【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長　殿
【提出日】	2024年2月13日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　小松　幹太
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	佐竹　優子 連絡場所　東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	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） 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）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で20兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

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）
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）

（注1）以下「当ファンド」という場合、上記を総称して、またはそれぞれを指していうものとします。
（注2）上記を、それぞれ「為替ヘッジあり」、「為替ヘッジなし」という場合があります。
（注3）上記の総称を「ダイワ先進国株式インデックス（投資一任専用）」とします。

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で20兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社
電話番号（コールセンター）　0120-106212（営業日の9:00～17:00）
ホームページ　https://www.daiwa-am.co.jp/

(5)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

(6)【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

(7)【申込期間】

2024年2月14日から2024年8月13日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8)【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ　https://www.daiwa-am.co.jp/

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社　証券保管振替機構

(12)【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、先進国の株式に投資し、投資成果をＭＳＣＩコクサイ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。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類表
〈ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用）〉
〈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）〉

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信	国　内	株　式	インデックス型
追加型投信	海　外	債　券	特殊型
	内　外	不動産投信	
		その他資産（　　）	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表〈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）〉

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）	ファミリーファンド	あり（フルヘッジ）	日経225
一般	年2回	日本			
大型株	年4回	北米			TOPIX
中小型株	年6回（隔月）	欧州			
債券	年12回（毎月）	アジア			
一般	日々	オセアニア	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、円ヘッジ・ベース)）
公債	その他（　）	中南米			
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。

属性区分表〈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)〉

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 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( ) 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	**年1回** 年2回 年4回 年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々 その他 ( )	**グローバル (除く日本)** 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	**ファミリー ファンド** ファンド・オブ・ ファンズ	あり ( ) **なし**	日経225 TOPIX **その他 (MSCIコクサイ 指数(配当込み、 円ベース)**

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

(注1) 商品分類の定義

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

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

（注2）属性区分の定義

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

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

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

＜信託金の限度額＞

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、各ファンドについて5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

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

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

2 先進国の株式に投資し、投資成果をMSCIコクサイ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。

●以下の2つのファンドがあります。

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(注1)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。

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(注1)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1）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。

（注）「先進国」…日本を除きます。
「株式」…DR（預託証券）を含みます。

※DR：Depositary Receipt の略で、ある国の株式発行会社の株式を海外で流通させるために、その会社の株式を銀行などに預託し、その代替として海外で発行される証券をいいます。DRは、株式と同様に金融商品取引所などで取引されます。また、通常は、預託された株式の通貨とは異なる通貨で取引されます。

運用プロセス

MSCIコクサイ指数について

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。

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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

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

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

分配方針

毎年11月20日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

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

［分配方針］

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

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

●マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

●株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。

●投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5％以下とします。

●外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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〕

●基準価額の動きに関する留意点

各ファンドはMSCIコクサイ指数（配当込み、円ヘッジ・ベース）、MSCIコクサイ指数（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果をあげることをめざして運用を行ないます。ただし、主として次の理由から、基準価額の動きが指数と完全に一致するものではありません。

- 指数の構成銘柄のすべてを指数の算出方法どおりに組入れ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

(2)【ファンドの沿革】

2022年2月18日　　信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者

収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金（※3）

お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務　など

↑↓※1　　収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※3）

委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（※2）の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成　など

↓運用指図↑↓※2　　損益↑↓信託金（※3）

受託会社	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行	信託契約（※2）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算　など

損益↑↓投資

投資対象	先進国（日本を除きます。）の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）　など （ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

※1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。

※2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。

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

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

＜委託会社の概況（2023年11月末日現在）＞

・資本金の額　151億7,427万2,500円

・沿革

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

・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

＜為替ヘッジあり＞

①　主要投資対象

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

②　投資態度

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、先進国の株式（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ないます。

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

ハ．マザーファンドにおいて、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、保有外貨建資産につい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。

＜為替ヘッジなし＞

①　主要投資対象

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

②　投資態度

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、先進国の株式（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ないます。

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

(2)【投資対象】

＜各ファンド共通＞

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

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)⑥、⑦および⑧に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

14．投資証券、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および外国投資証券で投資法人債券に類する証券ならびに前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、投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

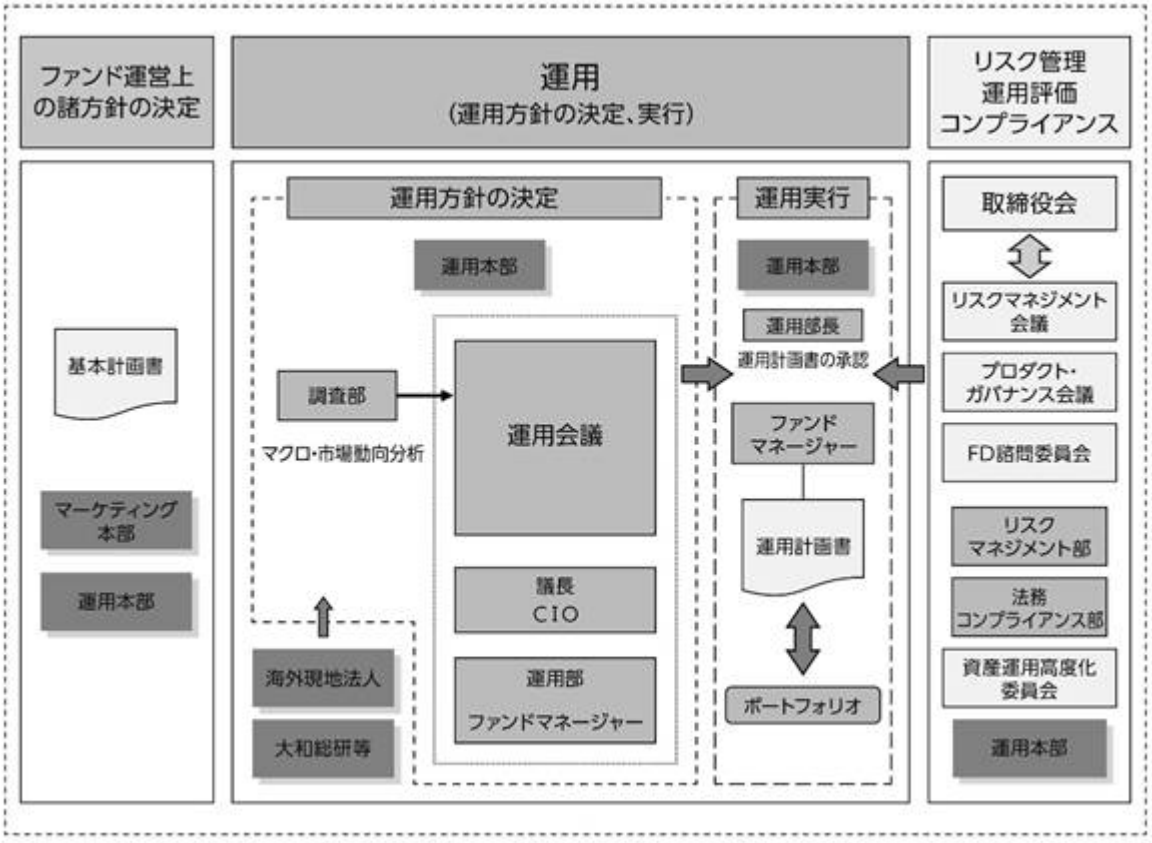
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

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

(3)【運用体制】

① 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

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

③ 職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

・基本的な運用方針の決定

・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④　リスクマネジメント会議、プロダクト・ガバナンス会議、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会

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

イ．リスクマネジメント会議

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

ロ．プロダクト・ガバナンス会議

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

ハ．FD諮問委員会

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

ニ．資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

⑤　受託会社に対する管理体制

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

※　上記の運用体制は2023年11月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

＜各ファンド共通＞

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

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

③ 留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

＜各ファンド共通＞

① マザーファンドの受益証券（信託約款）

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

② 株式（信託約款）

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

③ 投資信託証券（信託約款）

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

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

④ 投資する株式等の範囲（信託約款）

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

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

⑤ 信用取引

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書の権利行使により取得する株券

2．株式分割により取得する株券

3．有償増資により取得する株券

4．売出しにより取得する株券

5．信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（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（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みます。）の新株予約権に限ります。）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（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑥　先物取引等（信託約款）

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

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

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

⑦　スワップ取引（信託約款）

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

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

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

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

⑧　金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

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

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

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

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

⑨　デリバティブ取引等（信託約款）

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

⑩　有価証券の貸付け（信託約款）

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

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

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

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

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

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

⑪　外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

⑫　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

⑬　外国為替予約取引（信託約款）

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

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

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

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

⑭　信用リスク集中回避（信託約款）

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

⑮　資金の借入れ（信託約款）

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜為替ヘッジあり＞

＜参　考＞ マザーファンド（外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド）の概要

(1) 投資方針

①　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。

②　投資態度

イ．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。

ロ．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。

ハ．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。

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

(2) 投資対象

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1. 外国通貨表示の株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

21. 外国の者に対する権利で前20.の有価証券の性質を有するもの

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

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

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

(3) 主な投資制限

①　株式

株式への投資割合には、制限を設けません。

②　投資信託証券

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

③　外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

④　先物取引等

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

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

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

⑤　スワップ取引

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

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

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

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

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

⑥　金利先渡取引および為替先渡取引

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

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

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

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

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

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

＜為替ヘッジなし＞

＜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）の概要

(1) 投資方針

①　主要投資対象

外国の株式（預託証書を含みます。）を主要投資対象とします。

②　投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

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

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

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

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

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

(3) 主な投資制限

① 株式への投資割合には、制限を設けません。

② 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

3【投資リスク】

(1)価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

① 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

② 株価指数先物取引の利用に伴うリスク

株価指数先物の価格は、対象指数の値動き、先物市場の需給等を反映して変動します。先物を買建てている場合において、先物価格が上昇すれば収益が発生し、下落すれば損失が発生します（売建てている場合は逆の結果となります。）。

③ 外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

「為替ヘッジあり」において、保有実質外貨建資産については、為替変動リスクの低減のために、為替ヘッジを行ないます。ただし、影響をすべて排除できるわけではありません。為替ヘッジ

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

「為替ヘッジなし」において、保有実質外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。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。

④　その他

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

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

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

①　金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生した場合には、お買付け、ご換金の申込みの受付けを中止すること、すでに受付けたお買付け、ご換金の申込みを取消すことがあります。

