUP INC	8,425	165.630	1,395,432.750	
AMAZON.COM INC	647,400	212.100	137,313,540.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	39,700	75.150	2,983,455.000	
EXXON MOBIL CORP	293,009	112.120	32,852,169.080	
EVEREST GROUP LTD	3,300	334.610	1,104,213.000	
EOG RESOURCES INC	37,400	125.280	4,685,472.000	
EQT CORP	38,500	56.840	2,188,340.000	
AKAMA I TECHNOLOGIES INC	10,000	77.030	770,300.000	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	700	1,818.680	1,273,076.000	
GENCORA INC	12,600	295.540	3,723,804.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	19,400	117.080	2,271,352.000	
FORD MOTOR CO	264,723	10.430	2,761,060.890	
ENTEGRIS INC	10,300	75.340	776,002.000	
MICROSTRATEGY INC-CL A	16,900	382.870	6,470,503.000	
AERCAP HOLDINGS NV	12,200	115.840	1,413,248.000	
FORTINET INC	44,400	100.830	4,476,852.000	
MARKEL CORP	860	1,928.770	1,658,742.200	
NEXTERA ENERGY INC	139,580	74.780	10,437,792.400	
FREEPORT-MCMORAN INC	97,408	40.940	3,987,883.520	
INSULET CORP	4,800	304.630	1,462,224.000	
US BANCORP	105,600	42.990	4,539,744.000	
UNITED RENTALS INC	4,500	694.840	3,126,780.000	
F5 NETWORKS INC	4,000	286.610	1,146,440.000	
SUPER MICRO COMPUTER INC	34,200	41.560	1,421,352.000	
FASTENAL CO	76,200	42.170	3,213,354.000	
FISERV INC	37,833	163.020	6,167,535.660	
GENERAL ELECTRIC CO	72,306	236.600	17,107,599.600	

AXON ENTERPRISE INC	5,000	780.630	3,903,150.000	
GENERAL MOTORS CO	65,200	48.650	3,171,980.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	15,500	283.000	4,386,500.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	21,150	613.540	12,976,371.000	
ALPHABET INC-CL A	395,300	174.670	69,047,051.000	
ALPHABET INC-CL C	335,240	175.880	58,962,011.200	
OWENS CORNING	5,700	134.490	766,593.000	
GENERAL MILLS INC	37,100	53.560	1,987,076.000	
FIRSTENERGY CORP	37,218	40.340	1,501,374.120	
GENUINE PARTS CO	9,450	119.680	1,130,976.000	
FIFTH THIRD BANCORP	45,300	37.980	1,720,494.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	12,750	256.990	3,276,622.500	
HALLIBURTON CO	58,400	23.190	1,354,296.000	
HOME DEPOT INC	67,350	354.660	23,886,351.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	99,000	15.510	1,535,490.000	
HERSHEY CO/THE	10,100	169.120	1,708,112.000	
HUMANA INC	8,200	235.260	1,929,132.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	17,200	210.900	3,627,480.000	
HP INC	63,900	23.840	1,523,376.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	89,100	17.650	1,572,615.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	25,500	90.990	2,320,245.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	60,303	26.080	1,572,702.240	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	62,900	277.220	17,437,138.000	
HUBBELL INC	3,700	382.030	1,413,511.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	34,000	45.890	1,560,260.000	
ZOETIS INC	30,300	164.330	4,979,199.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	15,199	421.390	6,404,706.610	
CHENIERE ENERGY INC	15,100	238.340	3,598,934.000	
HYATT HOTELS CORP - CL A	2,900	130.560	378,624.000	
ALLEGION PLC	5,850	135.300	791,505.000	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	7,700	111.290	856,933.000	
WASTE CONNECTIONS INC	17,537	190.670	3,343,779.790	
JUNIPER NETWORKS INC	16,900	35.770	604,513.000	
JM SMUCKER CO/THE	7,300	95.720	698,756.000	
JOHNSON & JOHNSON	163,300	157.100	25,654,430.000	
ABBVIE INC	119,872	191.080	22,905,141.760	
HOLOGIC INC	15,300	64.750	990,675.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	22,500	130.840	2,943,900.000	
KROGER CO	42,500	65.560	2,786,300.000	

KLA CORP	9,100	867.670	7,895,797.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	14,300	486.450	6,956,235.000	
CORPAY INC	4,600	323.250	1,486,950.000	
LOWE'S COS INC	38,000	217.270	8,256,260.000	
ELI LILLY & CO	54,685	819.360	44,806,701.600	
LAM RESEARCH CORP	87,000	89.520	7,788,240.000	
LOEWS CORP	12,300	88.660	1,090,518.000	
MCDONALD'S CORP	48,450	301.910	14,627,539.500	
3M CO	36,590	142.320	5,207,488.800	
META PLATFORMS INC CLASS A	148,500	682.870	101,406,195.000	
S&P GLOBAL INC	21,339	501.490	10,701,295.110	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,200	542.470	2,278,374.000	
PHILLIPS 66	27,500	122.150	3,359,125.000	
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	11,200	196.820	2,204,384.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	17,200	74.010	1,272,972.000	
METLIFE INC	39,300	77.350	3,039,855.000	
MARVELL TECHNOLOGY INC	58,700	67.190	3,944,053.000	
ARISTA NETWORKS INC	72,700	92.350	6,713,845.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11,398	408.100	4,651,523.800	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,500	1,155.420	1,733,130.000	
BAKER HUGHES CO	67,123	39.040	2,620,481.920	
ROCKWELL AUTOMATION INC	7,700	317.850	2,447,445.000	
MERCK & CO. INC.	170,521	81.710	13,933,270.910	
DUPONT DE NEMOURS INC	28,451	66.870	1,902,518.370	
MASCO CORP	14,400	61.880	891,072.000	
M & T BANK CORP	11,099	178.030	1,975,954.970	
MARSH & MCLENNAN COS	33,470	217.380	7,275,708.600	
HEICO CORP-CLASS A	5,120	238.790	1,222,604.800	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	15,902	254.990	4,054,850.980	
WORKDAY INC-CLASS A	14,600	244.540	3,570,284.000	
BLOCK INC CLASS A	38,012	61.570	2,340,398.840	
TRANSUNION	13,300	83.980	1,116,934.000	
VISTRA CORP	23,100	173.750	4,013,625.000	
NETAPP INC	14,000	100.490	1,406,860.000	
NIKE INC -CL B	79,900	60.530	4,836,347.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	15,400	248.600	3,828,440.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	36,500	65.730	2,399,145.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	13,205	145.620	1,922,912.100	
NORTHROP GRUMMAN CORP	9,300	516.720	4,805,496.000	

NEWMONT CORP	76,411	57.900	4,424,196.900	
MCKESSON CORP	8,500	728.200	6,189,700.000	
XYLEM INC	16,500	125.500	2,070,750.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	105,500	184.330	19,446,815.000	
NUCOR CORP	15,600	121.920	1,901,952.000	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	10,800	710.850	7,677,180.000	
GODADDY INC - CLASS A	9,600	175.740	1,687,104.000	
EVERGY INC	15,650	67.985	1,063,965.250	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	47,724	46.450	2,216,779.800	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,750	356.760	624,330.000	
OKTA INC	11,300	97.480	1,101,524.000	
WIX.COM LTD	3,710	149.100	553,161.000	
EQUITABLE HOLDINGS INC	20,900	51.610	1,078,649.000	
KKR & CO INC	42,200	121.330	5,120,126.000	
PAYCHEX INC	22,000	153.220	3,370,840.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	58,500	89.910	5,259,735.000	
ALTRIA GROUP INC	114,300	59.810	6,836,283.000	
P G & E CORP	149,000	13.640	2,032,360.000	
PFIZER INC	384,313	24.540	9,431,041.020	
CIGNA CORP	18,400	317.400	5,840,160.000	
DELL TECHNOLOGIES -C	21,901	109.560	2,399,473.560	
XCEL ENERGY INC	39,100	67.620	2,643,942.000	
STERIS PLC	6,700	241.340	1,616,978.000	
SEA LTD-ADR	26,800	154.380	4,137,384.000	
FOX CORP - CLASS B	9,433	49.300	465,046.900	
FOX CORP - CLASS A	14,799	53.690	794,558.310	
STRYKER CORP	23,280	377.300	8,783,544.000	
DOW INC	47,718	29.900	1,426,768.200	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	7,900	137.260	1,084,354.000	
ZOOM COMMUNICATIONS INC CLASS A	17,100	76.630	1,310,373.000	
PARKER HANNIFIN CORP	8,800	654.090	5,755,992.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	127,600	83.930	10,709,468.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	158,867	160.280	25,463,202.760	
EXELON CORP	68,422	43.250	2,959,251.500	
INGERSOLL-RAND INC	27,408	80.500	2,206,344.000	
NVR INC	210	7,225.670	1,517,390.700	
CONOCOPHILLIPS	85,603	96.960	8,300,066.880	
TWILIO INC - A	9,800	113.390	1,111,222.000	

DOCUSIGN INC	13,800	74.060	1,022,028.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,600	245.000	882,000.000	
PURE STORAGE INC - CLASS A	21,000	51.650	1,084,650.000	
PEPSICO INC	93,000	130.850	12,169,050.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,320	386.690	1,283,810.800	
MONGODB INC	5,600	205.630	1,151,528.000	
SNAP INC - A	73,400	7.940	582,796.000	
CORTEVA INC	46,368	72.430	3,358,434.240	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	24,100	102.970	2,481,577.000	
AMCOR PLC	156,700	9.100	1,425,970.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,800	480.620	8,074,416.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,300	141.440	1,881,152.000	
ACCENTURE PLC-CL A	42,500	311.710	13,247,675.000	
PENTAIR PLC	11,275	96.620	1,089,390.500	
QUALCOMM INC	75,000	154.720	11,604,000.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	15,200	75.900	1,153,680.000	
DATADOG INC - CLASS A	19,500	120.450	2,348,775.000	
PINTEREST INC- CLASS A	40,300	33.840	1,363,752.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,300	529.240	3,863,452.000	
REPUBLIC SERVICES INC	14,900	251.260	3,743,774.000	
BOOKING HOLDINGS INC	2,300	5,298.380	12,186,274.000	
ROSS STORES INC	22,300	131.845	2,940,143.500	
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,130	188.560	1,155,872.800	
RESMED INC	10,000	249.340	2,493,400.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	7,630	180.210	1,375,002.300	
HUBSPOT INC	3,380	554.590	1,874,514.200	
REVVITY INC	8,200	93.530	766,946.000	
CARRIER GLOBAL CORP	52,687	71.240	3,753,421.880	
OTIS WORLDWIDE CORP	26,838	95.820	2,571,617.160	
AVANTOR INC	45,200	13.070	590,764.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	16,000	46.190	739,040.000	
DYNATRACE INC	20,300	53.030	1,076,509.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	30,700	67.960	2,086,372.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	61,385	21.510	1,320,391.350	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	25,100	34.840	874,484.000	
CHEVRON CORP	112,418	145.910	16,402,910.380	
ZSCALER INC	6,900	301.950	2,083,455.000	
EDISON INTERNATIONAL	26,100	48.320	1,261,152.000	
TESLA INC	196,250	325.310	63,842,087.500	

SNOWFLAKE INC-CLASS A	21,600	208.180	4,496,688.000	
GEN DIGITAL INC	35,500	29.780	1,057,190.000	
SYNOPSYS INC	10,500	478.860	5,028,030.000	
CARVANA CO	8,300	297.030	2,465,349.000	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	21,000	171.970	3,611,370.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	6,305	388.720	2,450,879.600	
DOORDASH INC - A	24,350	218.960	5,331,676.000	
ROBLOX CORP -CLASS A	36,400	97.170	3,536,988.000	
AIRBNB INC-CLASS A	29,600	135.540	4,011,984.000	
CBRE GROUP INC - A	20,400	132.970	2,712,588.000	
SOUTHERN CO/THE	74,400	90.350	6,722,040.000	
SYSCO CORP	33,200	74.290	2,466,428.000	
TRAVELERS COS INC/THE	15,403	263.470	4,058,228.410	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,400	111.500	490,600.000	
STEEL DYNAMICS INC	9,650	133.480	1,288,082.000	
SCHLUMBERGER LTD	92,052	36.300	3,341,487.600	
AT&T INC	486,491	28.190	13,714,181.290	
ON SEMICONDUCTOR CORP	28,300	51.020	1,443,866.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	16,200	335.880	5,441,256.000	
SEMPRA ENERGY	44,300	74.080	3,281,744.000	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	10,700	49.340	527,938.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	145,300	137.400	19,964,220.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	14,350	127.270	1,826,324.500	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	13,600	242.710	3,300,856.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	61,700	195.000	12,031,500.000	
SALESFORCE.COM INC	65,166	258.400	16,838,894.400	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	27,109	132.110	3,581,369.990	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	44,734	101.970	4,561,525.980	
TERADYNE INC	10,900	83.080	905,572.000	
UNION PACIFIC CORP	40,680	223.370	9,086,691.600	
MARATHON PETROLEUM CORP	21,088	166.150	3,503,771.200	
RTX CORP	90,479	145.690	13,181,885.510	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	49,800	100.000	4,980,000.000	
IQVIA HOLDINGS INC	12,104	156.890	1,898,996.560	
AMEREN CORPORATION	18,400	95.700	1,760,880.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	62,066	313.530	19,459,552.980	
APPROVIN CORP CLASS A	15,800	364.490	5,758,942.000	
TOAST INC CLASS A	30,300	41.540	1,258,662.000	

VERISIGN INC	5,800	279.900	1,623,420.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	53,400	13.420	716,628.000	
ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	49,900	72.600	3,622,740.000	
VALERO ENERGY CORP	21,342	134.110	2,862,175.620	
ULTA BEAUTY INC	3,100	459.170	1,423,427.000	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	17,788	55.270	983,142.760	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,930	171.070	672,305.100	
ELEVANCE HEALTH INC	15,400	384.550	5,922,070.000	
WALT DISNEY CO/THE	122,562	117.940	14,454,962.280	
WELLS FARGO & CO	221,022	72.360	15,993,151.920	
WASTE MANAGEMENT INC	27,300	236.500	6,456,450.000	
WILLIAMS COS INC	82,800	59.780	4,949,784.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	36,100	51.540	1,860,594.000	
WALMART INC	298,800	94.440	28,218,672.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	13,500	91.280	1,232,280.000	
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	166,100	4.570	759,077.000	
WABTEC CORP	11,611	201.700	2,341,938.700	
TJX COMPANIES INC	75,700	123.910	9,379,987.000	
WATERS CORP	4,100	342.300	1,403,430.000	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	5,700	74.000	421,800.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	3,500	283.610	992,635.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,763	296.330	2,004,079.790	
WILLIAMS-SONOMA INC	8,400	153.960	1,293,264.000	
WESTERN DIGITAL CORP	23,500	55.700	1,308,950.000	
WEC ENERGY GROUP INC	21,700	105.110	2,280,887.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	33,800	81.000	2,737,800.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	116,850	352.850	41,230,522.500	
PPL CORP	50,100	33.890	1,697,889.000	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	21,324	296.890	6,330,882.360	
PULTEGROUP INC	13,650	101.610	1,386,976.500	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	159,353	10.030	1,598,310.590	
PPG INDUSTRIES INC	15,500	106.300	1,647,650.000	
NORTHERN TRUST CORP	13,200	107.750	1,422,300.000	
NVIDIA CORP	1,655,100	141.970	234,974,547.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	26,813	173.370	4,648,569.810	

DRAFTKINGS INC CLASS A	30,600	36.500	1,116,900.000	
TYSON FOODS INC-CL A	19,400	54.810	1,063,314.000	
NETFLIX INC	28,990	1,212.150	35,140,228.500	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	25,600	402.760	10,310,656.000	
NRG ENERGY INC	13,850	152.040	2,105,754.000	
TEXTRON INC	12,400	77.380	959,512.000	
NEWS CORP - CLASS A	25,187	27.420	690,627.540	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,350	1,119.580	1,511,433.000	
OMNICOM GROUP	13,300	69.480	924,084.000	
JACOBS SOLUTIONS INC	8,320	125.890	1,047,404.800	
ORACLE CORP	114,033	215.220	24,542,182.260	
MASTERCARD INC - A	55,200	562.030	31,024,056.000	
ONEOK INC	42,400	83.750	3,551,000.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,300	560.750	4,093,475.000	
U HAUL NON VOTING SERIES N	6,600	55.100	363,660.000	
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	13,900	166.560	2,315,184.000	
EXPAND ENERGY CORP	14,200	116.460	1,653,732.000	
YUM! BRANDS INC	18,900	144.000	2,721,600.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,000	230.230	2,762,760.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	12,000	50.590	607,080.000	
BANK OF AMERICA CORP	490,401	44.090	21,621,780.090	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,200	487.470	1,559,904.000	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,000	56.220	730,860.000	
AMERICAN EXPRESS CO	38,000	287.790	10,936,020.000	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	31,035	72.250	2,242,278.750	
LINDE PLC	32,046	465.980	14,932,795.080	
ANALOG DEVICES INC	33,691	225.030	7,581,485.730	
ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	25,100	21.220	532,622.000	
MONDAYCOM LTD	2,900	279.950	811,855.000	
ADVANCED MICRO DEVICES	110,127	116.160	12,792,352.320	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	17,200	32.050	551,260.000	
NATERA INC	8,700	165.340	1,438,458.000	
LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER	14,400	96.720	1,392,768.000	
KENVUE INC	130,100	21.450	2,790,645.000	
VERALTO CORP	16,816	97.320	1,636,533.120	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	39,472	84.610	3,339,725.920	
BUNGE GLOBAL LTD	9,200	81.410	748,972.000	

VERTIV HOLDINGS CLASS A	24,600	110.970	2,729,862.000	
NUTANIX INC CLASS A	17,200	72.130	1,240,636.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17,400	258.080	4,490,592.000	
AVERY DENNISON CORP	5,430	174.640	948,295.200	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	33,600	78.950	2,652,720.000	
EMERSON ELECTRIC CO	38,200	125.540	4,795,628.000	
AON PLC-CLASS A	13,200	353.000	4,659,600.000	
AMGEN INC	36,500	295.220	10,775,530.000	
SAMSARA INC CLASS A	19,400	39.210	760,674.000	
EATON CORP PLC	26,536	323.660	8,588,641.760	
COOPER INC	13,600	69.700	947,920.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	11,100	164.880	1,830,168.000	
APPLIED MATERIALS INC	55,100	170.590	9,399,509.000	
CME GROUP INC	24,500	269.500	6,602,750.000	
ECOLAB INC	17,300	264.210	4,570,833.000	
EQUIFAX INC	8,500	264.290	2,246,465.000	
GILEAD SCIENCES INC	84,500	109.980	9,293,310.000	
KEURIG DR PEPPER INC	87,700	33.020	2,895,854.000	
HORMEL FOODS CORP	20,100	30.580	614,658.000	
STATE STREET CORP	19,513	96.140	1,875,979.820	
SOLVENTUM CORP	9,972	73.800	735,933.600	
GE VERNOVA	18,526	478.450	8,863,764.700	
SCHWAB (CHARLES) CORP	117,040	87.360	10,224,614.400	
CRH PUBLIC LIMITED PLC	46,000	90.040	4,141,840.000	
LABCORP HOLDINGS	5,700	261.120	1,488,384.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	34,800	30.620	1,065,576.000	
SMURFIT WESTROCK PLC	35,400	41.980	1,486,092.000	
FERGUSON ENTERPRISES LTD	13,500	212.850	2,873,475.000	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	12,000	264.610	3,175,320.000	
THE CAMPBELL S COMPANY	12,900	32.790	422,991.000	
CROWN HOLDINGS INC	7,980	99.850	796,803.000	
REDDIT INC CLASS A	4,600	118.180	543,628.000	
TE CONNECTIVITY LTD	20,295	162.620	3,300,372.900	
BLACKROCK INC	10,000	971.820	9,718,200.000	
CARDINAL HEALTH INC	16,400	161.410	2,647,124.000	
APTIV HOLDINGS LTD	15,600	67.250	1,049,100.000	
FEDEX CORP	15,500	224.380	3,477,890.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	43,974	192.830	8,479,506.420	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	17,413	76.090	1,324,955.170	

INTEL CORP	295,600	20.140	5,953,384.000	
HARTFORD INSURANCE GROUP INC	19,250	125.230	2,410,677.500	
ILLINOIS TOOL WORKS	18,900	241.480	4,563,972.000	
ILLUMINA INC	10,800	86.930	938,844.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	24,300	512.180	12,445,974.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,150	218.930	1,346,419.500	
SNAP-ON INC	3,600	310.000	1,116,000.000	
DUKE ENERGY CORP	52,728	116.860	6,161,794.080	
TARGET CORP	30,900	95.370	2,946,933.000	
DOVER CORP	9,300	176.540	1,641,822.000	
WW GRAINGER INC	3,200	1,064.230	3,405,536.000	
JABIL INC	7,300	175.840	1,283,632.000	
CINTAS CORP	24,700	221.980	5,482,906.000	
CONAGRA BRANDS INC	32,400	21.570	698,868.000	
CLOROX COMPANY	8,300	123.070	1,021,481.000	
ENTERGY CORP	29,400	82.070	2,412,858.000	
MICROSOFT CORP	478,600	474.960	227,315,856.000	
INCYTE CORP	11,200	67.750	758,800.000	
CVS HEALTH CORP	85,569	67.460	5,772,484.740	
MEDTRONIC PLC	86,998	87.270	7,592,315.460	
MICRON TECHNOLOGY INC	75,800	115.600	8,762,480.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	44,200	36.370	1,607,554.000	
KELLOGG CO	18,800	79.880	1,501,744.000	
KEYCORP	63,200	15.650	989,080.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	87,711	66.930	5,870,497.230	
CHUBB LTD	25,799	286.790	7,398,895.210	
ALLSTATE CORP	18,000	198.920	3,580,560.000	
EBAY INC	31,600	77.360	2,444,576.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	63,750	70.830	4,515,412.500	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	15,900	67.310	1,070,229.000	
TRIMBLE INC	16,700	71.080	1,187,036.000	
LENNAR CORP-A	15,900	108.610	1,726,899.000	
PROGRESSIVE CORP	39,800	267.850	10,660,430.000	
PACCAR INC	35,655	91.880	3,275,981.400	
BIOGEN INC	10,000	130.650	1,306,500.000	
IDEXX LABORATORIES INC	5,500	522.700	2,874,850.000	
STARBUCKS CORP	77,000	93.260	7,181,020.000	
PTC INC	8,200	169.340	1,388,588.000	
EVERSOURCE ENERGY	24,900	65.210	1,623,729.000	

	INTUIT INC	18,980	753.980	14,310,540.400	
	BEST BUY CO INC	13,550	69.600	943,080.000	
	BALL CORP	18,204	54.370	989,751.480	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	100,297	99.740	10,003,622.780	
	ELECTRONIC ARTS INC	16,800	148.480	2,494,464.000	
	VULCAN MATERIALS CO	9,000	260.770	2,346,930.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	17,500	455.450	7,970,375.000	
	CARNIVAL CORP	71,200	22.410	1,595,592.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	255,490	35.010	8,944,704.900	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,300	45.440	513,472.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	77,200	5.610	433,092.000	
	アメリカ・ドル 小計			3,484,930,406.550 (503,293,649,314)	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	397,606	26.310	10,461,013.860	
	HALEON PLC	600,757	3.961	2,379,598.470	
	WISE PLC CLASS A	43,484	10.270	446,580.680	
	BP PLC	1,063,428	3.863	4,108,554.070	
	UNILEVER PLC	166,246	46.350	7,705,502.100	
	BARCLAYS PLC	949,472	3.193	3,031,664.090	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	562,984	8.700	4,897,960.800	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	136,540	3.743	511,069.220	
	PRUDENTIAL PLC	172,851	8.876	1,534,225.470	
	NATWEST GROUP PLC	537,988	5.134	2,762,030.390	
	BAE SYSTEMS PLC	200,044	19.390	3,878,853.160	
	AVIVA PLC	177,900	6.058	1,077,718.200	
	GSK	273,284	15.115	4,130,687.660	
	INFORMA PLC	86,836	7.762	674,021.030	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	83,923	4.725	396,536.170	
	AUTO TRADER GROUP PLC	58,028	8.158	473,392.420	
	DCC PLC	6,470	46.860	303,184.200	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	4,807	59.450	285,776.150	
	HALMA PLC	25,182	31.120	783,663.840	
	ENTAIN PLC	39,644	7.514	297,885.010	
	JD SPORTS FASHION PLC	172,738	0.760	131,419.070	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	45,835	6.520	298,844.200	
	M&G PLC	149,120	2.548	379,957.760	
	RELX PLC	122,691	38.950	4,778,814.450	
	DIAGEO PLC	147,757	19.500	2,881,261.500	

RIO TINTO PLC	74,913	42.885	3,212,644.000	
STANDARD CHARTERED PLC	134,147	11.455	1,536,653.880	
TESCO PLC	446,828	3.982	1,779,269.090	
SMITH & NEPHEW PLC	55,249	10.940	604,424.060	
GLENCORE PLC	676,969	2.917	1,974,718.570	
SMITHS GROUP PLC	22,378	22.340	499,924.520	
PEARSON PLC	39,175	10.660	417,605.500	
SAINSBURY (J) PLC	116,988	2.868	335,521.580	
NEXT PLC	7,770	127.700	992,229.000	
WHITBREAD PLC	11,775	27.780	327,109.500	
BUNZL PLC	21,570	22.840	492,658.800	
VODAFONE GROUP PLC	1,322,159	0.737	974,431.180	
CRODA INTERNATIONAL PLC	8,668	30.710	266,194.280	
KINGFISHER PLC	118,387	2.740	324,380.380	
WPP PLC	70,427	5.510	388,052.770	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	44,555	11.655	519,288.520	
SEVERN TRENT PLC	17,641	27.050	477,189.050	
RENTOKIL INITIAL PLC	164,797	3.483	573,987.950	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	45,267	50.960	2,306,806.320	
SCHRODERS PLC	50,139	3.558	178,394.560	
SSE PLC	73,530	18.150	1,334,569.500	
BARRATT REDROW PLC	90,081	4.745	427,434.340	
ASTRAZENECA PLC	103,018	109.860	11,317,557.480	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	389,969	2.529	986,231.600	
3I GROUP PLC	64,643	41.230	2,665,230.890	
ASHTREAD GROUP PLC	28,468	42.670	1,214,729.560	
SAGE GROUP PLC/THE	65,433	12.620	825,764.460	
NATIONAL GRID PLC	325,244	10.630	3,457,343.720	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,993,144	0.765	3,054,755.160	
IMPERIAL BRANDS PLC	51,754	29.090	1,505,523.860	
CENTRICA PLC	331,287	1.660	549,936.420	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	131,526	35.880	4,719,152.880	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	21,410	20.480	438,476.800	
HSBC HOLDINGS PLC	1,173,146	8.665	10,165,310.090	
ANGLO AMERICAN PLC	74,294	21.135	1,570,203.690	
MONDI PLC	28,810	11.725	337,797.250	
COMPASS GROUP PLC	112,708	25.540	2,878,562.320	
BT GROUP PLC	394,982	1.840	726,964.370	
COCA-COLA HBC AG-DI	14,486	39.460	571,617.560	

	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	9,846	82.480	812,098.080	
	INTERTEK GROUP PLC	10,550	47.620	502,391.000	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	31,626	110.450	3,493,091.700	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	10,876	21.280	231,441.280	
	ADMIRAL GROUP PLC	17,013	33.000	561,429.000	
	ANTOFAGASTA PLC	25,763	17.910	461,415.330	
	EXPERIAN PLC	60,939	37.480	2,283,993.720	
イギリス・ポンド 小計				133,884,719.540 (26,191,867,684)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	86,033	28.500	2,451,940.500	
	AZRIELI GROUP LTD	3,016	260.000	784,160.000	
	ICL GROUP LTD	54,223	23.690	1,284,542.870	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,868	1,616.900	3,020,369.200	
	BANK HAPOALIM BM	87,812	56.900	4,996,502.800	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	104,878	56.350	5,909,875.300	
	NICE LTD	4,434	594.600	2,636,456.400	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,881	189.000	2,056,509.000	
イスラエル・シュケル 小計				23,140,356.070 (923,200,704)	
オーストラリ ア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	140,138	5.290	741,330.020	
	TELSTRA GROUP LTD	254,089	4.890	1,242,495.210	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	189,249	29.630	5,607,447.870	
	SGH LTD	12,846	53.680	689,573.280	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	173,395	4.900	849,635.500	
	BHP GROUP LTD	323,392	37.340	12,075,457.280	
	SOUTH32 LTD	283,778	2.940	834,307.320	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	120,996	25.210	3,050,309.160	
	FORTECUE METALS GROUP LTD	107,902	15.730	1,697,298.460	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	195,047	38.870	7,581,476.890	
	WESTPAC BANKING CORP	217,978	33.360	7,271,746.080	
	SANTOS LTD	204,063	6.960	1,420,278.480	
	RIO TINTO LTD	23,626	106.380	2,513,333.880	
	ORIGIN ENERGY LTD	108,239	11.450	1,239,336.550	
	XERO LTD	9,145	188.700	1,725,661.500	
	PRO MEDICUS LTD	3,616	270.500	978,128.000	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	15,021	40.320	605,646.720	
	COLES GROUP LTD	85,414	22.220	1,897,899.080	
WISETECH GLOBAL LTD	12,856	105.390	1,354,893.840		

	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	87,872	22.530	1,979,756.160	
	EVOLUTION MINING LTD	140,100	9.200	1,288,920.000	
	REECE LTD	13,293	16.530	219,733.290	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	106,643	179.350	19,126,422.050	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	96,188	23.280	2,239,256.640	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	77,861	32.200	2,507,124.200	
	QANTAS AIRWAYS LTD	46,622	10.190	475,078.180	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	27,010	40.210	1,086,072.100	
	MACQUARIE GROUP LTD	23,045	212.830	4,904,667.350	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	35,867	64.040	2,296,922.680	
	CSL LTD	30,825	238.860	7,362,859.500	
	WESFARMERS LTD	72,296	84.770	6,128,531.920	
	COCHLEAR LTD	4,209	272.850	1,148,425.650	
	BLUESCOPE STEEL LTD	27,548	22.530	620,656.440	
	SUNCORP GROUP LTD	68,038	21.430	1,458,054.340	
	ASX LTD	12,189	72.770	886,993.530	
	COMPUTERSHARE LTD	33,110	40.650	1,345,921.500	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	148,594	8.980	1,334,374.120	
	SONIC HEALTHCARE LTD	28,670	26.890	770,936.300	
	BRAMBLES LTD	86,834	23.030	1,999,787.020	
	CARSALES.COM LTD	23,716	35.950	852,590.200	
	SIGMA HEALTHCARE LTD	323,100	3.250	1,050,075.000	
	REA GROUP LTD	3,320	232.410	771,601.200	
	オーストラリア・ドル 小計			115,231,014.490 (10,805,212,230)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	47,800	73.120	3,495,136.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	26,181	74.200	1,942,630.200	
	BROOKFIELD RENEWABLE SUBORDINATE V	8,500	43.870	372,895.000	
	CELESTICA INC	7,300	170.260	1,242,898.000	
	IMPERIAL OIL LTD	11,300	111.150	1,255,995.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,300	4,829.990	6,278,987.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	19,687	91.390	1,799,194.930	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	28,600	124.570	3,562,702.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	11,250	309.500	3,481,875.000	
	BCE INC	4,130	31.010	128,071.300	
	FRANCO-NEVADA CORP	12,200	233.330	2,846,626.000	

SUNCOR ENERGY INC	77,830	55.670	4,332,796.100	
METRO INC/CN	13,200	104.340	1,377,288.000	
NATIONAL BANK OF CANADA	24,600	135.420	3,331,332.000	
BANK OF NOVA SCOTIA	78,500	73.780	5,791,730.000	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	59,200	92.610	5,482,512.000	
TORONTO-DOMINION BANK	110,300	96.230	10,614,169.000	
GREAT-WEST LIFECO INC	17,300	51.190	885,587.000	
ROYAL BANK OF CANADA	89,150	173.550	15,471,982.500	
TOURMALINE OIL CORP	22,400	66.630	1,492,512.000	
TC ENERGY CORP	65,450	67.350	4,408,057.500	
PEMBINA PIPELINE CORP	36,629	52.260	1,914,231.540	
BARRICK MINING CORP	108,300	29.320	3,175,356.000	
CAE INC	19,100	36.410	695,431.000	
THOMSON REUTERS CORP	9,941	264.980	2,634,166.180	
EMPIRE CO LTD 'A'	8,100	51.840	419,904.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,400	103.350	351,390.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	9,150	77.630	710,314.500	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	25,000	32.380	809,500.000	
HYDRO ONE LTD	20,800	49.240	1,024,192.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	9,460	222.310	2,103,052.600	
STANTEC INC	7,100	144.850	1,028,435.000	
WSP GLOBAL INC	8,300	271.520	2,253,616.000	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,200	121.550	632,060.000	
QUEBECOR INC -CL B	9,800	40.250	394,450.000	
EMERA INC	18,800	61.380	1,153,944.000	
TFI INTERNATIONAL INC	5,000	122.190	610,950.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	8,300	38.100	316,230.000	
WHITECAP RESOURCES INC	76,600	9.390	719,274.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	22,900	37.560	860,124.000	
IVANHOE MINES LTD-CL A	45,700	9.880	451,516.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	31,717	169.130	5,364,296.210	
ALAMOS GOLD INC-CLASS A	29,500	37.420	1,103,890.000	
KINROSS GOLD CORP	77,500	21.460	1,663,150.000	
BANK OF MONTREAL	45,600	145.290	6,625,224.000	
POWER CORP OF CANADA	35,200	52.290	1,840,608.000	
LUNDIN GOLD INC	7,600	73.870	561,412.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	76,700	143.180	10,981,906.000	
NUTRIEN LTD	30,819	85.420	2,632,558.980	
CAMECO CORP	27,500	90.530	2,489,575.000	

	FIRSTSERVICE CORP	2,600	240.000	624,000.000	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,200	68.270	901,164.000	
	TELUS CORP	10,800	21.920	236,736.000	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	29,300	52.450	1,536,785.000	
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,300	177.990	587,367.000	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	132,100	45.900	6,063,390.000	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,300	2,355.550	3,062,215.000	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	16,600	50.720	841,952.000	
	WESTON (GEORGE) LTD	3,737	267.610	1,000,058.570	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	22,400	39.420	883,008.000	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	5,300	134.800	714,440.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	36,100	87.290	3,151,169.000	
	ENBRIDGE INC	137,200	63.370	8,694,364.000	
	BROOKFIELD CORP	85,825	78.520	6,738,979.000	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	108,500	42.340	4,593,890.000	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	58,620	109.240	6,403,648.800	
	IA FINANCIAL CORP INC	5,800	142.260	825,108.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,200	62.920	578,864.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	33,650	141.090	4,747,678.500	
	CGI INC - CLASS A	12,600	147.080	1,853,208.000	
	IGM FINANCIAL INC	5,200	43.070	223,964.000	
	TMX GROUP LTD	17,600	55.980	985,248.000	
	OPEN TEXT CORP	16,300	38.410	626,083.000	
	SAPUTO INC	15,900	26.520	421,668.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,800	21.030	921,114.000	
	FORTIS INC	31,600	65.450	2,068,220.000	
	RB GLOBAL INC	11,700	144.440	1,689,948.000	
	LUNDIN MINING CORP	43,300	13.910	602,303.000	
	CENOVUS ENERGY INC	86,100	20.160	1,735,776.000	
	DOLLARAMA INC	17,500	193.740	3,390,450.000	
	ALTAGAS LTD	18,400	38.740	712,816.000	
	KEYERA CORP	14,200	42.580	604,636.000	
	ARC RESOURCES LTD	36,500	30.650	1,118,725.000	
	カナダ・ドル 小計			204,254,709.410 (21,704,105,421)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	164,800	2.580	425,184.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	88,400	34.950	3,089,580.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	149,040	44.450	6,624,828.000	

	SINGAPORE AIRLINES LTD	104,175	6.940	722,974.500	
	KEPPEL CORP LTD	101,900	7.220	735,718.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	180,800	2.250	406,800.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	237,000	16.060	3,806,220.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	423,100	0.705	298,285.500	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	519,950	3.950	2,053,802.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	109,300	7.800	852,540.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	62,600	6.890	431,314.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	60,000	14.000	840,000.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	134,500	3.010	404,845.000	
シンガポール・ドル 小計				20,692,091.500 (2,328,894,898)	
スイス・フラン	SANDOZ GROUP AG	26,616	42.760	1,138,100.160	
	GALDERMA GROUP N AG	6,955	111.300	774,091.500	
	AVOLTA AG	5,644	42.680	240,885.920	
	UBS GROUP AG-REG	209,664	26.100	5,472,230.400	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,003	286.400	573,659.200	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	438	596.000	261,048.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	44,776	269.700	12,076,087.200	
	SIKA AG-REG	9,748	209.000	2,037,332.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	7	132,400.000	926,800.000	
	ABB LTD-REG	100,886	47.620	4,804,191.320	
	SWISS RE AG	19,275	136.400	2,629,110.000	
	NESTLE SA-REG	167,093	84.250	14,077,585.250	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,423	1,014.500	1,443,633.500	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,549	296.800	756,543.200	
	JULIUS BAER GROUP LTD	12,899	52.440	676,423.560	
	SGS SA-REG	10,295	84.620	871,162.900	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,471	287.500	422,912.500	
	TEMENOS AG - REG	3,532	59.700	210,860.400	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,328	185.500	431,844.000	
	VAT GROUP AG	1,698	334.000	567,132.000	
	BKW AG	1,374	172.500	237,015.000	
	ALCON INC	31,875	70.900	2,259,937.500	
	SIG GROUP N AG	19,184	15.720	301,572.480	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,820	134.100	244,062.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	9,363	561.200	5,254,515.600		
BALOISE HOLDING AG - REG	2,624	185.400	486,489.600		
NOVARTIS AG-REG	121,137	97.160	11,769,670.920		

	BARRY CALLEBAUT AG-REG	212	876.500	185,818.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	34,254	150.400	5,151,801.600	
	SWISSCOM AG-REG	1,621	556.500	902,086.500	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,896	89.500	169,692.000	
	GEBERIT AG-REG	2,087	636.400	1,328,166.800	
	GIVAUDAN-REG	582	4,124.000	2,400,168.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	6,982	104.950	732,760.900	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,272	251.100	821,599.200	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	9,727	69.620	677,193.740	
	LONZA GROUP AG-REG	4,626	568.800	2,631,268.800	
	HOLCIM LTD	33,222	93.100	3,092,968.200	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,805	798.400	1,441,112.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	3,118	186.500	581,507.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,148	116.300	598,712.400	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	59	13,480.000	795,320.000	
	スイス・フラン 小計			92,455,071.250 (16,439,436,219)	
スウェーデン・ クローナ	SAGAX CLASS B	15,363	202.000	3,103,326.000	
	ERICSSON LM-B SHS	194,367	79.700	15,491,049.900	
	VOLVO AB-B SHS	111,147	264.600	29,409,496.200	
	SKF AB-B SHARES	23,823	206.600	4,921,831.800	
	TELE2 AB-B SHS	38,341	139.900	5,363,905.900	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	110,995	163.000	18,092,185.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	102,045	125.750	12,832,158.750	
	SWEDBANK AB - A SHARES	59,384	247.000	14,667,848.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	39,631	131.100	5,195,624.100	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	42,503	123.300	5,240,619.900	
	SKANSKA AB-B SHS	23,765	228.800	5,437,432.000	
	SANDVIK AB	74,595	210.500	15,702,247.500	
	INVESTOR AB-B SHS	121,108	274.900	33,292,589.200	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	187,909	152.950	28,740,681.550	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,377	377.400	2,029,279.800	
	SECURITAS AB-B SHS	34,394	137.500	4,729,175.000	
	TELIA CO AB	165,046	35.240	5,816,221.040	
	ALFA LAVAL AB	20,196	403.400	8,147,066.400	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	109,221	135.850	14,837,672.850	
	ASSA ABLOY AB-B	70,124	302.400	21,205,497.600	
	TRELLEBORG AB-B SHS	14,114	344.100	4,856,627.400	