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

(3)その他の留意点

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

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

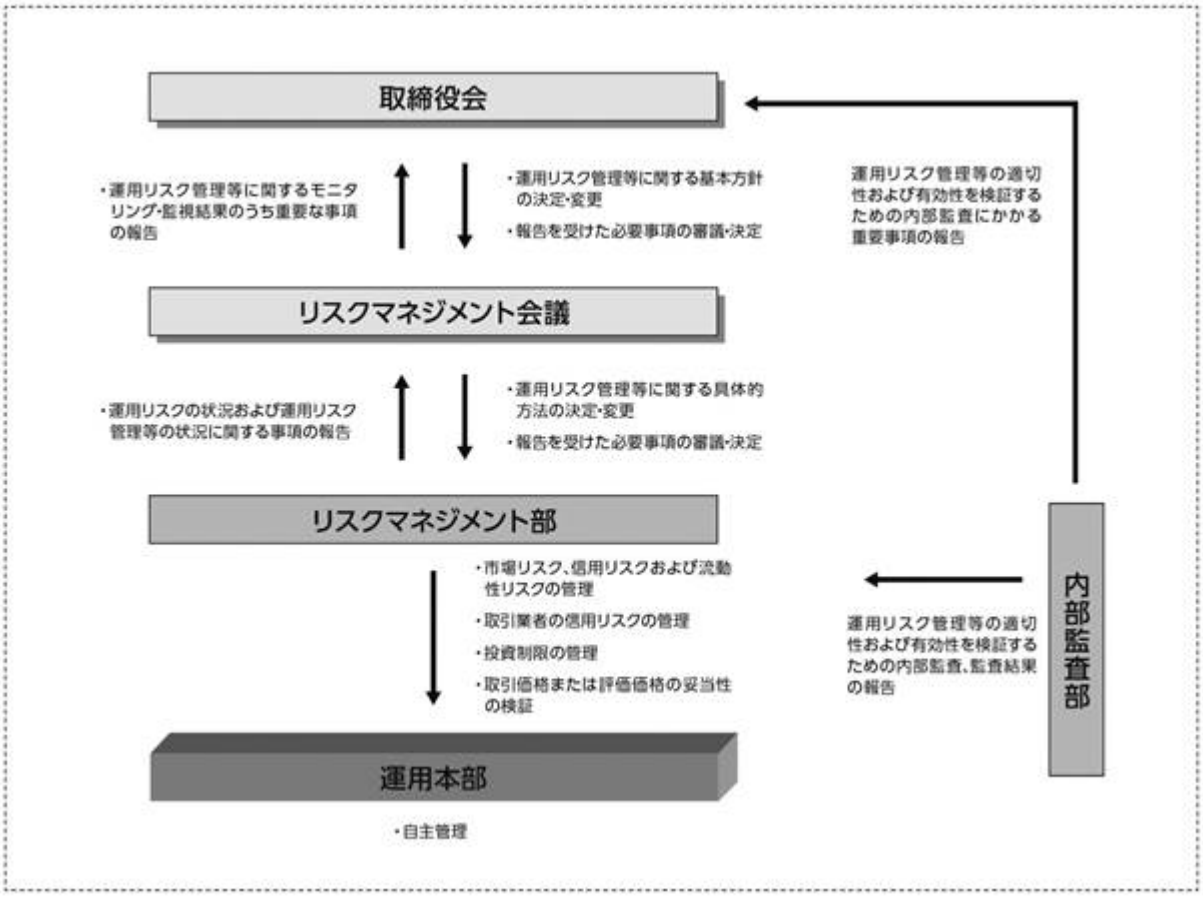
※　流動性リスクに関する事項

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

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

(4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※　流動性リスクに対する管理体制

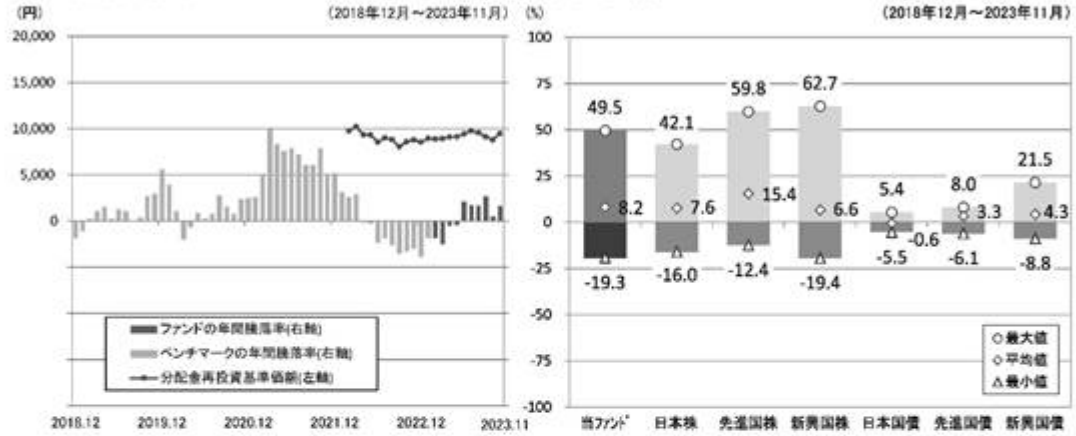
- **委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行ないます。**
- **取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。**

参考情報

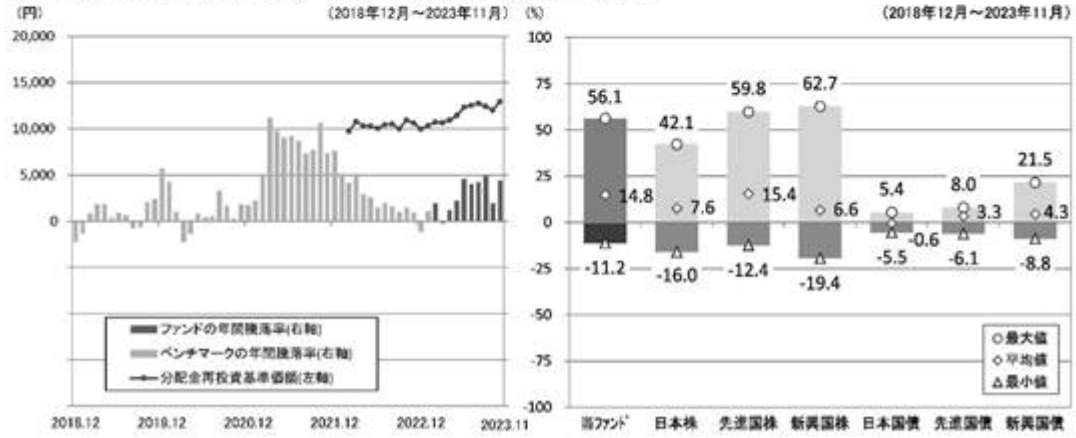
●下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移　　**他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較**

[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）]



[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）]



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

※資産クラスについて

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

※指数について

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

(2)【換金（解約）手数料】

① 換金手数料

ありません。

② 信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率0.2915％（税抜0.265%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され日々の基準価額に反映されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

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

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

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.235% （税抜）	年率0.01% （税抜）	年率0.02% （税抜）

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

①　個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」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。

②　法人の投資者に対する課税

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

＜注1＞個別元本について

①　投資者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。
②　投資者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
③　投資者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。
④　個別元本について、詳しくは販売会社にお問合せ下さい。

＜注2＞収益分配金の課税について

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

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

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

（※）上記は、2023年11月末日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

【ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用）】

(1)【投資状況】(2023年11月30日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		1,673,821	99.98
	内 日本	1,673,821	99.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		257	0.02
純資産総額		1,674,078	100.00

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

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

(2)【投資資産】(2023年11月30日現在)

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	外国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	609,860	2.7311 1,665,597	2.7446 1,673,821	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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額(分配落)(円)	純資産総額(分配付)(円)	1口当たりの純資産額(分配落)(円)	1口当たりの純資産額(分配付)(円)
第1計算期間末(2022年11月21日)	912,556	912,556	0.8782	0.8782
2022年11月末日	912,159	－	0.8778	－
12月末日	990,888	－	0.8547	－
2023年1月末日	1,035,656	－	0.8946	－
2月末日	1,028,055	－	0.8880	－
3月末日	1,033,903	－	0.8931	－
4月末日	1,050,605	－	0.9084	－
5月末日	1,056,103	－	0.9131	－
6月末日	1,422,221	－	0.9435	－
7月末日	1,476,911	－	0.9764	－
8月末日	1,475,882	－	0.9560	－
9月末日	1,518,627	－	0.9131	－
10月末日	1,495,324	－	0.8786	－
第2計算期間末(2023年11月20日)	1,665,049	1,665,049	0.9444	0.9444
11月末日	1,674,078	－	0.9490	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	△12.2
第2計算期間	7.5

(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	39,100	0
第2計算期間	726,849	2,892

（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（2023年11月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		99,321,781,061	92.82
	内 香港	628,905,911	0.59
	内 シンガポール	380,434,753	0.36
	内 イスラエル	191,709,799	0.18
	内 ノルウェー	201,775,941	0.19
	内 スウェーデン	1,002,078,394	0.94
	内 デンマーク	1,033,387,710	0.97
	内 イギリス	4,355,824,677	4.07
	内 アイルランド	145,681,264	0.14
	内 オランダ	1,302,274,406	1.22
	内 ベルギー	277,211,429	0.26
	内 フランス	3,372,157,588	3.15
	内 ドイツ	2,442,609,328	2.28
	内 スイス	2,836,691,767	2.65
	内 ポルトガル	61,957,230	0.06
	内 スペイン	787,065,568	0.74
	内 イタリア	757,474,112	0.71
	内 フィンランド	261,104,984	0.24
	内 オーストリア	53,145,940	0.05
	内 カナダ	3,327,911,701	3.11
	内 アメリカ	73,914,039,825	69.08
	内 オーストラリア	1,922,928,806	1.80
	内 ニュージーランド	65,409,928	0.06
投資証券		2,110,111,971	1.97
	内 香港	32,813,628	0.03
	内 シンガポール	42,853,943	0.04
	内 イギリス	35,392,120	0.03
	内 ベルギー	7,608,723	0.01

	内 フランス	34,844,958	0.03
	内 カナダ	5,864,892	0.01
	内 アメリカ	1,764,872,735	1.65
	内 オーストラリア	185,860,972	0.17
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,572,541,105	5.21
純資産総額		107,004,434,137	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）		4,061,016,760	3.80
	内 イギリス	97,352,048	0.09
	内 ドイツ	778,186,061	0.73
	内 カナダ	183,595,579	0.17
	内 アメリカ	2,950,327,149	2.76
	内 オーストラリア	51,555,923	0.05
為替予約取引（売建）		96,912,236,439	△90.57
	内 日本	96,912,236,439	△90.57

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

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

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

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

(2) 投資資産（2023年11月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	201,279	20,075.05 4,040,710,957	27,850.64 5,605,750,156	5.24
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	90,266	35,236.79 3,180,688,967	55,717.46 5,029,393,102	4.70
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	117,897	13,486.31 1,590,009,373	21,519.28 2,537,058,837	2.37
4	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	31,495	27,717.40 872,961,112	70,799.49 2,229,830,190	2.08

5	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	75,820	13,531.17 1,025,934,027	19,852.97 1,505,252,891	1.41
6	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	28,217	21,933.57 618,901,656	48,856.65 1,378,588,206	1.29
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	67,796	13,613.68 922,953,416	20,060.34 1,360,011,353	1.27
8	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	36,442	20,726.13 755,305,200	35,905.66 1,308,474,419	1.22
9	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	11,842	72,253.13 855,621,809	78,679.50 931,722,741	0.87
10	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	10,282	53,249.34 547,510,593	87,044.85 894,995,150	0.84
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	16,359	46,563.24 761,729,044	52,752.53 862,978,774	0.81
12	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	37,266	20,270.51 755,404,453	22,695.84 845,783,263	0.79
13	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	51,553	15,975.18 823,575,546	15,051.14 775,931,616	0.73
14	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	20,662	32,392.90 669,303,621	37,389.60 772,544,041	0.72
15	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	5,246	88,373.33 463,606,967	138,367.86 725,877,836	0.68
16	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	30,620	25,371.48 776,877,947	22,370.81 684,994,438	0.64
17	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	30,040	22,254.19 668,520,313	22,226.68 667,689,741	0.62
18	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	株式	ヘルスケア	44,030	10,732.37 472,547,106	14,932.40 657,473,748	0.61
19	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	10,791	54,474.13 587,831,325	60,272.22 650,397,606	0.61
20	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	12,800	46,241.30 591,889,146	45,741.71 585,493,906	0.55

21	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	34,164	18,673.91 637,981,337	16,709.35 570,858,329	0.53
22	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	5,811	52,702.24 306,253,271	90,799.54 527,636,169	0.49
23	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	23,100	25,405.60 586,869,894	21,164.84 488,907,889	0.46
24	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	5,640	71,449.69 402,976,783	86,456.57 487,615,056	0.46
25	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	4,758	94,944.29 451,745,348	101,622.09 483,517,914	0.45
26	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	32,296	16,124.75 520,767,727	14,873.18 480,344,515	0.45
27	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	22,438	23,526.49 527,887,599	20,369.19 457,043,997	0.43
28	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	52,398	9,135.40 478,678,680	8,563.88 448,730,504	0.42
29	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需品	18,882	21,485.60 405,693,344	22,954.68 433,430,373	0.41
30	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	17,482	26,287.14 459,553,153	24,584.22 429,781,355	0.40

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	92.82%
投資証券	1.97%
合計	94.79%

(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	4.67%
素材	3.79%
資本財・サービス	9.54%
一般消費財・サービス	9.76%
生活必需品	6.64%
ヘルスケア	11.76%
金融	14.37%
情報技術	22.50%

コミュニケーション・サービス	6.88%
公益事業	2.60%
不動産	0.30%
合計	92.82%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 EMINI DEC 23	買建	88	2,804,303,979	2,950,327,149	2.76%
	イギリス	FTSE 100 INDEX DEC 23	買建	7	98,113,281	97,352,048	0.09%
	オーストラリア	SPI 200 DEC 23	買建	3	50,916,504	51,555,923	0.05%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX DEC 23	買建	7	177,266,538	183,595,579	0.17%
	ドイツ	SWISS MKT IX DEC 23	買建	7	123,572,474	127,513,954	0.12%
		EURO STOXX 50 DEC 23	買建	92	613,933,750	650,672,107	0.61%
為替予約取引	日本	スイス・フラン売/円買 2023年12月	売建	16,779,600	2,786,873,425	2,827,357,566	△2.64%
		イスラエル・シュケル売/円買 2023年12月	売建	3,015,500	113,137,036	120,230,095	△0.11%
		ノルウェー・クローネ売/円買 2023年12月	売建	15,096,500	203,438,924	208,263,765	△0.19%
		ニュージーランド・ドル売/円買 2023年12月	売建	684,500	59,813,937	62,016,384	△0.06%
		シンガポール・ドル売/円買 2023年12月	売建	3,544,100	390,167,133	390,889,775	△0.37%
		カナダ・ドル売/円買 2023年12月	売建	29,968,500	3,251,582,250	3,239,636,805	△3.03%
		米ドル売/円買 2023年12月	売建	488,131,900	73,515,836,997	71,708,235,758	△67.01%
		ユーロ売/円買 2023年12月	売建	56,477,500	9,005,139,703	9,114,045,267	△8.52%

		スウェーデン・クローネ売/円買 2023年12月	売建	65,887,500	888,921,206	935,464,136	△0.87%
		香港ドル売/円買 2023年12月	売建	35,079,900	675,744,113	660,228,273	△0.62%
		英ポンド売/円買 2023年12月	売建	24,133,200	4,413,877,813	4,504,213,208	△4.21%
		豪ドル売/円買 2023年12月	売建	21,845,300	2,083,637,481	2,126,821,270	△1.99%
		デンマーク・クローネ売/円買 2023年12月	売建	46,889,500	1,002,202,106	1,014,834,137	△0.95%

(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

●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)

2023年11月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	9,490円
純資産総額	1百万円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	8.0%
3カ月間	-0.7%
6カ月間	3.9%
1年間	8.1%
3年間	-
5年間	-
設定来	-5.1%

※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 22年11月	第2期 23年11月								
分配金	0円	0円								

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

主要な資産の状況　　※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国株式・先物	1,219	96.6%
外国リート	56	1.9%
外国投資証券	4	0.1%
外国ワラント	1	0.0%
コール・ローン、その他		5.2%
合計	1,280	-

国・地域別構成	比率
アメリカ	73.5%
イギリス	4.2%
その他	20.9%
合計	98.6%

通貨別構成	比率
日本円	93.5%
米ドル	5.5%
ユーロ	0.6%
カナダ・ドル	0.2%
スイス・フラン	0.1%
スウェーデン・クローネ	0.1%
豪ドル	0.1%
デンマーク・クローネ	0.0%
英ポンド	0.0%
その他	-0.0%
合計	100.0%

株式業種別構成	比率
情報技術	22.5%
金融	14.4%
ヘルスケア	11.8%
一般消費財・サービス	9.8%
資本財・サービス	9.5%
コミュニケーション・サービス	6.9%
生活必需品	6.6%
エネルギー	4.7%
素材	3.8%
公益事業、他	2.9%
合計	92.8%

組入上位10銘柄	国・地域名	比率
APPLE INC	アメリカ	5.2%
MICROSOFT CORP	アメリカ	4.7%
S&P500 EMINI DEC 23	アメリカ	2.8%
AMAZON.COM INC	アメリカ	2.4%
NVIDIA CORP	アメリカ	2.1%
ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.4%
META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	1.3%
ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.3%
TESLA INC	アメリカ	1.2%
UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	0.9%
合計		23.2%

※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。
・2022年※は設定日(2月18日)から年末、2023年は11月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）】

(1) 【投資状況】 (2023年11月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)

親投資信託受益証券		59,979,207	99.99
	内 日本	59,979,207	99.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,999	0.01
純資産総額		59,985,206	100.00

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

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

(2) 【投資資産】（2023年11月30日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	外国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	11,365,941	5.3249 60,523,281	5.2771 59,979,207	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。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

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

第1計算期間末 (2022年11月21日)	15,978,901	15,978,901	1.0724	1.0724
2022年11月末日	17,690,859	－	1.0621	－
12月末日	17,938,124	－	0.9967	－
2023年1月末日	20,590,826	－	1.0341	－
2月末日	21,899,279	－	1.0702	－
3月末日	22,344,033	－	1.0647	－
4月末日	22,570,005	－	1.0937	－
5月末日	23,153,404	－	1.1443	－
6月末日	32,553,213	－	1.2340	－
7月末日	34,112,849	－	1.2525	－
8月末日	40,272,433	－	1.2741	－
9月末日	47,982,454	－	1.2431	－
10月末日	53,583,730	－	1.2010	－
第2計算期間末 (2023年11月20日)	60,880,527	60,880,527	1.3067	1.3067
11月末日	59,985,206	－	1.2948	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	7.2
第2計算期間	21.8

(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	14,966,956	1,067,476
第2計算期間	35,880,884	4,188,762

(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（2023年11月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		373,664,357,536	89.85
	内 香港	2,443,397,114	0.59
	内 シンガポール	1,438,707,296	0.35
	内 イスラエル	799,269,616	0.19
	内 ノルウェー	797,670,685	0.19
	内 スウェーデン	3,858,515,520	0.93
	内 デンマーク	3,880,843,101	0.93
	内 イギリス	15,868,602,436	3.82
	内 アイルランド	543,958,491	0.13
	内 オランダ	4,951,937,052	1.19
	内 ベルギー	1,006,210,283	0.24
	内 フランス	12,874,407,107	3.10
	内 ドイツ	9,223,304,802	2.22
	内 スイス	10,338,437,023	2.49
	内 ポルトガル	243,088,930	0.06
	内 スペイン	2,987,357,834	0.72
	内 イタリア	2,890,730,029	0.70
	内 フィンランド	905,022,356	0.22
	内 オーストリア	206,497,606	0.05
	内 カナダ	12,088,466,937	2.91
	内 アメリカ	279,434,936,688	67.19
	内 オーストラリア	6,653,182,957	1.60
	内 ニュージーランド	229,813,673	0.06
投資証券		7,914,490,575	1.90
	内 香港	127,549,626	0.03
	内 シンガポール	164,788,786	0.04
	内 イギリス	123,908,732	0.03
	内 ベルギー	30,455,501	0.01
	内 フランス	141,700,650	0.03
	内 カナダ	31,855,184	0.01
	内 アメリカ	6,648,620,557	1.60
	内 オーストラリア	645,611,539	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		34,291,168,264	8.25
純資産総額		415,870,016,375	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)		34,198,119,609	8.22
	内 イギリス	1,738,429,425	0.42
	内 ドイツ	5,468,284,222	1.31
	内 カナダ	1,783,499,906	0.43
	内 アメリカ	24,004,934,531	5.77
	内 オーストラリア	1,202,971,525	0.29
為替予約取引(買建)		21,065,506,780	5.07
	内 日本	21,065,506,780	5.07

(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) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

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

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

(2) 投資資産（2023年11月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	760,400	21,161.16 16,091,035,767	27,850.64 21,177,631,142	5.09
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	341,600	36,311.28 12,403,936,745	55,717.46 19,033,087,581	4.58
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	446,700	14,022.68 6,263,982,056	21,519.28 9,612,663,448	2.31
4	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	119,480	26,185.96 3,128,701,322	70,799.49 8,459,124,021	2.03
5	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	287,300	14,330.20 4,117,072,727	19,852.97 5,703,760,953	1.37
6	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	107,000	17,742.23 1,898,422,652	48,856.65 5,227,661,978	1.26

7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	255,440	14,224.75 3,633,606,957	20,060.34 5,124,215,293	1.23
8	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	137,950	27,508.85 3,794,865,373	35,905.66 4,953,187,149	1.19
9	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	44,966	77,026.88 3,463,594,096	78,679.50 3,537,902,784	0.85
10	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	38,985	54,546.79 2,126,509,066	87,044.85 3,393,443,485	0.82
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	62,750	46,566.47 2,922,055,809	52,752.53 3,310,221,778	0.80
12	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	141,270	20,183.59 2,851,337,744	22,695.84 3,206,241,656	0.77
13	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	195,505	16,267.26 3,180,335,025	15,051.14 2,942,573,869	0.71
14	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	78,250	31,111.04 2,434,449,563	37,389.60 2,925,736,677	0.70
15	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	19,912	80,057.99 1,594,116,391	138,367.86 2,755,180,990	0.66
16	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	116,500	25,672.68 2,990,879,937	22,370.81 2,606,200,262	0.63
17	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	113,967	21,404.71 2,439,432,171	22,226.68 2,533,109,077	0.61
18	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	40,900	51,047.11 2,087,830,722	60,272.22 2,465,134,101	0.59
19	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	株式	ヘルスケア	164,716	9,763.07 1,608,136,407	14,932.40 2,459,605,857	0.59
20	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	48,650	46,474.41 2,260,982,998	45,741.71 2,225,334,260	0.54
21	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	123,371	18,712.01 2,308,522,070	16,709.35 2,061,449,564	0.50
22	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	22,020	49,613.03 1,092,480,463	90,799.54 1,999,406,032	0.48
23	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	18,899	91,495.73 1,729,178,452	101,622.09 1,920,555,917	0.46
24	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	87,818	26,412.15 2,319,474,728	21,164.84 1,858,654,244	0.45

25	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	21,360	77,649.72 1,658,601,132	86,456.57 1,846,712,339	0.44
26	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	122,721	16,003.42 1,963,957,285	14,873.18 1,825,252,640	0.44
27	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	85,272	23,081.16 1,968,186,247	20,369.19 1,736,921,996	0.42
28	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	198,750	9,149.81 1,818,538,051	8,563.88 1,702,072,362	0.41
29	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需品	71,600	22,457.73 1,607,973,961	22,954.68 1,643,555,489	0.40
30	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	66,600	26,767.18 1,782,701,799	24,584.22 1,637,309,132	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	89.85%
投資証券	1.90%
合計	91.75%

(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	4.50%
素材	3.61%
資本財・サービス	9.21%
一般消費財・サービス	9.51%
生活必需品	6.41%
ヘルスケア	11.37%
金融	13.86%
情報技術	21.85%
コミュニケーション・サービス	6.69%
公益事業	2.51%
不動産	0.32%
合計	89.85%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 EMINI DEC 23	買建	716	23,463,487,913	24,004,934,531	5.77%
	イギリス	FTSE 100 INDEX DEC 23	買建	125	1,769,669,774	1,738,429,425	0.42%
	オーストラリア	SPI 200 DEC 23	買建	70	1,226,283,027	1,202,971,525	0.29%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX DEC 23	買建	68	1,771,075,883	1,783,499,906	0.43%
	ドイツ	SWISS MKT IX DEC 23	買建	75	1,387,281,459	1,366,220,940	0.33%
		EURO STOXX 50 DEC 23	買建	580	3,974,725,568	4,102,063,282	0.99%
為替予約取引	日本	スイス・フラン買/円売 2023年12月	買建	6,100,000	1,013,961,080	1,027,848,170	0.25%
		米ドル買/円売 2023年12月	買建	99,700,000	14,981,847,160	14,646,268,980	3.52%
		ユーロ買/円売 2023年12月	買建	14,900,000	2,379,978,920	2,404,484,520	0.58%
		英ポンド買/円売 2023年12月	買建	5,900,000	1,079,899,470	1,101,174,230	0.26%
		カナダ・ドル買/円売 2023年12月	買建	11,500,000	1,248,114,090	1,243,166,100	0.30%
		豪ドル買/円売 2023年12月	買建	6,600,000	630,276,320	642,564,780	0.15%

(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

●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）

2023年11月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	12,948円
純資産総額	59百万円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	7.8%
3カ月間	1.6%
6カ月間	13.2%
1年間	21.9%
3年間	-
5年間	-
設定来	29.5%

※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 22年11月	第2期 23年11月								
分配金	0円	0円								