	SAAB AB-B	22,379	460.000	10,294,340.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	8,345	341.000	2,845,645.000	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	50,255	63.460	3,189,182.300	
	INDUTRADE AB	19,117	256.400	4,901,598.800	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	13,673	285.000	3,896,805.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	5,314	466.600	2,479,512.400	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	10,335	244.200	2,523,807.000	
	LIFCO AB-B SHS	16,328	390.200	6,371,185.600	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	106,077	40.390	4,284,450.030	
	BEIJER REF AB	26,893	144.050	3,873,936.650	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	42,104	263.800	11,107,035.200	
	BOLIDEN AB	19,894	293.200	5,832,920.800	
	EPIROC AB-A	46,115	211.800	9,767,157.000	
	EPIROC AB-B	27,287	183.900	5,018,079.300	
	EQT AB	26,064	275.200	7,172,812.800	
	EVOLUTION AB	10,373	669.000	6,939,537.000	
	HEXAGON AB-B SHS	145,259	92.240	13,398,690.160	
	ADDTECH AB-B SHARES	18,173	314.600	5,717,225.800	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,859	339.600	3,687,716.400	
スウェーデン・クローナ 小計				372,414,173.130	
				(5,656,971,290)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	225,287	516.200	116,293,149.400	
	DANSKE BANK A/S	48,242	256.000	12,349,952.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	207	12,490.000	2,585,430.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	70,628	108.050	7,631,355.400	
	CARLSBERG AS-B	6,814	932.400	6,353,373.600	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	24,648	485.500	11,966,604.000	
	COLOPLAST-B	8,851	637.000	5,638,087.000	
	DSV PANALPINA A/S	14,276	1,596.500	22,791,634.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	7,990	298.150	2,382,218.500	
	DEMANT A/S	6,239	281.600	1,756,902.400	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	401	12,630.000	5,064,630.000	
	TRYG A/S	23,759	164.800	3,915,483.200	
	PANDORA A/S	5,758	1,149.000	6,615,942.000	
	GENMAB A/S	4,467	1,481.000	6,615,627.000	
	ORSTED A/S	11,806	273.500	3,228,941.000	
デンマーク・クローネ 小計				215,189,329.500	
				(4,805,177,728)	

ニュージーランド ド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	91,451	5.870	536,817.370	
	INFRATIL LTD	64,300	10.275	660,682.500	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	118,067	7.965	940,403.650	
	CONTACT ENERGY LTD	56,210	8.990	505,327.900	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	40,994	36.600	1,500,380.400	
ニュージーランド・ドル 小計				4,143,611.820 (360,411,356)	
ノルウェー・ク ローネ	DNB BANK	62,650	278.400	17,441,760.000	
	NORSK HYDRO ASA	98,439	55.240	5,437,770.360	
	ORKLA ASA	49,132	110.000	5,404,520.000	
	TELENOR ASA	43,057	152.500	6,566,192.500	
	EQUINOR ASA	59,779	273.300	16,337,600.700	
	YARA INTERNATIONAL ASA	11,626	388.400	4,515,538.400	
	MOWI ASA	32,574	188.400	6,136,941.600	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	14,018	249.000	3,490,482.000	
	AKER BP ASA	22,064	273.000	6,023,472.000	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	30,645	384.850	11,793,728.250	
	SALMAR ASA	4,713	454.400	2,141,587.200	
ノルウェー・クローネ 小計				85,289,593.010 (1,241,816,474)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	73,957	27.910	2,064,139.870	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	31,525	38.130	1,202,048.250	
	EXOR NV	5,778	80.950	467,729.100	
	DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	7,428	41.390	307,444.920	
	DSM FIRMENICH AG	12,323	96.420	1,188,183.660	
	FERROVIAL	34,020	44.550	1,515,591.000	
	LOTUS BAKERIES NV	25	8,640.000	216,000.000	
	SYENSCO SA	4,807	67.000	322,069.000	
	CVC CAPITAL PARTNERS PLC	13,810	15.770	217,783.700	
	COVESTRO V AG	11,566	60.400	698,586.400	
	BAYER AG-REG	65,129	27.480	1,789,744.920	
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,731	18.650	312,033.150	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	122,803	23.880	2,932,535.640	
	COMMERZBANK AG	58,682	28.100	1,648,964.200	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	13,642	88.840	1,211,955.280	
	SIEMENS AG-REG	50,438	214.950	10,841,648.100	
E.ON SE	148,932	15.485	2,306,212.020		

BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	19,201	75.300	1,445,835.300	
GEA GROUP AG	9,711	59.000	572,949.000	
CONTINENTAL AG	7,171	76.660	549,728.860	
BASF SE	59,170	42.120	2,492,240.400	
ALLIANZ SE-REG	25,658	341.600	8,764,772.800	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	11,235	67.420	757,463.700	
RHEINMETALL AG	2,941	1,795.500	5,280,565.500	
RWE AG	41,911	35.590	1,491,612.490	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	39,785	6.882	273,800.370	
BRENNTAG SE	7,967	60.000	478,020.000	
FRESENIUS SE & CO KGAA	28,027	44.000	1,233,188.000	
SAP SE	69,258	254.750	17,643,475.500	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	8,824	553.400	4,883,201.600	
ZALANDO SE	14,625	28.500	416,812.500	
HEIDELBERG MATERIALS AG	8,907	176.000	1,567,632.000	
RATIONAL AG	336	708.500	238,056.000	
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	4,070	103.600	421,652.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,707	205.600	350,959.200	
TALANX AG	4,211	110.400	464,894.400	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	9,997	33.860	338,498.420	
DELIVERY HERO SE	12,282	22.100	271,432.200	
NEMETSCHEK SE	3,764	123.800	465,983.200	
SCOUT24 AG	4,899	117.300	574,652.700	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	22,677	45.650	1,035,205.050	
KNORR-BREMSE AG	4,732	83.700	396,068.400	
SIEMENS ENERGY AG	45,182	84.820	3,832,337.240	
BEIERSDORF AG	6,464	115.450	746,268.800	
MERCK KGAA	8,427	114.800	967,419.600	
ADIDAS AG	11,372	200.000	2,274,400.000	
HENKEL AG & CO KGAA	6,771	61.700	417,770.700	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	231,501	30.730	7,114,025.730	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	14,685	49.880	732,487.800	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	47,936	50.820	2,436,107.520	
QIAGEN N.V.	14,061	40.680	572,001.480	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	86,624	35.420	3,068,222.080	
HANNOVER RUECK SE	4,030	268.600	1,082,458.000	
DHL GROUP	63,695	40.770	2,596,845.150	
DEUTSCHE BOERSE AG	12,475	267.900	3,342,052.500	
MTU AERO ENGINES AG	3,613	341.200	1,232,755.600	

SYMRISE AG	8,658	101.700	880,518.600	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,705	70.650	261,758.250	
VONOVIA SE	49,069	28.320	1,389,634.080	
LEG IMMOBILIEN SE	4,856	70.550	342,590.800	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	55,277	19.885	1,099,183.140	
NN GROUP NV	17,832	55.200	984,326.400	
ARCELORMITTAL	31,074	26.080	810,409.920	
HEINEKEN NV	19,075	78.100	1,489,757.500	
AEGON LTD	87,754	6.028	528,981.110	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	60,471	35.850	2,167,885.350	
AKZO NOBEL N.V.	11,137	58.080	646,836.960	
WOLTERS KLUWER	15,849	146.450	2,321,086.050	
ING GROEP NV	208,773	18.006	3,759,166.630	
KONINKLIJKE KPN NV	257,935	4.097	1,056,759.690	
ASML HOLDING NV	26,150	664.600	17,379,290.000	
ABN AMRO BANK NV-CVA	29,855	22.760	679,499.800	
IMCD NV	3,862	117.450	453,591.900	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	5,313	125.900	668,906.700	
ASR NEDERLAND NV	9,732	54.360	529,031.520	
ADYEN NV	1,638	1,656.200	2,712,855.600	
PROSUS NV	86,578	46.680	4,041,461.040	
JDE PEET'S NV	11,285	23.480	264,971.800	
INPOST SA	14,300	13.970	199,771.000	
ASM INTERNATIONAL NV	3,154	519.400	1,638,187.600	
RANDSTAD NV	7,252	37.840	274,415.680	
HEINEKEN HOLDING NV	8,448	67.550	570,662.400	
TOTALENERGIES SE	135,045	54.800	7,400,466.000	
MICHELIN (CGDE)	44,504	32.200	1,433,028.800	
AIR LIQUIDE SA	38,395	182.800	7,018,606.000	
KERING	4,955	172.580	855,133.900	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	36,239	220.450	7,988,887.550	
BOUYGUES SA	12,369	37.820	467,795.580	
BNP PARIBAS	67,533	75.280	5,083,884.240	
THALES SA	6,139	250.600	1,538,433.400	
DANONE	42,772	72.620	3,106,102.640	
CARREFOUR SA	35,355	12.815	453,074.320	
L'OREAL	15,978	371.050	5,928,636.900	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	29,764	95.800	2,851,391.200	
LEGRAND SA	17,390	109.900	1,911,161.000	

PERNOD RICARD SA	13,353	89.700	1,197,764.100	
EURAZEO SE	2,599	58.950	153,211.050	
REXEL SA	14,843	24.960	370,481.280	
SOCIETE GENERALE SA	47,751	48.440	2,313,058.440	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	18,240	461.400	8,415,936.000	
ACCOR SA	13,005	43.260	562,596.300	
CAPGEMINI SE	10,845	150.400	1,631,088.000	
PUBLICIS GROUPE	15,216	95.060	1,446,432.960	
BUREAU VERITAS SA	20,709	29.200	604,702.800	
EIFFAGE	4,559	118.200	538,873.800	
SODEXO SA	5,916	55.500	328,338.000	
IPSEN	2,461	103.300	254,221.300	
AMUNDI SA	4,052	66.900	271,078.800	
TELEPERFORMANCE	3,431	90.740	311,328.940	
EURONEXT NV	5,201	142.000	738,542.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	7,815	60.320	471,400.800	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,910	199.050	380,185.500	
ESSILORLUXOTTICA	19,689	242.000	4,764,738.000	
DASSAULT AVIATION SA	1,289	304.200	392,113.800	
FDJ UNITED	7,358	31.840	234,278.720	
AXA SA	117,536	41.620	4,891,848.320	
EDENRED	15,773	25.420	400,949.660	
RENAULT SA	12,530	43.040	539,291.200	
HERMES INTERNATIONAL	2,061	2,295.000	4,729,995.000	
STMICROELECTRONICS NV	44,912	25.590	1,149,298.080	
DASSAULT SYSTEMES SE	44,423	31.680	1,407,320.640	
ORANGE	123,469	12.750	1,574,229.750	
ALSTOM	22,563	18.850	425,312.550	
SANOFI	73,577	86.800	6,386,483.600	
VINCI SA	32,817	124.650	4,090,639.050	
AIRBUS SE	39,426	161.580	6,370,453.080	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	41,461	30.200	1,252,122.200	
CREDIT AGRICOLE SA	70,174	15.845	1,111,907.030	
BIOMERIEUX	2,702	120.600	325,861.200	
ENGIE	121,144	19.875	2,407,737.000	
SAFRAN SA	23,850	253.200	6,038,820.000	
ARKEMA	3,724	60.250	224,371.000	
ADP	2,262	107.800	243,843.600	
GETLINK SE	20,144	16.430	330,965.920	

BOLLORE	46,528	5.230	243,341.440	
UCB SA	8,339	163.450	1,363,009.550	
KBC GROUP NV	15,265	84.180	1,285,007.700	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,411	72.000	389,592.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	65,875	61.960	4,081,615.000	
AGEAS	9,768	56.550	552,380.400	
D' IETEREN GROUP	1,402	176.900	248,013.800	
ELIA GROUP SA/NV	3,400	92.800	315,520.000	
SOFINA	1,011	253.600	256,389.600	
ARGENX SE	4,039	502.600	2,030,001.400	
PRYSMIAN SPA	18,610	55.800	1,038,438.000	
GENERALI	56,994	30.820	1,756,555.080	
MEDIOBANCA SPA	32,588	19.185	625,200.780	
TENARIS SA	26,963	15.550	419,274.650	
UNICREDIT SPA	92,982	56.150	5,220,939.300	
UNIPOL GRUPPO SPA	23,180	16.755	388,380.900	
TELECOM ITALIA SPA	716,514	0.375	268,692.750	
INTESA SANPAOLO	1,003,568	4.820	4,837,699.540	
POSTE ITALIANE SPA	29,833	18.670	556,982.110	
MONCLER SPA	15,521	50.700	786,914.700	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	7,629	54.350	414,636.150	
ENI SPA	146,354	14.002	2,049,248.700	
BPER BANCA	64,630	7.550	487,956.500	
DAVIDE CAMPARI -MILANO NV	38,820	5.632	218,634.240	
BANCO BPM SPA	83,944	9.916	832,388.700	
DIASORIN SPA	1,344	93.320	125,422.080	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	18,401	10.140	186,586.140	
NEXI SPA	32,152	4.837	155,519.220	
BANCA MEDIOLANUM SPA	15,600	14.150	220,740.000	
LEONARDO SPA	26,885	48.610	1,306,879.850	
ENEL SPA	539,416	7.982	4,305,618.510	
SNAM SPA	131,435	5.256	690,822.360	
TERNA SPA	93,311	8.942	834,386.960	
FINECOBANK SPA	40,524	19.090	773,603.160	
STELLANTIS NV	132,358	8.483	1,122,792.910	
FERRARI NV	8,316	401.500	3,338,874.000	
TELEFONICA SA	243,404	4.594	1,118,197.970	
ENDESA SA	20,725	27.220	564,134.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	382,244	12.955	4,951,971.020	

IBERDROLA SA	384,318	16.205	6,227,873.190	
BANCO DE SABADELL SA	354,585	2.778	985,037.130	
BANKINTER SA	47,200	11.020	520,144.000	
REPSOL SA	76,779	12.255	940,926.640	
GRIFOLS SA	18,913	10.195	192,818.030	
BANCO SANTANDER SA	1,004,985	6.859	6,893,192.110	
AMADEUS IT GROUP SA	29,859	70.660	2,109,836.940	
CAIXABANK SA	261,770	7.300	1,910,921.000	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	87,000	3.726	324,162.000	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11,617	56.350	654,617.950	
AENA SME SA	4,988	230.400	1,149,235.200	
CELLNEX TELECOM SA	32,639	32.970	1,076,107.830	
ACCIONA SA	1,612	145.200	234,062.400	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	72,301	45.720	3,305,601.720	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	26,487	17.730	469,614.510	
UPM-KYMMENE OYJ	35,388	23.040	815,339.520	
NOKIA OYJ	354,278	4.490	1,590,708.220	
WARTSILA OYJ ABP	32,783	19.245	630,908.830	
STORA ENSO OYJ-R SHS	38,002	8.356	317,544.710	
ELISA OYJ	9,284	45.540	422,793.360	
SAMPO OYJ-A SHS	160,775	9.104	1,463,695.600	
FORTUM OYJ	29,279	16.010	468,756.790	
KESKO OYJ-B SHS	18,150	20.340	369,171.000	
KONE OYJ-B	22,553	56.060	1,264,321.180	
NESTE OYJ	27,615	10.395	287,057.920	
ORION OYJ-CLASS B	7,066	63.300	447,277.800	
METSO CORPORATION	40,573	10.795	437,985.530	
NORDEA BANK ABP	208,352	12.420	2,587,731.840	
VERBUND AG	4,439	68.300	303,183.700	
OMV AG	9,614	44.540	428,207.560	
ERSTE GROUP BANK AG	20,378	70.850	1,443,781.300	
RYANAIR HOLDINGS PLC	59,500	23.280	1,385,160.000	
AIB GROUP PLC	137,275	6.935	952,002.120	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	65,450	11.965	783,109.250	
KINGSPAN GROUP PLC	10,273	76.100	781,775.300	
JERONIMO MARTINS	18,484	21.560	398,515.040	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	208,130	3.609	751,141.170	
GALP ENERGIA SGPS SA	27,055	15.780	426,927.900	
EDP RENOVAVEIS SA	20,383	9.500	193,638.500	

	KERRY GROUP PLC-A	11,056	97.050	1,072,984.800	
ユーロ 小計				371,916,712.780 (61,946,447,681)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	97,000	51.400	4,985,800.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	154,000	32.750	5,043,500.000	
	MTR CORP	109,000	28.000	3,052,000.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	101,500	86.550	8,784,825.000	
	SINO LAND CO	284,000	8.300	2,357,200.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	187,669	47.400	8,895,510.600	
	WHARF HOLDINGS LTD	77,000	23.100	1,778,700.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	29,000	68.700	1,992,300.000	
	CLP HOLDINGS LTD	115,000	66.100	7,601,500.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	102,507	25.700	2,634,429.900	
	HONG KONG & CHINA GAS	783,475	6.800	5,327,630.000	
	HANG SENG BANK LTD	52,700	114.800	6,049,960.000	
	WH GROUP LTD	583,500	7.520	4,387,920.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	84,300	413.600	34,866,480.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	135,169	33.450	4,521,403.050	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	45,000	51.500	2,317,500.000	
	AIA GROUP LTD	748,400	69.150	51,751,860.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	96,000	26.000	2,496,000.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	117,000	20.950	2,451,150.000	
	SANDS CHINA LTD	170,000	14.920	2,536,400.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	103,000	89.600	9,228,800.000		
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	259,000	34.750	9,000,250.000		
香港・ドル 小計				182,061,118.550 (3,348,103,970)	
合計				659,045,294,969 [659,045,294,969]	

## (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	9,737	2,007,574.660	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	22,107	3,468,588.300	
		BXP INC	10,000	721,000.000	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	7,400	1,685,942.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	23,200	1,598,016.000	
		EQUINIX INC	6,708	5,987,829.120	
		AMERICAN TOWER CORP	31,800	6,830,640.000	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	22,600	822,640.000	

	KIMCO REALTY CORP	46,100	960,263.000	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,700	863,940.000	
	INVITATION HOMES INC	39,500	1,324,830.000	
	VICI PROPERTIES INC	71,700	2,303,004.000	
	VENTAS INC	29,700	1,896,642.000	
	WEYERHAEUSER CO	49,214	1,318,935.200	
	CROWN CASTLE INTL CORP	29,600	2,912,344.000	
	IRON MOUNTAIN INC	20,000	2,031,800.000	
	SUN COMMUNITIES INC	8,700	1,075,407.000	
	PROLOGIS INC	62,854	6,742,977.120	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,500	757,155.000	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	7,300	847,676.000	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,400	1,251,624.000	
	WELLTOWER INC	44,000	6,705,600.000	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	47,400	823,812.000	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	8,000	1,198,800.000	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	12,400	773,264.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	40,600	778,708.000	
	REALTY INCOME CORP	60,495	3,486,931.800	
	PUBLIC STORAGE	10,700	3,155,965.000	
	REGENCY CENTERS CORP	11,700	821,925.000	
	UDR INC	21,400	882,322.000	
	WP CAREY INC	14,900	943,766.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	22,900	3,995,363.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	14,400	2,154,240.000	
	アメリカ・ドル 小計		73,129,524.200 (10,561,365,885)	
イギリス・ポ ンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	46,190	284,530.400	
	SEGRO PLC	83,895	580,217.820	
	イギリス・ポンド 小計		864,748.220 (169,170,694)	
オーストラ リア・ドル	TRANSURBAN GROUP	198,019	2,865,334.930	
	APA GROUP	83,515	701,526.000	
	SCENTRE GROUP	326,820	1,202,697.600	
	STOCKLAND	149,947	841,202.670	

	GOODMAN GROUP	130,028	4,418,351.440	
	VICINITY CENTRES	243,623	618,802.420	
オーストラリア・ドル 小計			10,647,915.060 (998,454,995)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	261,700	683,037.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	409,391	872,002.830	
シンガポール・ドル 小計			1,555,039.830 (175,019,733)	
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	8,107	671,583.880	
	GECINA SA	3,108	295,260.000	
	KLEPIERRE	14,042	467,036.920	
	COVIVIO	3,649	186,281.450	
ユーロ 小計			1,620,162.250 (269,854,224)	
香港・ドル	LINK REIT	181,900	7,648,895.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	266,000	3,027,080.000	
香港・ドル 小計			10,675,975.000 (196,331,180)	
投資証券 合計			12,370,196,711 [12,370,196,711]	
合計			12,370,196,711 [12,370,196,711]	

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 527銘柄	97.9%	2.1%	76.6%
	投資証券 33銘柄			
イギリス・ポンド	株式 71銘柄	99.4%	0.6%	3.9%
	投資証券 2銘柄			
イスラエル・シェケル	株式 8銘柄	100%	-%	0.1%

オーストラリア・ドル	株式	42銘柄	91.5%	8.5%	1.8%
	投資証券	6銘柄			
カナダ・ドル	株式	83銘柄	100%	-%	3.2%
シンガポール・ドル	株式	13銘柄	93%	7.0%	0.4%
	投資証券	2銘柄			
スイス・フラン	株式	42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%	-%	0.7%
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	213銘柄	99.6%	0.4%	9.3%
	投資証券	4銘柄			
香港・ドル	株式	22銘柄	94.5%	5.5%	0.5%
	投資証券	2銘柄			

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【ダイワファンドラップ 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)】

(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6月18日から2025年6月16日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 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）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	64,541,484	75,592,269
親投資信託受益証券	6,371,161,073	6,954,993,897
未収入金	2,610,000	1,080,000
流動資産合計	6,438,312,557	7,031,666,166
資産合計	6,438,312,557	7,031,666,166
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,892,089	5,480,399
未払受託者報酬	626,456	732,798
未払委託者報酬	12,373,460	14,473,583
その他未払費用	156,530	183,123
流動負債合計	16,048,535	20,869,903
負債合計	16,048,535	20,869,903
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,953,160,126	2,036,904,712
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,469,103,896	4,973,891,551
（分配準備積立金）	2,281,542,828	2,229,182,513
元本等合計	6,422,264,022	7,010,796,263
純資産合計	6,422,264,022	7,010,796,263
負債純資産合計	6,438,312,557	7,031,666,166

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期		第9期	
	自 2023年6月16日 至 2024年6月17日		自 2024年6月18日 至 2025年6月16日	
営業収益				
受取利息		12,465		208,199
有価証券売買等損益		1,543,298,456		357,364,824
営業収益合計		1,543,310,921		357,573,023
営業費用				
支払利息		9,679		-
受託者報酬		1,116,041		1,446,090
委託者報酬		22,043,505		28,561,980
その他費用		278,833		361,373
営業費用合計		23,448,058		30,369,443
営業利益又は営業損失（ ）		1,519,862,863		327,203,580
経常利益又は経常損失（ ）		1,519,862,863		327,203,580
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,519,862,863		327,203,580
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（ ）		134,581,339		25,473,014
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,354,036,492		4,469,103,896
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,410,257,530		963,758,824
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,410,257,530		963,758,824
剰余金減少額又は欠損金増加額		680,471,650		760,701,735
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		680,471,650		760,701,735
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		4,469,103,896		4,973,891,551

## (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6月18日 至2025年6月16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6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2024年6月17日としており、2025年6月15日が休日のため、当計算期間末日を2025年6月16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6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
	1. 1 期首元本額	1,603,693,505円
期中追加設定元本額	802,382,236円	415,794,997円
期中一部解約元本額	452,915,615円	332,050,411円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,953,160,126口	2,036,904,712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6月16日 至2024年6月17日	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (4,146円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (1,385,269,436円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (2,187,561,068円)及び分配準備積立金(896,269,246円)より分配対象額は4,469,103,896円(1万口当たり22,881.40円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (189,093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 (301,541,473円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (2,744,709,038円)及び分配準備積立金(1,927,451,947円)より分配対象額は4,973,891,551円(1万口当たり24,418.87円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第9期
	2025年6月16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	第9期
	2024年6月17日現在	2025年6月16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	1,424,237,204	327,366,855
合計	1,424,237,204	327,366,855

## (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	第9期
2024年6月17日現在	2025年6月16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6月18日
至2025年6月16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	第9期
	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	3,288円	3,441円
(1万口当たり純資産額)	(32,881円)	(34,419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	477,988,547	1,413,937,920	
	外国株式インデックスマザーファンド	801,703,799	5,541,055,977	
親投資信託受益証券 合計			6,954,993,897	
合計			6,954,993,897	

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

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

「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6月17日現在 金額(円)	2025年6月16日現在 金額(円)

資産の部		
流動資産		
預金	998,941,026	700,287,179
コール・ローン	631,071,582	584,127,696
株式	30,588,982,178	41,713,943,384
投資証券	3,315,393,633	2,786,106,592
派生商品評価勘定	30,805,727	82,448,202
未収入金	744,192	1,923,639
未収配当金	252,254,458	231,706,961
差入委託証拠金	642,820,077	763,587,592
流動資産合計	36,461,012,873	46,864,131,245
資産合計	36,461,012,873	46,864,131,245
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	867	-
未払解約金	4,404,700	10,776,000
流動負債合計	4,405,567	10,776,000
負債合計	4,405,567	10,776,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	13,426,251,057
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		23,030,356,249
元本等合計		36,456,607,306
純資産合計		36,456,607,306
負債純資産合計		36,461,012,873

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1. 1 期首	2023年6月16日	2024年6月18日
期首元本額	13,177,740,509円	13,426,251,057円
期中追加設定元本額	2,520,427,957円	3,062,196,792円
期中一部解約元本額	2,271,917,409円	649,581,815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）	107,596,249円	133,899,697円
ダイワファンドラップ 外国株式 インデックス エマーGINGプラ ス（為替ヘッジなし）	464,270,984円	477,988,547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GINGプラス（為替ヘッジ なし）	341,221,546円	372,793,908円
D - I ' s 新興国株式インデッ クス	119,821,542円	108,128,077円
i F r e e 新興国株式インデッ クス	6,790,934,858円	8,696,050,730円
i F r e e 8資産バランス	3,523,421,415円	3,894,680,608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）	8,941,641円	5,190,817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）	656,216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	1,650,579,883円	1,788,688,257円
ダイワ・インデックスセレクト新興国株式	312,454,350円	265,356,693円
ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド	106,352,373円	96,088,700円
計	13,426,251,057円	15,838,866,034円
2. 期末日における受益権の総数	13,426,251,057口	15,838,866,034口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	---

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年6月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2024年6月17日現在	2025年6月16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	2,547,934,570	2,141,693,559
投資証券	153,746,579	261,765,222
合計	2,701,681,149	2,403,458,781

(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6月17日現在				2025年6月16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	1,909,596,775	-	1,939,538,502	29,941,727	1,722,483,620	-	1,804,831,182	82,347,562
合計	1,909,596,775	-	1,939,538,502	29,941,727	1,722,483,620	-	1,804,831,182	82,347,562

- (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6月17日現在				2025年6月16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)		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売建	479,067	-	479,751	684	-	-	-	-
サウジアラビ ア・リアル	479,067	-	479,751	684	-	-	-	-
買建	200,692,827	-	201,556,644	863,817	14,306,360	-	14,407,000	100,640
アメリカ・ドル	200,692,827	-	201,556,644	863,817	14,306,360	-	14,407,000	100,640
合計	201,171,894	-	202,036,395	863,133	14,306,360	-	14,407,000	100,640

- (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	2.7153円	2.9581円
(1万口当たり純資産額)	(27,153円)	(29,581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 PEF	29,000	0.000	0.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	42,000	14.820	622,440.000	
	CANADIAN SOLAR INC	18,500	11.040	204,240.000	
	IQIYI INC-ADR	126,000	1.730	217,980.000	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	17,700	18.420	326,034.000	
	PINDUODUO INC-ADR	8,700	100.580	875,046.000	
	KE HOLDINGS INC-ADR	14,300	18.470	264,121.000	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	13,400	13.910	186,394.000	
	SBERBANK ROSSII	698,708	0.000	0.000	
	JINKOSOLAR HOLDING ADR REP LTD	14,900	19.480	290,252.000	
	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	
	360 DIGITECH ADR INC	4,900	41.690	204,281.000	
	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			3,190,788.000 (460,813,603)	
インド・ルピー	BHARTI AIRTEL PARTLY PAID LTD	3,608	1,376.100	4,964,968.800	
	JIO FINANCIAL SERVICES LTD	129,991	294.050	38,223,853.550	
	TATA STEEL LTD	617,810	152.130	93,987,435.300	
	AXIS BANK LTD	91,997	1,205.800	110,929,982.600	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	3,155	12,408.000	39,147,240.000	
	TATA POWER CO LTD	44,549	397.200	17,694,862.800	
	FEDERAL BANK LTD	92,910	205.300	19,074,423.000	
	BANK OF BARODA	110,407	239.220	26,411,562.540	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	18,566	2,319.000	43,054,554.000	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	107,210	386.250	41,409,862.500	
	STATE BANK OF INDIA	116,609	792.350	92,395,141.150	
	NTPC LTD	261,836	331.950	86,916,460.200	
	POWER FINANCE CORPORATION	157,365	406.450	63,961,004.250	
	JSW STEEL LTD	28,598	987.250	28,233,375.500	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	241,479	285.500	68,942,254.500	
	INDIAN OIL CORP LTD	309,597	140.340	43,448,842.980	
	BAJAJ FINSERV LTD	11,345	2,011.000	22,814,795.000	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	172,724	312.300	53,941,705.200	

PUNJAB NATIONAL BANK	216,474	106.610	23,078,293.140	
STEEL AUTHORITY OF INDIA	240,861	129.350	31,155,370.350	
JINDAL STEEL & POWER LTD	28,454	920.750	26,199,020.500	
CANARA BANK	224,158	111.460	24,984,650.680	
UNION BANK OF INDIA	165,991	146.240	24,274,523.840	
ULTRATECH CEMENT LTD	1,986	11,224.000	22,290,864.000	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	20,038	2,107.400	42,228,081.200	
OIL INDIA LTD	48,136	477.750	22,996,974.000	
SHRIRAM FINANCE LTD	53,268	667.150	35,537,746.200	
TECH MAHINDRA LTD	20,866	1,659.000	34,616,694.000	
YES BANK LTD	1,124,842	20.160	22,676,814.720	
REC LTD	86,270	402.700	34,740,929.000	
COAL INDIA LTD	138,787	391.200	54,293,474.400	
INDUSIND BANK LTD	38,319	816.850	31,300,875.150	
BAJAJ FINANCE LTD	3,824	9,331.000	35,681,744.000	
INDUS TOWERS LTD	73,058	380.350	27,787,610.300	
GAIL INDIA LTD	224,065	191.340	42,872,597.100	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	88,756	641.800	56,963,600.800	
GRASIM INDUSTRIES LTD	11,637	2,663.800	30,998,640.600	
WIPRO LTD	62,662	260.210	16,305,279.020	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	28,443	3,445.700	98,006,045.100	
INFOSYS LTD	98,020	1,602.000	157,028,040.000	
LARSEN & TOUBRO LTD	20,484	3,587.400	73,484,301.600	
TATA MOTORS LTD	127,732	712.050	90,951,570.600	
DR. REDDY'S LABORATORIES	18,695	1,362.500	25,471,937.500	
HDFC BANK LIMITED	157,809	1,917.600	302,614,538.400	
ICICI BANK LTD	120,003	1,416.100	169,936,248.300	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	260,907	1,427.900	372,549,105.300	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	270,203	251.510	67,958,756.530	
ITC LTD	106,344	413.900	44,015,781.600	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	22,275	3,006.000	66,958,650.000	
HERO MOTOCORP LTD	6,689	4,333.800	28,988,788.200	
BHARTI AIRTEL LTD	45,726	1,840.400	84,154,130.400	
UPL LTD	34,005	632.500	21,508,162.500	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	18,283	1,687.800	30,858,047.400	
HCL TECHNOLOGIES LTD	33,331	1,695.300	56,506,044.300	
VEDANTA LTD	162,367	458.100	74,380,322.700	
インド・ルピー 小計			3,301,906,577.300	
			(5,580,222,115)	

インドネシア・ルピア	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	640,200	4,570.000	2,925,714,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	2,800,500	2,740.000	7,673,370,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	1,052,500	4,540.000	4,778,350,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,440,600	9,025.000	13,001,415,000.000	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	2,282,200	5,150.000	11,753,330,000.000	
	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				57,801,379,000.000 (514,432,274)	
オフショア・人民元	CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	667,200	2.230	1,487,856.000	
	INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	304,500	23.500	7,155,750.000	
	BANK OF BEIJING CO LTD -A	261,100	6.470	1,689,317.000	
	PING AN INSURANCE GROUP CO-A	108,853	54.480	5,930,311.440	
	IND & COMM BK OF CHINA-A	730,100	7.090	5,176,409.000	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	30,900	18.350	567,015.000	
	GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	8,900	22.000	195,800.000	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	42,000	7.910	332,220.000	
	KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	2,100	1,426.950	2,996,595.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	51,200	22.350	1,144,320.000	
	BANK OF JIANGSU CO LTD-A	162,700	11.500	1,871,050.000	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	337,200	8.060	2,717,832.000	
	SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	586,300	12.340	7,234,942.000	
	CITIC SECURITIES CO-A	47,300	26.300	1,243,990.000	
	CHINA MERCHANTS BANK-A	122,800	45.180	5,548,104.000	
	PING AN BANK CO LTD-A	267,300	11.580	3,095,334.000	
	CHINA STATE CONSTRUCTION -A	1,258,600	5.710	7,186,606.000	
	HAIER SMART HOME CO LTD-A	25,700	24.440	628,108.000	
	BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	281,300	3.890	1,094,257.000	
	SAIC MOTOR CORP LTD-A	108,000	16.120	1,740,960.000	
	XIAMEN C & D INC-A	163,900	9.960	1,632,444.000	
	BBMG CORPORATION-A	353,100	1.520	536,712.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	25,300	16.540	418,462.000	
	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	50,900	7.250	369,025.000	
	POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	301,100	4.850	1,460,335.000	
	CHINA COAL ENERGY CO-A	43,400	10.390	450,926.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	171,690	16.190	2,779,661.100		
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	382,500	2.940	1,124,550.000		
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	110,300	6.800	750,040.000		

	JIANGXI COPPER CO LTD-A	32,700	22.320	729,864.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP LTD A	57,250	12.980	743,105.000	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-A	59,000	8.860	522,740.000	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	807,300	5.600	4,520,880.000	
	BANK OF CHINA LTD-A	331,700	5.340	1,771,278.000	
	PETROCHINA CO LTD-A	310,500	8.990	2,791,395.000	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	732,600	5.930	4,344,318.000	
	CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	60,600	30.620	1,855,572.000	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	510,900	7.690	3,928,821.000	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	41,400	39.260	1,625,364.000	
	CHINA VANKE CO LTD -A	347,000	6.440	2,234,680.000	
	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	66,300	35.910	2,380,833.000	
	CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	287,400	8.340	2,396,916.000	
	CHINA MINSHENG BANKING-A	812,700	4.770	3,876,579.000	
	PICC HOLDING CO-A	73,000	8.500	620,500.000	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	792,000	4.020	3,183,840.000	
	CRRC CORP LTD-A	136,700	7.220	986,974.000	
	CHINA UNITED NETWORK-A	283,100	5.270	1,491,937.000	
	CGN POWER CO LTD-A	51,100	3.660	187,026.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD-A	31,700	17.000	538,900.000	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	534,600	5.560	2,972,376.000	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	226,500	6.730	1,524,345.000	
	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	13,000	54.780	712,140.000	
	HUAXIA BANK CO LTD-A	281,800	7.760	2,186,768.000	
	BYD CO LTD -A	1,900	346.000	657,400.000	
	WEICHAO POWER CO LTD-A	44,900	15.480	695,052.000	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	59,400	19.150	1,137,510.000	
	HUANENG POWER INTL INC-A	64,000	7.300	467,200.000	
	POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	223,100	5.310	1,184,661.000	
	CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	285,400	3.380	964,652.000	
	オフショア・人民元 小計			121,792,557.540 (2,446,276,594)	
サウジアラビア ア・リアル	SAUDI ARABIAN MINING	35,154	49.050	1,724,303.700	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS	6,538	98.700	645,300.600	
	SAUDI AWWAL BANK	28,600	31.950	913,770.000	
	ALMARAI	14,314	50.100	717,131.400	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	28,386	54.300	1,541,359.800	
	SAUDI TELECOM CO	52,816	41.800	2,207,708.800	

	AL RAJHI BANK	47,565	91.200	4,337,928.000	
	RIYAD BANK	40,995	27.100	1,110,964.500	
	ETIHAD ETISALAT CO	12,917	57.500	742,727.500	
	ALINMA BANK	49,136	25.300	1,243,140.800	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	72,605	33.950	2,464,939.750	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	196,147	25.400	4,982,133.800	
サウジアラビア・リアル 小計				22,631,408.650	(872,667,117)
タイ・パーツ	SCB X PUBLIC COMPANY LIMITED NON-V	179,800	118.000	21,216,400.000	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	99,600	169.500	16,882,200.000	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	203,500	152.500	31,033,750.000	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	3,719,100	1.970	7,326,627.000	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	359,100	20.300	7,289,730.000	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	49,900	284.000	14,171,600.000	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	673,400	22.000	14,814,800.000	
	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	1,505,600	4.400	6,624,640.000	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	481,000	21.000	10,101,000.000	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	163,600	113.000	18,486,800.000	
	BANGCHAK CORP PCL-NVDR	195,600	37.250	7,286,100.000	
	PTT PCL-NVDR	686,000	30.750	21,094,500.000	
	THAI OIL PCL-NVDR	376,600	29.500	11,109,700.000	
	CP ALL PCL-NVDR	401,200	45.000	18,054,000.000	
	BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	65,000	138.000	8,970,000.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	523,600	25.500	13,351,800.000	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	534,900	20.700	11,072,430.000		
タイ・パーツ 小計				238,886,077.000	(1,060,654,182)
チリ・ペソ	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	15,853	30,700.000	486,687,100.000	
	BANCO DE CHILE	1,689,366	142.300	240,396,781.800	
チリ・ペソ 小計				727,083,881.800	(111,668,450)
トルコ・リラ	AKBANK T.A.S.	332,664	59.500	19,793,508.000	
	TURKIYE IS BANKASI-C	821,090	11.350	9,319,371.500	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	99,505	92.500	9,204,212.500	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	172,197	131.300	22,609,466.100	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	663,979	24.800	16,466,679.200	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	188,702	80.900	15,265,991.800	
	YAPI VE KREDI BANKASI	451,111	27.500	12,405,552.500	