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国株式・先物	1,219	98.1%
外国リート	56	1.8%
外国投資証券	4	0.1%
コール・ローン、その他		8.3%
合計	1,279	-

国・地域別構成	比率
アメリカ	74.6%
イギリス	4.3%
その他	21.1%
合計	100.0%

通貨別構成	比率
米ドル	74.7%
ユーロ	9.6%
英ポンド	4.3%
カナダ・ドル	3.3%
スイス・フラン	2.8%
豪ドル	2.0%
デンマーク・クローネ	0.9%
スウェーデン・クローネ	0.9%
香港ドル	0.6%
その他	0.7%
合計	100.0%

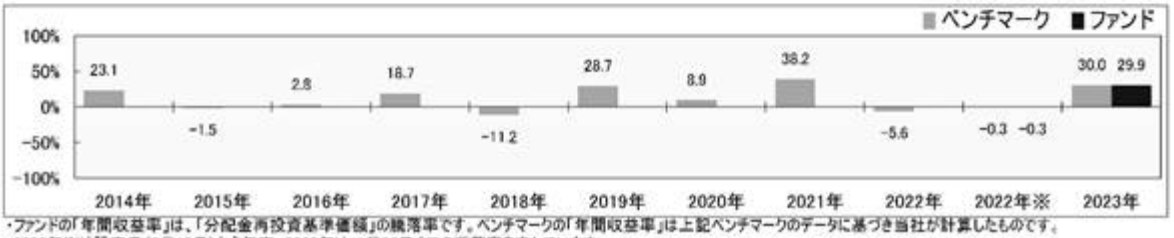
株式業種別構成	比率
情報技術	21.8%
金融	13.9%
ヘルスケア	11.4%
一般消費財・サービス	9.5%
資本財・サービス	9.2%
コミュニケーション・サービス	6.7%
生活必需品	6.4%
エネルギー	4.5%
素材	3.6%
公益事業、他	2.8%
合計	89.8%

組入上位10銘柄	国・地域名	比率
S&P500 EMINI DEC 23	アメリカ	5.8%
APPLE INC	アメリカ	5.1%
MICROSOFT CORP	アメリカ	4.6%
AMAZON.COM INC	アメリカ	2.3%
NVIDIA CORP	アメリカ	2.0%
ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.4%
META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	1.3%
ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.2%
TESLA INC	アメリカ	1.2%
EURO STOXX 50 DEC 23	ドイツ	1.0%
合計		25.8%

※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。
・2022年※は設定日（2月18日）から年末、2023年は1月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

（参考情報）ファンドの総経費率

	総経費率（①＋②）	運用管理費用の比率 ①	その他費用の比率 ②
ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用）	0.34%	0.29%	0.05%
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）	0.32%	0.29%	0.02%

※対象期間は2022年11月22日～2023年11月20日です。
※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。）を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した値（年率）です。
※詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧下さい。

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、次のイ．またはロ．に掲げる日を取得申込受付日とする受益権の取得申込みの受付けを行ないません。

イ．ニューヨーク証券取引所の休業日と同じ日付の日

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

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額（当初自己設定については1万口当たり1万円）です。

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

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

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受付けを中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消すことができるものとします。

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

２【換金（解約）手続等】

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

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

＜一部解約＞

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

ただし、販売会社は、次のイ．またはロ．に掲げる日を一部解約請求受付日とする一部解約の実行の請求の受付けを行ないません。

イ．ニューヨーク証券取引所の休業日と同じ日付の日

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

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

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

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・外国の株式：原則として金融商品取引所または店頭市場における計算時において知りう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。

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

毎年11月21日から翌年11月20日までとします。ただし、第1計算期間は、2022年2月18日から2022年11月20日までとします。

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

(5)【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合、もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1. の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項

を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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

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

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

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

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

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

② 信託約款の変更等

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

2. 委託会社は、前1. の事項（前1. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1. の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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

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

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

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

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

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

③ 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

④ 運用報告書

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

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

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

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

⑤ 公告

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

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

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

⑥ 関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

＜収益分配金および償還金にかかる請求権＞

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

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

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

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

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

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

＜換金請求権＞

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

第３ 【ファンドの経理状況】

【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）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(2022年11月22日から2023年11月20日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2022年11月21日現在	第2期 2023年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	839	2,420
親投資信託受益証券	912,413	1,664,799
未収入金	30	20
流動資産合計	913,282	1,667,239
資産合計	913,282	1,667,239
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	4	147
未払委託者報酬	626	1,860
その他未払費用	96	183
流動負債合計	726	2,190
負債合計	726	2,190
純資産の部		
元本等		
元本	※1 1,039,100	※1 1,763,057
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △ 126,544	※2 △ 98,008
元本等合計	912,556	1,665,049
純資産合計	912,556	1,665,049
負債純資産合計	913,282	1,667,239

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　2022年2月18日 至　2022年11月21日	第2期 自　2022年11月22日 至　2023年11月20日
営業収益		
有価証券売買等損益	△ 119,429	89,150
営業収益合計	△ 119,429	89,150
営業費用		
受託者報酬	29	191
委託者報酬	1,836	3,217
その他費用	276	364
営業費用合計	2,141	3,772
営業利益又は営業損失（△）	△ 121,570	85,378
経常利益又は経常損失（△）	△ 121,570	85,378
当期純利益又は当期純損失（△）	△ 121,570	85,378
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（△）	-	18
期首剰余金又は期首欠損金（△）	-	△ 126,544
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	357
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	357
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,974	57,181
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,974	57,181
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△ 126,544	△ 98,008

(3)【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	第1期 2022年11月21日現在	第2期 2023年11月20日現在
1. ※1 期首元本額	1,000,000円	1,039,100円
期中追加設定元本額	39,100円	726,849円
期中一部解約元本額	- 円	2,892円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,039,100口	1,763,057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126,544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98,008円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第1期 自2022年2月18日 至2022年11月21日	第2期 自2022年11月22日 至2023年11月20日

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

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

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

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	第2期 2023年11月20日現在

1．　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (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1期 2022年11月21日現在	第2期 2023年11月20日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	△119,150	89,131
合計	△119,150	89,131

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第1期 2022年11月21日現在	第2期 2023年11月20日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第2期 自2022年11月22日 至2023年11月20日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第1期 2022年11月21日現在	第2期 2023年11月20日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.8782円 (8,782円)	0.9444円 (9,444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	609,571	1,664,799	
親投資信託受益証券 合計			1,664,799	
合計			1,664,799	

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

	2022年11月21日現在 金 額（円）	2023年11月20日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	654,005,186	382,748,342

コール・ローン	3,193,751,390	1,421,533,048
株式	70,613,827,697	100,349,289,740
投資証券	1,731,577,137	2,098,001,155
派生商品評価勘定	3,665,069,820	691,765,446
未収入金	67,027,140	587,227
未収配当金	89,174,588	125,144,268
差入委託証拠金	870,931,448	1,701,736,322
流動資産合計	80,885,364,406	106,770,805,548
資産合計	80,885,364,406	106,770,805,548
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,843	491,882,995
未払解約金	2,103,950,030	127,390,020
流動負債合計	2,103,956,873	619,273,015
負債合計	2,103,956,873	619,273,015
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	31,119,989,052	38,867,844,166
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	47,661,418,481	67,283,688,367
元本等合計	78,781,407,533	106,151,532,533
純資産合計	78,781,407,533	106,151,532,533
負債純資産合計	80,885,364,406	106,770,805,548

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2022年11月22日 至2023年11月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2022年11月21日現在	2023年11月20日現在
1.　※1 期首	2022年2月18日	2022年11月22日
期首元本額	28,185,744,786円	31,119,989,052円
期中追加設定元本額	7,032,826,419円	13,337,971,454円
期中一部解約元本額	4,098,582,153円	5,590,116,340円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	24,565,463,207円	26,236,883,428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（為替ヘッジあり）	1,787,311,335円	1,252,655,052円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	2,580,313,844円	3,300,713,636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）	360,424円	609,571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）	2,186,540,242円	8,076,982,479円
計	31,119,989,052円	38,867,844,166円
2. 期末日における受益権の総数	31,119,989,052口	38,867,844,166口

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2022年11月22日 至2023年11月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年11月20日現在
1．　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (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	2022年11月21日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2023年11月20日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△10,658,091,414	10,317,839,023
新株予約権証券	-	△163,287
投資証券	△447,304,006	△112,698,050
合計	△11,105,395,420	10,204,977,686

（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	2022年11月21日現在				2023年11月20日現在			
	契約額等	うち1年超	時価	評価損益	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)	(円)	(円)		(円)	(円)

市場取引 株価指数 先物取引								
買建	2,939,006,935	-	3,116,786,130	177,779,195	3,538,630,136	-	3,713,453,097	174,822,961
合計	2,939,006,935	-	3,116,786,130	177,779,195	3,538,630,136	-	3,713,453,097	174,822,961

（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	2022年11月21日現在				2023年11月20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								
売建	75,961,729,804	-	72,474,446,022	3,487,283,782	98,390,372,124	-	98,365,312,634	25,059,490
アメリカ・ドル	56,558,293,764	-	53,478,657,891	3,079,635,873	73,515,836,997	-	73,001,736,480	514,100,517
イギリス・ポンド	3,310,054,105	-	3,234,001,938	76,052,167	4,413,877,813	-	4,493,802,145	△79,924,332
イスラエル・シュケル	134,933,621	-	129,682,757	5,250,864	113,137,036	-	121,326,833	△8,189,797
オーストラリア・ドル	1,712,697,296	-	1,682,835,264	29,862,032	2,083,637,481	-	2,126,989,479	△43,351,998
カナダ・ドル	2,875,368,542	-	2,764,610,588	110,757,954	3,251,582,250	-	3,266,245,837	△14,663,587
シンガポール・ドル	319,658,561	-	310,903,179	8,755,382	390,167,133	-	394,611,789	△4,444,656

スイス･フラン	2,192,550,294	-	2,171,434,322	21,115,972	2,786,873,425	-	2,836,780,989	△49,907,564
スウェーデン･クローナ	795,606,838	-	778,050,321	17,556,517	888,921,206	-	936,656,700	△47,735,494
デンマーク･クローネ	644,710,638	-	636,194,434	8,516,204	1,002,202,106	-	1,026,425,221	△24,223,115
ニュージーランド･ドル	45,022,215	-	44,840,386	181,829	59,813,937	-	61,414,709	△1,600,772
ノルウェー･クローネ	190,387,486	-	183,032,151	7,355,335	203,438,924	-	208,875,174	△5,436,250
ユーロ	6,617,687,850	-	6,524,461,759	93,226,091	9,005,139,703	-	9,217,449,921	△212,310,218
香港･ドル	564,758,594	-	535,741,032	29,017,562	675,744,113	-	672,997,357	2,746,756
合計	75,961,729,804	-	72,474,446,022	3,487,283,782	98,390,372,124	-	98,365,312,634	25,059,490

（注）　1．　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2．　換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2022年11月21日現在	2023年11月20日現在
1口当たり純資産額	2.5315円	2.7311円
（1万口当たり純資産額）	(25,315円)	(27,311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	1,666	182.700	304,378.200	
	PALO ALTO NETWORKS INC	3,845	247.590	951,983.550	
	FIRST SOLAR INC	1,458	155.020	226,019.160	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	2,216	133.180	295,126.880	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,594	126.820	202,151.080	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,150	120.560	138,644.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	5,606	29.880	167,507.280	
	ABBOTT LABORATORIES	22,037	99.550	2,193,783.350	
	HOWMET AEROSPACE INC	5,351	51.470	275,415.970	
	VERISK ANALYTICS INC	1,935	237.120	458,827.200	
	LAS VEGAS SANDS CORP	5,159	49.080	253,203.720	
	AMPHENOL CORP-CL A	7,515	89.700	674,095.500	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	619	540.020	334,272.380	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	8,313	54.670	454,471.710	
	QORVO INC	1,147	94.080	107,909.760	
	AFLAC INC	7,441	81.770	608,450.570	
	DARDEN RESTAURANTS INC	1,570	155.860	244,700.200	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1,895	89.600	169,792.000	
	ADOBE INC	5,811	602.660	3,502,057.260	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,724	77.460	211,001.040	
	LULULEMON ATHLETICA INC	1,603	422.440	677,171.320	
	GARMIN LTD	1,543	119.510	184,403.930	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2,840	269.990	766,771.600	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	8,482	191.210	1,621,843.220	
	WR BERKLEY CORP	2,312	70.210	162,325.520	
	AUTOZONE INC	239	2,627.050	627,864.950	
	DOLLAR TREE INC	2,780	115.000	319,700.000	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	14,565	9.050	131,813.250	
	CELANESE CORP	1,211	129.930	157,345.230	
	DR HORTON INC	3,776	128.060	483,554.560	
	DENTSPLY SIRONA INC	2,450	29.690	72,740.500	
	AUTODESK INC	2,759	217.330	599,613.470	
	MOODY'S CORP	2,078	356.670	741,160.260	
	DEVON ENERGY CORP	8,716	45.360	395,357.760	
	ALBEMARLE CORP	1,489	127.390	189,683.710	
	ATMOS ENERGY CORP	2,123	113.900	241,809.700	
	ALLIANT ENERGY CORP	3,369	49.230	165,855.870	