	KOC HOLDING AS	262,937	145.400	38,231,039.800	
	TURK HAVA YOLLARI AO	82,811	263.750	21,841,401.250	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	198,548	32.900	6,532,229.200	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	27,035	495.000	13,382,325.000	
トルコ・リラ 小計				185,051,776.850 (679,676,671)	
ブラジル・リアル	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	84,100	11.560	972,196.000	
	ENERGISA SA-UNITS	48,400	46.420	2,246,728.000	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	58,300	40.510	2,361,733.000	
	VIBRA ENERGIA SA	193,700	21.070	4,081,259.000	
	NATURA &CO HOLDING SA	113,300	10.240	1,160,192.000	
	TIM SA	72,926	20.560	1,499,358.560	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	339,700	10.910	3,706,127.000	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	60,160	38.490	2,315,558.400	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	783,300	32.530	25,480,749.000	
	USINAS SIDER MINAS GER-PF A	149,400	4.770	712,638.000	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	1,085,759	16.290	17,687,014.110	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	584,519	36.170	21,142,052.230	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	295,700	7.940	2,347,858.000	
	VALE SA	755,090	52.130	39,362,841.700	
	GERDAU SA-PREF	322,292	16.760	5,401,613.920	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	539,700	34.980	18,878,706.000	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	154,374	10.570	1,631,733.180	
	ITAUSA SA	324,429	10.710	3,474,634.590	
	BRASKEM SA-PREF A	89,500	10.150	908,425.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	21,700	45.690	991,473.000	
	BANCO DO BRASIL S.A.	285,900	21.590	6,172,581.000	
	COSAN SA	355,700	8.120	2,888,284.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	122,200	41.300	5,046,860.000	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	111,600	12.390	1,382,724.000	
	EMBRAER SA	20,200	66.440	1,342,088.000	
	METALURGICA GERDAU SA-PREF	149,000	9.190	1,369,310.000	
	MOTIVA INFRAESTRUTURA DE MOB	146,700	13.370	1,961,379.000	
BRF SA	64,800	21.000	1,360,800.000		
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	25,100	115.110	2,889,261.000		
LOJAS RENNER S.A.	112,692	18.360	2,069,025.120		
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS	55,100	4.760	262,276.000		
SUZANO SA	62,745	54.110	3,395,131.950		

	LOCALIZA RENT A CAR	94,700	44.020	4,168,694.000	
	MARFRIG GLOBAL FOODS SA	137,300	25.180	3,457,214.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	333,700	13.050	4,354,785.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	84,100	36.400	3,061,240.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GER	6,009	15.270	91,757.430	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	50,500	29.800	1,504,900.000	
	RAIA DROGASIL SA	63,100	13.880	875,828.000	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	108,400	29.790	3,229,236.000	
	KLABIN SA - UNIT	79,290	18.390	1,458,143.100	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	141,700	16.990	2,407,483.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	53,790	32.230	1,733,651.700	
	BANCO BRADESCO S.A.	320,221	14.110	4,518,318.310	
	AMBEV SA	397,800	13.640	5,425,992.000	
ブラジル・リアル 小計				222,789,853.300	
				(5,803,341,494)	
マレーシア・リンギット	MALAYAN BANKING BHD	140,500	9.700	1,362,850.000	
	PUBLIC BANK BERHAD	229,300	4.250	974,525.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	303,700	6.820	2,071,234.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	164,000	14.300	2,345,200.000	
マレーシア・リンギット 小計				6,753,809.000	
				(229,501,859)	
メキシコ・ペソ	AMERICA MOVIL L	1,654,100	16.410	27,143,781.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	28,815	183.160	5,277,755.400	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	10,200	435.330	4,440,366.000	
	CEMEX SAB-CPO	1,717,719	12.860	22,089,866.340	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	136,700	200.390	27,393,313.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	30,100	200.340	6,030,234.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	95,900	105.770	10,143,343.000	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	321,800	62.890	20,238,002.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	138,300	173.610	24,010,263.000	
メキシコ・ペソ 小計				146,766,923.740	
				(1,118,716,199)	
香港・ドル	TRIP.COM GROUP LTD	12,800	468.800	6,000,640.000	
	XPENG CLASS A INC	20,000	72.400	1,448,000.000	
	LI AUTO CLASS A INC	26,800	109.800	2,942,640.000	
	JD LOGISTICS INC	119,800	12.260	1,468,748.000	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	15,650	348.800	5,458,720.000	
	NIO CLASS A INC	44,880	26.950	1,209,516.000	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	1,364,000	3.720	5,074,080.000	

GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	312,000	16.340	5,098,080.000	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	25,000	30.950	773,750.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	64,000	24.900	1,593,600.000	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	134,000	11.760	1,575,840.000	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	301,000	14.340	4,316,340.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	5,521,800	4.250	23,467,650.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	674,000	3.440	2,318,560.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	102,500	510.000	52,275,000.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	222,000	19.900	4,417,800.000	
PETROCHINA CO LTD-H	2,884,000	7.400	21,341,600.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	114,500	12.760	1,461,020.000	
HUANENG POWER INTL INC-H	648,000	5.260	3,408,480.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	236,500	19.420	4,592,830.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	8,592,000	7.630	65,556,960.000	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	1,677,000	7.490	12,560,730.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	167,000	10.020	1,673,340.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	82,200	14.860	1,221,492.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,586,000	5.260	8,342,360.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	304,000	34.600	10,518,400.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	683,120	8.840	6,038,780.800	
SINOPHARM GROUP CO-H	124,400	19.200	2,388,480.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	259,000	27.050	7,005,950.000	
YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LTD	517,500	8.470	4,383,225.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	476,500	5.530	2,635,045.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	54,200	21.900	1,186,980.000	
BYD CO LTD-H	55,500	131.100	7,276,050.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,741,000	5.540	20,725,140.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	80,000	37.700	3,016,000.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	874,000	5.690	4,973,060.000	
CITIC LTD	260,000	11.180	2,906,800.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	2,843,000	1.130	3,212,590.000	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	340,000	15.740	5,351,600.000	
IND & COMM BK OF CHINA-H	10,101,000	6.100	61,616,100.000	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	120,500	28.000	3,374,000.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	354,000	6.600	2,336,400.000	
CHINA TOWER CORP LTD-H	351,000	11.440	4,015,440.000	
XIAOMI CORP-CLASS B	259,000	51.950	13,455,050.000	
MEITUAN-CLASS B	75,690	138.200	10,460,358.000	

ALIBABA GROUP HOLDING LTD	534,800	112.000	59,897,600.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-H	502,000	3.100	1,556,200.000	
CHINA FEIHE LTD	313,000	5.550	1,737,150.000	
CHINA ENERGY ENGINEERING C-H	930,000	1.080	1,004,400.000	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	472,000	6.680	3,152,960.000	
JD.COM INC - CL A	192,895	129.800	25,037,771.000	
NETEASE INC	51,600	207.000	10,681,200.000	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	19,600	138.600	2,716,560.000	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	50,400	36.600	1,844,640.000	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	991,000	1.580	1,565,780.000	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	152,200	22.900	3,485,380.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	65,000	58.000	3,770,000.000	
BAIDU INC-CLASS A	203,300	85.250	17,331,325.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	394,000	13.900	5,476,600.000	
CRRC CORP LTD - H	424,000	5.220	2,213,280.000	
CGN POWER CO LTD-H	1,331,000	2.720	3,620,320.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	879,500	47.700	41,952,150.000	
CHINA COAL ENERGY CO-H	324,000	8.740	2,831,760.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	3,070,000	1.410	4,328,700.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	470,050	14.100	6,627,705.000	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	1,881,580	4.690	8,824,610.200	
BBMG CORP-H	1,454,000	0.710	1,032,340.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	38,800	93.250	3,618,100.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	1,019,400	4.940	5,035,836.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	266,000	17.540	4,665,640.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	458,000	15.100	6,915,800.000	
LI NING CO LTD	163,500	15.480	2,530,980.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	108,500	12.000	1,302,000.000	
WEICHAI POWER CO LTD-H	219,000	16.420	3,595,980.000	
SUNNY OPTICAL TECH	19,700	63.450	1,249,965.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	474,000	5.110	2,422,140.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	277,600	26.600	7,384,160.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	129,600	12.080	1,565,568.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	380,000	17.900	6,802,000.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	69,800	64.300	4,488,140.000	
KUNLUN ENERGY CO LTD	192,000	8.060	1,547,520.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	254,000	20.100	5,105,400.000	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	430,000	3.530	1,517,900.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,187,100	7.320	8,689,572.000	

	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	326,000	6.730	2,193,980.000	
	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	2,497,000	0.860	2,147,420.000	
	CHINA MERCHANTS BANK-H	315,500	51.850	16,358,675.000	
	BANK OF CHINA LTD-H	8,967,000	4.570	40,979,190.000	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	255,000	7.200	1,836,000.000	
	CITIC SECURITIES CO LTD-H	111,500	21.700	2,419,550.000	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	601,000	3.930	2,361,930.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	184,000	8.180	1,505,120.000	
	BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-B	75,100	2.580	193,758.000	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	372,500	9.740	3,628,150.000	
香港・ドル 小計				769,222,130.000 (14,145,994,970)	
台湾・ドル	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTUR	330,000	15.000	4,950,000.000	
	WALSIN LIHWA CORP	21,035	0.000	0.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	45,000	145.000	6,525,000.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	18,000	299.000	5,382,000.000	
	SINO-AMERICAN SILICON PRODUC	71,000	94.800	6,730,800.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	230,000	143.500	33,005,000.000	
	WIWYNN CORP	3,000	2,565.000	7,695,000.000	
	THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	148,000	46.650	6,904,200.000	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	108,112	79.700	8,616,526.400	
	FORMOSA PLASTICS CORP	453,600	36.750	16,669,800.000	
	NAN YA PLASTICS CORP	309,140	29.400	9,088,716.000	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	242,000	25.050	6,062,100.000	
	WALSIN LIHWA CORP	265,000	21.150	5,604,750.000	
	CHINA STEEL CORP	477,686	19.200	9,171,571.200	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	132,616	108.500	14,388,836.000	
	DELTA ELECTRONICS INC	73,000	398.000	29,054,000.000	
	YAGEO CORPORATION	28,578	471.500	13,474,527.000	
	ACER INC	173,000	36.400	6,297,200.000	
	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	83,000	64.300	5,336,900.000	
	INVENTEC CORP	340,000	43.800	14,892,000.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	24,000	550.000	13,200,000.000	
	QUANTA COMPUTER INC	145,000	287.500	41,687,500.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	38,000	154.500	5,871,000.000	
NANYA TECHNOLOGY CORP	150,000	53.500	8,025,000.000		
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	130,400	135.000	17,604,000.000		
MEDIATEK INC	52,003	1,250.000	65,003,750.000		

	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	68,000	212.000	14,416,000.000	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	194,800	239.000	46,557,200.000	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	368,000	74.100	27,268,800.000	
	WAN HAI LINES LTD	97,000	101.000	9,797,000.000	
	EVA AIRWAYS CORP	158,000	40.000	6,320,000.000	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	330,000	26.750	8,827,500.000	
	FUBON FINANCIAL HOLDING CO	296,735	86.500	25,667,577.500	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	385,838	69.000	26,622,822.000	
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	671,000	16.300	10,937,300.000	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	251,429	31.550	7,932,584.950	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	251,399	33.300	8,371,586.700	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	300,718	40.850	12,284,330.300	
	TAISHIN FINANCIAL HOLDING	778,000	16.700	12,992,600.000	
	SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	1,086,000	11.800	12,814,800.000	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	334,884	24.200	8,104,192.800	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	825,028	42.700	35,228,695.600	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	219,781	27.950	6,142,878.950	
	LARGAN PRECISION CO LTD	5,000	2,330.000	11,650,000.000	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	37,000	510.000	18,870,000.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	76,000	102.500	7,790,000.000	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	60,000	116.000	6,960,000.000	
	WISTRON CORP	294,110	118.500	34,852,035.000	
	INNOLUX CORP	869,029	12.150	10,558,702.350	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	81,000	88.500	7,168,500.000	
	PEGATRON CORP	95,000	83.000	7,885,000.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	98,000	100.500	9,849,000.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	137,560	122.000	16,782,320.000	
	POU CHEN	187,000	30.900	5,778,300.000	
	COMPAL ELECTRONICS	223,000	28.650	6,388,950.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	428,000	1,030.000	440,840,000.000	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	999,902	156.500	156,484,663.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	49,760	684.000	34,035,840.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,073,000	47.450	50,913,850.000	
	台湾・ドル 小計			1,468,333,205.750 (7,174,129,210)	
南アフリカ・ラ ンド	AngloGold Ashanti Plc	16,392	897.000	14,703,624.000	
	PEPKOR HOLDINGS SHS LTD	151,181	27.100	4,097,005.100	
	GOLD FIELDS LTD	34,981	451.520	15,794,621.120	

CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,220	3,451.430	7,662,174.600	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	25,275	270.440	6,835,371.000	
NEDBANK GROUP LTD	16,557	245.390	4,062,922.230	
BID CORP LTD	16,110	443.870	7,150,745.700	
STANDARD BANK GROUP LTD	46,415	227.460	10,557,555.900	
SASOL LTD	97,599	96.560	9,424,159.440	
DISCOVERY LTD	16,908	215.960	3,651,451.680	
SANLAM LTD	51,532	86.750	4,470,401.000	
FIRSTRAND LTD	233,444	72.250	16,866,329.000	
ABSA GROUP LTD	40,814	172.280	7,031,435.920	
NASPERS LTD-N SHS	3,390	5,312.500	18,009,375.000	
MTN GROUP LTD	117,184	132.500	15,526,880.000	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	74,648	149.150	11,133,749.200	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	19,352	119.360	2,309,854.720	
VALTERRA PLATINUM LTD	8,899	761.590	6,777,389.410	
SIBANYE STILLWATER LTD	734,423	30.600	22,473,343.800	
南アフリカ・ランド 小計			188,538,388.820 (1,515,848,646)	
合計			41,713,943,384 [41,713,943,384]	

## (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	835,500	19,291,695.000	
	アメリカ・ドル 小計			19,291,695.000 (2,786,106,592)	
投資証券 合計				2,786,106,592 [2,786,106,592]	
合計				2,786,106,592 [2,786,106,592]	

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	14.2%	85.8%	7.3%
インド・ルピー	株式 55銘柄	100%	-%	12.5%
インドネシア・ルピア	株式 6銘柄	100%	-%	1.2%
オフショア・人民元	株式 59銘柄	100%	-%	5.5%
サウジアラビア・リアル	株式 12銘柄	100%	-%	2.0%
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%	-%	13.0%
マレーシア・リングギット	株式 4銘柄	100%	-%	0.5%
メキシコ・ペソ	株式 9銘柄	100%	-%	2.5%
香港・ドル	株式 94銘柄	100%	-%	31.8%
台湾・ドル	株式 59銘柄	100%	-%	16.1%
南アフリカ・ランド	株式 19銘柄	100%	-%	3.4%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

前記「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)」に記載のとおりであります。

【ダイワファンドラップ 日本債券インデックス】

(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6月18日から2025年6月16日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 日本債券インデックス

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	77,556,664	128,062,641
親投資信託受益証券	37,933,054,748	40,538,292,459
流動資産合計	38,010,611,412	40,666,355,100
資産合計	38,010,611,412	40,666,355,100
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	10,282,692	21,409,828
未払受託者報酬	2,149,631	4,328,372
未払委託者報酬	27,149,388	61,679,847
その他未払費用	1,034,950	1,082,006
流動負債合計	40,616,661	88,500,053
負債合計	40,616,661	88,500,053
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 41,077,266,835	<sup>1</sup> 45,588,181,446
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	<sup>2</sup> 3,107,272,084	<sup>2</sup> 5,010,326,399
（分配準備積立金）	198,720,895	163,410,591
元本等合計	37,969,994,751	40,577,855,047
純資産合計	37,969,994,751	40,577,855,047
負債純資産合計	38,010,611,412	40,666,355,100

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期		第9期	
	自	2023年6月16日 至 2024年6月17日	自	2024年6月18日 至 2025年6月16日
<b>営業収益</b>				
受取利息		17,385		300,036
有価証券売買等損益		1,584,599,819		1,382,702,002
営業収益合計		1,584,582,434		1,382,401,966
<b>営業費用</b>				
支払利息		15,078		-
受託者報酬		4,152,067		7,198,693
委託者報酬		52,180,403		100,134,216
その他費用		2,036,103		2,149,258
営業費用合計		58,383,651		109,482,167
営業利益又は営業損失（ ）		1,642,966,085		1,491,884,133
経常利益又は経常損失（ ）		1,642,966,085		1,491,884,133
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,642,966,085		1,491,884,133
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（ ）		245,753,938		92,365,565
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,294,495,854		3,107,272,084
剰余金増加額又は欠損金減少額		389,477,929		638,269,034
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		389,477,929		638,269,034
剰余金減少額又は欠損金増加額		805,042,012		1,141,804,781
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		805,042,012		1,141,804,781
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,107,272,084		5,010,326,399

## (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6月18日 至2025年6月16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6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2024年6月17日としており、2025年6月15日が休日のため、当計算期間末日を2025年6月16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6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
	1. 1 期首元本額	37,987,526,906円
期中追加設定元本額	13,620,058,958円	12,868,104,378円
期中一部解約元本額	10,530,319,029円	8,357,189,767円
2. 計算期間末日における受益権の総数	41,077,266,835口	45,588,181,446口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,107,272,084円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は5,010,326,399円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日

1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(899,273,056円)及び分配準備積立金(198,720,895円)より分配対象額は1,097,993,951円(1万口当たり267.30円)であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,055,159,429円)及び分配準備積立金(163,410,591円)より分配対象額は1,218,570,020円(1万口当たり267.30円)であり、分配を行っておりません。
------------	--	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16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に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第9期 2025年6月16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6月17日現在	第9期 2025年6月16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	1,412,868,922	1,330,953,323
合計	1,412,868,922	1,330,953,323

## (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6月17日現在	第9期 2025年6月16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6月18日 至2025年6月16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6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	0.9244円	0.8901円
(1万口当たり純資産額)	(9,244円)	(8,901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	日本債券インデックスマザーファンド	31,824,691,835	40,538,292,459	
親投資信託受益証券 合計			40,538,292,459	
合計			40,538,292,459	

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

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

## 「日本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6月17日現在 金額(円)	2025年6月16日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	551,265,147	371,897,741

国債証券	100,536,383,570	112,302,429,390
地方債証券	6,991,689,200	6,097,020,700
特殊債券	3,954,024,200	3,843,766,200
社債券	8,953,662,000	8,720,607,000
未収利息	273,015,858	354,403,183
前払費用	26,969,752	30,738,602
流動資産合計	121,287,009,727	131,720,862,816
資産合計	121,287,009,727	131,720,862,816
負債の部		
流動負債		
未払金	200,000,000	-
未払解約金	26,075,931	21,974,891
流動負債合計	226,075,931	21,974,891
負債合計	226,075,931	21,974,891
純資産の部		
元本等		
元本	1 91,769,046,895	103,390,699,779
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	29,291,886,901	28,308,188,146
元本等合計	121,060,933,796	131,698,887,925
純資産合計	121,060,933,796	131,698,887,925
負債純資産合計	121,287,009,727	131,720,862,816

## 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6月18日 至2025年6月16日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1. 1 期首	2023年6月16日	2024年6月18日
期首元本額	81,482,693,217円	91,769,046,895円
期中追加設定元本額	28,834,163,818円	29,241,960,313円
期中一部解約元本額	18,547,810,140円	17,620,307,429円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	34,251,260円	32,289,249円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	214,018,411円	165,868,655円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	41,043,894円	35,582,786円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	510,580,994円	420,295,551円
DCダイワ日本債券インデック ス	10,373,209,124円	10,852,963,402円
ダイワ国内債券インデックス (ラップ専用)	16,035,511,576円	26,112,989,477円
ダイワ・バランスファンド35 VA	8,266,520,169円	7,359,581,695円
ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	1,455,649,064円	1,366,798,648円
ダイワ国内バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専用)	186,728,513円	163,662,413円
ダイワ国内バランスファンド3 0VA(適格機関投資家専用)	207,601,314円	178,299,358円
ダイワ・ノーロード 日本債券 ファンド	60,843,581円	47,479,769円
ダイワファンドラップ 日本債券 インデックス	28,754,589,712円	31,824,691,835円
ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)	15,916,146,639円	15,310,914,564円
ダイワファンドラップオンライ ン 日本債券インデックス	1,729,671,691円	1,747,985,093円
スタイル9(4資産分散・保守 型)	2,103,275円	9,389,402円
スタイル9(4資産分散・ balan ス型)	4,723,980円	18,083,199円

スタイル9（4資産分散・積極型）	489,227円	2,043,691円
スタイル9（6資産分散・保守型）	1,426,296円	3,767,446円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	9,366,134円	34,455,402円
スタイル9（6資産分散・積極型）	810,659円	2,523,674円
スタイル9（8資産分散・保守型）	1,868,339円	6,108,052円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	7,325,726円	30,318,323円
スタイル9（8資産分散・積極型）	1,414,372円	3,553,566円
ダイワ国内債券インデックス（投資一任専用）	-円	8,444,232円
ダイワ・インデックスセレクト日本債券	729,326,060円	623,698,801円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	5,933,409,590円	5,726,038,799円
ダイワライフスタイル2 5	458,021,377円	448,275,204円
ダイワライフスタイル5 0	640,423,493円	659,038,099円
ダイワライフスタイル7 5	191,972,425円	195,559,394円
計	91,769,046,895円	103,390,699,779円
2. 期末日における受益権の総数	91,769,046,895口	103,390,699,779口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年6月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	2,362,219,800	3,717,321,680
地方債証券	58,396,600	117,546,800
特殊債券	58,579,600	72,261,000
社債券	33,639,200	72,342,600
合計	2,512,835,200	3,979,472,080

(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6月17日現在	2025年6月16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6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	1.3192円	1.2738円
(1万口当たり純資産額)	(13,192円)	(12,738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	463 2年国債	50,000,000	49,888,000	
	464 2年国債	720,000,000	718,099,200	
	465 2年国債	250,000,000	249,230,000	
	466 2年国債	900,000,000	898,092,000	
	467 2年国債	270,000,000	269,705,700	
	468 2年国債	230,000,000	229,682,600	
	469 2年国債	900,000,000	899,919,000	
	470 2年国債	150,000,000	150,214,500	
	471 2年国債	250,000,000	250,727,500	
	472 2年国債	490,000,000	489,637,400	
	149 5年国債	1,150,000,000	1,141,145,000	
	150 5年国債	1,400,000,000	1,386,084,000	
	151 5年国債	850,000,000	839,749,000	
	152 5年国債	600,000,000	593,754,000	
	153 5年国債	1,000,000,000	985,450,000	
	154 5年国債	1,300,000,000	1,280,786,000	
	155 5年国債	730,000,000	721,371,400	
	156 5年国債	1,080,000,000	1,064,577,600	
	157 5年国債	200,000,000	196,736,000	
	158 5年国債	1,310,000,000	1,285,096,900	
	161 5年国債	850,000,000	836,893,000	
	162 5年国債	500,000,000	491,275,000	
	163 5年国債	1,000,000,000	985,720,000	
	164 5年国債	270,000,000	263,746,800	
	165 5年国債	450,000,000	441,112,500	
	166 5年国債	1,100,000,000	1,082,015,000	
167 5年国債	150,000,000	147,220,500		
168 5年国債	400,000,000	395,496,000		

169 5年国債	300,000,000	295,530,000	
170 5年国債	300,000,000	296,115,000	
171 5年国債	50,000,000	48,957,000	
172 5年国債	300,000,000	294,957,000	
173 5年国債	360,000,000	354,693,600	
174 5年国債	740,000,000	732,119,000	
175 5年国債	500,000,000	498,160,000	
176 5年国債	620,000,000	620,533,200	
177 5年国債	250,000,000	251,295,000	
178 5年国債	1,050,000,000	1,049,517,000	
1 40年国債	100,000,000	98,051,000	
2 40年国債	110,000,000	102,933,600	
3 40年国債	195,000,000	180,263,850	
4 40年国債	180,000,000	163,837,800	
5 40年国債	185,000,000	159,314,600	
6 40年国債	285,000,000	237,159,900	
7 40年国債	290,000,000	227,064,200	
8 40年国債	340,000,000	244,293,400	
9 40年国債	220,000,000	111,392,600	
10 40年国債	230,000,000	137,678,000	
11 40年国債	320,000,000	181,232,000	
12 40年国債	380,000,000	186,165,800	
13 40年国債	420,000,000	200,419,800	
14 40年国債	430,000,000	218,328,200	
15 40年国債	410,000,000	230,059,200	
16 40年国債	900,000,000	554,517,000	
17 40年国債	1,080,000,000	874,249,200	
18 40年国債	135,000,000	136,089,450	
2 CT5年国債	900,000,000	884,016,000	
1 CT10年国債	400,000,000	380,588,000	
2 CT10年国債	800,000,000	777,464,000	
344 10年国債	780,000,000	774,922,200	
345 10年国債	950,000,000	941,906,000	
346 10年国債	780,000,000	771,880,200	
347 10年国債	900,000,000	888,597,000	
348 10年国債	1,050,000,000	1,034,481,000	
349 10年国債	1,250,000,000	1,229,075,000	
350 10年国債	800,000,000	784,792,000	
351 10年国債	600,000,000	587,226,000	

352 10年国債	20,000,000	19,521,000	
353 10年国債	750,000,000	729,952,500	
354 10年国債	1,100,000,000	1,067,440,000	
355 10年国債	320,000,000	309,555,200	
356 10年国債	700,000,000	675,080,000	
357 10年国債	620,000,000	596,049,400	
358 10年国債	1,100,000,000	1,053,855,000	
359 10年国債	1,000,000,000	955,700,000	
360 10年国債	1,300,000,000	1,238,744,000	
361 10年国債	750,000,000	712,515,000	
362 10年国債	1,000,000,000	947,140,000	
363 10年国債	1,080,000,000	1,019,703,600	
364 10年国債	1,280,000,000	1,204,313,600	
365 10年国債	1,450,000,000	1,359,433,000	
366 10年国債	900,000,000	846,657,000	
367 10年国債	1,050,000,000	984,343,500	
368 10年国債	1,250,000,000	1,167,287,500	
369 10年国債	1,250,000,000	1,189,312,500	
370 10年国債	1,550,000,000	1,469,353,500	
371 10年国債	1,060,000,000	992,965,600	
372 10年国債	1,050,000,000	1,011,969,000	
373 10年国債	1,000,000,000	944,190,000	
374 10年国債	490,000,000	468,709,500	
375 10年国債	1,000,000,000	978,340,000	
376 10年国債	810,000,000	775,842,300	
377 10年国債	950,000,000	931,703,000	
378 10年国債	750,000,000	746,790,000	
1 30年国債	16,000,000	17,229,600	
2 30年国債	184,000,000	195,777,840	
3 30年国債	30,000,000	31,859,700	
4 30年国債	36,000,000	39,541,320	
5 30年国債	28,000,000	29,837,080	
6 30年国債	24,000,000	25,942,800	
7 30年国債	55,000,000	59,303,200	
8 30年国債	27,000,000	28,211,220	
9 30年国債	43,000,000	43,682,410	
10 30年国債	45,000,000	44,649,000	
11 30年国債	40,000,000	41,415,600	
12 30年国債	60,000,000	63,913,800	

13	30年国債	75,000,000	79,265,250	
14	30年国債	82,000,000	89,230,760	
15	30年国債	50,000,000	54,838,000	
16	30年国債	250,000,000	274,115,000	
17	30年国債	130,000,000	141,324,300	
18	30年国債	80,000,000	86,180,000	
19	30年国債	500,000,000	538,085,000	
21	30年国債	60,000,000	64,386,600	
22	30年国債	170,000,000	185,572,000	
24	30年国債	92,000,000	100,138,320	
25	30年国債	150,000,000	159,972,000	
26	30年国債	300,000,000	322,470,000	
27	30年国債	150,000,000	162,256,500	
28	30年国債	350,000,000	376,978,000	
29	30年国債	200,000,000	212,164,000	
30	30年国債	220,000,000	229,847,200	
31	30年国債	300,000,000	308,022,000	
32	30年国債	385,000,000	398,159,300	
33	30年国債	280,000,000	277,082,400	
34	30年国債	270,000,000	272,548,800	
35	30年国債	270,000,000	263,690,100	
36	30年国債	350,000,000	339,972,500	
37	30年国債	450,000,000	428,553,000	
38	30年国債	260,000,000	242,387,600	
39	30年国債	270,000,000	254,785,500	
40	30年国債	240,000,000	222,280,800	
41	30年国債	250,000,000	227,132,500	
42	30年国債	320,000,000	289,715,200	
43	30年国債	300,000,000	270,819,000	
44	30年国債	300,000,000	269,850,000	
45	30年国債	300,000,000	259,635,000	
46	30年国債	300,000,000	258,444,000	
47	30年国債	350,000,000	305,945,500	
48	30年国債	470,000,000	394,630,800	
49	30年国債	220,000,000	184,069,600	
50	30年国債	400,000,000	294,596,000	
51	30年国債	400,000,000	260,320,000	
52	30年国債	400,000,000	271,600,000	
53	30年国債	350,000,000	241,920,000	

54	30年国債	400,000,000	288,136,000	
55	30年国債	350,000,000	250,754,000	
56	30年国債	390,000,000	277,890,600	
57	30年国債	350,000,000	248,038,000	
58	30年国債	510,000,000	359,478,600	
59	30年国債	350,000,000	239,116,500	
60	30年国債	350,000,000	249,816,000	
61	30年国債	300,000,000	202,362,000	
62	30年国債	400,000,000	253,896,000	
63	30年国債	330,000,000	202,075,500	
64	30年国債	330,000,000	200,517,900	
65	30年国債	370,000,000	223,095,200	
66	30年国債	270,000,000	161,443,800	
67	30年国債	470,000,000	295,724,000	
68	30年国債	370,000,000	230,939,200	
69	30年国債	410,000,000	261,268,400	
70	30年国債	420,000,000	265,742,400	
71	30年国債	400,000,000	251,100,000	
72	30年国債	400,000,000	249,300,000	
73	30年国債	360,000,000	222,922,800	
74	30年国債	420,000,000	282,332,400	
75	30年国債	380,000,000	275,800,200	
76	30年国債	380,000,000	281,846,000	
77	30年国債	375,000,000	291,480,000	
78	30年国債	400,000,000	294,376,000	
79	30年国債	370,000,000	257,090,800	
80	30年国債	330,000,000	266,580,600	
81	30年国債	375,000,000	287,261,250	
82	30年国債	330,000,000	264,976,800	
83	30年国債	350,000,000	308,003,500	
84	30年国債	300,000,000	257,727,000	
85	30年国債	407,000,000	365,840,090	
86	30年国債	220,000,000	202,268,000	
90	20年国債	20,000,000	20,396,400	
91	20年国債	100,000,000	102,107,000	
92	20年国債	310,000,000	316,646,400	
93	20年国債	100,000,000	102,273,000	
94	20年国債	130,000,000	133,179,800	
95	20年国債	50,000,000	51,553,500	

96 20年国債	55,000,000	56,491,050	
97 20年国債	40,000,000	41,288,800	
98 20年国債	320,000,000	329,600,000	
99 20年国債	100,000,000	103,287,000	
100 20年国債	155,000,000	160,916,350	
101 20年国債	350,000,000	365,246,000	
108 20年国債	300,000,000	310,629,000	
109 20年国債	55,000,000	57,019,050	
110 20年国債	260,000,000	271,432,200	
111 20年国債	400,000,000	419,952,000	
112 20年国債	250,000,000	261,452,500	
113 20年国債	310,000,000	324,796,300	
114 20年国債	70,000,000	73,448,900	
115 20年国債	180,000,000	189,646,200	
116 20年国債	200,000,000	211,040,000	
117 20年国債	200,000,000	210,130,000	
118 20年国債	95,000,000	99,578,050	
119 20年国債	93,000,000	96,571,200	
120 20年国債	317,000,000	326,069,370	
121 20年国債	200,000,000	208,942,000	
122 20年国債	200,000,000	207,942,000	
123 20年国債	200,000,000	211,376,000	
124 20年国債	300,000,000	315,498,000	
125 20年国債	130,000,000	138,339,500	
126 20年国債	110,000,000	115,828,900	
127 20年国債	350,000,000	366,646,000	
128 20年国債	250,000,000	262,157,500	
129 20年国債	200,000,000	208,594,000	
130 20年国債	140,000,000	146,081,600	
131 20年国債	150,000,000	155,589,000	
132 20年国債	100,000,000	103,770,000	
133 20年国債	100,000,000	104,410,000	
134 20年国債	30,000,000	31,330,200	
135 20年国債	92,000,000	95,500,600	
136 20年国債	550,000,000	567,292,000	
138 20年国債	300,000,000	307,407,000	
139 20年国債	370,000,000	381,662,400	
140 20年国債	570,000,000	591,597,300	
141 20年国債	400,000,000	414,920,000	

142 20年国債	240,000,000	250,696,800	
143 20年国債	210,000,000	216,113,100	
144 20年国債	140,000,000	143,029,600	
145 20年国債	340,000,000	352,032,600	
146 20年国債	20,000,000	20,681,400	
147 20年国債	600,000,000	614,730,000	
148 20年国債	400,000,000	405,648,000	
149 20年国債	432,000,000	437,201,280	
150 20年国債	670,000,000	670,824,100	
151 20年国債	550,000,000	539,407,000	
152 20年国債	850,000,000	830,764,500	
153 20年国債	300,000,000	295,035,000	
154 20年国債	580,000,000	563,023,400	
155 20年国債	660,000,000	625,495,200	
156 20年国債	560,000,000	495,376,000	
157 20年国債	710,000,000	609,826,100	
158 20年国債	500,000,000	441,830,000	
159 20年国債	480,000,000	426,705,600	
160 20年国債	500,000,000	447,280,000	
161 20年国債	550,000,000	483,158,500	
162 20年国債	690,000,000	602,294,100	
163 20年国債	550,000,000	477,009,500	
164 20年国債	650,000,000	552,870,500	
165 20年国債	470,000,000	397,018,400	
166 20年国債	720,000,000	620,920,800	
167 20年国債	550,000,000	458,353,500	
168 20年国債	660,000,000	538,520,400	
169 20年国債	600,000,000	478,692,000	
170 20年国債	550,000,000	435,616,500	
171 20年国債	520,000,000	408,631,600	
172 20年国債	280,000,000	221,998,000	
173 20年国債	650,000,000	511,634,500	
174 20年国債	800,000,000	625,128,000	
175 20年国債	600,000,000	473,286,000	
176 20年国債	700,000,000	548,254,000	
177 20年国債	560,000,000	427,996,800	
178 20年国債	680,000,000	525,198,000	
179 20年国債	600,000,000	460,302,000	
180 20年国債	650,000,000	522,593,500	

	181 20年国債	520,000,000	423,233,200	
	182 20年国債	640,000,000	536,492,800	
	183 20年国債	490,000,000	429,852,500	
	184 20年国債	550,000,000	456,714,500	
	185 20年国債	580,000,000	479,167,000	
	186 20年国債	600,000,000	529,086,000	
	187 20年国債	450,000,000	381,906,000	
	188 20年国債	350,000,000	311,566,500	
	189 20年国債	530,000,000	494,437,000	
	190 20年国債	430,000,000	393,424,200	
	191 20年国債	400,000,000	377,232,000	
	192 20年国債	285,000,000	285,763,800	
	27 メキシコ国債	100,000,000	97,250,100	
	11 フィリピン共和国	100,000,000	98,183,700	
	国債証券 合計		112,302,429,390	
地方債証券	796 東京都公債	100,000,000	95,555,200	
	808 東京都公債	100,000,000	94,529,200	
	827 東京都公債	100,000,000	93,672,300	
	16 東京都20年	100,000,000	103,391,900	
	3-5 北海道公債	100,000,000	93,725,700	
	37-2 宮城県公債	100,000,000	93,298,500	
	262 神奈川県公債	100,000,000	96,786,300	
	27 神奈川県20年	100,000,000	98,760,700	
	31 神奈川県20年	100,000,000	93,408,300	
	420 大阪府公債	200,000,000	197,295,600	
	7 大阪府20年	200,000,000	207,277,000	
	26-2 京都府15年	100,000,000	100,059,000	
	2-1 京都府公債	200,000,000	190,434,200	
	19兵庫県公債20年	100,000,000	100,906,300	
	2-1 静岡県公債	100,000,000	95,194,600	
	8 静岡県20年	200,000,000	209,289,400	
	21-5 愛知県公債	100,000,000	104,669,600	
	26-4 愛知県20年	100,000,000	100,345,900	
	27-12 愛知県15年	100,000,000	97,796,000	
	29-5 広島県公債	100,000,000	98,226,500	
	25-1 広島県20年	100,000,000	102,548,800	
	2-7 埼玉県公債	100,000,000	94,539,000	
	4 埼玉県30年	100,000,000	80,524,800	

9 埼玉県20年	100,000,000	104,726,000	
12 埼玉県20年	100,000,000	102,893,200	
29-1 福岡県公債	100,000,000	98,645,800	
5-1 福岡県公債	100,000,000	94,690,400	
13 千葉県20年	100,000,000	102,644,900	
16 千葉県20年	100,000,000	100,548,600	
28-2 新潟県公債	100,000,000	98,964,500	
168 共同発行地方	100,000,000	98,891,000	
170 共同発行地方	200,000,000	197,356,200	
195 共同発行地方	100,000,000	95,853,800	
196 共同発行地方	100,000,000	95,860,700	
206 共同発行地方	100,000,000	95,066,700	
244 共同発行地方	200,000,000	187,590,800	
255 共同発行地方	100,000,000	96,365,000	
4-3 長崎県公債	100,000,000	93,779,400	
6-1 大阪市5年	100,000,000	98,092,800	
6-2 大阪市公債	100,000,000	95,775,000	
11 名古屋市20年	200,000,000	208,846,400	
10 京都市20年	100,000,000	103,501,500	
20-1 神戸市20年	100,000,000	104,129,000	
14 横浜市20年	100,000,000	103,735,500	
19 横浜市20年	100,000,000	104,491,400	
26-5 札幌市15年	100,000,000	99,409,600	
2-4 札幌市公債	100,000,000	94,606,700	
4 川崎市公債30年	100,000,000	96,989,900	
1 北九州市15年	100,000,000	99,259,700	
17 北九州市20年	100,000,000	100,142,700	
23-4 福岡市20年	100,000,000	103,967,000	
1-5 千葉市公債	100,000,000	95,106,500	
3-2 徳島県公債	100,000,000	93,164,800	
1-1 山梨県公債	100,000,000	95,497,500	
2-2 岡山県公債	100,000,000	94,192,900	
地方債証券 合計		6,097,020,700	
特殊債券			
47日本政策投資CO	100,000,000	99,528,400	
174 日本政策投資	300,000,000	282,299,700	
69 政保政策投資C	100,000,000	94,252,100	
247 道路機構	200,000,000	152,636,200	
86 政保道路機構	100,000,000	103,709,400	
97 政保道路機構	100,000,000	104,396,800	

160 政保道路機構	200,000,000	206,921,200	
223 政保道路機構	100,000,000	99,294,600	
235 政保道路機構	100,000,000	97,074,300	
284 政保道路機構	200,000,000	167,881,000	
298 政保道路機構	100,000,000	87,100,600	
321 政保道路機構	200,000,000	196,801,000	
403 政保道路機構	100,000,000	94,687,200	
478 政保道路機構	100,000,000	96,544,500	
F124地方公共団体	100,000,000	100,997,300	
F143地方公共団体	100,000,000	100,892,800	
1 地方公共団15年	100,000,000	100,946,200	
31 地方公共団20	100,000,000	102,272,800	
F192地方公共団体	100,000,000	100,459,400	
F221地方公共団体	200,000,000	200,010,000	
F226地方公共団体	100,000,000	100,056,900	
97政保地方公共団	100,000,000	98,597,500	
129 地方公共団体	200,000,000	190,053,600	
F568地方公共団体	200,000,000	174,866,800	
4 国際協力銀行CO	100,000,000	98,383,200	
127 都市再生	100,000,000	99,091,800	
80 住宅支援機構	100,000,000	100,969,100	
123 住宅支援機構	100,000,000	103,148,300	
33 沖縄振興開発	200,000,000	190,900,000	
19 利付商工債	100,000,000	98,993,500	
特殊債券 合計		3,843,766,200	
社債券			
39 BPCE S.A.	100,000,000	99,227,000	
4 香港上海銀行	100,000,000	99,480,700	
33 首都高速道路	100,000,000	98,062,000	
30 阪神高速道路	100,000,000	98,868,300	
20 成田国際空港	100,000,000	99,161,000	
8 ビーエヌピーパリバ	100,000,000	98,797,500	
111 東日本高速道	100,000,000	98,027,200	
101 中日本高速道	400,000,000	392,422,800	
88 西日本高速道	100,000,000	97,414,600	
32大和ハウス工業	300,000,000	297,973,800	
22 積水ハウス	100,000,000	97,831,300	
12 アサヒグループHD	100,000,000	98,677,800	
11サントリーホールディング	100,000,000	97,964,100	
23 森ビル	100,000,000	82,878,600	

18 セブンアンドアイ	100,000,000	96,394,800	
35 東レ	300,000,000	292,127,400	
1 レゾナックHD	100,000,000	97,881,900	
4 アステラス製薬	300,000,000	294,114,600	
20 ZHD	100,000,000	96,615,100	
18 楽天グループ	100,000,000	86,008,200	
2 AGC	100,000,000	93,954,800	
7 日本製鉄	100,000,000	98,276,800	
32 住友電工	100,000,000	96,847,900	
16 クボタ	100,000,000	98,203,500	
62 日本電気	200,000,000	194,994,200	
17 パナソニック	100,000,000	99,430,000	
41 ソニーG	100,000,000	94,816,600	
15 デンソー	100,000,000	98,527,200	
31 トヨタ自動車	100,000,000	94,059,200	
6 楽天カード	100,000,000	97,644,100	
3 オリックス銀行	200,000,000	195,536,400	
1 日生2021基金	100,000,000	99,216,000	
7 凸版印刷	100,000,000	99,131,400	
31 豊田通商	200,000,000	195,427,000	
63 住友商事	100,000,000	93,573,200	
26 りそなホールデイン	100,000,000	97,910,800	
27 りそなホールデイン	200,000,000	196,025,000	
28 三井住友TB	300,000,000	292,833,900	
33 NTTファイナンス	100,000,000	97,693,600	
38 NTTファイナンス	200,000,000	190,859,000	
81 ホンダファイナンス	100,000,000	97,205,400	
78 トヨタファイナンス	100,000,000	98,491,100	
42 リコーリース	100,000,000	98,578,000	
22 イオンFS	200,000,000	197,513,200	
1 SOMPOHD	100,000,000	97,955,500	
7 三井住友海上	100,000,000	98,958,300	
82 三井不動産	100,000,000	97,732,000	
143 三菱地所	100,000,000	94,710,500	
111 住友不動産	100,000,000	98,233,000	
13 NTTファイナンス	100,000,000	99,091,700	
107東日本旅客鉄	100,000,000	80,846,000	
41 東海旅客鉄道	100,000,000	103,557,900	
52 阪急阪神HLDG	100,000,000	95,528,000	

67 阪急阪神HLDG	100,000,000	93,611,900	
68 名古屋鉄道	200,000,000	195,435,600	
34 KDDI	100,000,000	98,081,600	
15 ソフトバンク	100,000,000	96,412,800	
509 関西電力	100,000,000	98,918,100	
538 関西電力	100,000,000	94,214,000	
448 中国電力	100,000,000	93,653,800	
560 東北電力	200,000,000	185,816,000	
332 北海道電力	100,000,000	87,752,800	
34 沖縄電力	100,000,000	97,801,900	
85 電源開発	100,000,000	98,019,500	
87 電源開発	100,000,000	93,997,700	
11 東京電力パワー	100,000,000	98,744,700	
83 東京電力PG	100,000,000	101,069,000	
16 JERA	100,000,000	98,314,300	
65 東京瓦斯	100,000,000	94,526,900	
44 大阪瓦斯	100,000,000	92,935,200	
50 大阪瓦斯	100,000,000	98,011,300	
社債券 合計		8,720,607,000	
合計		130,963,823,290	

## 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。

【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)】

(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6月18日から2025年6月16日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	614,509,573	562,855,539
親投資信託受益証券	97,900,264,111	97,351,069,902
未収入金	31,914,773	20,508,933
流動資産合計	98,546,688,457	97,934,434,374
資産合計	98,546,688,457	97,934,434,374
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	153,189,482	93,163,245
未払受託者報酬	10,893,326	10,645,577
未払委託者報酬	196,080,708	191,621,273
その他未払費用	1,131,242	1,109,459
流動負債合計	361,294,758	296,539,554
負債合計	361,294,758	296,539,554
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 120,507,203,109	1 121,329,143,313
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 22,321,809,410	2 23,691,248,493
（分配準備積立金）	2,529,936,534	2,074,703,859
元本等合計	98,185,393,699	97,637,894,820
純資産合計	98,185,393,699	97,637,894,820
負債純資産合計	98,546,688,457	97,934,434,374

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期		第9期	
	自	2023年6月16日 至 2024年6月17日	自	2024年6月18日 至 2025年6月16日
<b>営業収益</b>				
受取利息		99,022		1,478,544
有価証券売買等損益		2,351,054,208		798,166,739
営業収益合計		2,350,955,186		796,688,195
<b>営業費用</b>				
支払利息		95,259		-
受託者報酬		21,668,684		21,632,116
委託者報酬		390,038,165		389,379,901
その他費用		2,208,697		2,189,231
営業費用合計		414,010,805		413,201,248
営業利益又は営業損失（ ）		2,764,965,991		1,209,889,443
経常利益又は経常損失（ ）		2,764,965,991		1,209,889,443
当期純利益又は当期純損失（ ）		2,764,965,991		1,209,889,443
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（ ）		493,619,925		58,900,655
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		19,058,366,403		22,321,809,410
剰余金増加額又は欠損金減少額		4,871,027,462		4,456,477,639
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		4,871,027,462		4,456,477,639
剰余金減少額又は欠損金増加額		5,863,124,403		4,674,927,934
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		5,863,124,403		4,674,927,934
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		22,321,809,410		23,691,248,493

## (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6月18日 至2025年6月16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6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2024年6月17日としており、2025年6月15日が休日のため、当計算期間末日を2025年6月16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6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
	1. 1 期首元本額	117,510,192,351円
期中追加設定元本額	32,679,578,644円	24,888,452,073円
期中一部解約元本額	29,682,567,886円	24,066,511,869円
2. 計算期間末日における受益権の総数	120,507,203,109口	121,329,143,313口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は22,321,809,410円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は23,691,248,493円であります。

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日

1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(7,818,348,912円)及び分配準備積立金(2,529,936,534円)より分配対象額は10,348,285,446円(1万口当たり858.73円)であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(8,344,163,631円)及び分配準備積立金(2,074,703,859円)より分配対象額は10,418,867,490円(1万口当たり858.73円)であり、分配を行っておりません。
------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第9期 2025年6月16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6月17日現在	第9期 2025年6月16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	2,046,035,439	801,491,246
合計	2,046,035,439	801,491,246

## (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6月17日現在	第9期 2025年6月16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6月18日 至2025年6月16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6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	0.8148円	0.8047円
(1万口当たり純資産額)	(8,148円)	(8,047円)

## (4)【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	116,741,899,391	97,351,069,902	
親投資信託受益証券 合計			97,351,069,902	
合計			97,351,069,902	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

「外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2024年6月17日現在 金額 (円)	2025年6月16日現在 金額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,766,384,203	1,213,941,714

コール・ローン		1,134,496,806	1,202,132,901
国債証券		122,603,987,234	131,381,088,870
派生商品評価勘定		547,672,494	19,112,737
未収入金		256,710	948,413
未収利息		870,695,083	950,523,358
前払費用		43,765,372	123,929,595
差入委託証拠金		231,066,642	226,471,478
流動資産合計		127,198,324,544	135,118,149,066
資産合計		127,198,324,544	135,118,149,066
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		297,470,129	1,081,611,756
未払金		848,406	11,810,530
未払解約金		33,437,142	62,422,385
流動負債合計		331,755,677	1,155,844,671
負債合計		331,755,677	1,155,844,671
純資産の部			
元本等			
元本	1	150,884,982,568	160,646,455,421
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	24,018,413,701	26,684,151,026
元本等合計		126,866,568,867	133,962,304,395
純資産合計		126,866,568,867	133,962,304,395
負債純資産合計		127,198,324,544	135,118,149,066

## 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6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分		2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1.	1 期首	2023年6月16日	2024年6月18日
	期首元本額	141,933,741,025円	150,884,982,568円
	期中追加設定元本額	40,419,718,586円	44,552,509,331円

期中一部解約元本額	31,468,477,043円	34,791,036,478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)	2,345,854,351円	-円
ダイワファンドラップ 外国債券 インデックス(為替ヘッジあ り)	116,437,041,046円	116,741,899,391円
ダイワファンドラップオンライ ン 外国債券インデックス(為替 ヘッジあり)	4,599,899,537円	4,792,001,832円
ダイワ先進国債券インデックス (為替ヘッジあり)(ラップ専 用)	18,119,568円	21,625,656円
ダイワバランスファンド2021-02 (適格機関投資家専用)	3,691,729,083円	3,888,821,561円
ダイワ先進国債券インデックス (為替ヘッジあり)(投資一任 専用)	-円	11,715,977円
ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジあり)(ダイワS MA専用)	16,856,752,538円	30,468,053,398円
ダイワバランスファンド2023-08 (適格機関投資家専用)	2,338,208,341円	-円
ダイワバランスファンド2024-01 (適格機関投資家専用)	2,268,146,411円	2,376,780,748円
ダイワバランスファンド2024-05 (適格機関投資家専用)	2,329,231,693円	2,345,556,858円
計	150,884,982,568円	160,646,455,421円
2. 期末日における受益権の総数	150,884,982,568口	160,646,455,421口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その 差額は24,018,413,701円であ ります。	貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その 差額は26,684,151,026円であ ります。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
----	----------------------------

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年6月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等</p>

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6月17日現在	2025年6月16日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	686,388,010	338,753,591
合計	686,388,010	338,753,591

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

(デリバティブ取引に関する注記)

#### ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 1. 債券関連

種類	2024年6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超				1年超		
市場取引								
債券先物取引								
買建	2,102,527,984	-	2,130,027,159	27,499,175	1,952,330,673	-	1,959,625,843	7,295,170
合計	2,102,527,984	-	2,130,027,159	27,499,175	1,952,330,673	-	1,959,625,843	7,295,170

(注)

#### 1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

#### 2. 債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

#### 2. 通貨関連

種類	2024年6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売建	124,144,766,074	-	123,922,062,884	222,703,190	133,122,565,752	-	134,192,359,941	1,069,794,189
アメリカ・ドル	56,537,161,105	-	56,787,658,356	250,497,251	59,522,290,805	-	59,660,395,490	138,104,685
イギリス・ ポンド	6,549,941,192	-	6,555,959,696	6,018,504	7,855,894,782	-	7,909,448,658	53,553,876
イスラエル・ シケル	501,946,602	-	503,870,427	1,923,825	447,732,735	-	436,423,176	11,309,559
オーストラリ ア・ドル	1,792,406,775	-	1,789,466,112	2,940,663	1,656,065,932	-	1,674,506,730	18,440,798
オフショア・ 人民元	12,653,663,385	-	12,688,397,505	34,734,120	15,553,876,935	-	15,605,895,030	52,018,095
カナダ・ドル	2,679,675,175	-	2,670,677,220	8,997,955	2,745,198,236	-	2,781,829,680	36,631,444
シンガポー ル・ドル	632,703,708	-	634,615,800	1,912,092	586,730,157	-	590,673,585	3,943,428
スウェーデン ・クローナ	316,454,982	-	317,587,554	1,132,572	257,460,256	-	260,466,899	3,006,643
デンマーク・ クローネ	407,755,647	-	403,512,012	4,243,635	319,197,161	-	324,752,113	5,554,952
ニュージーラ ンド・ドル	299,709,388	-	300,677,838	968,450	372,738,757	-	376,738,014	3,999,257
ノルウェー・ クローネ	228,045,706	-	225,459,668	2,586,038	229,252,557	-	236,728,450	7,475,893
ポーランド・ ズロチ	734,895,305	-	710,494,358	24,400,947	834,741,336	-	846,518,918	11,777,582
マレーシア・ リングギット	638,502,010	-	637,354,210	1,147,800	647,994,316	-	649,302,808	1,308,492
メキシコ・ペソ	1,109,162,182	-	1,027,983,216	81,178,966	1,082,865,077	-	1,113,648,400	30,783,323
ユーロ	39,062,742,912	-	38,668,348,912	394,394,000	41,010,526,710	-	41,725,031,990	714,505,280
合計	124,144,766,074	-	123,922,062,884	222,703,190	133,122,565,752	-	134,192,359,941	1,069,794,189

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	0.8408円	0.8339円
(1万口当たり純資産額)	(8,408円)	(8,339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	7,950,000.000	8,354,019.000	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	400,000.000	416,296.000	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	1,500,000.000	1,647,885.000	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	630,000.000	670,824.000	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	1,300,000.000	1,361,867.000	

3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	430,000.000	381,741.100	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,410,000.000	1,360,142.400	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	390,000.000	386,220.900	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,970,000.000	1,964,523.400	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	600,000.000	528,816.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	3,700,000.000	2,981,238.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	670,000.000	537,514.200	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	1,500,000.000	1,127,100.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,000,000.000	747,530.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,000,000.000	1,579,200.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,500,000.000	1,892,575.000	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	1,100,000.000	929,533.000	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	532,000.000	456,477.280	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	1,000,000.000	840,850.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,200,000.000	2,584,864.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	940,000.000	727,503.600	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	370,000.000	277,903.300	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	800,000.000	586,528.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	300,000.000	203,859.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	1,070,000.000	724,336.500	

1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,750,000.000	5,581,985.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	500,000.000	320,895.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	10,350,000.000	10,060,510.500	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	722,140.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	5,000,000.000	4,860,150.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	900,000.000	662,589.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	5,000,000.000	4,854,450.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	950,000.000	697,708.500	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	21,000,000.000	20,268,150.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	1,000,000.000	698,350.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	700,000.000	487,564.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	4,000,000.000	3,881,400.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	1,000,000.000	727,750.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	1,000,000.000	743,320.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	4,000,000.000	3,885,000.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	3,000,000.000	2,905,650.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	1,800,000.000	1,303,722.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	4,300,000.000	4,187,770.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,350,000.000	2,595,848.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,500,000.000	6,207,695.000	

3% United States Treasury Note/Bond 20490215	1,500,000.000	1,082,010.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	1,800,000.000	1,264,590.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	2,300,000.000	2,168,371.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	4,500,000.000	4,397,850.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	2,000,000.000	1,823,900.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	1,500,000.000	919,680.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	300,000.000	188,700.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,500,000.000	2,415,325.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	4,500,000.000	4,028,355.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	1,000,000.000	574,080.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	5,000,000.000	4,250,150.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	2,500,000.000	1,172,250.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	500,000.000	305,260.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	2,800,000.000	2,358,048.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	1,800,000.000	865,818.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,100,000.000	664,675.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	4,000,000.000	3,711,840.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	5,000,000.000	4,232,000.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	1,100,000.000	565,983.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	4,500,000.000	4,155,165.000	

0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	3,300,000.000	3,040,356.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	2,500,000.000	1,372,650.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	4,900,000.000	4,183,522.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	1,000,000.000	928,630.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	600,000.000	405,510.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	5,500,000.000	5,113,350.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	4,600,000.000	4,004,668.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,566,740.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	2,400,000.000	1,489,200.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,600,000.000	1,143,120.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	1,000,000.000	925,970.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	1,500,000.000	1,385,730.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	3,500,000.000	3,385,480.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	4,700,000.000	3,966,612.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	2,400,000.000	1,352,952.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	2,750,000.000	1,793,137.500	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	3,000,000.000	2,886,420.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,573,000.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	1,000,000.000	916,170.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	2,400,000.000	2,306,424.000	

1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	1,500,000.000	1,376,535.000	
0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,000,000.000	2,880,570.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	7,000,000.000	5,907,860.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	1,300,000.000	706,875.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	2,000,000.000	1,351,560.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,843,880.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	4,000,000.000	3,686,840.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	500,000.000	433,230.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	6,000,000.000	5,557,140.000	
2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	2,500,000.000	1,494,125.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	1,000,000.000	714,510.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	2,500,000.000	2,322,600.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	1,500,000.000	1,448,115.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	4,000,000.000	3,778,880.000	
2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	1,500,000.000	1,462,140.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	4,800,000.000	4,420,656.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	2,300,000.000	1,585,068.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,000,000.000	813,160.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	1,000,000.000	955,680.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	1,500,000.000	1,480,095.000	

2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	2,500,000.000	2,274,450.000	
3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	2,000,000.000	1,414,320.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	4,000,000.000	3,796,480.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	1,200,000.000	1,194,840.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	3,000,000.000	3,013,290.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	4,000,000.000	3,976,000.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	2,000,000.000	1,714,960.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	3,001,110.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	700,000.000	696,416.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	1,000,000.000	978,750.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	4,000,000.000	3,804,040.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	1,000,000.000	879,800.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	1,800,000.000	1,440,000.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131	3,500,000.000	3,463,145.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,500,000.000	1,474,305.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	3,000,000.000	2,820,030.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	1,800,000.000	1,438,650.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	2,500,000.000	2,194,325.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	2,000,000.000	1,974,640.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630	1,000,000.000	1,002,320.000	

4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260715	1,000,000.000	1,004,210.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815	4,800,000.000	4,662,336.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815	1,900,000.000	1,664,115.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430815	1,500,000.000	1,405,890.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	4,700,000.000	4,692,245.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	3,000,000.000	3,039,240.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930	3,000,000.000	3,081,090.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20331115	4,500,000.000	4,560,615.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20431115	600,000.000	589,404.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20531115	2,100,000.000	2,041,305.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301130	1,500,000.000	1,522,635.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	2,500,000.000	2,534,275.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340215	2,900,000.000	2,830,023.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540215	800,000.000	715,744.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440215	1,200,000.000	1,139,712.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310331	2,000,000.000	2,002,840.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270415	5,000,000.000	5,045,950.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340515	4,700,000.000	4,707,614.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	4,000,000.000	4,093,320.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540515	2,500,000.000	2,382,225.000	

4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440515	1,900,000.000	1,832,151.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260531	10,000,000.000	10,067,300.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	5,000,000.000	5,050,450.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310731	3,500,000.000	3,499,230.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340815	3,800,000.000	3,657,690.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540815	2,000,000.000	1,791,640.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,500,000.000	3,518,515.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20341115	2,000,000.000	1,978,280.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20541115	2,200,000.000	2,057,330.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20441115	1,200,000.000	1,154,616.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	3,500,000.000	3,553,935.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311231	3,500,000.000	3,565,870.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350215	4,500,000.000	4,578,390.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550215	2,300,000.000	2,197,558.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20450215	1,500,000.000	1,466,130.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320131	3,500,000.000	3,539,970.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	4,000,000.000	3,998,400.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	5,000,000.000	4,980,650.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550515	500,000.000	487,965.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350515	1,000,000.000	987,100.000	

アメリカ・ドル 小計			407,255,033.180 (58,815,771,892)	
イギリス・ポンド	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	810,000.000	451,494.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	475,000.000	463,362.500	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	730,000.000	380,884.800	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	820,000.000	595,869.400	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	900,000.000	422,946.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	650,000.000	616,629.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	800,000.000	746,040.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	917,000.000	371,605.080	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	500,000.000	268,805.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20541022	1,070,000.000	500,503.200	
	0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,200,000.000	1,057,848.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20411022	300,000.000	176,211.000	
	0.375% United Kingdom Gilt 20301022	400,000.000	331,684.000	
	0.5% United Kingdom Gilt 20611022	850,000.000	225,632.500	
	0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,500,000.000	1,366,665.000	
	0.625% United Kingdom Gilt 20501022	520,000.000	193,429.600	
	0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,330,000.000	910,917.000	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	1,700,000.000	1,354,084.000		
0.375% United Kingdom Gilt 20261022	1,050,000.000	1,005,343.500		

1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,000,000.000	440,160.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	1,000,000.000	635,200.000	
0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	200,000.000	177,504.000	
0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	1,300,000.000	992,290.000	
1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	200,000.000	91,392.000	
1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	500,000.000	408,990.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	500,000.000	165,315.000	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	1,100,000.000	1,103,630.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	800,000.000	722,904.000	
3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	1,000,000.000	930,530.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	700,000.000	548,100.000	
4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	600,000.000	476,160.000	
4.5% UNITED KINGDOM GILT 20280607	1,000,000.000	1,016,050.000	
4.625% UNITED KINGDOM GILT 20340131	1,000,000.000	1,013,250.000	
4.75% UNITED KINGDOM GILT 20431022	700,000.000	665,140.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20270307	1,100,000.000	1,096,689.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20540731	300,000.000	260,709.000	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20290722	1,000,000.000	1,005,250.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT 20340731	1,260,000.000	1,237,622.400	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20400131	510,000.000	480,440.400	

4.375% UNITED KINGDOM GILT 20280307	800,000.000	808,424.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20300307	700,000.000	709,436.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	963,000.000	1,032,037.470	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,690,000.000	1,696,050.200	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	915,000.000	886,186.650	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	550,000.000	546,650.500	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	770,000.000	676,468.100	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	500,000.000	505,530.000	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	911,000.000	852,404.480	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	907,500.000	940,433.170	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	743,000.000	643,824.360	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	330,000.000	308,391.600	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	600,000.000	601,944.000	
4% United Kingdom Gilt 20600122	827,000.000	667,529.590	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,200,000.000	1,108,236.000	
3.75% United Kingdom Gilt 20520722	700,000.000	550,991.000	
3.25% United Kingdom Gilt 20440122	875,000.000	678,527.500	
3.5% United Kingdom Gilt 20680722	838,900.000	603,982.830	
3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,150,000.000	917,021.500	
イギリス・ボンド 小計		39,641,348.330 (7,755,036,974)	

イスラエル・ シュケル	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,200,000.000	1,293,072.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	4,000,000.000	3,841,080.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	1,200,000.000	1,014,732.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,000,000.000	936,460.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	1,700,000.000	1,453,262.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,000,000.000	711,650.000	
	2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129	500,000.000	335,865.000	
	4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20350330	1,000,000.000	954,930.000	
イスラエル・シュケル 小計			10,541,051.000 (420,542,608)	
オーストラリ ア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	889,000.000	912,469.600	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	320,000.000	318,656.000	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	359,000.000	373,076.390	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	725,000.000	691,091.750	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	800,000.000	709,032.000	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	184,000.000	162,273.280	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,800,000.000	1,778,148.000	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	658,000.000	638,970.640	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	775,000.000	592,379.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,250,000.000	1,227,100.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	200,000.000	194,488.000	

	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	1,000,000.000	955,910.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	510,000.000	408,239.700	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	1,800,000.000	1,592,424.000	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	850,000.000	718,326.500	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	900,000.000	488,592.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	1,000,000.000	844,990.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	500,000.000	431,490.000	
	3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,000,000.000	928,690.000	
	3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	1,000,000.000	978,400.000	
	3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221	1,000,000.000	953,590.000	
	4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20351221	1,500,000.000	1,510,620.000	
	オーストラリア・ドル 小計		17,408,956.860 (1,632,437,885)	
オフショア・人 民元	3.25% China Government Bond 20281122	6,500,000.000	6,917,625.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	11,000,000.000	11,818,400.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	15,000,000.000	15,299,550.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	3,000,000.000	3,081,630.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	5,300,000.000	5,684,780.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	24,000,000.000	24,684,960.000	
	3.28% China Government Bond 20271203	14,000,000.000	14,677,180.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	12,000,000.000	13,149,000.000	

3.81% China Government Bond 20500914	5,500,000.000	7,595,390.000	
3.01% China Government Bond 20280513	8,000,000.000	8,370,480.000	
3.72% China Government Bond 20510412	7,000,000.000	9,547,090.000	
3.02% China Government Bond 20310527	8,800,000.000	9,542,808.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	5,000,000.000	5,076,150.000	
2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	13,000,000.000	13,208,260.000	
3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	6,500,000.000	6,836,570.000	
3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	6,000,000.000	6,435,540.000	
3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	10,000,000.000	10,723,600.000	
4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	7,400,000.000	10,351,564.000	
3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	7,000,000.000	9,551,080.000	
3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	10,600,000.000	13,574,254.000	
2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	3,500,000.000	3,665,375.000	
3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	3,300,000.000	4,368,903.000	
2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	5,300,000.000	5,718,329.000	
2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	12,000,000.000	12,179,280.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	9,800,000.000	10,504,620.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	4,000,000.000	4,191,840.000	
2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	10,500,000.000	10,701,180.000	
3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,000,000.000	6,428,850.000	

2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	8,000,000.000	8,609,360.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	3,000,000.000	3,144,030.000	
2.5% CHINA GOVERNMENT BOND 20270725	12,000,000.000	12,240,360.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	7,000,000.000	7,506,310.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	2,000,000.000	2,134,540.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	13,000,000.000	13,589,810.000	
2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	16,000,000.000	16,346,400.000	
3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	4,000,000.000	4,989,200.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	8,000,000.000	8,655,600.000	
2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	13,000,000.000	13,718,380.000	
2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	8,000,000.000	8,722,880.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	21,000,000.000	22,226,610.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	4,000,000.000	4,128,720.000	
3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	6,000,000.000	7,593,480.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	9,000,000.000	9,669,510.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	11,000,000.000	11,570,350.000	
2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	20,000,000.000	20,558,000.000	
2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	11,000,000.000	11,705,980.000	
2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	15,000,000.000	15,130,800.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	11,000,000.000	11,571,780.000	

3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	7,300,000.000	9,059,446.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	12,000,000.000	12,928,440.000	
2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225	8,000,000.000	8,407,600.000	
2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20290115	10,000,000.000	10,302,800.000	
2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20270225	25,000,000.000	25,253,750.000	
2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225	9,000,000.000	9,479,070.000	
2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325	10,000,000.000	10,384,000.000	
2.05% CHINA GOVERNMENT BOND 20290415	21,000,000.000	21,425,040.000	
2.27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525	10,000,000.000	10,485,000.000	
1.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20260615	20,000,000.000	20,050,800.000	
2.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20310625	21,000,000.000	21,640,500.000	
1.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20290715	10,000,000.000	10,154,300.000	
1.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20270815	10,000,000.000	10,036,700.000	
2.11% CHINA GOVERNMENT BOND 20340825	5,000,000.000	5,177,000.000	
1.42% CHINA GOVERNMENT BOND 20271115	17,000,000.000	16,992,520.000	
2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20341125	18,000,000.000	18,537,480.000	
1.43% CHINA GOVERNMENT BOND 20300125	15,000,000.000	14,957,250.000	
1.92% CHINA GOVERNMENT BOND 20550115	4,000,000.000	4,010,920.000	
1.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20350215	12,000,000.000	11,914,800.000	
1.45% CHINA GOVERNMENT BOND 20280225	5,000,000.000	5,001,950.000	

	1.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20320325	15,000,000.000	15,191,400.000	
	1.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20280525	7,000,000.000	7,004,830.000	
	1.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20350525	7,000,000.000	7,015,960.000	
オフショア・人民元 小計			763,107,944.000 (15,327,480,920)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	560,000.000	460,219.200	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	907,000.000	1,002,788.270	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	300,000.000	344,775.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	620,000.000	654,527.800	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	140,000.000	138,244.400	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	500,000.000	430,505.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,920,000.000	1,898,515.200	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	930,000.000	900,100.500	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	600,000.000	586,848.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	2,020,000.000	1,451,955.800	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,300,000.000	1,269,944.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	2,400,000.000	2,207,880.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	2,000,000.000	1,827,140.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	250,000.000	166,037.500	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	1,500,000.000	1,463,835.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,000,000.000	904,540.000		

	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	500,000.000	462,885.000	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,000,000.000	951,680.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	1,500,000.000	1,527,930.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201	800,000.000	667,880.000	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20331201	1,500,000.000	1,494,495.000	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340601	1,500,000.000	1,460,865.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260801	1,200,000.000	1,217,088.000	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20341201	800,000.000	792,352.000	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20350601	1,000,000.000	987,450.000	
	カナダ・ドル 小計		25,270,480.670 (2,685,241,276)	
シンガポール・ ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	203,000.000	208,856.550	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	600,000.000	627,300.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	239,000.000	250,352.500	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	420,000.000	456,120.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	500,000.000	518,500.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	300,000.000	316,674.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	200,000.000	200,536.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	660,000.000	658,020.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	800,000.000	817,600.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	350,000.000	315,700.000	

	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	400,000.000	390,000.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	170,000.000	151,130.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	200,000.000	225,700.000	
シンガポール・ドル 小計			5,136,489.050 (578,111,843)	
スウェーデン・ クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	2,520,000.000	2,822,299.200	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	4,780,000.000	4,725,269.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	2,550,000.000	2,473,500.000	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	500,000.000	504,125.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	3,000,000.000	2,851,500.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	4,000,000.000	3,578,280.000	
スウェーデン・クローナ 小計			16,954,973.200 (257,546,043)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	4,740,000.000	5,764,314.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	3,200,000.000	3,109,280.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	1,700,000.000	1,593,988.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	2,400,000.000	1,272,624.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	2,000,000.000	1,741,780.000	
デンマーク・クローネ 小計			13,481,986.000 (301,052,747)	
ニュージーラン ド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	1,000,000.000	1,019,120.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	300,000.000	283,068.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	300,000.000	246,183.000	

	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	500,000.000	486,585.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	500,000.000	432,070.000	
	2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	500,000.000	432,865.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	200,000.000	130,462.000	
	5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20540515	250,000.000	240,192.500	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20350515	700,000.000	696,850.000	
ニュージーランド・ドル 小計			3,967,395.500 (345,084,061)	
ノルウェー・ク ローネ	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,000,000.000	2,901,300.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	2,000,000.000	1,904,620.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	2,000,000.000	1,837,320.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	2,500,000.000	2,208,800.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	2,000,000.000	1,705,620.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	2,000,000.000	1,780,840.000	
ノルウェー・クローネ 小計			12,338,500.000 (179,648,560)	
ポーランド・ズ ロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	2,640,000.000	2,588,942.400	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	1,815,000.000	1,738,951.500	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	2,300,000.000	2,110,089.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	1,800,000.000	1,487,034.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	900,000.000	851,508.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,000,000.000	799,410.000	

	7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	2,000,000.000	2,157,100.000	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	2,000,000.000	2,071,200.000	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725	1,000,000.000	993,610.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20341025	2,000,000.000	1,924,340.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300125	1,500,000.000	1,500,960.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	600,000.000	618,666.000	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	1,800,000.000	1,709,442.000	
	ポーランド・ズロチ 小計		20,551,252.900 (801,704,376)	
マレーシア・リ ンギット	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,760,000.000	1,854,793.600	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,000,000.000	1,043,530.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	1,950,000.000	1,975,174.500	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,400,000.000	1,426,992.000	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,500,000.000	1,523,610.000	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	700,000.000	804,153.000	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	500,000.000	528,915.000	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	1,420,000.000	1,581,525.000	
	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	500,000.000	509,045.000	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,000,000.000	1,102,060.000	
	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	1,600,000.000	1,785,472.000	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	1,500,000.000	1,513,980.000		

	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,200,000.000	1,227,336.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,327,482.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	400,000.000	401,188.000	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	1,400,000.000	1,417,220.000	
マレーシア・リングgit 小計			20,022,476.100 (680,385,763)	
メキシコ・ペソ	8% Mexican Bonos 20471107	11,450,000.000	9,446,364.500	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	10,000,000.000	9,591,300.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	10,000,000.000	8,224,200.000	
	7.5% MEXICAN BONOS 20330526	10,000,000.000	9,057,200.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20290301	30,000,000.000	29,834,400.000	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	20,800,000.000	20,571,408.000	
	10% Mexican Bonos 20361120	2,750,000.000	2,879,882.500	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	6,500,000.000	6,459,895.000	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	5,000,000.000	4,572,850.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	12,700,000.000	12,020,042.000	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	14,050,000.000	11,557,811.000	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	10,300,000.000	9,315,217.000	
メキシコ・ペソ 小計			133,530,570.000 (1,017,823,417)	
ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	190,000.000	172,005.100	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	270,000.000	185,697.900	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	200,000.000	193,618.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	150,000.000	129,729.000	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	474,490.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	300,000.000	278,349.000	

0.125% Finland Government Bond 20360415	350,000.000	255,696.000	
0.25% Finland Government Bond 20400915	150,000.000	95,647.500	
0.125% Finland Government Bond 20520415	200,000.000	86,448.000	
0.125% Finland Government Bond 20310915	200,000.000	171,922.000	
FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	400,000.000	390,876.000	
1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	1,300,000.000	1,197,729.000	
2.95% FINLAND GOVERNMENT BOND 20550415	500,000.000	449,785.000	
0.75% Austria Government Bond 20261020	490,000.000	482,821.500	
1.5% Austria Government Bond 20470220	270,000.000	191,295.000	
1.5% Austria Government Bond 20861102	280,000.000	142,970.800	
0.5% Austria Government Bond 20270420	1,000,000.000	974,240.000	
2.1% Austria Government Bond 21170920	200,000.000	127,682.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	700,000.000	658,161.000	
Austria Government Bond 20300220	450,000.000	403,488.000	
0.75% Austria Government Bond 20510320	1,100,000.000	604,340.000	
Austria Government Bond 20401020	500,000.000	302,850.000	
0.85% Austria Government Bond 21200630	100,000.000	34,129.000	
Austria Government Bond 20310220	1,000,000.000	868,930.000	
0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	200,000.000	146,018.000	
0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	150,000.000	56,826.000	

0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	500,000.000	447,490.000	
1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	200,000.000	149,114.000	
2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	1,000,000.000	1,001,600.000	
2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	800,000.000	809,048.000	
1% Belgium Government Bond 20310622	300,000.000	273,549.000	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	460,000.000	389,578.600	
1% Belgium Government Bond 20260622	95,000.000	94,152.600	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	300,000.000	192,339.000	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	730,000.000	713,640.700	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	310,000.000	216,156.800	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	400,000.000	327,600.000	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	500,000.000	446,265.000	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	600,000.000	568,308.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	350,000.000	231,714.000	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	900,000.000	800,865.000	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	600,000.000	384,216.000	
Belgium Government Bond 20271022	300,000.000	286,404.000	
Belgium Government Bond 20311022	400,000.000	338,964.000	
0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	1,000,000.000	848,380.000	
1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	400,000.000	234,164.000	

2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	500,000.000	463,705.000	
3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	1,300,000.000	1,312,857.000	
3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	400,000.000	360,836.000	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20550622	400,000.000	372,340.000	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	455,000.000	497,506.100	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	800,000.000	874,504.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	800,000.000	866,400.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	496,000.000	585,121.280	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	2,000,000.000	2,341,880.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,270,000.000	1,505,000.800	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	1,390,000.000	1,573,076.900	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,020,000.000	1,192,859.400	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	656,000.000	690,039.840	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,098,000.000	1,034,601.480	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,125,000.000	1,985,302.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,150,000.000	2,106,032.500	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,000,000.000	974,740.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	1,100,000.000	1,069,200.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	1,250,000.000	900,787.500	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	200,000.000	189,832.000	

0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	1,300,000.000	1,221,883.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	500,000.000	460,055.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,000,000.000	967,780.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	700,000.000	635,768.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	500,000.000	388,615.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,076,412.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,300,000.000	1,151,085.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	200,000.000	150,252.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	1,500,000.000	1,404,780.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	800,000.000	388,072.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,000,000.000	873,690.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,000,000.000	874,110.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	1,100,000.000	946,957.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	800,000.000	622,992.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	1,000,000.000	1,000,520.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	400,000.000	312,100.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330815	1,700,000.000	1,722,695.000	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340215	800,000.000	783,880.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20540815	1,100,000.000	997,645.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20410515	1,000,000.000	966,670.000	

2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340815	1,000,000.000	1,008,320.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20350215	1,200,000.000	1,197,036.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	200,000.000	91,210.000	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20261210	1,200,000.000	1,202,580.000	
1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270610	1,800,000.000	1,794,906.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	1,000,000.000	976,490.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	2,000,000.000	1,934,760.000	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	1,000,000.000	1,008,260.000	
2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300418	3,000,000.000	3,036,450.000	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	2,300,000.000	2,561,142.000	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,600,000.000	3,086,434.000	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	1,210,000.000	1,365,618.100	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	182,000.000	183,181.180	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	1,265,000.000	1,332,993.750	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	1,143,000.000	1,262,123.460	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,000,000.000	998,600.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	2,410,000.000	2,446,029.500	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	1,990,000.000	1,852,073.100	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,200,000.000	5,186,272.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	1,650,000.000	1,336,731.000	

1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	800,000.000	440,904.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	1,000,000.000	805,980.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	2,700,000.000	2,648,835.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	560,000.000	406,380.800	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,000,000.000	3,835,120.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	1,000,000.000	855,190.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	2,750,000.000	2,609,145.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	1,250,000.000	780,237.500	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	4,000,000.000	3,716,080.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	1,400,000.000	902,230.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	2,200,000.000	1,842,830.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	500,000.000	484,005.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	1,000,000.000	468,810.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	1,100,000.000	903,650.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	1,000,000.000	767,510.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	1,500,000.000	1,445,220.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	2,000,000.000	1,876,020.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,400,000.000	1,178,884.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	1,100,000.000	920,040.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20331125	3,600,000.000	3,713,796.000	

3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20490625	100,000.000	87,060.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270924	2,000,000.000	2,018,580.000	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550525	800,000.000	698,424.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20341125	1,300,000.000	1,279,941.000	
3.2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350525	2,200,000.000	2,190,628.000	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	800,000.000	889,856.000	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	880,000.000	963,028.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	390,000.000	389,091.300	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	910,000.000	865,146.100	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,670,000.000	1,645,434.300	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	700,000.000	648,277.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	250,000.000	177,357.500	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,100,000.000	495,110.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	700,000.000	606,417.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	1,500,000.000	1,391,820.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	1,000,000.000	872,080.000	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	700,000.000	553,336.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715	500,000.000	496,665.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20340715	500,000.000	493,035.000	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,000,000.000	1,071,640.000	