CITIGROUP INC	24,422	45.360	1,107,781.920	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	5,197	229.390	1,192,139.830	
AMERICAN ELECTRIC POWER	6,535	77.390	505,743.650	
DOMINO'S PIZZA INC	407	372.420	151,574.940	
HESS CORP	3,373	144.450	487,229.850	
DAVITA INC	609	96.160	58,561.440	
DANAHER CORP	8,922	207.780	1,853,813.160	
FORTIVE CORP	4,457	68.100	303,521.700	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	7,105	111.400	791,497.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	6,706	73.960	495,975.760	
TE CONNECTIVITY LTD	4,011	131.460	527,286.060	
APPLE INC	201,279	189.690	38,180,613.510	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	3,019	86.380	260,781.220	
BOEING CO/THE	7,302	208.040	1,519,108.080	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,913	100.890	193,002.570	
BECTON DICKINSON AND CO	3,549	233.270	827,875.230	
LEIDOS HOLDINGS INC	1,982	105.260	208,625.320	
NISOURCE INC	4,111	26.080	107,214.880	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,404	82.600	115,970.400	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	9,521	47.200	449,391.200	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	54,023	36.230	1,957,253.290	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	16,359	358.930	5,871,735.870	
ANSYS INC	1,167	299.460	349,469.820	
TRUIST FINANCIAL CORP	16,986	31.970	543,042.420	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	9,132	104.960	958,494.720	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	26,792	50.840	1,362,105.280	
JPMORGAN CHASE & CO	37,266	152.820	5,694,990.120	
T ROWE PRICE GROUP INC	2,855	97.790	279,190.450	
LKQ CORP	2,916	45.530	132,765.480	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	4,398	58.510	257,326.980	
CADENCE DESIGN SYS INC	3,443	268.270	923,653.610	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,352	347.830	470,266.160	
DOLLAR GENERAL CORP	3,077	121.110	372,655.470	
SERVICENOW INC	2,546	654.360	1,666,000.560	
CATERPILLAR INC	6,557	253.070	1,659,379.990	
BROWN & BROWN INC	3,473	73.010	253,563.730	
ESSENTIAL UTILITIES INC	2,456	35.570	87,359.920	
CHARLES RIVER LABORATORIES	574	189.040	108,508.960	
CMS ENERGY CORP	3,093	57.400	177,538.200	

MOSAIC CO/THE	3,841	36.150	138,852.150	
DELTA AIR LINES INC	2,019	36.060	72,805.140	
CORNING INC	10,170	28.480	289,641.600	
CISCO SYSTEMS INC	52,071	47.755	2,486,650.600	
MORGAN STANLEY	16,088	80.280	1,291,544.640	
DECKERS OUTDOOR CORP	431	620.510	267,439.810	
MSCI INC	1,080	521.420	563,133.600	
FAIR ISAAC CORP	299	1,042.270	311,638.730	
LENNOX INTERNATIONAL INC	470	405.610	190,636.700	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	800	221.860	177,488.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,998	55.000	164,890.000	
BROADCOM INC	5,246	977.730	5,129,171.580	
UNITED THERAPEUTICS CORP	600	228.940	137,364.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	800	118.080	94,464.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,605	163.730	262,786.650	
ARAMARK	2,858	27.710	79,195.180	
DTE ENERGY COMPANY	2,490	103.600	257,964.000	
CENTENE CORP	7,164	72.610	520,178.040	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,182	176.660	208,812.120	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	6,565	27.770	182,310.050	
DARLING INGREDIENTS INC	1,900	43.560	82,764.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,720	245.450	667,624.000	
GARTNER INC	1,023	417.610	427,215.030	
SPLUNK INC	2,266	151.010	342,188.660	
DOMINION ENERGY INC	9,676	46.760	452,449.760	
MONSTER BEVERAGE CORP	9,544	54.790	522,915.760	
SMITH (A.O.) CORP	1,400	76.380	106,932.000	
DEERE & CO	3,609	384.150	1,386,397.350	
QUANTA SERVICES INC	1,926	183.110	352,669.860	
POOL CORP	438	350.220	153,396.360	
GLOBAL PAYMENTS INC	3,494	112.050	391,502.700	
VMWARE INC-CLASS A	3,219	149.620	481,626.780	
BURLINGTON STORES INC	766	136.000	104,176.000	
NASDAQ INC	4,541	53.480	242,852.680	
VAIL RESORTS INC	448	225.440	100,997.120	
TARGA RESOURCES CORP	2,431	86.020	209,114.620	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	874	109.160	95,405.840	
WESTLAKE CORP	424	129.990	55,115.760	
CONSOLIDATED EDISON INC	4,576	91.360	418,063.360	

COGNEX CORP	1,994	36.940	73,658.360	
WEBSTER FINANCIAL CORP	2,200	43.180	94,996.000	
TELEFLEX INC	645	212.790	137,249.550	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,128	178.080	200,874.240	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	994	342.750	340,693.500	
BIO-RAD LABORATORIES-A	241	299.360	72,145.760	
CATALENT INC	1,863	39.870	74,277.810	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	2,006	176.540	354,139.240	
MOLINA HEALTHCARE INC	783	353.310	276,641.730	
CARLISLE COS INC	600	273.260	163,956.000	
IDEX CORP	960	198.010	190,089.600	
COLGATE-PALMOLIVE CO	9,981	75.580	754,363.980	
ROLLINS INC	4,060	39.440	160,126.400	
AECOM	1,700	86.980	147,866.000	
WATSCO INC	400	389.980	155,992.000	
GRACO INC	2,100	80.590	169,239.000	
AMETEK INC	2,965	155.660	461,531.900	
TORO CO	1,300	85.330	110,929.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	3,347	92.400	309,262.800	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	2,847	51.480	146,563.560	
HEICO CORP	535	169.970	90,933.950	
GENERAC HOLDINGS INC	684	114.120	78,058.080	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	521	457.340	238,274.140	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3,306	97.230	321,442.380	
TYLER TECHNOLOGIES INC	614	411.340	252,562.760	
COSTCO WHOLESALE CORP	5,640	577.150	3,255,126.000	
EPAM SYSTEMS INC	763	258.240	197,037.120	
RPM INTERNATIONAL INC	2,036	101.920	207,509.120	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	700	272.420	190,694.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	352	2,162.220	761,101.440	
CUMMINS INC	1,727	225.500	389,438.500	
CDW CORP/DE	1,687	215.290	363,194.230	
COSTAR GROUP INC	4,957	82.730	410,092.610	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,278	399.900	511,072.200	
MERCADOLIBRE INC	609	1,448.000	881,832.000	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	990	152.300	150,777.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,387	168.290	569,998.230	
DEXCOM INC	5,135	104.970	539,020.950	
NORDSON CORP	772	233.460	180,231.120	

COPART INC	10,540	50.220	529,318.800	
DIAMONDBACK ENERGY INC	2,150	156.150	335,722.500	
SEAGEN INC	1,996	212.000	423,152.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	862	206.640	178,123.680	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	1,038	224.460	232,989.480	
TRANSDIGM GROUP INC	710	957.630	679,917.300	
BIO-TECHNE CORP	2,164	61.050	132,112.200	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	1,079	108.940	117,546.260	
KINDER MORGAN INC	25,343	16.960	429,817.280	
HCA HEALTHCARE INC	2,645	246.380	651,675.100	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	420	228.180	95,835.600	
COTERRA ENERGY INC	10,513	26.750	281,222.750	
T-MOBILE US INC	6,617	147.710	977,397.070	
ZILLOW GROUP INC - C	1,786	39.090	69,814.740	
COCA-COLA CO/THE	52,398	57.260	3,000,309.480	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	2,575	60.080	154,706.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,925	118.980	229,036.500	
FRANKLIN RESOURCES INC	3,373	24.270	81,862.710	
CSX CORP	25,234	31.620	797,899.080	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,271	211.720	269,096.120	
EXPEDIA GROUP INC	1,996	136.380	272,214.480	
AMAZON.COM INC	117,897	145.180	17,116,286.460	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,044	66.900	538,143.600	
EXXON MOBIL CORP	51,553	104.960	5,411,002.880	
AES CORP	9,021	17.010	153,447.210	
EVEREST GROUP LTD	448	396.300	177,542.400	
EOG RESOURCES INC	7,416	124.000	919,584.000	
EQT CORP	5,103	40.370	206,008.110	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	2,210	112.370	248,337.700	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	134	1,460.110	195,654.740	
CENCORA INC	2,262	195.000	441,090.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	3,592	113.150	406,434.800	
FORD MOTOR CO	49,708	10.270	510,501.160	
EXACT SCIENCES CORP	2,647	66.300	175,496.100	
ENTEGRIS INC	1,893	102.860	194,713.980	
AERCAP HOLDINGS NV	2,801	68.590	192,120.590	
FORTINET INC	8,569	51.260	439,246.940	
MARKEL CORP	170	1,403.480	238,591.600	
NEXTERA ENERGY INC	26,013	57.370	1,492,365.810	

FREEPORT-MCMORAN INC	18,038	36.000	649,368.000	
INSULET CORP	809	174.060	140,814.540	
US BANCORP	19,361	37.640	728,748.040	
UNITED RENTALS INC	849	480.980	408,352.020	
F5 NETWORKS INC	659	163.080	107,469.720	
SUPER MICRO COMPUTER INC	600	288.590	173,154.000	
FASTENAL CO	7,442	60.750	452,101.500	
FISERV INC	7,698	124.080	955,167.840	
GENERAL ELECTRIC CO	13,880	119.930	1,664,628.400	
AXON ENTERPRISE INC	900	223.480	201,132.000	
PAYLOCITY HOLDING CORP	500	152.540	76,270.000	
GENERAL MOTORS CO	18,042	28.030	505,717.260	
GENERAL DYNAMICS CORP	2,962	244.690	724,771.780	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	4,267	339.190	1,447,323.730	
FIRST HORIZON CORP	6,400	12.350	79,040.000	
ALPHABET INC-CL A	75,820	135.310	10,259,204.200	
ALPHABET INC-CL C	67,796	136.940	9,283,984.240	
OWENS CORNING	1,083	131.370	142,273.710	
GENERAL MILLS INC	6,978	64.760	451,895.280	
FIRSTENERGY CORP	5,898	37.180	219,287.640	
GENUINE PARTS CO	1,954	137.410	268,499.140	
FIFTH THIRD BANCORP	8,620	27.560	237,567.200	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,330	185.690	432,657.700	
HALLIBURTON CO	11,733	37.990	445,736.670	
REPLIGEN CORP	600	150.600	90,360.000	
HOME DEPOT INC	12,800	307.270	3,933,056.000	
ASSURANT INC	902	161.280	145,474.560	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	18,748	11.080	207,727.840	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	431	236.750	102,039.250	
HERSHEY CO/THE	1,815	196.000	355,740.000	
HUMANA INC	1,608	498.090	800,928.720	
NXP SEMICONDUCTORS NV	3,309	200.940	664,910.460	
HENRY SCHEIN INC	1,491	68.750	102,506.250	
HP INC	12,405	28.310	351,185.550	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	18,238	15.930	290,531.340	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	4,663	83.600	389,826.800	
KRAFT HEINZ CO/THE	11,498	33.660	387,022.680	
ENPHASE ENERGY INC	1,738	92.860	161,390.680	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	11,470	152.890	1,753,648.300	