6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	1,135,000.000	1,249,566.900	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	505,000.000	449,136.900	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	500,000.000	461,195.000	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	300,000.000	242,898.000	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	450,000.000	397,876.500	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	350,000.000	255,279.500	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,700,000.000	1,706,562.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	710,000.000	645,567.500	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,050,000.000	2,050,164.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	700,000.000	646,170.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	1,500,000.000	1,495,290.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	900,000.000	915,840.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	700,000.000	699,951.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	500,000.000	481,030.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	3,500,000.000	3,505,565.000	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	500,000.000	472,755.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	900,000.000	667,863.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	900,000.000	737,046.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	500,000.000	459,005.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	600,000.000	566,862.000	

1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	700,000.000	529,851.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,000,000.000	898,980.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	400,000.000	249,872.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	200,000.000	150,140.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	2,000,000.000	1,749,100.000	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	700,000.000	465,787.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	450,000.000	273,937.500	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	300,000.000	265,731.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	300,000.000	262,071.000	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	700,000.000	653,716.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	200,000.000	135,962.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	500,000.000	506,905.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	400,000.000	382,484.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	1,400,000.000	1,479,702.000	
4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	1,000,000.000	1,088,240.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	1,500,000.000	1,581,570.000	
3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,300,000.000	1,341,717.000	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	650,000.000	677,423.500	
3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	500,000.000	523,635.000	
4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	800,000.000	866,592.000	

3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280801	1,000,000.000	1,045,420.000	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,200,000.000	1,241,952.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350201	1,000,000.000	1,037,790.000	
4.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20541001	700,000.000	703,885.000	
3.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311115	1,000,000.000	1,011,210.000	
3.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350801	1,600,000.000	1,626,752.000	
3.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20351001	500,000.000	505,050.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	1,840,000.000	2,052,520.000	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	1,488,000.000	1,746,867.360	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,900,000.000	2,238,827.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	1,650,000.000	1,872,106.500	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	1,270,000.000	1,327,010.300	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,290,000.000	1,465,968.900	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	500,000.000	566,505.000	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,080,000.000	2,237,830.400	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	605,000.000	666,776.550	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,370,000.000	1,428,855.200	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,000,000.000	1,091,390.000	

5% Belgium Government Bond 20350328	750,000.000	872,647.500	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	865,000.000	939,355.400	
4% Belgium Government Bond 20320328	500,000.000	539,805.000	
3% Belgium Government Bond 20340622	300,000.000	300,714.000	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	680,000.000	682,910.400	
2% IRISH TREASURY 20450218	510,000.000	417,414.600	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	500,000.000	435,225.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	150,000.000	135,694.500	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	100,000.000	94,407.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	300,000.000	288,036.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	419,568.000	
IRISH TREASURY 20311018	200,000.000	170,940.000	
0.55% IRISH TREASURY 20410422	200,000.000	134,478.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	380,000.000	412,915.600	
4.15% Austria Government Bond 20370315	300,000.000	330,819.000	
3.8% Austria Government Bond 20620126	170,000.000	179,275.200	
3.15% Austria Government Bond 20440620	400,000.000	388,324.000	
2.4% Austria Government Bond 20340523	800,000.000	771,536.000	
2.75% Finland Government Bond 20280704	120,000.000	122,305.200	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,420,000.000	1,603,094.800	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	910,000.000	885,839.500	

2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,100,000.000	961,213.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	880,000.000	778,236.800	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	500,000.000	495,800.000	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	2,100,000.000	2,082,129.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	820,000.000	785,789.600	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	1,170,000.000	1,153,701.900	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	3,650,000.000	3,576,379.500	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	780,000.000	647,267.400	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	900,000.000	871,164.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	900,000.000	833,040.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	400,000.000	218,688.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	800,000.000	747,680.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	150,000.000	107,793.000	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	1,500,000.000	1,296,225.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	306,819.500	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	1,000,000.000	946,750.000	
0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	900,000.000	674,505.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	500,000.000	331,975.000	
0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,000,000.000	1,742,760.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	1,400,000.000	1,313,606.000	

3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	640,000.000	615,424.000	
3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	1,000,000.000	1,016,680.000	
3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730	630,000.000	654,948.000	
3.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20331031	1,200,000.000	1,249,944.000	
3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290531	1,500,000.000	1,563,870.000	
3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20340430	2,100,000.000	2,132,508.000	
3.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310730	1,000,000.000	1,023,020.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300131	1,000,000.000	1,010,000.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	680,000.000	808,948.400	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,100,000.000	1,192,389.000	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	800,000.000	921,720.000	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	500,000.000	564,720.000	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,000,000.000	1,043,760.000	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	490,000.000	584,927.700	
4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20370415	1,000,000.000	1,090,070.000	
2.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20260721	500,000.000	505,480.000	
2.125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20281017	1,000,000.000	1,002,390.000	
4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20450215	300,000.000	320,439.000	
2.25% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20340418	500,000.000	476,030.000	
1.95% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20290615	500,000.000	496,025.000	

	0.475% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20301018	500,000.000	453,045.000	
	0.3% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20311017	600,000.000	522,390.000	
	3.625% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20540612	400,000.000	387,072.000	
	ユーロ 小計		243,655,262.400 (40,583,220,505)	
国債証券 合計			131,381,088,870 [131,381,088,870]	
合計			131,381,088,870 [131,381,088,870]	

- (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 165銘柄	100%	44.9%
イギリス・ポンド	国債証券 58銘柄	100%	5.9%
イスラエル・シュケル	国債証券 8銘柄	100%	0.3%
オーストラリア・ドル	国債証券 22銘柄	100%	1.2%
オフショア・人民元	国債証券 71銘柄	100%	11.7%
カナダ・ドル	国債証券 25銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券 13銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 6銘柄	100%	0.2%
デンマーク・クローネ	国債証券 5銘柄	100%	0.2%
ニュージーランド・ドル	国債証券 9銘柄	100%	0.3%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	100%	0.1%
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	100%	0.6%
マレーシア・リングgit	国債証券 16銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 12銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券 268銘柄	100%	30.9%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）】

(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6月18日から2025年6月16日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	91,698,982	168,453,348
親投資信託受益証券	18,482,881,094	26,052,513,368
流動資産合計	18,574,580,076	26,220,966,716
資産合計	18,574,580,076	26,220,966,716
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	5,295,506	40,026,978
未払受託者報酬	1,678,711	2,656,234
未払委託者報酬	30,217,594	47,812,914
その他未払費用	629,445	996,016
流動負債合計	37,821,256	91,492,142
負債合計	37,821,256	91,492,142
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sub>1</sub> 12,917,741,944	<sub>1</sub> 18,710,739,378
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,619,016,876	7,418,735,196
（分配準備積立金）	2,293,470,531	1,962,111,188
元本等合計	18,536,758,820	26,129,474,574
純資産合計	18,536,758,820	26,129,474,574
負債純資産合計	18,574,580,076	26,220,966,716

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期		第9期	
	自 2023年6月16日 至 2024年6月17日		自 2024年6月18日 至 2025年6月16日	
営業収益				
受取利息		16,297		357,496
有価証券売買等損益		1,961,420,603		447,459,058
営業収益合計		1,961,436,900		447,101,562
営業費用				
支払利息		10,675		-
受託者報酬		2,952,141		4,945,370
委託者報酬		53,140,220		89,018,061
その他費用		1,106,917		1,854,365
営業費用合計		57,209,953		95,817,796
営業利益又は営業損失（ ）		1,904,226,947		542,919,358
経常利益又は経常損失（ ）		1,904,226,947		542,919,358
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,904,226,947		542,919,358
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（ ）		124,034,201		63,495,761
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,070,172,139		5,619,016,876
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,274,249,089		3,362,878,498
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,274,249,089		3,362,878,498
剰余金減少額又は欠損金増加額		505,597,098		1,083,736,581
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		505,597,098		1,083,736,581
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,619,016,876		7,418,735,196

## (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6月18日 至2025年6月16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6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2024年6月17日としており、2025年6月15日が休日のため、当計算期間末日を2025年6月16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6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
	1. 1 期首元本額	8,196,839,818円
期中追加設定元本額	6,628,810,445円	8,320,396,861円
期中一部解約元本額	1,907,908,319円	2,527,399,427円
2. 計算期間末日における受益権の総数	12,917,741,944口	18,710,739,378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6月16日 至2024年6月17日	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(6,832円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(1,780,174,633円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,325,546,345円)及び分配準備積立金(513,289,066円)より分配対象額は5,619,016,876円(1万口当たり4,349.84円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(5,456,624,008円)及び分配準備積立金(1,962,111,188円)より分配対象額は7,418,735,196円(1万口当たり3,964.96円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第9期
	2025年6月16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	第9期
	2024年6月17日現在	2025年6月16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	1,906,346,967	428,095,660
合計	1,906,346,967	428,095,660

## (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	第9期
2024年6月17日現在	2025年6月16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6月18日
至2025年6月16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	第9期
	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	1.4350円	1.3965円
(1万口当たり純資産額)	(14,350円)	(13,965円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	7,142,958,728	26,052,513,368	
親投資信託受益証券 合計			26,052,513,368	
合計			26,052,513,368	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

## 「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2024年6月17日現在 金額 (円)	2025年6月16日現在 金額 (円)
資産の部		
流動資産		

預金		2,275,059,100	2,411,669,275
コール・ローン		1,934,895,701	1,239,485,159
国債証券		316,701,120,710	332,386,902,609
派生商品評価勘定		7,054,649	7,692,152
未収入金		336,112	2,715,975
未収利息		2,345,610,298	2,649,765,248
前払費用		158,918,326	173,055,867
流動資産合計		323,422,994,896	338,871,286,285
資産合計		323,422,994,896	338,871,286,285
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		12,155,750	1,242,505
未払金		62,857	35,510
未払解約金		50,784,648	76,754,967
流動負債合計		63,003,255	78,032,982
負債合計		63,003,255	78,032,982
純資産の部			
元本等			
元本	1	86,637,182,960	92,889,444,303
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		236,722,808,681	245,903,809,000
元本等合計		323,359,991,641	338,793,253,303
純資産合計		323,359,991,641	338,793,253,303
負債純資産合計		323,422,994,896	338,871,286,285

## 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6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1. 1 期首	2023年6月16日	2024年6月18日
期首元本額	79,274,139,359円	86,637,182,960円
期中追加設定元本額	14,136,210,121円	16,478,826,746円
期中一部解約元本額	6,773,166,520円	10,226,565,403円
期末元本額の内訳 ファンド名		

ダイワ外国債券インデックスV A	353,386,145円	277,900,961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	4,730,030円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	32,397,835円	24,917,757円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	14,812,611円	12,385,718円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	185,995,811円	147,712,078円
外国債券インデックスファンド (F0Fs用)(適格機関投資家専 用)	731,151,994円	964,924,636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)	590,336,025円	667,057,238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)	956,757,996円	1,028,574,741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)	4,952,142,404円	7,142,958,728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)	1,134,690,990円	1,077,882,036円
D-I's 外国債券インデック ス	1,759,500円	1,389,137円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	21,281,066円	26,007,029円
iFree 外国債券インデック ス	2,085,512,930円	1,314,132,605円
iFree 8資産バランス	2,512,941,378円	3,091,527,705円
iFree 年金バランス	596,873,006円	720,414,402円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2060	1,954,816円	3,641,146円
DCダイワ外国債券インデック ス	51,717,310,895円	50,894,144,304円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,176,149,491円	1,217,184,241円
ダイワ・ライフ・バランス50	875,664,748円	975,382,066円
ダイワ・ライフ・バランス70	712,618,374円	792,786,843円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	712,072,206円	776,125,300円

DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	579,249,593円	634,495,162円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	236,172,504円	302,956,186円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	34,551,660円	32,815,448円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	21,468,866円	27,157,786円
ダイワつみたてインデックス外 国債券	2,292,449,559円	2,702,030,472円
ダイワつみたてインデックスバ ランス30	4,872,476円	5,257,691円
ダイワつみたてインデックスバ ランス50	2,179,468円	2,866,171円
ダイワつみたてインデックスバ ランス70	3,623,955円	36,309,993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)	1,855,240,936円	2,911,995,855円
ダイワ世界バランスファンド4 0VA	90,058,800円	83,002,090円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	26,205,450円	26,997,549円
ダイワ・バランスファンド35 VA	2,623,544,925円	2,220,067,551円
ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	169,056,701円	146,975,221円
スタイル9(4資産分散・保守 型)	85,432円	315,795円
スタイル9(4資産分散・ balan ス型)	1,110,127円	3,721,549円
スタイル9(4資産分散・積極 型)	989,244円	3,928,369円
スタイル9(6資産分散・保守 型)	27,564円	117,952円
スタイル9(6資産分散・ balan ス型)	728,074円	3,601,928円
スタイル9(6資産分散・積極 型)	279,364円	1,637,839円
スタイル9(8資産分散・保守 型)	36,200円	180,725円

スタイル9(8資産分散・バランス型)	724,764円	2,278,539円
スタイル9(8資産分散・積極型)	789,451円	2,378,158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	2,825,120円
ダイワ・インデックスセレクト外国債券	139,355,079円	117,205,552円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	69,704,013円	66,986,339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)	3,116,465,492円	6,177,489,546円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,895,512,178円	6,112,379,343円
ダイワライフスタイル25	25,294,949円	24,284,842円
ダイワライフスタイル50	59,367,643円	58,130,970円
ダイワライフスタイル75	17,277,292円	17,275,861円
計	86,637,182,960円	92,889,444,303円
2. 期末日における受益権の総数	86,637,182,960口	92,889,444,303口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年6月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	3,710,370,172	2,989,504,497
合計	3,710,370,172	2,989,504,497

(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6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち 1年超	(円)	(円)	(円)	うち 1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	1,848,810,519	-	1,843,709,418	5,101,101	1,145,772,252	-	1,152,221,899	6,449,647
アメリカ・ドル	547,073,296	-	551,559,227	4,485,931	69,180,071	-	69,729,880	549,809
イギリス・ポンド	17,396,464	-	17,373,673	22,791	9,832,979	-	9,954,639	121,660
イスラエル・シェケル	-	-	-	-	44,810,036	-	43,678,152	1,131,884
オフショア・人民元	736,173,859	-	738,429,295	2,255,436	620,721,263	-	623,312,551	2,591,288
カナダ・ドル	168,635,030	-	168,197,400	437,630	233,241,297	-	236,223,120	2,981,823
シンガポール・ドル	51,914,150	-	52,071,040	156,890	29,822,378	-	30,022,815	200,437
スウェーデン・クローナ	-	-	-	-	17,962,692	-	18,172,462	209,770
ニュージーランド・ドル	15,374,640	-	15,424,320	49,680	-	-	-	-
ノルウェー・クローネ	12,131,042	-	11,993,476	137,566	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	148,292,739	-	137,439,276	10,853,463	-	-	-	-
ユーロ	151,819,299	-	151,221,711	597,588	120,201,536	-	121,128,280	926,744
合計	1,848,810,519	-	1,843,709,418	5,101,101	1,145,772,252	-	1,152,221,899	6,449,647

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	3,7323円	3,6473円
(1万口当たり純資産額)	(37,323円)	(36,473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	745,031.380	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	768,066.120	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	784,393.260	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,545,936.800	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	2,976,000.000	3,010,104.960	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	887,308.730	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	538,963.480	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	516,970.710	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	931,270.730	

4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,074,310.350	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,039,330.000	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,167,214.400	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,000,213.100	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,178,000.000	1,134,143.060	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	987,224.080	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,385,678.320	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,250,513.880	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,301,814.150	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,337,023.120	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,168,323.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,302,067.980	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,060,982.010	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	3,930,573.400	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,218,473.900	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,073,489.600	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,739,654.940	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	2,715,926.420	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	1,785,581.240	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	4,307,000.000	3,621,540.950	

3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	1,327,000.000	1,071,910.790	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,492,930.260	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,074,822.680	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,063,000.000	1,423,944.490	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	2,935,000.000	2,204,449.150	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,373,208.680	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	492,319.130	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	1,148,000.000	780,100.440	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	1,911,029.850	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,242,212.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	1,784,176.200	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	5,151,759.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	722,140.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,538,189.200	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	1,726,412.450	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,213,696.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,468,860.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,694,385.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,450,000.000	1,710,957.500	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,289,020.000	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	1,741,300.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	6,161,722.500	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,183,250.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	2,824,616.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	11,500,000.000	11,169,375.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,489,285.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,332,213.800	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,603,430.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,340,137.600	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,303,198.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	3,390,298.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,150,000.000	2,915,582.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,676,803.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,943,480.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,736,440.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,439,500.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,286,165.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	2,200,000.000	1,348,864.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,711,128.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,424,200.000	

1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,903,760.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,350,000.000	4,876,525.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	2,830,500.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,932,260.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,415,800.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,475,950.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	6,245,655.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	4,400,000.000	2,525,952.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	1,300,000.000	1,239,056.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,508,432.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,780,204.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,251,488.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	1,900,000.000	890,910.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	3,400,000.000	2,075,768.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,274,460.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,265,780.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,737,280.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,639,550.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,200,000.000	2,982,262.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	3,400,000.000	2,054,450.000	

0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,247,860.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,691,480.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	8,294,720.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,691,560.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,000,000.000	3,087,180.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,193,569.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,616,850.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,604,250.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,449,240.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	3,239,454.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	9,135,446.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,643,150.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,176,495.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,718,800.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,000,000.000	6,964,640.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	1,500,000.000	1,391,685.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	3,971,200.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	2,714,910.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	6,000,000.000	5,555,820.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	4,261,004.000	

1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,619,100.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,836,400.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,692,788.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	3,900,000.000	2,198,547.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	5,700,000.000	3,716,685.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,772,840.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,573,000.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,580,850.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,805,050.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,588,450.000	
0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,360,665.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	10,000,000.000	8,439,800.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,600,000.000	3,588,750.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	2,703,120.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,517,420.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	7,000,000.000	6,727,770.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	5,000,000.000	4,804,850.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	5,161,576.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	6,500,000.000	5,952,830.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,836,160.000	

1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	7,900,000.000	6,845,034.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,982,617.000	
2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	6,900,000.000	4,123,785.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	1,786,275.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,645,200.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	5,000,000.000	4,827,050.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,834,160.000	
2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,873,800.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	6,300,000.000	5,802,111.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	3,445,800.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,219,740.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,883,390.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,934,540.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	5,000,000.000	4,778,400.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,950,060.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,892,320.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,960,190.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	3,971,506.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	9,500,000.000	8,642,910.000	
3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	5,200,000.000	3,677,232.000	

3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	2,000,000.000	1,649,640.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,189,043.200	
3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,457,450.000	
3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,384,535.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,489,250.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	3,500,000.000	3,515,505.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031	3,000,000.000	3,012,510.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	6,700,000.000	6,659,800.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	3,700,000.000	3,172,676.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	3,001,110.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	2,500,000.000	2,487,625.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	3,000,000.000	2,995,950.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20421115	2,500,000.000	2,242,425.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	5,000,000.000	4,974,400.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271231	1,500,000.000	1,498,500.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	5,000,000.000	4,893,750.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	8,000,000.000	7,608,080.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	2,500,000.000	2,199,500.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	4,500,000.000	3,600,000.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131	3,700,000.000	3,661,039.000	

4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300228	7,500,000.000	7,501,125.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280229	3,000,000.000	3,005,490.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,800,000.000	1,769,166.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280331	3,700,000.000	3,671,510.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	3,000,000.000	2,930,910.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280430	2,000,000.000	1,976,740.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	6,300,000.000	5,922,063.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	5,600,000.000	4,475,800.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	2,500,000.000	2,194,325.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280531	3,700,000.000	3,669,142.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531	1,500,000.000	1,481,385.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260615	3,000,000.000	3,000,060.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	3,000,000.000	2,961,960.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630	3,500,000.000	3,508,120.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260715	5,000,000.000	5,021,050.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	3,500,000.000	3,519,740.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815	11,000,000.000	10,684,520.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260815	6,000,000.000	6,018,000.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815	5,000,000.000	4,379,250.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430815	2,300,000.000	2,155,698.000	

4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	3,000,000.000	2,995,050.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300831	3,100,000.000	3,112,276.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	3,000,000.000	3,039,240.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260915	3,000,000.000	3,019,380.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930	1,500,000.000	1,540,545.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	4,200,000.000	4,288,578.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261015	1,000,000.000	1,007,220.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	6,174,600.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20331115	10,000,000.000	10,134,700.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261115	3,800,000.000	3,829,526.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20431115	2,300,000.000	2,259,382.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301031	3,100,000.000	3,221,024.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20531115	5,300,000.000	5,151,865.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301130	3,000,000.000	3,045,270.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	4,000,000.000	4,054,840.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261215	2,000,000.000	2,009,840.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310131	2,000,000.000	1,991,980.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301231	4,500,000.000	4,427,820.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	8,500,000.000	8,511,900.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	1,000,000.000	993,510.000	

4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270115	7,000,000.000	6,998,180.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340215	10,200,000.000	9,953,874.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270215	4,000,000.000	4,007,480.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540215	4,400,000.000	3,936,592.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440215	3,000,000.000	2,849,280.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310228	3,600,000.000	3,629,448.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,200,000.000	5,251,896.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270315	5,000,000.000	5,022,350.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	5,000,000.000	5,028,200.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310331	2,000,000.000	2,002,840.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270415	5,000,000.000	5,045,950.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340515	8,500,000.000	8,513,770.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270515	4,000,000.000	4,038,720.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	2,500,000.000	2,558,325.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310430	1,600,000.000	1,643,088.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540515	7,000,000.000	6,670,230.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440515	3,500,000.000	3,375,015.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	5,600,000.000	5,707,352.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260531	5,000,000.000	5,033,650.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310531	2,300,000.000	2,361,318.000	

4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270615	4,500,000.000	4,557,915.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260630	4,000,000.000	4,020,240.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310630	2,500,000.000	2,517,325.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	100,000.000	101,009.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270715	2,200,000.000	2,218,546.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	4,200,000.000	4,212,222.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	8,300,000.000	8,306,640.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310731	5,000,000.000	4,998,900.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340815	10,500,000.000	10,106,775.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270815	7,000,000.000	6,972,070.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540815	5,300,000.000	4,747,846.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310831	4,000,000.000	3,915,040.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440815	1,800,000.000	1,620,486.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	4,500,000.000	4,481,505.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	5,000,000.000	4,931,050.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270915	1,000,000.000	988,260.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	4,500,000.000	4,467,645.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	800,000.000	784,776.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310930	2,300,000.000	2,234,128.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271015	1,310,000.000	1,308,336.300	

4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	5,000,000.000	5,026,450.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20341115	9,000,000.000	8,902,260.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271115	4,200,000.000	4,218,354.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20541115	6,100,000.000	5,704,415.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	5,700,000.000	5,703,762.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311031	5,800,000.000	5,790,546.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	6,000,000.000	6,017,220.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	5,500,000.000	5,529,920.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20441115	2,400,000.000	2,309,232.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311130	3,500,000.000	3,493,280.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271215	4,000,000.000	4,007,880.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	4,000,000.000	4,061,640.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311231	3,500,000.000	3,565,870.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	1,500,000.000	1,504,980.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280115	3,000,000.000	3,022,950.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	6,500,000.000	6,566,495.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350215	8,600,000.000	8,749,812.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280215	5,500,000.000	5,544,110.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550215	5,600,000.000	5,350,576.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20450215	3,500,000.000	3,420,970.000	

	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270131	6,500,000.000	6,511,115.000	
	4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320131	4,000,000.000	4,045,680.000	
	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320229	4,000,000.000	3,987,080.000	
	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	4,000,000.000	4,008,560.000	
	3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280315	3,000,000.000	2,997,060.000	
	3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,991,400.000	
	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320331	3,500,000.000	3,487,400.000	
	4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	7,000,000.000	6,997,200.000	
	3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280415	3,000,000.000	2,985,810.000	
	3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	2,500,000.000	2,490,325.000	
	4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320430	3,500,000.000	3,460,065.000	
	4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550515	2,300,000.000	2,244,639.000	
	4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350515	3,500,000.000	3,454,850.000	
	3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280515	4,000,000.000	3,981,080.000	
	3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	4,500,000.000	4,472,550.000	
	アメリカ・ドル 小計		1,054,588,957.790 (152,303,737,283)	
イギリス・ポンド	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,282,000.000	714,586.800	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,429,107.500	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	918,297.600	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,053,671.500	

1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	850,591.400	
1.25% United Kingdom Gilt 20270722	2,610,000.000	2,476,002.600	
1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,398,825.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,740,000.000	705,117.600	
1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	650,508.100	
1.625% United Kingdom Gilt 20541022	1,600,000.000	748,416.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20291022	2,100,000.000	1,851,234.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20411022	2,190,000.000	1,286,340.300	
0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,300,000.000	1,077,973.000	
0.5% United Kingdom Gilt 20611022	3,300,000.000	875,985.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20280131	2,200,000.000	2,004,442.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,700,000.000	632,366.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	3,700,000.000	2,534,130.000	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	1,991,300.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20460131	1,550,000.000	717,464.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20261022	2,700,000.000	2,585,169.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,800,000.000	792,288.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	3,100,000.000	1,969,120.000	
0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	2,700,000.000	2,396,304.000	
0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	3,100,000.000	2,366,230.000	

1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	1,300,000.000	594,048.000	
1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	4,100,000.000	3,353,718.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	1,220,000.000	403,368.600	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	2,000,000.000	2,006,600.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	1,000,000.000	903,630.000	
3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	2,600,000.000	2,419,378.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	2,500,000.000	1,957,500.000	
4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	1,000,000.000	793,600.000	
4.5% UNITED KINGDOM GILT 20280607	2,700,000.000	2,743,335.000	
4.625% UNITED KINGDOM GILT 20340131	3,300,000.000	3,343,725.000	
4.75% UNITED KINGDOM GILT 20431022	1,500,000.000	1,425,300.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20270307	2,300,000.000	2,293,077.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20540731	1,280,000.000	1,112,358.400	
4% UNITED KINGDOM GILT 20311022	2,200,000.000	2,176,218.000	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20290722	2,100,000.000	2,111,025.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT 20340731	2,500,000.000	2,455,600.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20400131	2,000,000.000	1,884,080.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20280307	1,300,000.000	1,313,689.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20300307	1,600,000.000	1,621,568.000	
4.5% UNITED KINGDOM GILT 20350307	1,000,000.000	996,270.000	

5.375% UNITED KINGDOM GILT 20560131	350,000.000	356,412.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,017,033.810	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,440,000.000	1,445,155.200	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,862,000.000	1,803,365.620	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,757,000.000	1,746,299.870	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	1,451,851.240	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,200,071.980	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,245,625.920	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	1,979,898.880	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	2,300,000.000	2,383,467.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,163,736.360	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,846,000.000	1,725,123.920	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,565,054.400	
4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	947,617.580	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,456,406.810	
3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,221,625.760	
3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,466,000.000	1,912,284.360	
3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	997,878.420	
3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,724,000.000	1,374,734.840	
イギリス・ボンド 小計		96,927,201.370 (18,961,868,404)	

イスラエル・ シュケル	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	1,847,340.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	2,200,000.000	2,370,632.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,728,486.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,029,464.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,123,752.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,051,664.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	3,000,000.000	2,134,950.000	
	1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	2,300,000.000	1,873,603.000	
	2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129	1,720,000.000	1,155,375.600	
	3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290228	3,800,000.000	3,718,414.000	
	4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20350330	1,500,000.000	1,432,395.000	
	3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20270930	2,500,000.000	2,466,550.000	
	4.6% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290831	1,600,000.000	1,612,672.000	
イスラエル・シュケル 小計			25,545,297.600 (1,019,147,530)	
オーストラリ ア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,041,509.600	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,348,313.200	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	2,258,000.000	2,346,536.180	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,060,944.990	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	2,207,000.000	1,956,042.030	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	698,480.640	

2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,651,701.920	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,143,932.240	
3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	956,978.720	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,472,520.000	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,847,636.000	
2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,743,461.700	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,112,653.300	
1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,512,491.200	
1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	2,700,000.000	2,281,743.000	
1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,744,320.000	
1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	760,032.000	
1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,112,475.000	
0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,158,576.000	
1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,600,000.000	1,380,768.000	
3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,700,000.000	1,578,773.000	
3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	2,000,000.000	1,956,800.000	
3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221	1,600,000.000	1,525,744.000	
4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20540621	900,000.000	885,807.000	
4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340621	1,100,000.000	1,117,149.000	
4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20351221	1,700,000.000	1,712,036.000	

	4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20360321	1,500,000.000	1,508,010.000	
オーストラリア・ドル 小計			42,615,434.720 (3,996,049,314)	
オフショア・人 民元	3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,321,250.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,372,000.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,099,850.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,326,520.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	25,000,000.000	26,815,000.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,371,020.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	16,500,000.000	17,384,400.000	
	3.28% China Government Bond 20271203	29,000,000.000	30,402,730.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	13,696,875.000	
	3.81% China Government Bond 20500914	16,300,000.000	22,509,974.000	
	3.01% China Government Bond 20280513	27,000,000.000	28,250,370.000	
	3.72% China Government Bond 20510412	17,000,000.000	23,185,790.000	
	3.02% China Government Bond 20310527	15,800,000.000	17,133,678.000	
	2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,568,535.000	
	2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,080,100.000	
	3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,784,790.000	
	3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,362,950.000	
3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,825,620.000		

4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	7,000,000.000	9,792,020.000	
3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	8,800,000.000	12,007,072.000	
3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	23,000,000.000	29,453,570.000	
2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	15,500,000.000	16,232,375.000	
3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	11,500,000.000	15,224,965.000	
2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	16,000,000.000	17,262,880.000	
2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	17,000,000.000	17,253,980.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	15,200,000.000	16,292,880.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	15,719,400.000	
2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	15,000,000.000	15,287,400.000	
3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	7,071,735.000	
2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	5,380,850.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	4,000,000.000	4,192,040.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	19,000,000.000	20,374,270.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	32,000,000.000	34,152,640.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	9,931,015.000	
2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	17,200,000.000	17,572,380.000	
3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	19,500,000.000	24,322,350.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	5,500,000.000	5,950,725.000	
2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	19,000,000.000	20,049,940.000	

2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	20,000,000.000	20,606,000.000	
2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	15,000,000.000	16,355,400.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	15,000,000.000	15,876,150.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	25,000,000.000	25,804,500.000	
3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	21,700,000.000	27,463,086.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	35,000,000.000	37,603,650.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	33,000,000.000	34,711,050.000	
2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	35,000,000.000	35,976,500.000	
2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	40,000,000.000	42,567,200.000	
2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	30,000,000.000	30,261,600.000	
2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925	25,000,000.000	25,790,000.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	30,000,000.000	31,559,400.000	
3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	36,000,000.000	44,676,720.000	
2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	20,000,000.000	20,690,200.000	
2.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20261115	60,000,000.000	60,809,400.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	36,000,000.000	38,785,320.000	
2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225	50,000,000.000	52,547,500.000	
2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20290115	58,000,000.000	59,756,240.000	
2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20270225	35,000,000.000	35,355,250.000	
2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225	8,000,000.000	8,425,840.000	

2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325	35,000,000.000	36,344,000.000	
2.05% CHINA GOVERNMENT BOND 20290415	73,000,000.000	74,477,520.000	
1.85% CHINA GOVERNMENT BOND 20270515	85,000,000.000	85,664,700.000	
2.27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525	21,000,000.000	22,018,500.000	
1.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20260615	45,000,000.000	45,114,300.000	
2.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20310625	30,000,000.000	30,915,000.000	
1.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20290715	28,000,000.000	28,432,040.000	
1.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20270815	45,000,000.000	45,165,150.000	
2.11% CHINA GOVERNMENT BOND 20340825	44,000,000.000	45,557,600.000	
1.87% CHINA GOVERNMENT BOND 20310915	33,000,000.000	33,534,930.000	
1.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20260925	10,000,000.000	9,989,800.000	
1.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20291015	1,000,000.000	1,010,520.000	
1.42% CHINA GOVERNMENT BOND 20271115	13,000,000.000	12,994,280.000	
2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20341125	11,000,000.000	11,328,460.000	
1.06% CHINA GOVERNMENT BOND 20261215	5,000,000.000	4,973,200.000	
1.49% CHINA GOVERNMENT BOND 20311225	9,100,000.000	9,031,932.000	
1.43% CHINA GOVERNMENT BOND 20300125	20,000,000.000	19,943,000.000	
1.92% CHINA GOVERNMENT BOND 20550115	4,000,000.000	4,010,920.000	
1.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20350215	29,000,000.000	28,794,100.000	
1.45% CHINA GOVERNMENT BOND 20280225	5,000,000.000	5,001,950.000	

	1.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270315	10,000,000.000	10,029,400.000	
	1.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20320325	35,000,000.000	35,446,600.000	
	1.65% CHINA GOVERNMENT BOND 20350515	7,000,000.000	6,971,160.000	
	1.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20280525	30,000,000.000	30,020,700.000	
	1.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20350525	7,000,000.000	7,015,960.000	
	オフショア・人民元 小計		1,869,422,667.000 (37,548,475,920)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	955,000.000	784,838.100	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,383,000.000	1,529,058.630	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,306,845.320	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,163,041.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	963,844.970	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	948,949.060	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,151,170.370	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,469,000.000	1,452,561.890	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,200,134.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	635,752.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,666,710.900	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,191,793.600	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,173,827.500	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,744,920.000	

1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	293,928.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	3,106,138.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	2,650,000.000	1,759,997.500	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	2,200,000.000	2,146,958.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,700,000.000	2,442,258.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,388,655.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	97,180.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	1,200,000.000	1,200,144.000	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	2,270,000.000	2,160,313.600	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	1,300,000.000	1,324,206.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,700,000.000	1,638,460.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201	1,180,000.000	985,123.000	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280901	1,200,000.000	1,215,072.000	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20331201	1,000,000.000	996,330.000	
4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290301	1,800,000.000	1,870,524.000	
3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340601	1,700,000.000	1,655,647.000	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340301	1,500,000.000	1,519,965.000	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290901	800,000.000	818,176.000	
4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260801	700,000.000	709,968.000	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20341201	2,600,000.000	2,575,144.000	

	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,700,000.000	1,712,274.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300301	2,000,000.000	1,981,300.000	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270201	1,700,000.000	1,707,701.000	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20350601	1,600,000.000	1,579,920.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20571201	850,000.000	822,604.500	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270501	700,000.000	700,469.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300901	300,000.000	296,109.000	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270801	500,000.000	497,635.000	
	カナダ・ドル 小計		59,115,646.940 (6,281,628,644)	
シンガポール・ ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	794,272.200	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	845,809.500	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	419,000.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	616,848.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	648,125.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	818,000.000	863,464.440	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	451,206.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	747,750.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	562,100.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	650,000.000	650,962.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	487,080.000	

	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	585,000.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	500,000.000	444,500.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	198,456.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	247,320.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	620,000.000	699,670.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	500,000.000	511,350.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20280801	400,000.000	412,600.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20290401	600,000.000	624,300.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20340501	300,000.000	327,600.000	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20540601	100,000.000	116,693.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20350301	230,000.000	240,129.200	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20300401	160,000.000	164,616.000	
	シンガポール・ドル 小計		11,658,851.340 (1,312,203,718)	
スウェーデン・ クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	3,655,000.000	4,093,453.800	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	7,097,789.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,898,500.000	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,327,225.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	6,083,200.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,472,850.000	
	1.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20331111	4,000,000.000	3,857,600.000	

	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20350511	2,700,000.000	2,686,095.000	
スウェーデン・クローナ 小計			36,516,712.800 (554,688,868)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	16,614,358.200	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,955,415.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	4,090,000.000	3,834,947.600	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	1,855,910.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	435,445.000	
	2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20331115	2,000,000.000	1,985,580.000	
	2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20261115	50,000.000	50,504.000	
デンマーク・クローネ 小計			29,732,159.800 (663,919,128)	
ニュージーラン ド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	600,000.000	611,472.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	1,500,000.000	1,415,340.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	402,098.900	
	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	1,100,000.000	1,070,487.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	530,000.000	457,994.200	
	1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	225,907.500	
	0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	1,100,000.000	999,075.000	
	2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	940,000.000	813,786.200	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	247,877.800	
	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20340515	500,000.000	492,175.000	

	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20300515	1,100,000.000	1,127,841.000	
	5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20540515	700,000.000	672,539.000	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20350515	500,000.000	497,750.000	
	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20360515	1,300,000.000	1,256,463.000	
ニュージーランド・ドル 小計			10,290,806.600 (895,094,358)	
ノルウェー・ク ローネ	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,303,595.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,333,085.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,536,841.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,240,896.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	2,984,835.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	3,200,000.000	2,849,344.000	
	3.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20421006	1,600,000.000	1,515,696.000	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20330815	4,000,000.000	3,725,440.000	
	3.625% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20340413	3,500,000.000	3,392,655.000	
	3.625% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20390531	2,000,000.000	1,922,880.000	
3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20350612	3,900,000.000	3,801,564.000		
ノルウェー・クローネ 小計			35,606,831.000 (518,435,460)	
ポーランド・ズ ロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,292,348.820	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	3,037,177.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,440,361.200	

	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,478,390.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	2,081,464.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	5,000,000.000	3,997,050.000	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	3,700,000.000	3,645,018.000	
	7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	5,000,000.000	5,392,750.000	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	5,000,000.000	5,178,000.000	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725	6,000,000.000	5,961,660.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20341025	4,500,000.000	4,329,765.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300125	2,000,000.000	2,001,280.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20270125	1,000,000.000	931,190.000	
	4.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300725	1,400,000.000	1,364,118.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	852,727.970	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,466,368.500	
	ポーランド・ズロチ 小計		53,449,668.490 (2,085,071,567)	
マレーシア・リ ンギット	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,391,343.290	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	3,378,000.000	3,559,939.080	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,800,000.000	1,878,354.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	740,437.210	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,454,512.560	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,915,685.640	

4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,493,427.000	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,290,552.600	
4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,035,787.500	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,569,096.000	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,211,527.100	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,149,017.000	
4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	2,200,000.000	2,370,852.000	
4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	2,000,000.000	2,231,840.000	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	656,058.000	
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,362,621.800	
4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,367,352.000	
3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	2,000,000.000	2,042,280.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	2,550,000.000	2,557,573.500	
4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,682,595.000	
2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,726,884.000	
3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	1,400,000.000	1,410,388.000	
4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	1,900,000.000	2,117,455.000	
4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	521,650.000	
4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	2,200,000.000	2,362,778.000	
3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	1,000,000.000	1,009,320.000	

	4.054% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390418	1,200,000.000	1,243,980.000	
	4.18% MALAYSIAN GOVERNMENT 20440516	1,500,000.000	1,578,960.000	
	3.336% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300515	1,000,000.000	1,004,650.000	
マレーシア・リングgit 小計			49,936,916.280 (1,696,911,345)	
メキシコ・ペソ	8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	17,572,713.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	6,713,910.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	37,000,000.000	30,429,540.000	
	7.5% MEXICAN BONOS 20330526	30,000,000.000	27,171,600.000	
	7% MEXICAN BONOS 20260903	23,000,000.000	22,701,230.000	
	8% MEXICAN BONOS 20350524	5,000,000.000	4,572,150.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20290301	10,000,000.000	9,944,800.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20280302	10,000,000.000	10,019,700.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20300228	10,000,000.000	9,894,000.000	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	27,660,631.680	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,293,119.020	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	29,361,713.520	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	17,279,885.580	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	44,515,000.000	42,131,666.900	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	29,654,000.000	24,393,973.480	
7.75% Mexican Bonos 20341123	35,944,000.000	32,507,394.160		
メキシコ・ペソ 小計			321,648,027.340 (2,451,729,923)	
ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	329,525.560	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	247,597.200	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	774,472.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	406,484.200	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	474,490.000	

0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	463,915.000	
0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	226,473.600	
0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	255,060.000	
Finland Government Bond 20300915	500,000.000	440,065.000	
0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	172,896.000	
0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	515,766.000	
FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	195,438.000	
0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	278,991.000	
1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	800,000.000	737,064.000	
1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	267,378.300	
2.75% FINLAND GOVERNMENT BOND 20380415	400,000.000	381,836.000	
3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20330915	300,000.000	304,197.000	
2.875% FINLAND GOVERNMENT BOND 20290415	1,000,000.000	1,022,840.000	
2.95% FINLAND GOVERNMENT BOND 20550415	400,000.000	359,828.000	
3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20340915	600,000.000	604,890.000	
2.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20300415	500,000.000	502,390.000	
3.2% FINLAND GOVERNMENT BOND 20450415	350,000.000	340,172.000	
3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20350915	500,000.000	500,040.000	
0.75% Austria Government Bond 20261020	626,000.000	616,829.100	
1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	555,464.000	

1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	122,546.400	
0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,247,027.200	
2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	344,741.400	
0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,159,692.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,203,494.400	
Austria Government Bond 20300220	980,000.000	878,707.200	
0.75% Austria Government Bond 20510320	1,200,000.000	659,280.000	
Austria Government Bond 20401020	400,000.000	242,280.000	
0.85% Austria Government Bond 21200630	750,000.000	255,967.500	
Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	1,042,716.000	
0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	438,054.000	
0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	113,652.000	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	1,800,000.000	1,675,944.000	
0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	1,500,000.000	1,342,470.000	
1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	1,000,000.000	745,570.000	
2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	300,000.000	300,480.000	
2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	1,300,000.000	1,314,703.000	
3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20531020	500,000.000	468,480.000	
2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20290523	200,000.000	204,952.000	
3.45% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20301020	800,000.000	839,936.000	

2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20340220	500,000.000	502,255.000	
3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20390715	500,000.000	497,455.000	
2.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20291020	800,000.000	805,992.000	
2.95% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20350220	300,000.000	300,135.000	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,617,586.420	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	758,000.000	641,957.780	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,063,000.000	1,053,518.040	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	848,743.880	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	474,436.200	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,075,349.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	404,422.400	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	491,400.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,433,290.600	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	1,350,000.000	1,204,915.500	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,420,770.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	463,428.000	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	420,000.000	373,737.000	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	550,709.600	
Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,145,616.000	
Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,355,856.000	

0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	173,182.800	
0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	1,400,000.000	1,187,732.000	
1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	468,328.000	
2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	800,000.000	741,928.000	
3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	1,500,000.000	1,514,835.000	
3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	600,000.000	541,254.000	
3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20430622	700,000.000	683,732.000	
2.85% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20341022	1,100,000.000	1,084,369.000	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20550622	1,000,000.000	930,850.000	
2.7% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20291022	100,000.000	101,413.000	
3.1% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20350622	200,000.000	199,974.000	
3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20420622	700,000.000	685,818.000	
2.6% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20301022	550,000.000	552,024.000	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,276,021.140	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,363,347.060	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,028,850.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,301,555.680	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,569,025.120	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	2,731,517.200	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	1,371,000.000	1,551,574.410	

4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	2,725,000.000	3,186,805.750	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,147,925.850	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,174,000.000	1,234,918.860	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,708,000.000	2,551,640.080	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	2,502,882.540	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,370,511.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	2,200,000.000	2,144,428.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,207,600.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	3,470,000.000	2,500,586.100	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,832,626.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,891,556.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	4,700,000.000	4,417,577.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,760,330.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	3,150,000.000	1,524,253.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,589,420.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	3,500,000.000	2,720,305.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,913,440.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	2,500,000.000	2,242,525.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,076,856.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,900,000.000	1,682,355.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	2,400,000.000	1,803,024.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,873,040.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,700,000.000	824,653.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,600,000.000	1,397,904.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,000,000.000	874,110.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	3,800,000.000	3,271,306.000	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	1,600,000.000	1,298,224.000	
1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,592,783.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	2,650,000.000	2,063,661.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	3,200,000.000	3,201,664.000	
2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	2,400,000.000	2,388,048.000	
2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,000,000.000	995,410.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,000,000.000	780,250.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330815	2,400,000.000	2,432,040.000	
2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,516,515.000	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340215	2,400,000.000	2,351,640.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20540815	2,100,000.000	1,904,595.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20410515	1,000,000.000	966,670.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340815	3,500,000.000	3,529,120.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20350215	1,900,000.000	1,895,307.000	

2.9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20560815	950,000.000	930,705.500	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20350215	800,000.000	798,160.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	2,100,000.000	957,705.000	
2.9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260618	800,000.000	808,296.000	
2.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260917	1,000,000.000	1,010,390.000	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20261210	100,000.000	100,215.000	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270311	3,000,000.000	3,017,790.000	
1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270610	100,000.000	99,717.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	2,800,000.000	2,734,172.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	2,600,000.000	2,515,188.000	
1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,963,850.000	
1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	424,865.800	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	1,000,000.000	1,008,260.000	
2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20281019	100,000.000	101,378.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	100,000.000	100,263.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	1,100,000.000	1,103,102.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291011	10,000.000	10,171.100	
2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300418	500,000.000	506,075.000	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,700,293.420	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,927,000.000	3,474,612.430	

4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,000,973.990	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	2,964,000.000	2,983,236.360	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,501,602.500	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,493,752.080	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	1,714,596.200	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,099,000.000	5,175,230.050	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,788,000.000	2,594,763.720	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	5,073,570.320	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,784,435.200	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	5,369,000.000	4,349,641.660	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	764,417.310	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	3,050,000.000	2,977,074.500	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,770,000.000	2,232,564.600	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,335,570.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	1,850,484.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	5,177,412.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	5,650,000.000	4,831,823.500	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,696,461.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,850,000.000	1,778,941.500	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	5,650,000.000	5,248,963.000	

FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,767,400.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,334,530.600	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,417,790.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	5,000,000.000	4,337,850.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	980,000.000	278,124.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	3,600,000.000	2,040,264.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,853,190.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	4,000,000.000	3,872,040.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,600,000.000	1,218,906.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	4,200,000.000	3,450,300.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	3,000,000.000	2,302,530.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	4,300,000.000	4,142,964.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	4,100,000.000	3,845,841.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	842,060.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	2,100,000.000	1,756,440.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260924	3,200,000.000	3,222,752.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20330525	4,600,000.000	4,597,838.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290225	4,300,000.000	4,356,975.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20331125	3,200,000.000	3,301,152.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20490625	700,000.000	609,420.000	

2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270924	3,100,000.000	3,128,799.000	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550525	1,200,000.000	1,047,636.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300225	4,600,000.000	4,642,872.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20341125	3,700,000.000	3,642,909.000	
3.6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20420525	1,200,000.000	1,186,524.000	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20560525	900,000.000	858,861.000	
3.2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350525	1,500,000.000	1,493,610.000	
2.4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280924	1,100,000.000	1,103,806.000	
2.7% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310225	1,200,000.000	1,200,192.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,238,935.860	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	1,952,121.600	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	1,892,131.150	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,464,579.560	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,879,000.000	1,786,384.090	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	138,000.000	135,970.020	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,148,806.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,299,064.500	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,111,332.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	1,200,000.000	851,316.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,248,044.000	

NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	2,300,000.000	2,233,185.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,450,000.000	652,645.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,126,203.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	624,069.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	835,092.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	1,000,000.000	872,080.000	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	1,500,000.000	1,185,720.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715	900,000.000	893,997.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300115	1,300,000.000	1,314,625.000	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20440115	600,000.000	617,052.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20340715	1,000,000.000	986,070.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20350715	600,000.000	586,872.000	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,189,520.400	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,633,448.480	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,342,074.420	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,904,735.350	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,303,552.600	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,378,030.760	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	2,054,811.080	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,057,651.080	

2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	706,030.160	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,424,355.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,515,828.600	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,650,000.000	1,500,262.500	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,700,216.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,200,030.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,093,406.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,594,880.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	2,470,000.000	2,469,827.100	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,450,000.000	1,394,987.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	2,900,000.000	2,964,960.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,103,339.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,151,462.500	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,796,469.000	
0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,310,731.500	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,150,208.500	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,228,410.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,836,020.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,984,017.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	2,146,848.000	

1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,135,395.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	2,600,000.000	2,337,348.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	749,616.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	525,490.000	
0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,803,727.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,574,190.000	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	1,100,000.000	731,951.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	960,000.000	584,400.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	2,300,000.000	2,182,102.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,682,963.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	3,100,000.000	3,034,745.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	2,300,000.000	2,009,211.000	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,600,000.000	2,428,088.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	543,848.000	
1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	295,146.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	811,048.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,600,000.000	1,540,880.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	2,300,000.000	2,199,283.000	
2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	1,000,000.000	1,012,160.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	1,500,000.000	1,585,395.000	

4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	2,800,000.000	3,047,072.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	3,100,000.000	3,268,578.000	
3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,500,000.000	1,548,135.000	
4.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20430901	1,600,000.000	1,692,832.000	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	1,200,000.000	1,250,628.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311030	900,000.000	959,202.000	
3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	1,200,000.000	1,256,724.000	
4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	2,100,000.000	2,274,804.000	
3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280801	700,000.000	731,794.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260915	900,000.000	919,926.000	
4.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340301	2,100,000.000	2,249,142.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,592,205.000	
4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290201	600,000.000	635,202.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270215	200,000.000	202,918.000	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,000,000.000	1,034,960.000	
4.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20391001	2,000,000.000	2,073,240.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290701	400,000.000	413,012.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340701	700,000.000	729,435.000	
4.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20371030	50,000.000	52,143.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310715	1,200,000.000	1,236,936.000	

3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270715	1,500,000.000	1,540,695.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260828	100,000.000	101,254.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350201	500,000.000	518,895.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291001	200,000.000	203,670.000	
4.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20541001	1,000,000.000	1,005,550.000	
3.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311115	1,300,000.000	1,314,573.000	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271015	800,000.000	809,880.000	
3.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350801	1,000,000.000	1,016,720.000	
4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460430	200,000.000	202,450.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20401001	300,000.000	298,362.000	
2.55% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270225	800,000.000	806,064.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300701	500,000.000	505,575.000	
2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280615	500,000.000	505,305.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320715	700,000.000	708,029.000	
3.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20351001	600,000.000	606,060.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	1,254,000.000	1,398,837.000	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,344,640.530	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,126,885.650	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,607,333.780	

4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,862,998.600	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,544,000.000	1,754,617.040	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,541,341.430	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,592,870.800	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	1,998,125.430	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,417,581.280	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	2,006,000.000	2,189,328.340	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,215,361.120	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,504,000.000	1,633,283.840	
4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	842,095.800	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	650,420.220	
3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	748,777.860	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	965,113.080	
2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	761,986.260	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	478,747.500	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	775,608.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	678,472.500	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	708,052.500	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	912,114.000	

1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	419,568.000	
0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	275,065.000	
0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	484,620.000	
0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	712,976.000	
IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	683,760.000	
0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	268,956.000	
0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	84,994.000	
3% IRISH TREASURY 20431018	200,000.000	193,222.000	
2.6% IRISH TREASURY 20341018	300,000.000	294,060.000	
3.15% IRISH TREASURY 20551018	320,000.000	303,398.400	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	896,461.500	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,514,048.290	
3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	356,441.280	
3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	701,895.630	
2.4% Austria Government Bond 20340523	1,371,000.000	1,322,219.820	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	396,472.690	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	370,858.400	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	2,993,948.880	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	1,997,519.400	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,705,716.160	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,250,000.000	1,105,450.000	

1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,607,908.000	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,883,831.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,676,990.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,021,443.500	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,351,592.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	2,200,000.000	1,825,626.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,830,893.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,548,736.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	3,450,000.000	3,062,634.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	3,800,000.000	3,517,280.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	2,560,000.000	2,329,548.800	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	765,408.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	1,200,000.000	1,169,664.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,243,040.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,600,000.000	1,149,792.000	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,901,130.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	306,819.500	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	2,500,000.000	2,366,875.000	
0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	700,000.000	524,615.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,657,541.000	

1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	398,370.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	2,200,000.000	2,131,514.000	
0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,829,898.000	
1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	1,600,000.000	1,068,256.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	3,600,000.000	3,377,844.000	
2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,700,000.000	1,667,088.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,300,000.000	1,250,080.000	
3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	2,600,000.000	2,643,368.000	
2.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260531	2,300,000.000	2,317,779.000	
3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730	2,100,000.000	2,183,160.000	
3.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20331031	1,500,000.000	1,562,430.000	
3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290531	1,400,000.000	1,459,612.000	
3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20340430	2,600,000.000	2,640,248.000	
2.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270531	200,000.000	201,826.000	
4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20541031	1,000,000.000	1,003,560.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20341031	1,600,000.000	1,644,784.000	
3.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310730	1,200,000.000	1,227,624.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300131	200,000.000	202,000.000	
3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350430	1,200,000.000	1,199,304.000	
2.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280531	500,000.000	502,890.000	

3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410131	500,000.000	491,000.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,592,203.770	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,901,318.460	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,858,000.000	2,140,694.700	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,228,385.120	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,050,988.400	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	1,935,335.700	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,699,000.000	2,028,147.270	
4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20370415	850,000.000	926,559.500	
4.125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20270414	680,000.000	707,200.000	
2.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20260721	840,000.000	849,206.400	
3.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20300215	630,000.000	673,873.200	
2.125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20281017	1,300,000.000	1,303,107.000	
4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20450215	570,000.000	608,834.100	
2.25% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20340418	720,000.000	685,483.200	
1.95% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20290615	1,000,000.000	992,050.000	
0.475% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20301018	900,000.000	815,481.000	
0.7% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20271015	620,000.000	603,619.600	
0.9% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20351012	750,000.000	608,955.000	
1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20520412	630,000.000	343,532.700	

	0.3% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20311017	750,000.000	652,987.500	
	1.15% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20420411	520,000.000	365,705.600	
	1.65% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20320716	570,000.000	533,685.300	
	3.5% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20380618	500,000.000	510,005.000	
	2.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20341020	630,000.000	626,509.800	
	3.625% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20540612	240,000.000	232,243.200	
	3% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20350615	300,000.000	299,028.000	
	3.375% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20400615	300,000.000	296,703.000	
	ユーロ 小計		612,979,954.050 (102,097,941,147)	
国債証券 合計			332,386,902,609 [332,386,902,609]	
合計			332,386,902,609 [332,386,902,609]	

(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 284銘柄	100%	45.8%
イギリス・ポンド	国債証券 63銘柄	100%	5.7%
イスラエル・シケル	国債証券 13銘柄	100%	0.3%
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	100%	1.2%
オフショア・人民元	国債証券 83銘柄	100%	11.3%
カナダ・ドル	国債証券 42銘柄	100%	1.9%
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	7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	16銘柄	100%	0.6%
マレーシア・リングgit	国債証券	29銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	16銘柄	100%	0.7%
ユーロ	国債証券	412銘柄	100%	30.7%

## 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)】

(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6月18日から2025年6月16日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 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）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	21,442,163	23,631,332
親投資信託受益証券	4,451,186,900	4,688,675,200
未収入金	1,715,010	889,822
流動資産合計	4,474,344,073	4,713,196,354
資産合計	4,474,344,073	4,713,196,354
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,682,146	786,243
未払受託者報酬	426,769	498,347
未払委託者報酬	7,896,049	9,220,045
その他未払費用	159,964	186,810
流動負債合計	10,164,928	10,691,445
負債合計	10,164,928	10,691,445
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,306,897,601	1,328,244,951
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,399,281,544	1,420,054,958
（分配準備積立金）	665,131,531	587,175,657
元本等合計	4,464,179,145	4,702,504,909
純資産合計	4,464,179,145	4,702,504,909
負債純資産合計	4,474,344,073	4,713,196,354

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期		第9期	
	自	2023年6月16日 至 2024年6月17日	自	2024年6月18日 至 2025年6月16日
<b>営業収益</b>				
受取利息		3,773		60,886
有価証券売買等損益		500,025,405		55,365,728
営業収益合計		500,029,178		55,304,842
<b>営業費用</b>				
支払利息		2,877		-
受託者報酬		792,746		991,605
委託者報酬		14,667,471		18,346,118
その他費用		297,127		371,703
営業費用合計		15,760,221		19,709,426
営業利益又は営業損失（ ）		484,268,957		75,014,268
経常利益又は経常損失（ ）		484,268,957		75,014,268
当期純利益又は当期純損失（ ）		484,268,957		75,014,268
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（ ）		30,949,214		11,146,210
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		661,979,943		1,399,281,544
剰余金増加額又は欠損金減少額		446,193,928		263,958,395
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		446,193,928		263,958,395
剰余金減少額又は欠損金増加額		162,212,070		179,316,923
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		162,212,070		179,316,923
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,399,281,544		1,420,054,958

## (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6月18日 至2025年6月16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6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2024年6月17日としており、2025年6月15日が休日のため、当計算期間末日を2025年6月16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6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
	1. 1 期首元本額	2,408,871,747円
期中追加設定元本額	1,231,686,050円	611,590,534円
期中一部解約元本額	575,660,196円	394,038,184円
2. 計算期間末日における受益権の総数	3,064,897,601口	3,282,449,951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6月16日 至2024年6月17日	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(1,317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(453,315,443円)、投資信託約款に規定される収益調整金(734,150,013円)及び分配準備積立金(211,814,771円)より分配対象額は1,399,281,544円(1万口当たり4,565.51円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(832,879,301円)及び分配準備積立金(587,175,657円)より分配対象額は1,420,054,958円(1万口当たり4,326.20円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第9期
	2025年6月16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	第9期
	2024年6月17日現在	2025年6月16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	475,666,605	47,916,738
合計	475,666,605	47,916,738

## (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	第9期
2024年6月17日現在	2025年6月16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6月18日
至2025年6月16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	第9期
	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	1.4566円	1.4326円
(1万口当たり純資産額)	(14,566円)	(14,326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	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	483,942,447	937,154,548	
	外国債券インデックスマザーファンド	1,028,574,741	3,751,520,652	
親投資信託受益証券 合計			4,688,675,200	
合計			4,688,675,200	

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、「ダイワ新興国債券インデックス・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6月17日現在 金額(円)	2025年6月16日現在 金額(円)

資産の部		
流動資産		
預金	159,745,222	79,380,786
コール・ローン	655,242,007	115,872,557
国債証券	46,204,219,780	53,899,860,071
派生商品評価勘定	1,585,232	803,250
未収入金	-	229,600
未収利息	815,086,743	918,367,486
前払費用	75,992,260	63,821,786
流動資産合計	47,911,871,244	55,078,335,536
資産合計	47,911,871,244	55,078,335,536
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,614,873	-
未払金	54,209,972	40,009,832
未払解約金	57,101	8,286,114
流動負債合計	57,881,946	48,295,946
負債合計	57,881,946	48,295,946
純資産の部		
元本等		
元本	1 25,463,772,957	28,417,348,768
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	22,390,216,341	26,612,690,822
元本等合計	47,853,989,298	55,030,039,590
純資産合計	47,853,989,298	55,030,039,590
負債純資産合計	47,911,871,244	55,078,335,536

## 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6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1. 1 期首	2023年6月16日	2024年6月18日
期首元本額	21,168,871,625円	25,463,772,957円
期中追加設定元本額	5,141,491,854円	4,085,805,967円
期中一部解約元本額	846,590,522円	1,132,230,156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）	557,526,488円	694,299,412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）	468,407,935円	483,942,447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）	553,737,479円	505,806,538円
D - I ' s 新興国債券インデッ クス	66,352,663円	71,192,051円
i F r e e 新興国債券インデッ クス	9,083,935,978円	10,655,854,022円
i F r e e 8資産バランス	4,878,463,525円	5,833,290,999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）	5,516,935円	6,231,747円
D Cダイワ新興国債券インデッ クスファンド	9,686,537,756円	10,010,045,724円
スタイル9（8資産分散・保守 型）	30,139円	81,138円
スタイル9（8資産分散・ balan ス型）	650,543円	2,208,585円
スタイル9（8資産分散・積極 型）	758,049円	5,476,500円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券	122,832,052円	109,585,370円
ダイワ・ノーロード 新興国債券 ファンド	39,023,415円	39,334,235円
計	25,463,772,957円	28,417,348,768円
2. 期末日における受益権の総数	25,463,772,957口	28,417,348,768口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年6月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）

国債証券	161,323,128	1,218,399,206
合計	161,323,128	1,218,399,206

（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6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買建	557,154,321	-	555,124,680	2,029,641	81,513,440	-	82,316,690	803,250
オフショア・ 人民元	56,006,090	-	56,213,300	207,210	81,513,440	-	82,316,690	803,250
チェコ・コル ナ	68,076,560	-	67,925,000	151,560	-	-	-	-
トルコ・リラ	36,829,200	-	37,496,800	667,600	-	-	-	-
ハンガリー・ フォリント	55,664,161	-	54,790,320	873,841	-	-	-	-
ポーランド・ ズロチ	62,266,492	-	61,386,560	879,932	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	42,903,840	-	42,353,300	550,540	-	-	-	-
ルーマニア・ レイ	203,589,200	-	202,515,000	1,074,200	-	-	-	-
南アフリカ・ ランド	31,818,778	-	32,444,400	625,622	-	-	-	-
合計	557,154,321	-	555,124,680	2,029,641	81,513,440	-	82,316,690	803,250

（注） 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	1.8793円	1.9365円
(1万口当たり純資産額)	(18,793円)	(19,365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	89,095,500.000	
		7.26% INDIA GOVERNMENT BOND 20320822	110,000,000.000	115,892,700.000	
		7.18% INDIA GOVERNMENT BOND 20330814	150,000,000.000	156,951,000.000	
		7.26% INDIA GOVERNMENT BOND 20290114	100,000,000.000	104,608,000.000	
		7.72% INDIA GOVERNMENT BOND 20490615	63,000,000.000	69,715,170.000	
		6.45% INDIA GOVERNMENT BOND 20291007	100,000,000.000	102,098,000.000	
		7.16% INDIA GOVERNMENT BOND 20500920	73,000,000.000	74,841,060.000	

5.79% INDIA GOVERNMENT BOND 20300511	80,000,000.000	79,236,000.000	
5.77% INDIA GOVERNMENT BOND 20300803	100,000,000.000	98,593,000.000	
6.67% INDIA GOVERNMENT BOND 20501217	110,000,000.000	107,676,800.000	
6.1% INDIA GOVERNMENT BOND 20310712	110,000,000.000	109,532,500.000	
6.99% INDIA GOVERNMENT BOND 20511215	110,000,000.000	110,070,400.000	
6.54% INDIA GOVERNMENT BOND 20320117	115,000,000.000	116,926,250.000	
7.1% INDIA GOVERNMENT BOND 20290418	120,000,000.000	124,608,000.000	
7.54% INDIA GOVERNMENT BOND 20360523	115,000,000.000	122,806,200.000	
7.38% INDIA GOVERNMENT BOND 20270620	47,000,000.000	48,645,000.000	
7.36% INDIA GOVERNMENT BOND 20520912	130,000,000.000	135,759,000.000	
7.41% INDIA GOVERNMENT BOND 20361219	110,000,000.000	116,378,900.000	
7.26% INDIA GOVERNMENT BOND 20330206	120,000,000.000	126,690,000.000	
7.06% INDIA GOVERNMENT BOND 20280410	78,000,000.000	80,873,520.000	
7.17% INDIA GOVERNMENT BOND 20300417	70,000,000.000	73,171,000.000	
7.3% INDIA GOVERNMENT BOND 20530619	150,000,000.000	155,787,000.000	
7.18% INDIA GOVERNMENT BOND 20370724	130,000,000.000	135,296,200.000	
7.37% INDIA GOVERNMENT BOND 20281023	60,000,000.000	62,769,600.000	
7.32% INDIA GOVERNMENT BOND 20301113	50,000,000.000	52,971,000.000	
7.37% INDIA GOVERNMENT BOND 20540123	8,000,000.000	8,340,880.000	
7.1% INDIA GOVERNMENT BOND 20340408	130,000,000.000	135,548,400.000	

	7.04% INDIA GOVERNMENT BOND 20290603	70,000,000.000	72,630,600.000	
	7.02% INDIA GOVERNMENT BOND 20310618	50,000,000.000	51,975,500.000	
	6.79% INDIA GOVERNMENT BOND 20341007	140,000,000.000	143,952,200.000	
	6.75% INDIA GOVERNMENT BOND 20291223	50,000,000.000	51,395,500.000	
	6.79% INDIA GOVERNMENT BOND 20311230	40,000,000.000	41,258,400.000	
	6.79% INDIA GOVERNMENT BOND 20341202	10,000,000.000	10,234,200.000	
	6.33% INDIA GOVERNMENT BOND 20350505	25,000,000.000	25,047,000.000	
	インド・ルピー 小計		3,111,374,480.000 (5,258,222,872)	
インドネシア・ ルピア	8.25% Indonesia Treasury Bond 20360515	15,250,000,000.000	16,934,667,500.000	
	8.75% Indonesia Treasury Bond 20310515	10,000,000,000.000	11,084,400,000.000	
	7.5% Indonesia Treasury Bond 20320815	7,000,000,000.000	7,347,690,000.000	
	7.5% Indonesia Treasury Bond 20380515	9,000,000,000.000	9,442,800,000.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20390415	12,000,000,000.000	13,478,160,000.000	
	8.25% Indonesia Treasury Bond 20290515	17,000,000,000.000	18,156,000,000.000	
	7% Indonesia Treasury Bond 20300915	30,000,000,000.000	30,836,700,000.000	
	7.5% Indonesia Treasury Bond 20350615	22,000,000,000.000	23,158,740,000.000	
	7.5% Indonesia Treasury Bond 20400415	19,000,000,000.000	19,928,530,000.000	
	5.5% Indonesia Treasury Bond 20260415	20,600,000,000.000	20,507,094,000.000	
	6.5% Indonesia Treasury Bond 20310215	28,000,000,000.000	28,096,880,000.000	
6.25% Indonesia Treasury Bond 20360615	7,300,000,000.000	7,002,233,000.000		

6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20320415	36,300,000,000.000	36,043,722,000.000	
5.125% INDONESIA TREASURY BOND 20270415	17,500,000,000.000	17,190,600,000.000	
7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20420615	15,000,000,000.000	15,158,250,000.000	
6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20370715	2,700,000,000.000	2,596,050,000.000	
7% INDONESIA TREASURY BOND 20330215	24,000,000,000.000	24,493,440,000.000	
6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20280815	16,100,000,000.000	16,173,577,000.000	
7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20430615	18,000,000,000.000	18,226,800,000.000	
7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20380615	20,000,000,000.000	20,390,200,000.000	
6.625% INDONESIA TREASURY BOND 20340215	23,500,000,000.000	23,455,350,000.000	
6.875% INDONESIA TREASURY BOND 20290415	26,000,000,000.000	26,538,460,000.000	
6.75% INDONESIA TREASURY BOND 20350715	25,000,000,000.000	25,067,000,000.000	
6.5% INDONESIA TREASURY BOND 20300715	21,000,000,000.000	21,159,180,000.000	
7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20400815	4,500,000,000.000	4,566,915,000.000	
7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20450815	2,000,000,000.000	2,023,480,000.000	
10.5% Indonesia Treasury Bond 20300815	3,480,000,000.000	4,068,050,400.000	
9.5% Indonesia Treasury Bond 20310715	5,100,000,000.000	5,836,491,000.000	
8.375% Indonesia Treasury Bond 20260915	22,024,000,000.000	22,629,660,000.000	
8.25% Indonesia Treasury Bond 20320615	6,000,000,000.000	6,530,220,000.000	
7% Indonesia Treasury Bond 20270515	20,000,000,000.000	20,310,000,000.000	
6.125% Indonesia Treasury Bond 20280515	20,000,000,000.000	19,943,600,000.000	

	6.625% Indonesia Treasury Bond 20330515	17,000,000,000.000	16,938,970,000.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20340315	26,920,000,000.000	29,850,780,400.000	
	9% Indonesia Treasury Bond 20290315	17,000,000,000.000	18,524,900,000.000	
インドネシア・ルピア 小計			603,689,590,300.000 (5,372,837,354)	
ウルグアイ・ペソ	8.5% Uruguay Government International Bond 20280315	2,800,000.000	2,742,180.000	
	8.25% Uruguay Government International Bond 20310521	12,000,000.000	11,652,000.000	
	9.75% URUGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 20330720	11,000,000.000	11,511,500.000	
ウルグアイ・ペソ 小計			25,905,680.000 (91,162,088)	
オフショア・人民元	3.25% China Government Bond 20281122	4,800,000.000	5,108,400.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,900,000.000	6,338,960.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	3,400,000.000	3,467,898.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	4,200,000.000	4,314,282.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	5,700,000.000	6,113,820.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	4,800,000.000	4,936,992.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	4,000,000.000	4,214,400.000	
	3.28% China Government Bond 20271203	3,700,000.000	3,878,969.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	5,500,000.000	6,026,625.000	
	3.03% China Government Bond 20260311	3,900,000.000	3,952,026.000	
	3.81% China Government Bond 20500914	5,500,000.000	7,595,390.000	
3.01% China Government Bond 20280513	3,000,000.000	3,138,930.000		

3.72% China Government Bond 20510412	2,000,000.000	2,727,740.000	
3.02% China Government Bond 20310527	7,000,000.000	7,590,870.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,568,535.000	
2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	1,800,000.000	1,885,050.000	
3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	2,000,000.000	2,647,820.000	
2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	3,500,000.000	3,776,255.000	
2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	2,800,000.000	2,841,832.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	3,000,000.000	3,215,700.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	3,500,000.000	3,667,860.000	
2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	2,200,000.000	2,242,152.000	
3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	2,000,000.000	2,571,540.000	
2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	2,500,000.000	2,690,425.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	3,600,000.000	3,772,836.000	
2.5% CHINA GOVERNMENT BOND 20270725	3,700,000.000	3,774,111.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	3,000,000.000	3,216,990.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	1,600,000.000	1,707,632.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	3,300,000.000	3,449,721.000	
2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	3,200,000.000	3,269,280.000	
3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	1,200,000.000	1,496,760.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	3,700,000.000	4,003,215.000	

2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	3,000,000.000	3,165,780.000	
2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	3,200,000.000	3,296,960.000	
2.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20260215	2,600,000.000	2,618,798.000	
2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	2,500,000.000	2,725,900.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	3,700,000.000	3,916,117.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	3,300,000.000	3,406,194.000	
3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	2,200,000.000	2,784,276.000	
2.3% CHINA GOVERNMENT BOND 20260515	5,000,000.000	5,041,150.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	3,200,000.000	3,438,048.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	3,000,000.000	3,155,550.000	
2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	3,000,000.000	3,083,700.000	
2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	3,000,000.000	3,192,540.000	
2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	4,500,000.000	4,539,240.000	
2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925	1,200,000.000	1,237,920.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	4,700,000.000	4,944,306.000	
3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	2,800,000.000	3,474,856.000	
2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	4,000,000.000	4,138,040.000	
2.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20261115	3,000,000.000	3,040,470.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	2,400,000.000	2,585,688.000	
2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225	4,300,000.000	4,519,085.000	

2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20290115	2,200,000.000	2,266,616.000	
2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20270225	4,000,000.000	4,040,600.000	
2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225	5,500,000.000	5,792,765.000	
2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325	900,000.000	934,560.000	
2.05% CHINA GOVERNMENT BOND 20290415	2,200,000.000	2,244,528.000	
1.85% CHINA GOVERNMENT BOND 20270515	1,650,000.000	1,662,903.000	
2.49% CHINA GOVERNMENT BOND 20440525	1,700,000.000	1,846,999.000	
2.27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525	3,900,000.000	4,089,150.000	
2.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20310625	2,700,000.000	2,782,350.000	
1.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20290715	3,000,000.000	3,046,290.000	
2.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20540520	2,300,000.000	2,620,252.000	
2.47% CHINA GOVERNMENT BOND 20540725	2,500,000.000	2,789,675.000	
1.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20270815	1,000,000.000	1,003,670.000	
2.11% CHINA GOVERNMENT BOND 20340825	4,700,000.000	4,866,380.000	
2.33% CHINA GOVERNMENT BOND 20440815	500,000.000	530,880.000	
1.87% CHINA GOVERNMENT BOND 20310915	1,000,000.000	1,016,210.000	
2.17% CHINA GOVERNMENT BOND 20340829	3,300,000.000	3,429,756.000	
2.25% CHINA GOVERNMENT BOND 20390829	1,000,000.000	1,041,510.000	
2.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20540925	2,100,000.000	2,227,638.000	
1.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20291015	500,000.000	505,260.000	

	1.42% CHINA GOVERNMENT BOND 20271115	300,000.000	299,868.000	
	2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20341125	2,000,000.000	2,059,720.000	
	1.49% CHINA GOVERNMENT BOND 20311225	2,500,000.000	2,481,300.000	
	1.43% CHINA GOVERNMENT BOND 20300125	3,000,000.000	2,991,450.000	
	1.92% CHINA GOVERNMENT BOND 20550115	2,200,000.000	2,206,006.000	
	1.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20350215	6,000,000.000	5,957,400.000	
	1.45% CHINA GOVERNMENT BOND 20280225	4,300,000.000	4,301,677.000	
	1.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20320325	2,000,000.000	2,025,520.000	
	1.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20550425	1,800,000.000	1,810,602.000	
	1.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	300,000.000	298,971.000	
	1.45% CHINA GOVERNMENT BOND 20300425	2,000,000.000	1,991,860.000	
オフショア・人民元 小計			267,670,000.000 (5,376,312,552)	
コロンビア・ペ ソ	6% Colombian TES 20280428	7,300,000,000.000	6,548,538,000.000	
	7.5% Colombian TES 20260826	5,000,000,000.000	4,903,650,000.000	
	7.75% Colombian TES 20300918	4,000,000,000.000	3,414,200,000.000	
	7% Colombian TES 20320630	5,300,000,000.000	4,020,686,000.000	
	7.25% Colombian TES 20341018	4,500,000,000.000	3,216,690,000.000	
	5.75% Colombian TES 20271103	3,500,000,000.000	3,211,950,000.000	
	7.25% Colombian TES 20501026	8,000,000,000.000	4,598,000,000.000	
	6.25% Colombian TES 20360709	3,750,000,000.000	2,349,375,000.000	
	7% COLOMBIAN TES 20310326	4,500,000,000.000	3,593,790,000.000	
	9.25% COLOMBIAN TES 20420528	9,300,000,000.000	6,947,379,000.000	

	13.25% COLOMBIAN TES 20330209	5,200,000,000.000	5,378,932,000.000	
	11.5% COLOMBIAN TES 20460725	4,500,000,000.000	3,960,225,000.000	
コロンビア・ペソ 小計			52,143,415,000.000 (1,821,473,773)	
セルビア・ディ ナール	4.5% Serbia Treasury Bonds 20260111	24,000,000.000	23,991,120.000	
	5.875% Serbia Treasury Bonds 20280208	25,000,000.000	25,953,750.000	
	4.5% Serbia Treasury Bonds 20320820	35,000,000.000	33,885,250.000	
	7% SERBIA TREASURY BONDS 20311026	29,000,000.000	32,282,510.000	
	5.25% SERBIA TREASURY BONDS 20350727	25,000,000.000	24,970,000.000	
セルビア・ディナール 小計			141,082,630.000 (200,736,457)	
タイ・パーツ	4.875% Thailand Government Bond 20290622	48,050,000.000	54,323,888.500	
	3.65% Thailand Government Bond 20310620	39,200,000.000	43,860,096.000	
	3.4% Thailand Government Bond 20360617	34,600,000.000	40,402,766.000	
	2.125% Thailand Government Bond 20261217	43,400,000.000	43,808,394.000	
	3.775% Thailand Government Bond 20320625	40,000,000.000	45,670,000.000	
	2.875% Thailand Government Bond 20460617	34,900,000.000	37,802,284.000	
	2.875% Thailand Government Bond 20281217	39,000,000.000	40,823,250.000	
	3.3% Thailand Government Bond 20380617	40,000,000.000	46,440,400.000	
	1.6% Thailand Government Bond 20291217	38,500,000.000	38,642,065.000	
	1.6% Thailand Government Bond 20350617	20,500,000.000	20,312,015.000	
	1.585% Thailand Government Bond 20351217	40,900,000.000	40,722,903.000	

	2% Thailand Government Bond 20311217	60,000,000.000	61,487,400.000	
	2% Thailand Government Bond 20420617	29,000,000.000	28,337,930.000	
	1% THAILAND GOVERNMENT BOND 20270617	61,000,000.000	60,412,570.000	
	2.65% THAILAND GOVERNMENT BOND 20280617	50,000,000.000	51,721,000.000	
	3.39% THAILAND GOVERNMENT BOND 20370617	48,500,000.000	57,075,770.000	
	2.35% THAILAND GOVERNMENT BOND 20260617	17,000,000.000	17,146,200.000	
	3.45% THAILAND GOVERNMENT BOND 20430617	49,500,000.000	57,931,335.000	
	3.35% THAILAND GOVERNMENT BOND 20330617	37,000,000.000	41,725,270.000	
	2.25% THAILAND GOVERNMENT BOND 20270317	50,000,000.000	50,653,500.000	
	2.4% THAILAND GOVERNMENT BOND 20290317	37,000,000.000	38,195,840.000	
	2.8% THAILAND GOVERNMENT BOND 20340617	40,000,000.000	43,762,400.000	
	2.4% THAILAND GOVERNMENT BOND 20271117	28,000,000.000	28,606,760.000	
	2.5% THAILAND GOVERNMENT BOND 20291117	44,000,000.000	45,859,880.000	
	2.98% THAILAND GOVERNMENT BOND 20450617	12,000,000.000	13,215,960.000	
	2.05% THAILAND GOVERNMENT BOND 20280417	6,000,000.000	6,096,840.000	
	2.41% THAILAND GOVERNMENT BOND 20350317	1,500,000.000	1,597,950.000	
	2.7% THAILAND GOVERNMENT BOND 20400617	2,000,000.000	2,207,960.000	
	タイ・パーツ 小計		1,058,842,626.500 (4,701,261,262)	
チェコ・コルナ	2.5% Czech Republic Government Bond 20280825	26,600,000.000	25,703,846.000	
	1% Czech Republic Government Bond 20260626	27,400,000.000	26,751,442.000	