HUBBELL INC	739	300.860	222,335.540	
INTERNATIONAL PAPER CO	4,724	33.380	157,687.120	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	1,500	67.240	100,860.000	
ZOETIS INC	5,998	174.800	1,048,450.400	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	2,932	228.620	670,313.840	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	1,700	58.070	98,719.000	
CHENIERE ENERGY INC	3,278	173.500	568,733.000	
HYATT HOTELS CORP - CL A	600	115.330	69,198.000	
ALLEGION PLC	942	106.350	100,181.700	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	1,800	133.590	240,462.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	2,912	17.470	50,872.640	
WASTE CONNECTIONS INC	3,442	134.840	464,119.280	
JUNIPER NETWORKS INC	3,530	26.990	95,274.700	
JM SMUCKER CO/THE	1,225	111.690	136,820.250	
JOHNSON & JOHNSON	30,620	149.790	4,586,569.800	
ABBVIE INC	22,438	138.300	3,103,175.400	
HOLOGIC INC	3,473	71.870	249,604.510	
KIMBERLY-CLARK CORP	4,377	121.200	530,492.400	
KROGER CO	8,892	42.440	377,376.480	
KLA CORP	1,704	544.540	927,896.160	
LOCKHEED MARTIN CORP	2,941	444.680	1,307,803.880	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	840	232.810	195,560.400	
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	2,872	29.360	84,321.920	
LOWE'S COS INC	7,553	203.700	1,538,546.100	
ELI LILLY & CO	10,282	591.710	6,083,962.220	
LAM RESEARCH CORP	1,709	700.340	1,196,881.060	
LOEWS CORP	2,228	67.000	149,276.000	
MCDONALD'S CORP	9,214	275.750	2,540,760.500	
3M CO	7,108	95.340	677,676.720	
META PLATFORMS INC CLASS A	28,217	335.040	9,453,823.680	
S&P GLOBAL INC	4,197	408.120	1,712,879.640	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	755	462.060	348,855.300	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	736	78.990	58,136.640	
PHILLIPS 66	5,833	116.370	678,786.210	
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	2,189	184.990	404,943.110	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	3,867	39.800	153,906.600	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,688	66.360	244,735.680	

METLIFE INC	8,521	62.550	532,988.550	
MARVELL TECHNOLOGY INC	11,568	55.580	642,949.440	
ARISTA NETWORKS INC	3,360	214.630	721,156.800	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,161	318.250	687,738.250	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	282	1,049.050	295,832.100	
BAKER HUGHES CO	12,517	33.710	421,948.070	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,500	275.260	412,890.000	
MERCK & CO. INC.	32,296	101.750	3,286,118.000	
DUPONT DE NEMOURS INC	6,019	71.220	428,673.180	
MASCO CORP	2,541	60.110	152,739.510	
M & T BANK CORP	1,806	126.730	228,874.380	
MARSH & MCLENNAN COS	6,354	197.860	1,257,202.440	
HEICO CORP-CLASS A	1,147	136.150	156,164.050	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	3,309	205.770	680,892.930	
WORKDAY INC-CLASS A	2,800	231.660	648,648.000	
BLOCK INC CLASS A	7,370	58.190	428,860.300	
TRANSUNION	2,557	58.300	149,073.100	
VISTRA CORP	4,057	34.860	141,427.020	
NETAPP INC	3,097	77.520	240,079.440	
NIKE INC -CL B	15,804	105.960	1,674,591.840	
NORFOLK SOUTHERN CORP	2,919	211.040	616,025.760	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	7,072	83.530	590,724.160	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,496	104.320	260,382.720	
ALLY FINANCIAL INC	3,709	27.510	102,034.590	
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,853	464.170	860,107.010	
APTIV PLC	3,476	81.180	282,181.680	
NEWMONT CORP	9,604	36.350	349,105.400	
MCKESSON CORP	1,756	450.200	790,551.200	
XYLEM INC	2,966	101.160	300,040.560	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	19,666	91.950	1,808,288.700	
NUCOR CORP	3,279	156.760	514,016.040	
GODADDY INC - CLASS A	1,930	92.110	177,772.300	
EVERGY INC	2,923	50.390	147,289.970	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	8,824	60.960	537,911.040	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	269	280.010	75,322.690	
OKTA INC	1,995	70.220	140,088.900	
LIBERTY BROADBAND-C	1,445	83.330	120,411.850	
WIX.COM LTD	785	96.790	75,980.150	
EQUITABLE HOLDINGS INC	4,293	28.380	121,835.340	

KKR & CO INC	8,075	66.920	540,379.000	
PAYCHEX INC	3,974	117.520	467,024.480	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	746	968.550	722,538.300	
ALTRIA GROUP INC	23,102	40.820	943,023.640	
P G & E CORP	25,848	17.920	463,196.160	
PFIZER INC	72,091	29.920	2,156,962.720	
CIGNA CORP	3,819	282.560	1,079,096.640	
DELL TECHNOLOGIES -C	3,276	73.600	241,113.600	
XCEL ENERGY INC	7,520	60.560	455,411.200	
STERIS PLC	1,293	200.230	258,897.390	
SEA LTD-ADR	4,100	37.570	154,037.000	
FOX CORP - CLASS B	1,530	28.430	43,497.900	
FOX CORP - CLASS A	3,495	30.360	106,108.200	
STRYKER CORP	4,284	288.380	1,235,419.920	
DOW INC	9,060	51.700	468,402.000	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	1,793	93.420	167,502.060	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	3,626	64.120	232,499.120	
PARKER HANNIFIN CORP	1,555	432.640	672,755.200	
UBER TECHNOLOGIES INC	24,781	54.440	1,349,077.640	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	2,992	238.160	712,574.720	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	30,040	151.070	4,538,142.800	
EXELON CORP	12,353	38.950	481,149.350	
INGERSOLL-RAND INC	5,226	70.320	367,492.320	
NVR INC	39	6,298.000	245,622.000	
CONOCOPHILLIPS	15,407	114.590	1,765,488.130	
TWILIO INC - A	2,053	63.110	129,564.830	
DOCUSIGN INC	2,333	42.950	100,202.350	
PAYCOM SOFTWARE INC	700	177.500	124,250.000	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	2,244	69.290	155,486.760	
PEPSICO INC	17,482	166.760	2,915,298.320	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	409	189.270	77,411.430	
DROPBOX INC-CLASS A	2,950	27.140	80,063.000	
MONGODB INC	996	392.570	390,999.720	
SNAP INC - A	12,910	11.890	153,499.900	
CORTEVA INC	9,349	47.320	442,394.680	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,596	95.750	440,067.000	
AMCOR PLC	19,545	9.370	183,136.650	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	3,101	207.090	642,186.090	
ROKU INC	2,320	92.970	215,690.400	

AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,290	132.100	302,509.000	
ACCENTURE PLC-CL A	8,025	327.830	2,630,835.750	
PENTAIR PLC	2,222	62.940	139,852.680	
QUALCOMM INC	14,143	129.470	1,831,094.210	
INVESCO LTD	3,700	13.840	51,208.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	2,895	72.540	210,003.300	
DATADOG INC - CLASS A	3,590	109.540	393,248.600	
PINTEREST INC- CLASS A	7,896	31.490	248,645.040	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,382	802.430	1,108,958.260	
REPUBLIC SERVICES INC	2,818	158.720	447,272.960	
BOOKING HOLDINGS INC	464	3,135.250	1,454,756.000	
ROSS STORES INC	4,401	128.820	566,936.820	
PACKAGING CORP OF AMERICA	998	155.310	154,999.380	
RESMED INC	1,797	148.940	267,645.180	
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,327	134.890	178,999.030	
ROBERT HALF INTL INC	1,209	80.850	97,747.650	
MODERNA INC	4,282	76.440	327,316.080	
HUBSPOT INC	676	468.620	316,787.120	
REVVITY INC	1,876	87.970	165,031.720	
CARRIER GLOBAL CORP	10,528	53.220	560,300.160	
OTIS WORLDWIDE CORP	5,459	84.540	461,503.860	
BILL HOLDINGS INC	1,159	63.720	73,851.480	
AVANTOR INC	9,780	19.340	189,145.200	
CARLYLE GROUP INC/THE	2,773	31.850	88,320.050	
DYNATRACE INC	3,505	51.200	179,456.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	6,172	66.470	410,252.840	
REGIONS FINANCIAL CORP	12,697	16.410	208,357.770	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	2,996	13.420	40,206.320	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	6,130	26.600	163,058.000	
MATCH GROUP INC	3,049	32.430	98,879.070	
CHEVRON CORP	23,100	144.460	3,337,026.000	
ZSCALER INC	1,318	187.470	247,085.460	
EDISON INTERNATIONAL	4,460	65.930	294,047.800	
ETSY INC	1,409	72.530	102,194.770	
TESLA INC	36,442	234.300	8,538,360.600	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	3,383	161.850	547,538.550	
GEN DIGITAL INC	8,505	20.660	175,713.300	
UNITY SOFTWARE INC	3,542	29.200	103,426.400	
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,745	91.760	160,121.200	

SYNOPSYS INC	1,922	534.780	1,027,847.160	
CHEWY INC - CLASS A	856	20.520	17,565.120	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	3,552	72.690	258,194.880	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,296	407.700	528,379.200	
VIATRIS INC	18,081	9.450	170,865.450	
DOORDASH INC - A	3,438	95.230	327,400.740	
ROBLOX CORP -CLASS A	5,270	37.910	199,785.700	
AIRBNB INC-CLASS A	5,497	127.150	698,943.550	
CBRE GROUP INC - A	3,973	78.140	310,450.220	
SOUTHERN CO/THE	14,274	69.770	995,896.980	
SYSCO CORP	6,574	70.890	466,030.860	
TRAVELERS COS INC/THE	2,961	171.820	508,759.020	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	600	59.570	35,742.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,600	57.990	92,784.000	
STEEL DYNAMICS INC	2,359	110.930	261,683.870	
SCHLUMBERGER LTD	18,264	52.850	965,252.400	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,749	32.620	57,052.380	
AT&T INC	91,697	15.900	1,457,982.300	
APA CORP	3,632	36.870	133,911.840	
SOUTHWEST AIRLINES CO	1,008	24.810	25,008.480	
ON SEMICONDUCTOR CORP	5,583	70.030	390,977.490	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	2,388	45.910	109,633.080	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,129	270.280	845,706.120	
SEMPRA ENERGY	8,278	72.260	598,168.280	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	3,596	52.890	190,192.440	
CLARIVATE PLC	3,377	7.210	24,348.170	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	24,448	20.490	500,939.520	
UIPATH INC - CLASS A	4,500	18.270	82,215.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	2,240	75.880	169,971.200	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	2,164	99.050	214,344.200	
TEXAS INSTRUMENTS INC	11,521	154.620	1,781,377.020	
SALESFORCE.COM INC	12,434	221.220	2,750,649.480	
WESTROCK CO	3,840	37.910	145,574.400	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	5,086	86.840	441,668.240	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	9,392	52.240	490,638.080	
TERADYNE INC	2,046	92.090	188,416.140	
UNION PACIFIC CORP	7,725	219.210	1,693,397.250	
MARATHON OIL CORP	7,622	25.560	194,818.320	