0.95% Czech Republic Government Bond 20300515	27,500,000.000	24,077,625.000	
0.25% Czech Republic Government Bond 20270210	27,000,000.000	25,642,710.000	
2.75% Czech Republic Government Bond 20290723	21,800,000.000	21,065,122.000	
2% Czech Republic Government Bond 20331013	29,500,000.000	25,102,140.000	
1.2% Czech Republic Government Bond 20310313	23,000,000.000	19,932,030.000	
0.05% Czech Republic Government Bond 20291129	15,500,000.000	13,214,525.000	
4.2% Czech Republic Government Bond 20361204	15,300,000.000	15,060,861.000	
1.75% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20320623	29,500,000.000	25,505,110.000	
1.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20400424	16,500,000.000	11,044,935.000	
3.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20350530	20,000,000.000	18,758,200.000	
6% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20260226	15,000,000.000	15,279,150.000	
5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20300930	26,000,000.000	27,504,360.000	
5.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20281212	20,500,000.000	21,792,525.000	
1.95% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20370730	14,000,000.000	10,754,380.000	
4.9% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20340414	26,000,000.000	27,381,640.000	
5.75% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20290329	12,000,000.000	12,897,120.000	
6.2% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20310616	8,000,000.000	8,997,360.000	
4.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20321111	14,300,000.000	14,724,138.000	
3% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20330303	11,000,000.000	10,242,100.000	
3.6% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20360603	5,000,000.000	4,690,200.000	

チェコ・コロナ 小計			406,121,519.000 (2,725,075,392)	
チリ・ペソ	5% BONOS TESORERIA PESOS 20350301	970,000,000.000	920,685,200.000	
	6% BONOS TESORERIA PESOS 20430101	630,000,000.000	649,989,900.000	
	4.7% BONOS TESORERIA PESOS 20300901	800,000,000.000	773,832,000.000	
	5% BONOS TESORERIA PESOS 20281001	720,000,000.000	716,680,800.000	
	7% BONOS TESORERIA PESOS 20340501	220,000,000.000	239,718,600.000	
	6% BONOS TESORERIA PESOS 20330401	850,000,000.000	866,974,500.000	
	6.2% BONOS TESORERIA PESOS 20401001	350,000,000.000	366,866,500.000	
	5.8% BONOS TESORERIA PESOS 20291001	1,000,000,000.000	1,015,710,000.000	
	5.8% BONOS TESORERIA PESOS 20341001	440,000,000.000	442,956,800.000	
5.3% BONOS TESORERIA PESOS 20371101	150,000,000.000	144,022,500.000		
チリ・ペソ 小計			6,137,436,800.000 (942,612,093)	
ドミニカ・ペソ	13.625% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20330203	11,400,000.000	13,040,574.000	
	11.25% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20350915	12,500,000.000	12,843,000.000	
	10.75% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20360601	20,000,000.000	20,055,000.000	
	10.5% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20370315	18,000,000.000	17,758,800.000	
ドミニカ・ペソ 小計			63,697,374.000 (155,988,500)	
トルコ・リラ	11% Turkey Government Bond 20270224	2,970,000.000	1,988,444.700	
	10.5% Turkey Government Bond 20270811	20,000,000.000	12,310,400.000	
	12.4% Turkey Government Bond 20280308	15,000,000.000	8,903,250.000	

	11.7% Turkey Government Bond 20301113	13,900,000.000	6,753,176.000	
	16.9% TURKEY GOVERNMENT BOND 20260902	8,500,000.000	6,678,195.000	
	17.8% TURKEY GOVERNMENT BOND 20330713	11,500,000.000	7,147,940.000	
	17.3% TURKEY GOVERNMENT BOND 20280719	23,000,000.000	15,402,180.000	
	26.2% TURKEY GOVERNMENT BOND 20331005	52,000,000.000	44,895,760.000	
	31.08% TURKEY GOVERNMENT BOND 20281108	39,500,000.000	35,847,435.000	
	30% TURKEY GOVERNMENT BOND 20290912	33,000,000.000	28,927,800.000	
	トルコ・リラ 小計		168,854,580.700 (620,185,989)	
ハンガリー・ フォリント	3% Hungary Government Bond 20271027	270,000,000.000	250,843,500.000	
	2.75% Hungary Government Bond 20261222	170,000,000.000	161,581,600.000	
	6.75% Hungary Government Bond 20281022	373,000,000.000	375,737,820.000	
	3% Hungary Government Bond 20300821	300,000,000.000	255,183,000.000	
	3.25% Hungary Government Bond 20311022	332,000,000.000	274,085,920.000	
	3% Hungary Government Bond 20381027	100,000,000.000	63,963,000.000	
	1.5% Hungary Government Bond 20260422	224,000,000.000	215,891,200.000	
	2% Hungary Government Bond 20290523	265,000,000.000	224,934,650.000	
	2.25% Hungary Government Bond 20330420	315,000,000.000	228,431,700.000	
	1.5% Hungary Government Bond 20260826	100,000,000.000	94,751,000.000	
	3% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20410425	130,000,000.000	77,769,900.000	
	2.25% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20340622	75,000,000.000	51,462,000.000	

	4.5% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20280323	100,000,000.000	95,197,000.000	
	4.75% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20321124	235,000,000.000	207,373,400.000	
	9.5% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20261021	190,000,000.000	197,206,700.000	
	7% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20351024	100,000,000.000	98,724,000.000	
ハンガリー・フォリント 小計			2,873,136,390.000 (1,177,985,919)	
ブラジル・リアル	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20270101	19,000,000.000	17,986,160.000	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20290101	18,000,000.000	16,300,440.000	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20310101	15,500,000.000	13,345,500.000	
	10% BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F 20330101	9,000,000.000	7,485,750.000	
	10% BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F 20350101	10,000,000.000	8,052,400.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20260101	26,000,000.000	24,082,760.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20260701	30,000,000.000	26,026,200.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20270701	13,500,000.000	10,369,755.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20300101	10,000,000.000	5,600,500.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20280101	9,200,000.000	6,652,336.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20280701	4,000,000.000	2,720,920.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20290101	20,000,000.000	12,737,800.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20320101	5,000,000.000	2,149,800.000	
ブラジル・リアル 小計			153,510,321.000 (3,998,713,596)	
ペルー・ソル	6.35% Peru Government Bond 20280812	1,270,000.000	1,360,792.300	

	6.15% Peru Government Bond 20320812	3,350,000.000	3,453,079.500	
	5.94% Peru Government Bond 20290212	2,300,000.000	2,433,262.000	
	5.4% Peru Government Bond 20340812	2,850,000.000	2,660,218.500	
	5.35% Peru Government Bond 20400812	2,100,000.000	1,769,754.000	
	7.3% PERU GOVERNMENT BOND 20330812	2,500,000.000	2,708,525.000	
	7.6% PERU GOVERNMENT BOND 20390812	1,800,000.000	1,885,842.000	
	8.2% Peru Government Bond 20260812	175,000.000	183,144.500	
	6.9% Peru Government Bond 20370812	4,465,000.000	4,480,806.100	
	6.95% Peru Government Bond 20310812	3,370,000.000	3,676,838.500	
	ペルー・ソル 小計		24,612,262.400 (981,500,107)	
ポーランド・ズ ロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,900,000.000	4,805,234.000	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	7,100,000.000	6,802,510.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	10,850,000.000	9,954,115.500	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	9,400,000.000	7,765,622.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	6,300,000.000	5,960,556.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	9,400,000.000	7,514,454.000	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	6,150,000.000	6,058,611.000	
	7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	9,400,000.000	10,138,370.000	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	9,200,000.000	9,527,520.000	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725	8,000,000.000	7,948,880.000	

	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20341025	8,600,000.000	8,274,662.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300125	8,000,000.000	8,005,120.000	
	4.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300725	1,500,000.000	1,461,555.000	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	6,950,000.000	6,600,345.500	
ポーランド・ズロチ 小計			100,817,555.000 (3,932,892,821)	
マレーシア・リ ンギット	4.07% Malaysia Government Investment Issue 20260930	4,650,000.000	4,708,357.500	
	4.258% Malaysia Government Investment Issue 20270726	1,800,000.000	1,841,562.000	
	4.369% Malaysia Government Investment Issue 20281031	4,400,000.000	4,563,768.000	
	4.13% Malaysia Government Investment Issue 20290709	5,000,000.000	5,162,100.000	
	3.726% Malaysia Government Investment Issue 20260331	4,200,000.000	4,223,184.000	
	3.465% Malaysia Government Investment Issue 20301015	5,100,000.000	5,127,744.000	
	3.422% Malaysia Government Investment Issue 20270930	4,250,000.000	4,278,305.000	
	3.447% Malaysia Government Investment Issue 20360715	3,700,000.000	3,634,066.000	
	4.417% MALAYSIA T-BILL 20410930	3,300,000.000	3,556,377.000	
	3.804% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20311008	3,300,000.000	3,374,085.000	
	3.635% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20300830	1,000,000.000	1,014,670.000	
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	4,850,000.000	4,887,490.500	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	3,850,000.000	3,910,599.000	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	3,100,000.000	3,279,273.000	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	3,700,000.000	3,745,584.000		

3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	3,820,000.000	3,889,103.800	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	4,300,000.000	4,738,858.000	
4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	4,200,000.000	4,526,172.000	
4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	4,450,000.000	4,965,844.000	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	3,100,000.000	3,128,892.000	
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	5,000,000.000	5,113,900.000	
4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	2,750,000.000	3,133,515.000	
3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	5,000,000.000	5,105,700.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	4,400,000.000	4,413,068.000	
4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	5,000,000.000	5,061,500.000	
2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	5,400,000.000	5,180,652.000	
3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	3,200,000.000	3,223,744.000	
4.193% MALAYSIAN GOVERNMENT 20321007	4,000,000.000	4,175,840.000	
4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	4,100,000.000	4,569,245.000	
4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	1,500,000.000	1,564,950.000	
3.599% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280731	3,900,000.000	3,948,906.000	
4.291% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430814	4,500,000.000	4,787,775.000	
4.662% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380331	1,400,000.000	1,536,528.000	
4.245% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300930	3,600,000.000	3,756,384.000	
4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	4,100,000.000	4,403,359.000	

	3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	2,500,000.000	2,523,300.000	
	4.467% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390915	4,900,000.000	5,301,947.000	
	4.054% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390418	3,000,000.000	3,109,950.000	
	4.18% MALAYSIAN GOVERNMENT 20440516	2,500,000.000	2,631,600.000	
	4.119% MALAYSIAN GOVERNMENT 20341130	5,000,000.000	5,217,100.000	
	3.336% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300515	1,000,000.000	1,004,650.000	
マレーシア・リングgit 小計			158,319,647.800 (5,379,875,784)	
メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	43,000,000.000	42,241,050.000	
	8% Mexican Bonos 20471107	40,000,000.000	33,000,400.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	55,000,000.000	52,752,150.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	60,000,000.000	49,345,200.000	
	7.5% MEXICAN BONOS 20330526	55,400,000.000	50,176,888.000	
	7% MEXICAN BONOS 20260903	40,000,000.000	39,480,400.000	
	8% MEXICAN BONOS 20350524	6,000,000.000	5,486,580.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20290301	60,000,000.000	59,668,800.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20280302	25,000,000.000	25,049,250.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20300228	20,000,000.000	19,788,000.000	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	60,500,000.000	59,835,105.000	
	10% Mexican Bonos 20361120	16,890,000.000	17,687,714.700	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	59,500,000.000	59,132,885.000	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	33,500,000.000	30,638,095.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	67,850,000.000	64,217,311.000	
7.75% Mexican Bonos 20421113	65,000,000.000	53,470,300.000		
7.75% Mexican Bonos 20341123	71,000,000.000	64,211,690.000		
メキシコ・ペソ 小計			726,181,818.700 (5,535,248,295)	
ルーマニア・レイ	5.8% Romania Government Bond 20270726	2,800,000.000	2,720,676.000	

5% Romania Government Bond 20290212	2,600,000.000	2,401,464.000	
4.85% Romania Government Bond 20260422	2,500,000.000	2,458,725.000	
3.65% Romania Government Bond 20310924	2,500,000.000	2,040,350.000	
4.15% Romania Government Bond 20280126	2,600,000.000	2,410,642.000	
3.25% Romania Government Bond 20260624	2,000,000.000	1,930,100.000	
4.15% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20301024	2,500,000.000	2,146,525.000	
4.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20341011	2,700,000.000	2,213,271.000	
2.5% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20271025	2,300,000.000	2,070,460.000	
4.85% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20290725	2,300,000.000	2,094,403.000	
6.7% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20320225	3,000,000.000	2,878,320.000	
4.25% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20360428	2,300,000.000	1,762,789.000	
8.25% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20320929	2,500,000.000	2,608,325.000	
8.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20281030	2,700,000.000	2,804,058.000	
8% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20300429	2,700,000.000	2,758,158.000	
7.9% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20380224	2,600,000.000	2,722,720.000	
7.2% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20261028	2,400,000.000	2,404,584.000	
7.2% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20331030	2,700,000.000	2,656,638.000	
7.35% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20310428	2,500,000.000	2,486,775.000	
7.2% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20270531	3,000,000.000	2,996,340.000	
7.1% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20340731	1,600,000.000	1,561,712.000	

	6.3% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20290425	1,650,000.000	1,585,089.000	
	6.3% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20280426	100,000.000	97,287.000	
	6.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20350425	500,000.000	475,030.000	
	6.85% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20300729	300,000.000	291,099.000	
ルーマニア・レイ 小計			52,575,540.000 (1,746,033,683)	
南アフリカ・ランド	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	52,000,000.000	53,950,520.000	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	17,720,000.000	13,029,693.200	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	16,280,000.000	10,903,367.200	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	38,000,000.000	34,632,820.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	72,000,000.000	57,034,080.000	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	55,000,000.000	47,251,050.000	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	58,500,000.000	57,182,580.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	47,700,000.000	38,346,984.000	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	55,000,000.000	52,028,900.000	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	58,000,000.000	53,593,740.000	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	49,400,000.000	42,169,816.000	
	11.625% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20530331	12,000,000.000	12,408,120.000	
	10.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20380331	5,100,000.000	5,151,153.000	
	10% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20330331	5,000,000.000	5,120,850.000	
南アフリカ・ランド 小計			482,803,673.400 (3,881,741,534)	

国債証券 合計		53,899,860,071 [53,899,860,071]	
合計		53,899,860,071 [53,899,860,071]	

- (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 34銘柄	100%	9.8%
インドネシア・ルピア	国債証券 35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 83銘柄	100%	10.0%
コロンビア・ペソ	国債証券 12銘柄	100%	3.4%
セルビア・ディナール	国債証券 5銘柄	100%	0.4%
タイ・バーツ	国債証券 28銘柄	100%	8.7%
チェコ・コルナ	国債証券 22銘柄	100%	5.1%
チリ・ペソ	国債証券 10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 10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%	7.4%
ペルー・ソル	国債証券 10銘柄	100%	1.8%
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	100%	7.3%
マレーシア・リンギット	国債証券 41銘柄	100%	10.0%
メキシコ・ペソ	国債証券 17銘柄	100%	10.1%
ルーマニア・レイ	国債証券 25銘柄	100%	3.2%
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。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「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）」に記載のとおりであります。

### 【ダイワファンドラップ J - REITインデックス】

(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6月18日から2025年6月16日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## ダイワファンドラップ J - R E I T インデックス

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	28,724,049	72,537,637
親投資信託受益証券	11,708,209,024	16,944,848,276
未収入金	-	3,000,000
流動資産合計	11,736,933,073	17,020,385,913
資産合計	11,736,933,073	17,020,385,913
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	4,326,925	41,026,850
未払受託者報酬	1,174,838	1,652,388
未払委託者報酬	17,035,805	23,960,247
その他未払費用	293,640	413,021
流動負債合計	22,831,208	67,052,506
負債合計	22,831,208	67,052,506
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 9,360,680,454	1 12,453,630,988
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,353,421,411	4,499,702,419
（分配準備積立金）	711,028,109	1,254,169,348
元本等合計	11,714,101,865	16,953,333,407
純資産合計	11,714,101,865	16,953,333,407
負債純資産合計	11,736,933,073	17,020,385,913

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期		第9期	
	自 2023年6月16日	至 2024年6月17日	自 2024年6月18日	至 2025年6月16日
<b>営業収益</b>				
受取利息		6,445		109,744
有価証券売買等損益		451,809,539		1,379,839,252
<b>営業収益合計</b>		<b>451,803,094</b>		<b>1,379,948,996</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		4,097		-
受託者報酬		2,172,249		3,064,722
委託者報酬		31,498,919		44,439,798
その他費用		542,918		766,038
<b>営業費用合計</b>		<b>34,218,183</b>		<b>48,270,558</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>		<b>486,021,277</b>		<b>1,331,678,438</b>
経常利益又は経常損失（ ）		486,021,277		1,331,678,438
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>		<b>486,021,277</b>		<b>1,331,678,438</b>
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（ ）		20,462,159		43,480,162
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>		<b>1,974,867,931</b>		<b>2,353,421,411</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,270,028,249		1,345,108,924
<b>当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>1,270,028,249</b>		<b>1,345,108,924</b>
剰余金減少額又は欠損金増加額		425,915,651		487,026,192
<b>当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>425,915,651</b>		<b>487,026,192</b>
分配金		1 -		1 -
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>		<b>2,353,421,411</b>		<b>4,499,702,419</b>

## (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6月18日 至2025年6月16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6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2024年6月17日としており、2025年6月15日が休日のため、当計算期間末日を2025年6月16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6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
	1. 1 期首元本額	6,389,175,673円
期中追加設定元本額	4,354,491,040円	5,016,373,943円
期中一部解約元本額	1,382,986,259円	1,923,423,409円
2. 計算期間末日における受益権の総数	9,360,680,454口	12,453,630,988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6月16日 至2024年6月17日	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,972,046,627円)及び分配準備積立金(711,028,109円)より分配対象額は3,683,074,736円(1万口当たり3,934.62円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(104,917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(658,061,321円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,304,024,949円)及び分配準備積立金(596,003,110円)より分配対象額は5,558,194,297円(1万口当たり4,463.11円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第9期
	2025年6月16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	第9期
	2024年6月17日現在	2025年6月16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	442,792,390	1,351,604,139
合計	442,792,390	1,351,604,139

## (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	第9期
2024年6月17日現在	2025年6月16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6月18日
至2025年6月16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	第9期
	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	1.2514円	1.3613円
(1万口当たり純資産額)	(12,514円)	(13,613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J - REITマザーファンド	4,936,303,282	16,944,848,276	
親投資信託受益証券 合計			16,944,848,276	
合計			16,944,848,276	

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

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

「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6月17日現在 金額 (円)	2025年6月16日現在 金額 (円)
資産の部		
流動資産		

コール・ローン		6,840,179,349	8,034,824,481
投資証券	2	314,436,883,200	244,793,677,200
派生商品評価勘定		-	159,656,000
未収入金		3,450,506,931	1,266,673,039
未収配当金		2,533,455,970	2,006,391,081
差入委託証拠金		508,426,997	397,099,042
流動資産合計		327,769,452,447	256,658,320,843
資産合計		327,769,452,447	256,658,320,843
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		28,616,000	-
前受金		8,400,000	160,272,000
未払解約金		1,747,066,000	626,750,000
流動負債合計		1,784,082,000	787,022,000
負債合計		1,784,082,000	787,022,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	103,664,583,904	74,539,061,065
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		222,320,786,543	181,332,237,778
元本等合計		325,985,370,447	255,871,298,843
純資産合計		325,985,370,447	255,871,298,843
負債純資産合計		327,769,452,447	256,658,320,843

## 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6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1. 1 期首	2023年6月16日	2024年6月18日
期首元本額	143,357,852,675円	103,664,583,904円
期中追加設定元本額	8,638,388,918円	5,213,729,543円
期中一部解約元本額	48,331,657,689円	34,339,252,382円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ-REITオープン	3,732,059,711円	3,125,772,749円
ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	84,518,908,283円	53,826,059,442円
ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	561,312,597円	697,894,699円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	24,574,738円	27,910,142円
iFree J-REITイン デックス	676,165,505円	511,672,995円
iFree 8資産バランス	2,865,827,270円	3,376,710,749円
ダイワJ-REITオープン (奇数月決算型)	97,468,809円	91,405,955円

	D Cダイワ・ターゲットイヤー 2060	320,562円	471,097円
	D C・ダイワJ - R E I Tオー プン	5,277,909,415円	5,242,448,787円
	D Cダイワ・ターゲットイヤー 2030	9,135,460円	8,385,587円
	D Cダイワ・ターゲットイヤー 2040	10,258,995円	9,249,706円
	ダイワ国内R E I Tインデック ス(投資一任専用)	5,532,494円	6,138,165円
	ダイワ・ノーロード J - R E I Tファンド	89,714,633円	71,107,333円
	ダイワファンドラップ J - R E I Tインデックス	3,723,274,510円	4,936,303,282円
	ダイワJ - R E I Tインデック ス(ダイワSMA専用)	728,631,453円	1,308,011,544円
	ダイワファンドラップオンライ ン J - R E I Tインデックス	594,563,162円	674,397,154円
	スタイル9(6資産分散・保守 型)	39,631円	50,544円
	スタイル9(6資産分散・バラ ンス型)	1,163,872円	3,087,757円
	スタイル9(6資産分散・積極 型)	687,709円	1,523,314円
	スタイル9(8資産分散・保守 型)	46,263円	58,166円
	スタイル9(8資産分散・バラ ンス型)	871,592円	2,258,085円
	スタイル9(8資産分散・積極 型)	452,507円	3,266,088円
	ダイワ・インデックスセレクト J - R E I T	745,664,733円	614,877,725円
計		103,664,583,904円	74,539,061,065円
2.	期末日における受益権の総数	103,664,583,904口	74,539,061,065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 1,483,150,000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 727,500,000円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年6月16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6月17日現在	2025年6月16日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資証券	1,535,913,516	13,909,959,533
合計	1,535,913,516	13,909,959,533

(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6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超				1年超		
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買建	9,520,000,000	-	9,492,000,000	28,000,000	9,676,128,000	-	9,836,400,000	160,272,000
合計	9,520,000,000	-	9,492,000,000	28,000,000	9,676,128,000	-	9,836,400,000	160,272,000

## (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6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	3.1446円	3.4327円

(1万口当たり純資産額)	(31,446円)	(34,327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	5,257	621,377,400	
	サンケイリアルエステート	7,610	687,183,000	
	SOSILA物流リート投	11,852	1,334,535,200	
	東海道リート投資法	4,619	509,013,800	
	日本アコモデーションファンド投資 法人	41,010	4,884,291,000	
	森ヒルズリート	27,933	3,751,401,900	
	産業ファンド	43,492	5,271,230,400	
	アドバンス・レジデンス	46,690	7,045,521,000	
	A P I 投資法人	34,638	4,173,879,000	
	G L P 投資法人	78,160	10,106,088,000	
	コンフォリア・レジデンシャル	12,027	3,444,532,800	
	日本プロロジスリート	124,141	9,906,451,800	
	星野リゾート・リート	10,046	2,435,150,400	
	O n e リート投資法人	4,143	1,041,135,900	
	イオンリート投資	28,845	3,669,084,000	
	ヒューリックリート投資法	20,990	3,253,450,000	
	日本リート投資法人	30,325	2,704,990,000	
	積水ハウス・リート投資	70,954	5,484,744,200	
	トーセイ・リート投資法人	5,165	687,461,500	
	ヘルスケア&メディカル投資	5,857	674,726,400	
	サムティ・レジデンシャル	6,472	610,956,800	
	野村不動産マスターF	75,694	11,013,477,000	
	いちごホテルリート投資	3,931	493,733,600	
	ラサールロジポート投資	29,497	4,049,938,100	
スターアジア不動産投	43,774	2,512,627,600		
マリモ地方創生リート	4,313	477,880,400		
三井不ロジパーク	51,779	5,333,237,000		

日本ホテル&レジデンシャル投資法人	5,009	341,112,900	
投資法人みらい	32,710	1,455,595,000	
三菱地所物流REIT	24,607	2,876,558,300	
CREロジスティクスファンド	10,168	1,558,754,400	
ザイマックス・リート	4,067	459,164,300	
タカラレーベン不動産投	15,513	1,396,170,000	
日本ビルファンド	138,555	18,469,381,500	
ジャパンリアルエステイト	122,000	14,688,800,000	
日本都市ファンド投資法人	123,173	12,428,155,700	
オリックス不動産投資	47,330	8,992,700,000	
日本プライムリアルティ	16,245	6,026,895,000	
NTT都市開発リート投資法人	23,919	3,152,524,200	
東急リアル・エステート	15,926	3,086,458,800	
グローバル・ワン不動産投資法人	17,125	2,303,312,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人	52,519	8,234,979,200	
森トラストリート投資法人	45,786	3,131,762,400	
インヴィンシブル投資法人	130,876	8,402,239,200	
フロンティア不動産投資	44,067	3,679,594,500	
平和不動産リート	18,205	2,434,008,500	
日本ロジスティクスファンド投資法人	47,367	4,433,551,200	
福岡リート投資法人	13,403	2,295,933,900	
KDX不動産投資法人	65,803	10,291,589,200	
いちごオフィスリート投資法人	17,332	1,572,012,400	
大和証券オフィス投資法人	9,738	3,086,946,000	
阪急阪神リート投資法人	11,326	1,766,856,000	
スタートプロシード投資法人	3,971	702,867,000	
大和ハウスリート投資法人	35,424	8,530,099,200	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	87,266	6,693,302,200	
大和証券リビング投資法人	35,083	3,389,017,800	
ジャパンエクセレント投資法人	20,397	2,735,237,700	
投資証券 合計		244,793,677,200	
合計		244,793,677,200	

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。

【ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）】

(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6月18日から2025年6月16日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	55,733,279	63,340,232
親投資信託受益証券	20,783,620,019	21,146,679,875
未収入金	-	9,140,000
流動資産合計	20,839,353,298	21,219,160,107
資産合計	20,839,353,298	21,219,160,107
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	12,049,981	28,801,980
未払受託者報酬	2,259,984	2,309,537
未払委託者報酬	42,375,491	43,304,771
その他未払費用	564,917	577,301
流動負債合計	57,250,373	74,993,589
負債合計	57,250,373	74,993,589
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 20,883,336,459	<sup>1</sup> 20,503,902,892
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	<sup>2</sup> 101,233,534	<sup>2</sup> 640,263,626
（分配準備積立金）	1,773,357,939	1,373,958,052
元本等合計	20,782,102,925	21,144,166,518
純資産合計	20,782,102,925	21,144,166,518
負債純資産合計	20,839,353,298	21,219,160,107

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期		第9期	
	自 2023年6月16日	至 2024年6月17日	自 2024年6月18日	至 2025年6月16日
<b>営業収益</b>				
受取利息	8,853		126,403	
有価証券売買等損益	2,329,711		905,927,856	
営業収益合計	2,338,564		906,054,259	
<b>営業費用</b>				
支払利息	5,969		-	
受託者報酬	4,286,925		4,794,556	
委託者報酬	80,381,409		89,899,648	
その他費用	1,077,524		1,204,415	
営業費用合計	85,751,827		95,898,619	
営業利益又は営業損失（ ）	83,413,263		810,155,640	
経常利益又は経常損失（ ）	83,413,263		810,155,640	
当期純利益又は当期純損失（ ）	83,413,263		810,155,640	
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（ ）	45,196,985		295,748,016	
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	37,492,093		101,233,534	
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,620,999		237,821,077	
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,620,999		-	
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-		237,821,077	
剰余金減少額又は欠損金増加額	107,130,348		10,731,541	
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-		10,731,541	
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	107,130,348		-	
分配金	1 -		1 -	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	101,233,534		640,263,626	

## (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6月18日 至2025年6月16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6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2024年6月17日としており、2025年6月15日が休日のため、当計算期間末日を2025年6月16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6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
	1. 1 期首元本額	18,214,604,055円
期中追加設定元本額	6,627,669,356円	4,922,529,420円
期中一部解約元本額	3,958,936,952円	5,301,962,987円
2. 計算期間末日における受益権の総数	20,883,336,459口	20,503,902,892口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は101,233,534円であります。	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,769,436,900円)及び分配準備積立金(1,773,357,939円)より分配対象額は6,542,794,839円(1万口当たり3,133.02円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(100,950円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(5,050,074,049円)及び分配準備積立金(1,373,857,102円)より分配対象額は6,424,032,101円(1万口当たり3,133.08円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>外貨建資産について為替変動リスクを回避することを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第9期
	2025年6月16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	第9期
	2024年6月17日現在	2025年6月16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	29,297,483	680,733,146
合計	29,297,483	680,733,146

## (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	第9期
2024年6月17日現在	2025年6月16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6月18日
至2025年6月16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	第9期
	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	0.9952円	1.0312円

(1万口当たり純資産額)	( 9,952円)	(10,312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	先進国リート・インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド	24,167,634,143	21,146,679,875	
親投資信託受益証券 合計			21,146,679,875	
合計			21,146,679,875	

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

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

「先進国リート・インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2024年6月17日現在 金額(円)	2025年6月16日現在 金額(円)
--	-----------------------	-----------------------

資産の部		
流動資産		
預金	203,072,547	261,179,826
コール・ローン	162,870,581	534,573,297
投資信託受益証券	382,552,153	482,734,580
投資証券	24,226,719,052	26,874,799,640
派生商品評価勘定	28,810,416	24,931,957
未収入金	26,004,087	103,221,956
未収配当金	68,941,817	68,255,651
差入委託証拠金	367,357,284	359,017,827
流動資産合計	25,466,327,937	28,708,714,734
資産合計	25,466,327,937	28,708,714,734
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	111,207,805	232,331,837
未払金	-	415,701
未払解約金	-	21,690,000
流動負債合計	111,207,805	254,437,538
負債合計	111,207,805	254,437,538
純資産の部		
元本等		
元本	1 30,158,213,460	32,519,331,878
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 4,803,093,328	4,065,054,682
元本等合計	25,355,120,132	28,454,277,196
純資産合計	25,355,120,132	28,454,277,196
負債純資産合計	25,466,327,937	28,708,714,734

## 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6月18日 至2025年6月16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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

## (2)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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

## 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法

### (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

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1. 1 期首	2023年6月16日	2024年6月18日
期首元本額	27,483,964,976円	30,158,213,460円
期中追加設定元本額	10,991,030,606円	9,878,138,629円
期中一部解約元本額	8,316,782,122円	7,517,020,211円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国RE	24,721,803,282円	24,167,634,143円
ITインデックス（為替ヘッジ		
あり）		
ダイワファンドラップオンライ	1,115,161,590円	1,192,223,759円
ン 外国REITインデックス		
（為替ヘッジあり）		
ダイワ海外REITインデック	1,517,667円	1,242,365円
ス（為替ヘッジあり）（投資一		
任専用）		
ダイワ・マクロ・ナビゲー	508,448,807円	419,369,715円
ター・ファンド2021-10（為替		
ヘッジあり / 適格機関投資家専		
用）		
ダイワ外国REITインデック	3,811,282,114円	6,738,861,896円
ス（為替ヘッジあり）（ダイワ		
SMA専用）		

計	30,158,213,460円	32,519,331,878円
2. 期末日における受益権の総数	30,158,213,460口	32,519,331,878口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は4,803,093,328円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は4,065,054,682円であります。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>投資信託約款の運用の基本方針に規定する投資成果を得ることを目的として、当該規定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、外貨建資産について為替変動リスクを回避すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年6月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	4,834,167	2,831,527
投資証券	691,987,897	436,101,961
合計	696,822,064	433,270,434

(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6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)		(円)		(円)	
市場取引								
不動産投信								
指数先物取引								
買建	864,506,730	-	847,236,722	17,270,008	1,144,021,171	-	1,168,042,924	24,021,753
合計	864,506,730	-	847,236,722	17,270,008	1,144,021,171	-	1,168,042,924	24,021,753

## (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6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)	(円)	(円)		(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	24,598,604,673	-	24,663,732,054	65,127,381	27,699,925,460	-	27,931,347,093	231,421,633
アメリカ・ドル	18,738,965,171	-	18,821,412,448	82,447,277	21,491,872,374	-	21,643,059,820	151,187,446
イギリス・ポンド	1,353,097,721	-	1,352,156,720	941,001	1,349,694,734	-	1,364,937,158	15,242,424
イスラエル・シェケル	31,962,707	-	31,904,330	58,377	42,139,672	-	41,229,468	910,204
オーストラリア・ドル	1,931,862,032	-	1,925,279,283	6,582,749	2,135,150,037	-	2,161,943,053	26,793,016
カナダ・ドル	375,751,000	-	373,855,908	1,895,092	403,744,286	-	409,909,724	6,165,438
シンガポール・ドル	789,317,071	-	790,828,920	1,511,849	843,027,765	-	852,130,699	9,102,934
ニュージーランド・ドル	78,224,046	-	78,316,984	92,938	30,221,136	-	30,554,069	332,933
ユーロ	1,049,195,211	-	1,038,536,662	10,658,549	1,104,605,564	-	1,126,809,135	22,203,571
香港・ドル	250,229,714	-	251,440,799	1,211,085	299,469,892	-	300,773,967	1,304,075
合計	24,598,604,673	-	24,663,732,054	65,127,381	27,699,925,460	-	27,931,347,093	231,421,633

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	0.8407円	0.8750円
(1万口当たり純資産額)	(8,407円)	(8,750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	37,210	3,342,574.300	
	アメリカ・ドル	小計		3,342,574.300 (482,734,580)	
投資信託受益証券 合計				482,734,580 [482,734,580]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	15,519	139,050.240	
		URBAN EDGE PROPERTIES	15,723	288,359.820	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	13,201	158,147.980	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	17,804	3,670,828.720	

SIMON PROPERTY GROUP INC	38,435	6,030,451.500	
BXP INC	18,237	1,314,887.700	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	16,851	140,537.340	
VORNADO REALTY TRUST	20,808	840,643.200	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	4,886	113,501.780	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	8,788	289,828.240	
UNITI GROUP INC	31,651	129,769.100	
NEXPOINT RESIDENTIAL	2,718	92,194.560	
EQUITY RESIDENTIAL	42,827	2,949,923.760	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	27,963	319,057.830	
EPR PROPERTIES	9,491	536,716.050	
CITY OFFICE REIT INC	4,603	24,856.200	
GLOBAL NET LEASE INC	25,679	189,767.810	
EQUINIX INC	12,198	10,888,422.720	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	12,529	343,169.310	
CHATHAM LODGING TRUST	5,858	40,713.100	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7,507	712,639.510	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,864	47,800.160	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	6,929	16,629.600	
HOST HOTELS & RESORTS INC	87,603	1,333,317.660	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	39,756	1,447,118.400	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17,233	47,218.420	
RLJ LODGING TRUST	19,668	138,659.400	
FARMLAND PARTNERS INC	5,044	57,602.480	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	10,333	70,884.380	
KIMCO REALTY CORP	85,155	1,773,778.650	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7,392	46,495.680	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	44,412	663,515.280	
WHITESTONE REIT	5,779	71,659.600	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	34,387	1,588,679.400	
PIEDMONT REALTY TRUST INC CLASS A	15,712	117,682.880	

PARK HOTELS & RESORTS INC	26,137	258,756.300	
INVITATION HOMES INC	71,398	2,394,688.920	
OUTFRONT MEDIA INC	17,445	272,142.000	
LAMAR ADVERTISING CO-A	11,021	1,314,364.460	
JBG SMITH PROPERTIES	10,953	200,549.430	
ALEXANDER & BALDWIN INC	9,417	168,187.620	
GLADSTONE LAND CORP	3,874	39,204.880	
AMERICOLD REALTY TRUST	32,774	551,914.160	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	7,310	24,927.100	
VICI PROPERTIES INC	132,111	4,243,405.320	
BRT APARTMENTS CORP	1,402	21,969.340	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,673	206,973.550	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	23,522	762,112.800	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,826	78,422.500	
BROADSTONE NET LEASE INC	23,629	380,899.480	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	13,279	60,685.030	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	5,979	120,716.010	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	28,883	521,049.320	
PARAMOUNT GROUP INC	22,471	144,937.950	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	16,718	143,106.080	
NETSTREIT CORP	10,578	173,373.420	
CTO REALTY GROWTH INC	3,062	55,116.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	28,517	1,044,292.540	
STAG INDUSTRIAL INC	23,381	850,600.780	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	1,311	19,415.910	
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2,551	38,239.490	
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	15,687	556,104.150	
ORION OFFICE REIT INC	6,028	11,513.480	
DIGITAL CORE REIT UNITS	103,900	52,989.000	
VENTAS INC	54,783	3,498,442.380	
CARETRUST REIT INC	23,518	677,553.580	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	9,809	272,886.380	

BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	38,340	981,120.600	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	6,148	1,474.900	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	29,649	539,908.290	
UMH PROPERTIES INC	9,514	159,549.780	
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	1,769	43,181.290	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C	4,638	17,717.160	
PEAKSTONE REALTY TRUST CLASS E	4,650	59,845.500	
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	1,890	60,196.500	
AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	19,182	679,042.800	
LINEAGE INC	7,442	324,843.300	
MODIV INDUSTRIAL INC CLASS C	1,056	14,910.720	
SILA RLTY TR INC TRUST	7,134	172,000.740	
CURLINE PROPERTIES	11,971	268,748.950	
FRONTVIEW REIT INC	1,719	19,476.270	
MILLROSE PROPERTIES INC CLASS A	15,071	409,931.200	
IRON MOUNTAIN INC	36,812	3,739,731.080	
TERRENO REALTY CORP	12,504	734,610.000	
SUN COMMUNITIES INC	15,007	1,855,015.270	
ACADIA REALTY TRUST	14,996	289,272.840	
ALEXANDER'S INC	274	61,650.000	
PROLOGIS INC	116,155	12,461,108.400	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	19,306	1,392,155.660	
BRANDYWINE REALTY TRUST	22,387	100,517.630	
SAUL CENTERS INC	1,434	49,057.140	
VERIS RESIDENTIAL INC	10,473	156,257.160	
CAMDEN PROPERTY TRUST	13,369	1,552,408.280	
COUSINS PROPERTIES INC	21,011	631,800.770	
SITE CENTERS CORP	6,118	69,806.380	
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,509	1,112,973.910	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,054	2,291,040.840	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	16,592	819,976.640	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	9,664	920,882.560	

GETTY REALTY CORP	6,564	190,159.080	
WELLTOWER INC	76,351	11,635,892.400	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	87,671	1,523,721.980	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	13,488	424,737.120	
SERVICE PROPERTIES TRUST	21,206	49,834.100	
KILROY REALTY CORP	13,325	469,306.500	
LTC PROPERTIES INC	5,868	205,966.800	
LXP INDUSTRIAL TRUST	37,061	316,871.550	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	14,650	2,195,302.500	
MACERICH CO/THE	31,146	490,238.040	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	23,944	1,493,147.840	
NATL HEALTH INVESTORS INC	5,692	403,733.560	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	23,504	997,039.680	
REALTY INCOME CORP	109,683	6,322,128.120	
COPT DEFENSE PROPERTIES TRUST	14,095	403,117.000	
PUBLIC STORAGE	19,750	5,825,262.500	
REGENCY CENTERS CORP	20,456	1,437,034.000	
SAFEHOLD INC	5,623	85,863.210	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	13,872	411,720.960	
SL GREEN REALTY CORP	8,777	572,260.400	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	26,555	92,411.400	
UDR INC	37,732	1,555,690.360	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,652	67,500.720	
WP CAREY INC	27,426	1,737,162.840	
ELME	11,414	186,961.320	
AGREE REALTY CORP	13,413	999,939.150	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	35,320	1,307,546.400	
CUBESMART	28,342	1,218,706.000	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	25,177	213,752.730	
DIGITAL REALTY TRUST INC	39,657	6,918,956.790	
EXTRA SPACE STORAGE INC	26,566	3,974,273.600	
CENTERSPACE	2,149	136,504.480	
KITE REALTY GROUP TRUST	27,529	612,795.540	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,965	48,948.150	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,694	82,449.120	

	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	26,916	201,331.680	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	75,243	331,821.630	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	11,605	20,076.650	
	DOUGLAS EMMETT INC	20,985	313,306.050	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	203,400	12,610.800	
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	82,300	15,637.000	
	PRIME US REIT	75,240	10,985.040	
アメリカ・ドル 小計			143,296,965.170 (20,694,947,709)	
イギリス・ポ ンド	WAREHOUSE REIT PLC	54,523	58,230.560	
	HELICAL PLC	13,564	29,569.520	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	44,442	18,443.430	
	HAMMERSON REIT PLC	58,042	169,482.640	
	ASSURA PLC	389,248	195,013.240	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	89,696	90,054.780	
	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITE	51,354	2,701.220	
	CLS HOLDINGS PLC	20,382	13,309.440	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	73,653	59,953.540	
	REGIONAL REIT LTD	19,105	22,352.850	
	NEWRIVER REIT PLC	59,892	46,955.320	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	254,223	371,165.580	
	CUSTODIAN REIT PLC	59,552	48,177.560	
	PRS REIT PLC/THE	70,486	80,917.920	
	SOCIAL HOUSING REIT PLC	46,825	33,854.470	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	80,532	83,109.020	
	AEW UK REIT PLC	20,041	20,802.550	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	168,349	138,719.570	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	62,827	96,627.920	
	HOME REIT PLC	84,338	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	96,960	597,273.600	
	SEGRO PLC	176,087	1,217,817.690	
UNITE GROUP PLC/THE	54,078	446,413.890		
BRITISH LAND CO PLC	130,049	502,769.430		
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	52,869	185,570.190		
DERWENT LONDON PLC	14,616	288,227.520		

	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	173,957	180,045.490	
	WORKSPACE GROUP PLC	18,688	76,153.600	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	28,439	183,431.550	
	BIG YELLOW GROUP PLC	25,604	253,479.600	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	266,579	532,091.680	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	66,072	35,678.880	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	322,882	477,542.470	
イギリス・ポンド 小計			6,555,936.720 (1,282,537,901)	
イスラエル・ シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	101,181	188,196.660	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	26,700	238,190.700	
	REIT 1 LTD	23,763	465,754.800	
イスラエル・シュケル 小計			892,142.160 (35,592,635)	
オーストラリ ア・ドル	DEXUS/AU	144,388	1,012,159.880	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	53,426	39,535.240	
	ABACUS STORAGE KING STAPLED UNITS	71,161	109,587.940	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	45,710	139,415.500	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	184,360	65,447.800	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	74,476	236,088.920	
	RURAL FUNDS GROUP	50,015	92,277.670	
	WAYPOINT REIT	93,819	247,682.160	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	87,709	376,271.610	
	CENTURIA OFFICE REIT	52,359	65,448.750	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	108,969	185,792.140	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	240,395	313,715.470	
	REGION GROUP	156,106	374,654.400	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	36,785	92,698.200	
	NATIONAL STORAGE REIT	185,499	450,762.570	
	DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	26,925	78,890.250	
SCENTRE GROUP	698,305	2,569,762.400		

	ARENA REIT	55,651	220,377.960	
	BWP TRUST	74,833	276,882.100	
	GPT GROUP	257,155	1,272,917.250	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	69,444	281,942.640	
	MIRVAC GROUP	529,709	1,255,410.330	
	STOCKLAND	320,464	1,797,803.040	
	ABACUS GROUP UNIT	52,859	62,902.210	
	GOODMAN GROUP	272,650	9,264,647.000	
	VICINITY CENTRES	519,449	1,319,400.460	
	CHARTER HALL GROUP	63,497	1,224,222.160	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	50,420	278,822.600	
オーストラリア・ドル 小計			23,705,518.650 (2,222,866,484)	
カナダ・ドル	NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	4,700	34,686.000	
	PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	6,425	98,431.000	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	7,100	53,534.000	
	SLATE GROCERY REIT	3,600	52,272.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	7,700	150,458.000	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,500	35,775.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	15,700	78,343.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,100	288,558.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	19,000	222,490.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	10,100	137,057.000	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	14,000	246,960.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	21,600	315,360.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	2,400	43,992.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	7,200	115,200.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	9,500	243,105.000	

	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	10,600	473,078.000	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	18,000	194,400.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	19,500	342,420.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	1,000	15,940.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,200	222,336.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	7,200	106,488.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	8,400	141,456.000	
	カナダ・ドル 小計		3,612,339.000 (383,847,143)	
シンガポール・ ドル	KEPPEL DC REIT	240,200	547,656.000	
	AIMS APAC REIT	85,000	111,350.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	393,900	322,998.000	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	66,400	42,164.000	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	234,600	116,127.000	
	EC WORLD REIT	32,900	0.000	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	472,600	1,233,486.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	744,600	1,585,998.000	
	SUNTEC REIT	295,400	336,756.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	454,900	509,488.000	
	KEPPEL REIT	322,200	281,925.000	
	CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	341,400	297,018.000	
	ESR-REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	85,450	197,389.500	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	90,100	68,476.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	181,854	396,441.720	
	STARHILL GLOBAL REIT	190,400	96,152.000	
	CAPITALAND CHINA TRUST	163,400	111,929.000	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	56,000	225,120.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	279,100	547,036.000	

	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	311,100	373,320.000	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	144,600	80,976.000	
	QUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	298,700	85,129.500	
シンガポール・ドル 小計			7,566,935.720 (851,658,615)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	146,115	286,385.400	
ニュージーランド・ドル 小計			286,385.400 (24,909,802)	
ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	5,346	135,788.400	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	3,770	132,515.500	
	HAMBORNER REIT AG	8,459	54,983.500	
	WERELDHAVE NV	4,001	69,777.440	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	12,345	1,022,659.800	
	NSI NV	2,144	49,740.800	
	ICADE	3,694	88,064.960	
	CARMILA	6,643	110,805.240	
	ALTAREA	567	60,215.400	
	GECINA SA	6,273	595,935.000	
	KLEPIERRE	26,554	883,186.040	
	COVIVIO	6,441	328,813.050	
	MERCIALYS	10,897	117,469.660	
	AEDIFICA	5,619	367,763.550	
	COFINIMMO	4,502	345,753.600	
	RETAIL ESTATES	1,562	94,657.200	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	21,419	443,801.680	
	CARE PROPERTY INVEST	4,567	56,356.780	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	4,523	140,439.150	
	MONTEA NV	2,570	163,966.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,703	19,472.210	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	40,725	249,644.250	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	47,438	507,112.220	
	STONEWEG EUROPEAN REAL ESTATE	41,700	64,218.000	

	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	65,387	69,571.760	
ユーロ 小計			6,172,711.190 (1,028,126,776)	
韓国・ウォン	SK REITS LTD	18,539	85,557,485.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT LTD	3,204	0.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	13,618	75,171,360.000	
	LOTTE REIT CO LTD	19,578	74,200,620.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	6,661	32,372,460.000	
	JR REIT XXVII	23,768	64,886,640.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	5,929	26,265,470.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	20,694	89,398,080.000	
韓国・ウォン 小計			447,852,115.000 (47,337,969)	
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	291,000	232,800.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	96,000	206,400.000	
	FORTUNE REIT	211,000	964,270.000	
	LINK REIT	346,700	14,578,735.000	
	CHAMPION REIT	254,000	492,760.000	
香港・ドル 小計			16,474,965.000 (302,974,606)	
投資証券 合計			26,874,799,640 [26,874,799,640]	
合計			27,357,534,220 [27,357,534,220]	

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 投資証券	1銘柄 141銘柄	2.3%	97.7%	77.4%
イギリス・ポンド	投資証券	33銘柄	-%	100%	4.7%
イスラエル・シケル	投資証券	3銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券	28銘柄	-%	100%	8.1%
カナダ・ドル	投資証券	22銘柄	-%	100%	1.4%
シンガポール・ドル	投資証券	22銘柄	-%	100%	3.1%
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%	3.8%
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%	1.1%

## 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。

【ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）】

(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6月18日から2025年6月16日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	17,405,102	40,531,604
親投資信託受益証券	7,453,264,693	10,163,607,871
流動資産合計	7,470,669,795	10,204,139,475
資産合計	7,470,669,795	10,204,139,475
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,492,533	19,361,334
未払受託者報酬	727,036	1,015,367
未払委託者報酬	13,632,481	19,039,069
その他未払費用	181,673	253,765
流動負債合計	17,033,723	39,669,535
負債合計	17,033,723	39,669,535
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 4,068,540,757	1 5,486,936,130
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,385,095,315	4,677,533,810
（分配準備積立金）	1,539,571,039	1,313,667,616
元本等合計	7,453,636,072	10,164,469,940
純資産合計	7,453,636,072	10,164,469,940
負債純資産合計	7,470,669,795	10,204,139,475

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期		第9期	
	自 2023年6月16日 至 2024年6月17日		自 2024年6月18日 至 2025年6月16日	
営業収益				
受取利息		3,086		53,378
有価証券売買等損益		1,089,971,625		100,357,178
営業収益合計		1,089,974,711		100,410,556
営業費用				
支払利息		1,662		-
受託者報酬		1,292,227		1,949,968
委託者報酬		24,230,508		36,563,640
その他費用		322,883		487,338
営業費用合計		25,847,280		39,000,946
営業利益又は営業損失（ ）		1,064,127,431		61,409,610
経常利益又は経常損失（ ）		1,064,127,431		61,409,610
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,064,127,431		61,409,610
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（ ）		82,726,329		48,919,434
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,630,777,106		3,385,095,315
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,228,932,092		1,936,371,772
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少 額		1,228,932,092		1,936,371,772
剰余金減少額又は欠損金増加額		456,014,985		656,423,453
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加 額		456,014,985		656,423,453
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,385,095,315		4,677,533,810

## (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6月18日 至2025年6月16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6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2024年6月17日としており、2025年6月15日が休日のため、当計算期間末日を2025年6月16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6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
	1. 1 期首元本額	3,020,170,856円
期中追加設定元本額	1,871,437,793円	2,192,925,167円
期中一部解約元本額	823,067,892円	774,529,794円
2. 計算期間末日における受益権の総数	4,068,540,757口	5,486,936,130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6月16日 至2024年6月17日	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (1,649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 (981,397,436円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (1,845,524,276円)及び分配準備積立金(558,171,954円)より分配対象額は3,385,095,315円(1万口当たり8,320.17円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額 (14,103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 (12,476,073円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (3,363,866,194円)及び分配準備積立金(1,301,177,440円)より分配対象額は4,677,533,810円(1万口当たり8,524.86円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	--	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第9期
	2025年6月16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	第9期
	2024年6月17日現在	2025年6月16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	1,043,761,787	68,347,329
合計	1,043,761,787	68,347,329

## (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	第9期
2024年6月17日現在	2025年6月16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6月18日
至2025年6月16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	第9期
	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	1.8320円	1.8525円
(1万口当たり純資産額)	(18,320円)	(18,525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・グローバルREITインデックス・マザーファンド	2,626,255,264	10,163,607,871	
親投資信託受益証券 合計			10,163,607,871	
合計			10,163,607,871	

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

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

「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6月17日現在 金額(円)	2025年6月16日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		

預金		354,676,827	472,152,544
コール・ローン		317,329,086	359,903,106
投資信託受益証券		1,763,894,916	1,478,950,340
投資証券		38,951,062,271	45,521,940,900
派生商品評価勘定		7,265,592	36,431,290
未収入金		942,018	1,615,430
未収配当金		109,471,581	114,203,036
差入委託証拠金		418,509,770	410,251,991
流動資産合計		41,923,152,061	48,395,448,637
資産合計		41,923,152,061	48,395,448,637
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		44,675,540	7,374,085
未払金		33,085,238	-
未払解約金		831,000	12,725,000
流動負債合計		78,591,778	20,099,085
負債合計		78,591,778	20,099,085
純資産の部			
元本等			
元本	1	10,981,310,353	12,500,149,430
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		30,863,249,930	35,875,200,122
元本等合計		41,844,560,283	48,375,349,552
純資産合計		41,844,560,283	48,375,349,552
負債純資産合計		41,923,152,061	48,395,448,637

## 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6月18日 至2025年6月16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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

## (2)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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

## 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法

### (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

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1. 1 期首	2023年6月16日	2024年6月18日
期首元本額	9,843,782,869円	10,981,310,353円
期中追加設定元本額	2,203,448,196円	2,436,041,310円
期中一部解約元本額	1,065,920,712円	917,202,233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	87,906,063円	-円
(適格機関投資家専用)		
ダイワファンドラップ 外国RE	1,955,980,762円	2,626,255,264円
ITインデックス(為替ヘッジ		
なし)		
ダイワファンドラップオンライ	351,688,573円	270,886,617円
ン 外国REITインデックス		
(為替ヘッジなし)		
D-I's グローバルREIT	1,440,421円	1,354,223円
インデックス		
DCダイワ・ターゲットイヤー	21,117,268円	21,399,314円
2050		
iFree 外国REITイン	651,464,417円	614,241,119円
デックス		
iFree 8資産バランス	2,475,793,628円	2,906,000,690円

グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)	365,994,567円	443,429,567円
グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)	234,273,674円	226,449,161円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	3,565,459円	6,390,038円
DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド	4,119,965,423円	4,589,495,796円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	7,703,940円	7,393,088円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	8,750,218円	8,119,780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)	4,537,854円	5,135,087円
ダイワバランスファンド2021-02(適格機関投資家専用)	138,343,907円	124,495,154円
スタイル9(6資産分散・保守型)	21,229円	20,848円
スタイル9(6資産分散・バランス型)	815,174円	2,093,883円
スタイル9(6資産分散・積極型)	749,411円	2,754,481円
スタイル9(8資産分散・保守型)	22,560円	33,676円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	543,086円	1,421,077円
スタイル9(8資産分散・積極型)	543,573円	3,114,298円
ダイワ・インデックスセレクトグローバルREIT	204,302,936円	171,726,759円
ダイワ・ノーロードグローバルREITファンド	64,844,404円	56,368,123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)	29,208,816円	260,390,699円
ダイワバランスファンド2023-08(適格機関投資家専用)	87,624,943円	-円
ダイワバランスファンド2024-01(適格機関投資家専用)	83,814,309円	76,089,763円
ダイワバランスファンド2024-05(適格機関投資家専用)	80,293,738円	75,090,925円

計	10,981,310,353円	12,500,149,430円
2. 期末日における受益権の総数	10,981,310,353口	12,500,149,430口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年6月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券

重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載してあります。

(2)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6月17日現在	2025年6月16日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	25,600,657	13,657,467
投資証券	2,157,697,371	3,039,547,241
合計	2,183,298,028	3,025,889,774

（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6月17日現在				2025年6月16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	1,171,910,880	-	1,134,681,168	37,229,712	1,329,696,037	-	1,354,101,601	24,405,564
合計	1,171,910,880	-	1,134,681,168	37,229,712	1,329,696,037	-	1,354,101,601	24,405,564

(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6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)	(円)	(円)		(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	311,890,156	-	311,709,920	180,236	345,342,452	-	349,994,093	4,651,641
アメリカ・ドル	206,470,440	-	207,361,440	891,000	177,382,000	-	178,626,092	1,244,092
ユーロ	105,419,716	-	104,348,480	1,071,236	167,960,452	-	171,368,001	3,407,549
合計	311,890,156	-	311,709,920	180,236	345,342,452	-	349,994,093	4,651,641

### （注） 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

（1口当たり情報）

	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3,8105円 (38,105円)	3,8700円 (38,700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	114,000	10,240,620.000	
		アメリカ・ドル 小計		10,240,620.000 (1,478,950,340)	
投資信託受益証券 合計				1,478,950,340 [1,478,950,340]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	25,585	229,241.600	
		URBAN EDGE PROPERTIES	26,860	492,612.400	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	21,380	256,132.400	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	30,397	6,267,253.460	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	65,630	10,297,347.000	
		BXP INC	31,062	2,239,570.200	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	27,100	226,014.000	
		VORNADO REALTY TRUST	35,500	1,434,200.000	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	8,259	191,856.570	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	14,956	493,248.880	
		UNITI GROUP INC	51,242	210,092.200	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	4,588	155,624.960	
		EQUITY RESIDENTIAL	73,157	5,039,054.160	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	47,698	544,234.180	
		EPR PROPERTIES	16,206	916,449.300	
		CITY OFFICE REIT INC	7,500	40,500.000	
		GLOBAL NET LEASE INC	41,594	307,379.660	
		EQUINIX INC	20,806	18,572,267.840	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	21,398	586,091.220	
CHATHAM LODGING TRUST	9,853	68,478.350			

RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	12,743	1,209,692.990	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	5,248	87,589.120	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	10,300	24,720.000	
HOST HOTELS & RESORTS INC	149,586	2,276,698.920	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	67,889	2,471,159.600	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	29,616	81,147.840	
RLJ LODGING TRUST	31,635	223,026.750	
FARMLAND PARTNERS INC	8,636	98,623.120	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	17,053	116,983.580	
KIMCO REALTY CORP	145,485	3,030,452.550	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	13,195	82,996.550	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	75,803	1,132,496.820	
WHITESTONE REIT	9,217	114,290.800	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	58,736	2,713,603.200	
PIEDMONT REALTY TRUST INC CLASS A	26,473	198,282.770	
PARK HOTELS & RESORTS INC	44,184	437,421.600	
INVITATION HOMES INC	121,925	4,089,364.500	
OUTFRONT MEDIA INC	29,453	459,466.800	
LAMAR ADVERTISING CO-A	18,800	2,242,088.000	
JBG SMITH PROPERTIES	17,761	325,203.910	
ALEXANDER & BALDWIN INC	15,494	276,722.840	
GLADSTONE LAND CORP	6,732	68,127.840	
AMERICOLD REALTY TRUST	55,943	942,080.120	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	11,179	38,120.390	
VICI PROPERTIES INC	225,700	7,249,484.000	
BRT APARTMENTS CORP	2,049	32,107.830	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	6,039	340,297.650	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	40,095	1,299,078.000	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	8,417	136,776.250	

BROADSTONE NET LEASE INC	40,319	649,942.280	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	21,916	100,156.120	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	9,928	200,446.320	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	49,331	889,931.240	
PARAMOUNT GROUP INC	39,039	251,801.550	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	28,574	244,593.440	
NETSTREIT CORP	17,391	285,038.490	
CTO REALTY GROWTH INC	5,300	95,400.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	48,724	1,784,272.880	
STAG INDUSTRIAL INC	39,877	1,450,725.260	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	2,366	35,040.460	
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	4,425	66,330.750	
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	26,763	948,748.350	
ORION OFFICE REIT INC	9,048	17,281.680	
DIGITAL CORE REIT UNITS	181,000	92,310.000	
VENTAS INC	93,545	5,973,783.700	
CARETRUST REIT INC	40,100	1,155,281.000	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	16,500	459,030.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	65,491	1,675,914.690	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,759	1,861.380	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	50,576	920,988.960	
UMH PROPERTIES INC	15,639	262,266.030	
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	2,816	68,738.560	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C	7,508	28,680.560	
PEAKSTONE REALTY TRUST CLASS E	7,600	97,812.000	
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	3,029	96,473.650	
AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	32,700	1,157,580.000	
LINEAGE INC	12,700	554,355.000	
MODIV INDUSTRIAL INC CLASS C	1,600	22,592.000	

SILA RLTY TR INC TRUST	11,700	282,087.000	
CURLINE PROPERTIES	20,144	452,232.800	
FRONTVIEW REIT INC	2,900	32,857.000	
MILLROSE PROPERTIES INC CLASS A	25,700	699,040.000	
IRON MOUNTAIN INC	62,813	6,381,172.670	
TERRENO REALTY CORP	21,327	1,252,961.250	
SUN COMMUNITIES INC	25,607	3,165,281.270	
ACADIA REALTY TRUST	25,544	492,743.760	
ALEXANDER'S INC	393	88,425.000	
PROLOGIS INC	198,400	21,284,352.000	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	32,960	2,376,745.600	
BRANDYWINE REALTY TRUST	36,941	165,865.090	
SAUL CENTERS INC	2,561	87,611.810	
VERIS RESIDENTIAL INC	16,996	253,580.320	
CAMDEN PROPERTY TRUST	22,768	2,643,820.160	
COUSINS PROPERTIES INC	35,816	1,076,987.120	
SITE CENTERS CORP	10,022	114,351.020	
EASTGROUP PROPERTIES INC	11,042	1,888,071.580	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	13,667	3,887,714.820	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	28,342	1,400,661.640	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	16,463	1,568,759.270	
GETTY REALTY CORP	10,798	312,818.060	
WELLTOWER INC	130,435	19,878,294.000	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	149,740	2,602,481.200	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	22,974	723,451.260	
SERVICE PROPERTIES TRUST	33,681	79,150.350	
KILROY REALTY CORP	22,667	798,331.740	
LTC PROPERTIES INC	9,690	340,119.000	
LXP INDUSTRIAL TRUST	63,232	540,633.600	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	24,991	3,744,901.350	
MACERICH CO/THE	53,200	837,368.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	40,866	2,548,403.760	
NATL HEALTH INVESTORS INC	9,656	684,900.080	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	40,142	1,702,823.640	
REALTY INCOME CORP	187,316	10,796,894.240	
COPT DEFENSE PROPERTIES TRUST	24,064	688,230.400	

	PUBLIC STORAGE	33,703	9,940,699.850	
	REGENCY CENTERS CORP	34,907	2,452,216.750	
	SAFEHOLD INC	9,705	148,195.350	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	23,635	701,486.800	
	SL GREEN REALTY CORP	14,962	975,522.400	
	DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	46,467	161,705.160	
	UDR INC	64,460	2,657,685.800	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,629	107,420.940	
	WP CAREY INC	46,776	2,962,791.840	
	ELME	18,797	307,894.860	
	AGREE REALTY CORP	22,886	1,706,151.300	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	60,253	2,230,566.060	
	CUBESMART	48,411	2,081,673.000	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	42,952	364,662.480	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	67,704	11,812,316.880	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	45,321	6,780,021.600	
	CENTERSPACE	3,459	219,715.680	
	KITE REALTY GROUP TRUST	47,007	1,046,375.820	
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3,092	77,021.720	
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	9,328	135,069.440	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	44,419	332,254.120	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	128,479	566,592.390	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	16,005	27,688.650	
	DOUGLAS EMMETT INC	35,758	533,866.940	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	341,662	21,183.040	
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	171,300	32,547.000	
	EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	0.000	
	PRIME US REIT	155,920	22,764.320	
	アメリカ・ドル 小計		244,233,341.120 (35,272,179,125)	
イギリス・ポンド	WAREHOUSE REIT PLC	86,763	92,662.880	
	HELICAL PLC	23,433	51,083.940	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	61,021	25,323.710	

	HAMMERSON REIT PLC	97,368	284,314.560	
	ASSURA PLC	642,860	322,072.860	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	144,983	145,562.930	
	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITE	76,976	4,048.930	
	CLS HOLDINGS PLC	29,656	19,365.360	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	112,420	91,509.880	
	REGIONAL REIT LTD	31,830	37,241.100	
	NEWRIVER REIT PLC	101,749	79,771.210	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	426,476	622,654.960	
	CUSTODIAN REIT PLC	90,504	73,217.730	
	PRS REIT PLC/THE	113,932	130,793.930	
	SOCIAL HOUSING REIT PLC	72,416	52,356.760	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	132,736	136,983.550	
	AEW UK REIT PLC	32,682	33,923.910	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	267,895	220,745.480	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	99,533	153,081.750	
	HOME REIT PLC	117,587	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	162,657	1,001,967.120	
	SEGRE PLC	295,397	2,042,965.650	
	UNITE GROUP PLC/THE	90,718	748,877.090	
	BRITISH LAND CO PLC	218,165	843,425.890	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	87,315	306,475.650	
	DERWENT LONDON PLC	24,518	483,494.960	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	287,296	297,351.360	
	WORKSPACE GROUP PLC	29,606	120,644.450	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	47,707	307,710.150	
	BIG YELLOW GROUP PLC	42,952	425,224.800	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	447,204	892,619.180	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	104,674	56,523.960	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	541,655	801,107.740	
	イギリス・ポンド 小計		10,905,103.430 (2,133,365,384)	
イスラエル・ シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	169,724	315,686.640	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	50,267	448,431.900	
	REIT 1 LTD	44,595	874,062.000	

イスラエル・シュケル 小計			1,638,180.540 (65,356,360)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	242,975	1,703,254.750	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	88,653	65,603.220	
	ABACUS STORAGE KING STAPLED UNITS	115,395	177,708.300	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	75,197	229,350.850	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	308,949	109,676.890	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	118,714	376,323.380	
	RURAL FUNDS GROUP	86,746	160,046.370	
	WAYPOINT REIT	149,546	394,801.440	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	147,596	633,186.840	
	CENTURIA OFFICE REIT	86,351	107,938.750	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	184,766	315,026.030	
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	398,406	519,919.830	
	REGION GROUP	262,693	630,463.200	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	60,426	152,273.520	
	NATIONAL STORAGE REIT	312,155	758,536.650	
	DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	48,020	140,698.600	
	SCENTRE GROUP	1,175,099	4,324,364.320	
	ARENA REIT	88,446	350,246.160	
	BWP TRUST	123,877	458,344.900	
	GPT GROUP	432,737	2,142,048.150	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	115,142	467,476.520	
	MIRVAC GROUP	891,388	2,112,589.560	
	STOCKLAND	539,273	3,025,321.530	
ABACUS GROUP UNIT	100,940	120,118.600		
GOODMAN GROUP	458,812	15,590,431.760		
VICINITY CENTRES	874,123	2,220,272.420		
CHARTER HALL GROUP	106,852	2,060,106.560		
INGENIA COMMUNITIES GROUP	83,464	461,555.920		
オーストラリア・ドル 小計			39,807,685.020 (3,732,766,624)	
カナダ・ドル	NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	7,000	51,660.000	

PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	10,841	166,084.120	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,800	73,892.000	
SLATE GROCERY REIT	6,100	88,572.000	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	12,900	252,066.000	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	3,900	55,809.000	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	25,600	127,744.000	
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6,800	478,584.000	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	30,100	352,471.000	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	16,100	218,477.000	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	23,100	407,484.000	
CHOICE PROPERTIES REIT	36,200	528,520.000	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	3,800	69,654.000	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	12,000	192,000.000	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	15,700	401,763.000	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	17,700	789,951.000	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	28,566	308,512.800	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	32,800	575,968.000	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	1,650	26,301.000	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,300	368,244.000	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	11,700	173,043.000	
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	13,900	234,076.000	
カナダ・ドル 小計		5,940,875.920 (631,277,476)	

シンガポール・ドル	KEPPEL DC REIT	404,183	921,537.240	
	AIMS APAC REIT	142,200	186,282.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	662,890	543,569.800	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT	114,700	72,834.500	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	385,840	190,990.800	
	EC WORLD REIT	36,500	0.000	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	795,277	2,075,672.970	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	1,269,522	2,704,081.860	
	SUNTEC REIT	497,000	566,580.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	765,500	857,360.000	
	KEPPEL REIT	542,100	474,337.500	
	CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRUST	574,556	499,863.720	
	ESR-REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	140,550	324,670.500	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	142,400	108,224.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	305,901	666,864.180	
	STARHILL GLOBAL REIT	316,000	159,580.000	
	CAPITALAND CHINA TRUST	260,342	178,334.270	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	92,900	373,458.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	469,669	920,551.240	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	523,584	628,300.800	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	237,600	133,056.000		
QUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	513,500	146,347.500		
シンガポール・ドル 小計			12,732,496.880 (1,433,042,524)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	232,905	456,493.800	
ニュージーランド・ドル 小計			456,493.800 (39,705,830)	
ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	8,110	205,994.000	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	5,680	199,652.000	
	HAMBORNER REIT AG	13,318	86,567.000	

	WERELDHAVE NV	6,574	114,650.560	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	19,564	1,620,681.760	
	NSI NV	3,397	78,810.400	
	ICADE	5,815	138,629.600	
	CARMILA	12,358	206,131.440	
	ALTAREA	937	99,509.400	
	GECINA SA	9,941	944,395.000	
	KLEPIERRE	42,083	1,399,680.580	
	COVIVIO	10,207	521,067.350	
	MERCIALYS	16,419	176,996.820	
	AEDIFICA	8,906	582,897.700	
	COFINIMMO	7,135	547,968.000	
	RETAIL ESTATES	2,353	142,591.800	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	33,945	703,340.400	
	CARE PROPERTY INVEST	6,928	85,491.520	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	6,861	213,034.050	
	MONTEA NV	3,966	253,030.800	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	9,559	27,768.890	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	64,542	395,642.460	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	75,181	803,684.890	
	STONEWEG EUROPEAN REAL ESTATE	64,220	98,898.800	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	98,529	104,834.850	
	ユーロ 小計		9,751,950.070 (1,624,284,804)	
韓国・ウォン	SK REITS LTD	32,181	148,515,315.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT LTD	5,591	0.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	23,689	130,763,280.000	
	LOTTE REIT CO LTD	32,639	123,701,810.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	10,468	50,874,480.000	
	JR REIT XXVII	41,466	113,202,180.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	10,067	44,596,810.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	36,103	155,964,960.000	
	韓国・ウォン 小計		767,618,835.000 (81,137,311)	

香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	501,000	400,800.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	181,000	389,150.000	
	FORTUNE REIT	334,000	1,526,380.000	
	LINK REIT	583,300	24,527,765.000	
	CHAMPION REIT	425,000	824,500.000	
香港・ドル 小計			27,668,595.000 (508,825,462)	
投資証券 合計			45,521,940,900 [45,521,940,900]	
合計			47,000,891,240 [47,000,891,240]	

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	4.0%	96%	78.3%
	投資証券 142銘柄			
イギリス・ポンド	投資証券 33銘柄	-%	100%	4.5%
イスラエル・シケル	投資証券 3銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券 28銘柄	-%	100%	7.9%
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%	3.0%
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%	1.1%

## 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。

## 2【ファンドの現況】

ダイワファンドラップ TOPIXインデックス

## 【純資産額計算書】

2025年6月30日

資産総額	38,757,571,269円
負債総額	46,633,124円
純資産総額( - )	38,710,938,145円
発行済数量	15,275,398,062口
1単位当たり純資産額( / )	2.5342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6月30日

資産総額	459,587,091,119円
負債総額	9,218,983,783円
純資産総額( - )	450,368,107,336円
発行済数量	211,810,895,374口
1単位当たり純資産額( / )	2.1263円

ダイワファンドラップ 日経225インデックス

## 純資産額計算書

2025年6月30日

資産総額	26,965,430,856円
負債総額	65,375,201円
純資産総額( - )	26,900,055,655円
発行済数量	9,625,713,985口
1単位当たり純資産額( / )	2.7946円

(参考) ストックインデックス225・マザーファンド

## 純資産額計算書

2025年6月30日

資産総額	408,625,884,468円
------	------------------

負債総額	8,858,755,735円
純資産総額( - )	399,767,128,733円
発行済数量	70,241,122,485口
1単位当たり純資産額( / )	5.6914円

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)

純資産額計算書

2025年6月30日

資産総額	96,096,502,145円
負債総額	165,958,694円
純資産総額( - )	95,930,543,451円
発行済数量	43,976,385,363口
1単位当たり純資産額( / )	2.1814円

(参考) 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

純資産額計算書

2025年6月30日

資産総額	146,639,669,672円
負債総額	2,176,803,881円
純資産総額( - )	144,462,865,791円
発行済数量	42,020,320,403口
1単位当たり純資産額( / )	3.4379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)

純資産額計算書

2025年6月30日

資産総額	49,754,160,892円
負債総額	53,654,779円
純資産総額( - )	49,700,506,113円
発行済数量	12,810,947,908口
1単位当たり純資産額( / )	3.8795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6月30日

資産総額	713,474,499,796円
負債総額	465,968,478円
純資産総額（ - ）	713,008,531,318円
発行済数量	100,051,862,818口
1単位当たり純資産額（ / ）	7.1264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）

## 純資産額計算書

2025年6月30日

資産総額	7,249,620,403円
負債総額	7,458,259円
純資産総額（ - ）	7,242,162,144円
発行済数量	2,044,825,181口
1単位当たり純資産額（ / ）	3.5417円

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

前記「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）」の記載と同じ。

(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6月30日

資産総額	48,423,845,085円
負債総額	344,955,400円
純資産総額（ - ）	48,078,889,685円
発行済数量	15,889,121,905口
1単位当たり純資産額（ / ）	3.0259円

ダイワファンドラップ 日本債券インデックス

## 純資産額計算書

2025年6月30日

資産総額	40,856,749,625円
------	-----------------

負債総額	38,952,111円
純資産総額( - )	40,817,797,514円
発行済数量	45,763,230,213口
1単位当たり純資産額( / )	0.8919円

## (参考) 日本債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

2025年6月30日

資産総額	133,962,207,433円
負債総額	67,317,707円
純資産総額( - )	133,894,889,726円
発行済数量	104,880,640,767口
1単位当たり純資産額( / )	1.2766円

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

## 純資産額計算書

2025年6月30日

資産総額	98,489,489,857円
負債総額	115,323,001円
純資産総額( - )	98,374,166,856円
発行済数量	121,884,780,272口
1単位当たり純資産額( / )	0.8071円

## (参考) 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド

## 純資産額計算書

2025年6月30日

資産総額	137,811,463,153円
負債総額	2,477,436,326円
純資産総額( - )	135,334,026,827円
発行済数量	161,784,298,519口
1単位当たり純資産額( / )	0.8365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)

## 純資産額計算書

2025年6月30日

資産総額	26,819,252,982円
負債総額	16,243,166円
純資産総額( - )	26,803,009,816円
発行済数量	18,944,981,445口
1単位当たり純資産額( / )	1.4148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6月30日

資産総額	345,223,672,760円
負債総額	230,987,150円
純資産総額( - )	344,992,685,610円
発行済数量	93,346,453,709口
1単位当たり純資産額( / )	3.6958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)

## 純資産額計算書

2025年6月30日

資産総額	4,782,920,783円
負債総額	796,497円
純資産総額( - )	4,782,124,286円
発行済数量	3,292,138,443口
1単位当たり純資産額( / )	1.4526円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

前記「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)」の記載と同じ。

(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6月30日

資産総額	56,663,645,100円
負債総額	326,477,394円
純資産総額( - )	56,337,167,706円
発行済数量	28,590,527,534口
1単位当たり純資産額( / )	1.9705円

ダイワファンドラップ J - R E I T インデックス

## 純資産額計算書

2025年6月30日

資産総額	17,128,625,050円
負債総額	21,720,451円
純資産総額( - )	17,106,904,599円
発行済数量	12,541,085,801口
1単位当たり純資産額( / )	1.3641円

## (参考) ダイワ J - R E I T マザーファンド

## 純資産額計算書

2025年6月30日

資産総額	252,411,674,169円
負債総額	779,441,662円
純資産総額( - )	251,632,232,507円
発行済数量	73,147,029,216口
1単位当たり純資産額( / )	3.4401円

ダイワファンドラップ 外国 R E I T インデックス (為替ヘッジあり)

## 純資産額計算書

2025年6月30日

資産総額	21,098,324,003円
負債総額	27,147,984円
純資産総額( - )	21,071,176,019円
発行済数量	20,613,241,694口
1単位当たり純資産額( / )	1.0222円

## (参考) 先進国リート・インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド

## 純資産額計算書

2025年6月30日

資産総額	28,549,180,132円
負債総額	425,648,018円
純資産総額( - )	28,123,532,114円
発行済数量	32,417,623,231口
1単位当たり純資産額( / )	0.8675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)

## 純資産額計算書

2025年6月30日

資産総額	10,240,912,713円
負債総額	12,718,390円
純資産総額( - )	10,228,194,323円
発行済数量	5,536,426,739口
1単位当たり純資産額( / )	1.8474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6月30日

資産総額	48,433,584,176円
負債総額	44,121,053円
純資産総額( - )	48,389,463,123円
発行済数量	12,535,791,670口
1単位当たり純資産額( / )	3.8601円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等  
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典  
ありません。

(3) 譲渡制限の内容  
譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

2025年6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

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. 商品会議

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

##### ロ. 商品担当役員

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

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

##### ホ. リスクマネジメント会議

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2025年6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	85	407,533
追加型株式投資信託	796	31,415,365
株式投資信託 合計	881	31,822,898
単位型公社債投資信託	70	129,191
追加型公社債投資信託	14	1,377,645
公社債投資信託 合計	84	1,506,836
総合計	965	33,329,734

## 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	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
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	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	11,505	11,879	38,549
当期変動額						
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					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,048	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せん。

### (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。

剰余金の配当の総額	11,858百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,546円
基準日	2024年3月31日
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ぼ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。

剰余金の配当の総額	16,551百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	5,076円
基準日	2025年3月31日
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、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、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係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

#### 市場リスクの管理

##### ( ) 為替変動リスクの管理

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

##### ( ) 価格変動リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

## 2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

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

	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、  
記載を省略してあります。

## (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、  
記載を省略してあります。

## 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	㈱かんぼ生命保険	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あります。

(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(株)	東京都 千代田 区	100,000	金融商品 取引業	-	なし	証券投資 信託受益 証券の募 集販売	証券投資信 託の代行手 数料 (注2)	13,749	未払手 数料	3,491
							本社ビル の管理	不動産の賃 借料(注3)	1,030	長期差 入保証 金	1,010

同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	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(株)	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	(株)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いません。

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	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。

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

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

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

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

#### 5【その他】

##### a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2024年5月15日、株式会社かんぼ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、かんぼ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、株式会社かんぼ生命保険、三井物産株式会社、三井物産かんぼ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ぼ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】

	名 称	資本金の額 (2024年03月末日現在)	事業の内容	備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	(注6)	
	みずほ信託銀行株式会社	247,369百万円	(注6)	
再信託受託会社	株式会社日本カスト ディ銀行	51,000百万円	(注6)	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	(注1)	

(注1) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

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

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

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

(注7) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注8) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注9) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

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

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

(注12) 農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでいます。

(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。

## 2【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

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

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

## 3【資本関係】

該当事項はありません。

## 第3【参考情報】

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

(提出年月日)	(書類名)
2024年9月10日	有価証券報告書、有価証券届出書
2025年3月7日	半期報告書、有価証券届出書

**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8月1日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 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）の2024年6月18日から2025年6月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 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）の2025年6月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2025年8月1日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2024年6月18日から2025年6月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2025年6月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2025年8月1日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の2024年6月18日から2025年6月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の2025年6月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2025年8月1日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 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）の2024年6月18日から2025年6月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 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）の2025年6月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2025年8月1日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2024年6月18日から2025年6月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2025年6月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2025年8月1日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）の2024年6月18日から2025年6月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）の2025年6月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2025年8月1日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）の2024年6月18日から2025年6月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）の2025年6月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2025年8月1日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）の2024年6月18日から2025年6月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）の2025年6月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2025年8月1日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ J - R E I T インデックスの2024年6月18日から2025年6月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ J - R E I T インデックスの2025年6月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2025年8月1日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ TOPIXインデックスの2024年6月18日から2025年6月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ TOPIXインデックスの2025年6月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2025年8月1日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 日経225インデックスの2024年6月18日から2025年6月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 日経225インデックスの2025年6月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2025年8月1日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 日本債券インデックスの2024年6月18日から2025年6月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 日本債券インデックスの2025年6月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。