MARATHON PETROLEUM CORP	5,542	147.900	819,661.800	
RTX CORP	18,243	79.680	1,453,602.240	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	9,223	147.980	1,364,819.540	
IQVIA HOLDINGS INC	2,288	204.790	468,559.520	
AMEREN CORPORATION	3,619	77.120	279,097.280	
UNITEDHEALTH GROUP INC	11,842	536.290	6,350,746.180	
TOAST INC CLASS A	5,972	14.400	85,996.800	
VERISIGN INC	1,416	210.120	297,529.920	
LUCID GROUP INC	15,308	4.250	65,059.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	8,597	16.700	143,569.900	
ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	5,500	8.100	44,550.000	
VALERO ENERGY CORP	4,688	124.110	581,827.680	
ULTA BEAUTY INC	713	409.270	291,809.510	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	3,008	45.050	135,510.400	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	767	135.960	104,281.320	
ELEVANCE HEALTH INC	3,004	462.950	1,390,701.800	
WALT DISNEY CO/THE	23,451	94.150	2,207,911.650	
WELLS FARGO & CO	47,120	42.960	2,024,275.200	
WASTE MANAGEMENT INC	5,244	170.550	894,364.200	
WILLIAMS COS INC	14,697	35.430	520,714.710	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,418	202.610	287,300.980	
WHIRLPOOL CORP	636	112.490	71,543.640	
WALMART INC	18,882	155.350	2,933,318.700	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,639	111.670	294,697.130	
WYNN RESORTS LTD	1,145	86.870	99,466.150	
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	33,900	3.310	112,209.000	
WABTEC CORP	2,369	115.510	273,643.190	
TJX COMPANIES INC	14,661	88.840	1,302,483.240	
WATERS CORP	759	261.880	198,766.920	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	697	218.020	151,959.940	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	9,298	21.220	197,303.560	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,454	242.030	351,911.620	
WESTERN DIGITAL CORP	4,444	46.620	207,179.280	
WEC ENERGY GROUP INC	3,920	81.740	320,420.800	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	6,486	63.750	413,482.500	
VISA INC-CLASS A SHARES	20,662	249.560	5,156,408.720	
PPL CORP	7,743	26.090	202,014.870	

CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	4,120	121.690	501,362.800	
PULTEGROUP INC	2,592	88.300	228,873.600	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	28,848	10.710	308,962.080	
PPG INDUSTRIES INC	3,058	135.870	415,490.460	
NORTHERN TRUST CORP	2,667	75.380	201,038.460	
FERGUSON PLC	2,871	166.480	477,964.080	
NVIDIA CORP	31,495	492.980	15,526,405.100	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	4,858	130.260	632,803.080	
DRAFTKINGS INC CLASS A	5,300	38.370	203,361.000	
ASPEN TECHNOLOGY CORP	300	183.660	55,098.000	
TYSON FOODS INC-CL A	3,833	48.740	186,820.420	
NETFLIX INC	5,685	465.910	2,648,698.350	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	4,910	466.420	2,290,122.200	
NRG ENERGY INC	2,411	48.080	115,920.880	
GLOBE LIFE INC	1,011	118.300	119,601.300	
TEXTRON INC	2,388	77.400	184,831.200	
NEWS CORP - CLASS A	3,749	21.030	78,841.470	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	99	1,652.000	163,548.000	
OMNICOM GROUP	2,311	79.060	182,707.660	
JACOBS SOLUTIONS INC	1,745	135.320	236,133.400	
ORACLE CORP	20,736	115.360	2,392,104.960	
MASTERCARD INC - A	10,791	400.300	4,319,637.300	
ONEOK INC	7,325	66.630	488,064.750	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,366	524.720	716,767.520	
U HAUL NON VOTING SERIES N	882	53.150	46,878.300	
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	2,328	107.080	249,282.240	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	1,813	81.580	147,904.540	
HF SINCLAIR CORP	1,900	53.680	101,992.000	
OVINTIV INC	3,000	45.000	135,000.000	
YUM! BRANDS INC	3,618	127.660	461,873.880	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	2,174	154.390	335,643.860	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	2,976	59.380	176,714.880	
BANK OF AMERICA CORP	91,878	29.980	2,754,502.440	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	649	390.490	253,428.010	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,586	87.520	226,326.720	
AMERICAN EXPRESS CO	8,108	162.560	1,318,036.480	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	5,547	73.000	404,931.000	

LINDE PLC	6,234	407.880	2,542,723.920	
ANALOG DEVICES INC	6,364	183.050	1,164,930.200	
ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	3,600	21.010	75,636.000	
MONDAYCOM LTD	200	169.700	33,940.000	
ADVANCED MICRO DEVICES	20,536	120.620	2,477,052.320	
LIBERTY MEDIA LIBERTY SIRIUSXM COR	2,840	25.980	73,783.200	
LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER	3,069	63.860	195,986.340	
CONFLUENT INC CLASS A	2,100	19.010	39,921.000	
KENVUE INC	19,000	19.680	373,920.000	
GLOBAL E ONLINE LTD	1,200	30.520	36,624.000	
VERALTO CORP	2,832	70.990	201,043.680	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	9,428	64.480	607,917.440	
BUNGE GLOBAL LTD	2,184	106.800	233,251.200	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,029	94.200	191,131.800	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,283	105.540	346,487.820	
AVERY DENNISON CORP	1,070	189.960	203,257.200	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	6,782	69.530	471,552.460	
EMERSON ELECTRIC CO	7,270	89.270	648,992.900	
AON PLC-CLASS A	2,641	329.740	870,843.340	
AMGEN INC	6,805	265.390	1,805,978.950	
EATON CORP PLC	5,236	227.800	1,192,760.800	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2,151	235.630	506,840.130	
APPLIED MATERIALS INC	10,738	148.590	1,595,559.420	
CME GROUP INC	4,542	213.420	969,353.640	
ECOLAB INC	3,135	184.350	577,937.250	
EQUIFAX INC	1,576	205.210	323,410.960	
GILEAD SCIENCES INC	15,953	75.450	1,203,653.850	
KEURIG DR PEPPER INC	12,104	31.730	384,059.920	
HORMEL FOODS CORP	3,880	32.520	126,177.600	
STATE STREET CORP	3,952	70.190	277,390.880	
SCHWAB (CHARLES) CORP	19,454	56.780	1,104,598.120	
BAXTER INTERNATIONAL INC	6,528	35.460	231,482.880	
CAMPBELL SOUP CO	2,716	40.880	111,030.080	
CROWN HOLDINGS INC	1,392	83.590	116,357.280	
CARDINAL HEALTH INC	2,973	103.390	307,378.470	
FEDEX CORP	3,102	255.950	793,956.900	

CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	4,693	107.680	505,342.240	
FMC CORP	1,360	53.650	72,964.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,594	73.940	265,740.360	
INTEL CORP	53,288	43.810	2,334,547.280	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	4,318	30.340	131,008.120	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	4,335	76.540	331,800.900	
WOLFSPEED INC	1,500	36.710	55,065.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	3,873	239.920	929,210.160	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	10,227	5.080	51,953.160	
ILLUMINA INC	1,993	94.320	187,979.760	
SEALED AIR CORP	1,450	33.300	48,285.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	4,505	305.280	1,375,286.400	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,239	142.360	176,384.040	
SNAP-ON INC	623	277.760	173,044.480	
CARMAX INC	1,749	63.970	111,883.530	
DUKE ENERGY CORP	10,107	90.010	909,731.070	
TARGET CORP	5,969	129.890	775,313.410	
DOVER CORP	1,784	137.790	245,817.360	
WW GRAINGER INC	541	802.200	433,990.200	
JABIL INC	1,700	131.390	223,363.000	
CINTAS CORP	1,199	547.970	657,016.030	
CONAGRA BRANDS INC	5,109	28.180	143,971.620	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	1,700	95.800	162,860.000	
CLOROX COMPANY	1,827	139.170	254,263.590	
ENTERGY CORP	2,623	99.110	259,965.530	
MICROSOFT CORP	90,266	369.850	33,384,880.100	
INCYTE CORP	1,856	54.270	100,725.120	
CVS HEALTH CORP	15,917	68.810	1,095,248.770	
MEDTRONIC PLC	17,006	74.760	1,271,368.560	
MICRON TECHNOLOGY INC	13,880	77.560	1,076,532.800	
BLACKROCK INC	1,932	716.860	1,384,973.520	
CENTERPOINT ENERGY INC	6,679	27.800	185,676.200	
HASBRO INC	2,289	45.150	103,348.350	
KELLOGG CO	4,142	52.800	218,697.600	
KEYCORP	12,565	12.320	154,800.800	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	17,173	70.630	1,212,928.990	
COOPER COS INC/THE	551	337.120	185,753.120	
CHUBB LTD	5,196	222.630	1,156,785.480	
ARROW ELECTRONICS INC	737	123.490	91,012.130	

	ALLSTATE CORP	3,364	134.190	451,415.160	
	EBAY INC	7,402	40.140	297,116.280	
	PAYPAL HOLDINGS INC	14,125	56.540	798,627.500	
	EASTMAN CHEMICAL CO	1,392	81.520	113,475.840	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,849	123.810	352,734.690	
	TRIMBLE INC	3,599	43.330	155,944.670	
	LENNAR CORP-A	3,358	127.490	428,111.420	
	LEAR CORP	828	134.190	111,109.320	
	PROGRESSIVE CORP	7,521	157.570	1,185,083.970	
	PACCAR INC	6,396	91.360	584,338.560	
	BIOGEN INC	1,919	228.000	437,532.000	
	IDEXX LABORATORIES INC	1,058	463.690	490,584.020	
	STARBUCKS CORP	14,588	105.570	1,540,055.160	
	PTC INC	1,684	153.940	259,234.960	
	EVERSOURCE ENERGY	4,318	58.510	252,646.180	
	INTUIT INC	3,560	560.160	1,994,169.600	
	BORGWARNER INC	2,741	34.420	94,345.220	
	BEST BUY CO INC	2,316	68.220	157,997.520	
	BALL CORP	4,550	52.360	238,238.000	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	18,974	54.340	1,031,047.160	
	ELECTRONIC ARTS INC	3,380	133.700	451,906.000	
	VULCAN MATERIALS CO	1,756	212.350	372,886.600	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3,204	350.500	1,123,002.000	
	VF CORP	5,442	17.210	93,656.820	
	PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	5,018	13.190	66,187.420	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	564	84.300	47,545.200	
	CARNIVAL CORP	11,116	14.790	164,405.640	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	7,674	16.990	130,381.260	
	COMCAST CORP-CLASS A	53,255	42.420	2,259,077.100	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	1,900	39.800	75,620.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	13,100	3.290	43,099.000	
アメリカ・ドル 小計				499,843,256.610 (74,951,496,328)	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	86,250	26.085	2,249,831.250	
	HALEON PLC	72,327	3.268	236,400.790	
	WISE PLC CLASS A	7,805	7.146	55,774.530	
	BP PLC	230,734	4.777	1,102,216.310	
	UNILEVER PLC	32,930	38.160	1,256,608.800	

BARCLAYS PLC	212,709	1.428	303,748.450	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	110,496	2.440	269,610.240	
PRUDENTIAL PLC	33,907	9.450	320,421.150	
NATWEST GROUP PLC	69,835	2.078	145,117.130	
JOHNSON MATTHEY PLC	3,080	15.240	46,939.200	
BAE SYSTEMS PLC	41,395	10.555	436,924.220	
AVIVA PLC	31,964	4.222	134,952.000	
GSK	54,797	14.106	772,966.480	
INFORMA PLC	16,200	7.490	121,338.000	
MELROSE INDUSTRIES PLC	17,308	5.220	90,347.760	
AUTO TRADER GROUP PLC	10,587	7.068	74,828.910	
DCC PLC	1,637	53.480	87,546.760	
OCADO GROUP PLC	5,149	5.606	28,865.290	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	740	89.400	66,156.000	
HALMA PLC	3,978	20.530	81,668.340	
ENTAIN PLC	9,775	8.558	83,654.450	
JD SPORTS FASHION PLC	45,396	1.387	62,986.950	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	6,857	4.905	33,633.580	
M&G PLC	25,964	2.052	53,278.120	
ENDEAVOUR MINING PLC	2,357	17.270	40,705.390	
RELX PLC	24,468	29.840	730,125.120	
DIAGEO PLC	28,896	28.095	811,833.120	
RIO TINTO PLC	14,318	54.460	779,758.280	
STANDARD CHARTERED PLC	33,616	6.600	221,865.600	
TESCO PLC	103,514	2.760	285,698.640	
SMITH & NEPHEW PLC	9,237	10.245	94,633.060	
GLENCORE PLC	140,166	4.676	655,486.290	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,200	7.256	23,219.200	
SMITHS GROUP PLC	4,080	16.525	67,422.000	
PEARSON PLC	8,271	9.524	78,773.000	
SAINSBURY (J) PLC	17,631	2.663	46,951.350	
NEXT PLC	1,456	77.140	112,315.840	
TAYLOR WIMPEY PLC	57,808	1.257	72,664.650	
WHITBREAD PLC	2,465	33.420	82,380.300	
BUNZL PLC	3,703	29.450	109,053.350	
VODAFONE GROUP PLC	281,452	0.750	211,229.720	
CRODA INTERNATIONAL PLC	2,498	45.980	114,858.040	
KINGFISHER PLC	24,703	2.332	57,607.390	
WPP PLC	13,021	7.130	92,839.730	

	UNITED UTILITIES GROUP PLC	8,244	10.840	89,364.960	
	SEVERN TRENT PLC	4,460	26.970	120,286.200	
	RENTOKIL INITIAL PLC	30,337	4.637	140,672.660	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	9,194	53.960	496,108.240	
	ST JAMES'S PLACE PLC	8,844	6.874	60,793.650	
	SCHRODERS PLC	7,217	4.071	29,380.400	
	SSE PLC	13,672	17.950	245,412.400	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	12,368	4.840	59,861.120	
	ASTRAZENECA PLC	20,064	102.600	2,058,566.400	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	80,741	2.296	185,381.330	
	3I GROUP PLC	13,104	21.710	284,487.840	
	ASHTEAD GROUP PLC	5,656	52.440	296,600.640	
	SAGE GROUP PLC/THE	11,548	9.844	113,678.510	
	NATIONAL GRID PLC	50,462	10.160	512,693.920	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	877,858	0.433	380,770.900	
	IMPERIAL BRANDS PLC	12,215	18.520	226,221.800	
	CRH PLC	9,873	48.200	475,878.600	
	CENTRICA PLC	72,184	1.517	109,539.220	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	1,155	45.210	52,217.550	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	27,389	25.215	690,613.630	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	3,483	23.800	82,895.400	
	HSBC HOLDINGS PLC	254,997	6.154	1,569,251.530	
	ANGLO AMERICAN PLC	16,886	22.340	377,233.240	
	MONDI PLC	5,248	13.910	72,999.680	
	COMPASS GROUP PLC	22,846	20.920	477,938.320	
	PERSIMMON PLC	3,969	12.400	49,215.600	
	BT GROUP PLC	75,578	1.189	89,862.240	
	COCA-COLA HBC AG-DI	2,574	21.170	54,491.580	
	BURBERRY GROUP PLC	4,508	15.645	70,527.660	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	2,078	60.960	126,674.880	
	INTERTEK GROUP PLC	1,713	38.090	65,248.170	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	5,750	85.500	491,625.000	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2,039	17.605	35,896.590	
	ADMIRAL GROUP PLC	3,977	25.990	103,362.230	
	ANTOFAGASTA PLC	6,056	13.790	83,512.240	
	ABRDN PLC	27,775	1.722	47,828.550	
	EXPERIAN PLC	11,460	29.330	336,121.800	

イギリス・ポンド 小計				23,568,449.460 (4,399,993,830)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	14,335	18.160	260,323.600	
	AZRIELI GROUP LTD	530	195.000	103,350.000	
	ICL GROUP LTD	8,294	19.250	159,659.500	
	ELBIT SYSTEMS LTD	300	742.000	222,600.000	
	BANK HAPOALIM BM	15,160	30.020	455,103.200	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	24,049	26.870	646,196.630	
	NICE LTD	742	721.500	535,353.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,883	130.000	244,790.000	
イスラエル・シュケル 小計				2,627,375.930 (105,958,130)	
オーストラリア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	23,727	4.560	108,195.120	
	TELSTRA GROUP LTD	66,609	3.840	255,778.560	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	39,009	24.070	938,946.630	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	30,136	3.550	106,982.800	
	BHP GROUP LTD	66,049	46.610	3,078,543.890	
	SOUTH32 LTD	64,500	3.170	204,465.000	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	24,678	31.400	774,889.200	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	21,722	25.220	547,828.840	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	42,689	27.730	1,183,765.970	
	WESTPAC BANKING CORP	48,148	21.100	1,015,922.800	
	SANTOS LTD	45,095	6.990	315,214.050	
	RIO TINTO LTD	4,751	125.620	596,820.620	
	ORIGIN ENERGY LTD	27,578	8.600	237,170.800	
	AURIZON HOLDINGS LTD	19,619	3.640	71,413.160	
	PILBARA MINERALS LTD	30,083	3.560	107,095.480	
	XERO LTD	2,278	101.240	230,624.720	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	2,748	33.480	92,003.040	
	COLES GROUP LTD	16,386	15.420	252,672.120	
	WISETECH GLOBAL LTD	1,645	67.250	110,626.250	
	IDP EDUCATION LTD	2,088	23.790	49,673.520	
	IGO LTD	8,081	8.900	71,920.900	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	16,320	11.760	191,923.200	
	REECE LTD	2,322	19.450	45,162.900	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	13,906	4.920	68,417.520	
	SEEK LTD	4,813	23.180	111,565.340	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	8,616	10.610	91,415.760	

	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	22,225	102.470	2,277,395.750	
	AMPOL LTD	5,198	33.550	174,392.900	
	ORICA LTD	4,783	15.750	75,332.250	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	20,961	15.020	314,834.220	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	16,486	35.320	582,285.520	
	QANTAS AIRWAYS LTD	6,373	5.240	33,394.520	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	4,796	48.110	230,735.560	
	MACQUARIE GROUP LTD	5,101	167.420	854,009.420	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	7,793	40.230	313,512.390	
	CSL LTD	6,228	258.610	1,610,623.080	
	WESFARMERS LTD	14,007	53.000	742,371.000	
	COCHLEAR LTD	1,133	259.750	294,296.750	
	BLUESCOPE STEEL LTD	5,024	20.440	102,690.560	
	SUNCORP GROUP LTD	14,504	13.360	193,773.440	
	ASX LTD	2,260	57.130	129,113.800	
	COMPUTERSHARE LTD	6,054	23.650	143,177.100	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	27,097	5.860	158,788.420	
	SONIC HEALTHCARE LTD	5,223	29.480	153,974.040	
	BRAMBLES LTD	15,735	13.170	207,229.950	
	MINERAL RESOURCES LTD	1,881	63.460	119,368.260	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,064	51.600	106,502.400	
	REA GROUP LTD	608	158.410	96,313.280	
オーストラリア・ドル 小計				19,773,152.800 (1,929,266,518)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	10,213	78.240	799,065.120	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	4,176	46.060	192,346.560	
	IMPERIAL OIL LTD	3,395	79.110	268,578.450	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	261	3,154.170	823,238.370	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	3,305	97.530	322,336.650	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	5,069	62.710	317,876.990	
	INTACT FINANCIAL CORP	2,331	209.040	487,272.240	
	BCE INC	668	54.190	36,198.920	
	FRANCO-NEVADA CORP	2,456	165.160	405,632.960	
	SUNCOR ENERGY INC	16,887	46.330	782,374.710	
	METRO INC/CN	2,377	70.160	166,770.320	
	NATIONAL BANK OF CANADA	4,801	91.340	438,523.340	
	BANK OF NOVA SCOTIA	15,103	61.090	922,642.270	

CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	11,680	54.220	633,289.600	
TORONTO-DOMINION BANK	23,137	84.780	1,961,554.860	
GREAT-WEST LIFECO INC	3,335	42.710	142,437.850	
ROYAL BANK OF CANADA	17,537	120.490	2,113,033.130	
TOURMALINE OIL CORP	3,656	66.340	242,539.040	
TC ENERGY CORP	13,754	50.340	692,376.360	
PEMBINA PIPELINE CORP	6,494	44.470	288,788.180	
BARRICK GOLD CORP	23,952	21.550	516,165.600	
CAE INC	3,752	28.840	108,207.680	
THOMSON REUTERS CORP	1,897	188.360	357,318.920	
EMPIRE CO LTD 'A'	1,800	38.610	69,498.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	631	104.900	66,191.900	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,560	58.280	90,916.800	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	4,700	20.900	98,230.000	
HYDRO ONE LTD	4,866	38.370	186,708.420	
LOBLAW COMPANIES LTD	1,861	121.760	226,595.360	
STANTEC INC	1,400	96.440	135,016.000	
NORTHLAND POWER INC	2,632	22.520	59,272.640	
WSP GLOBAL INC	1,457	190.240	277,179.680	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	974	113.730	110,773.020	
PARKLAND CORP	1,621	43.590	70,659.390	
QUEBECOR INC -CL B	1,949	30.990	60,399.510	
EMERA INC	3,524	49.090	172,993.160	
TFI INTERNATIONAL INC	924	155.360	143,552.640	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,193	31.280	68,597.040	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	5,043	58.670	295,872.810	
BRP INC/CA- SUB VOTING	403	102.830	41,440.490	
IVANHOE MINES LTD-CL A	7,402	11.010	81,496.020	
AGNICO EAGLE MINES LTD	5,983	66.370	397,091.710	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	6,997	8.180	57,235.460	
AIR CANADA	1,700	17.890	30,413.000	
KINROSS GOLD CORP	14,757	7.300	107,726.100	
BANK OF MONTREAL	8,923	112.030	999,643.690	
POWER CORP OF CANADA	6,972	36.630	255,384.360	
SHOPIFY INC - CLASS A	15,286	93.870	1,434,896.820	
NUTRIEN LTD	6,174	77.570	478,917.180	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	1,532	35.600	54,539.200	
CAMECO CORP	5,802	61.190	355,024.380	
FIRSTSERVICE CORP	422	209.780	88,527.160	

	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	3,882	41.360	160,559.520	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	772	26.940	20,797.680	
	TELUS CORP	600	24.220	14,532.000	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	5,374	49.400	265,475.600	
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	623	147.820	92,091.860	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	14,109	91.280	1,287,869.520	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	274	1,198.560	328,405.440	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	3,947	76.890	303,484.830	
	WESTON (GEORGE) LTD	800	164.440	131,552.000	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	7,123	19.640	139,895.720	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	1,000	111.240	111,240.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	7,920	69.480	550,281.600	
	ENBRIDGE INC	26,473	46.220	1,223,582.060	
	BROOKFIELD CORP	18,142	46.450	842,695.900	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	21,041	26.290	553,167.890	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	11,719	98.390	1,153,032.410	
	IA FINANCIAL CORP INC	1,609	87.330	140,513.970	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	2,364	48.970	115,765.080	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	6,999	158.140	1,106,821.860	
	CGI INC - CLASS A	2,457	138.890	341,252.730	
	ONEX CORPORATION	1,104	88.640	97,858.560	
	IGM FINANCIAL INC	1,318	33.840	44,601.120	
	TMX GROUP LTD	3,490	28.980	101,140.200	
	OPEN TEXT CORP	3,210	53.140	170,579.400	
	SAPUTO INC	2,900	27.010	78,329.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	7,781	15.310	119,127.110	
	FORTIS INC	5,938	56.460	335,259.480	
	RB GLOBAL INC	2,896	84.480	244,654.080	
	LUNDIN MINING CORP	6,600	8.980	59,268.000	
	CENOVUS ENERGY INC	18,231	24.800	452,128.800	
	DOLLARAMA INC	4,134	98.570	407,488.380	
	ALTAGAS LTD	3,201	27.500	88,027.500	
	KEYERA CORP	2,200	32.140	70,708.000	
	ARC RESOURCES LTD	7,734	21.400	165,507.600	
カナダ・ドル 小計				30,851,054.960 (3,370,477,755)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	30,400	3.090	93,936.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	17,900	27.350	489,565.000	

	DBS GROUP HOLDINGS LTD	24,300	32.690	794,367.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	13,750	6.240	85,800.000	
	KEPPEL CORP LTD	17,300	6.470	111,931.000	
	UOL GROUP LTD	3,000	6.150	18,450.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	5,200	6.180	32,136.000	
	SEATRIUM	963,171	0.107	103,059.290	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	1,200	29.770	35,724.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	44,700	12.970	579,759.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	130,000	0.935	121,550.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	112,400	2.330	261,892.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	40,100	3.870	155,187.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	11,400	5.090	58,026.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	11,800	9.540	112,572.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	27,800	3.680	102,304.000	
シンガポール・ドル 小計				3,156,258.290 (352,143,738)	
スイス・フラン	SANDOZ GROUP AG	4,977	25.540	127,112.580	
	AVOLTA AG	1,251	31.690	39,644.190	
	UBS GROUP AG-REG	41,958	23.140	970,908.120	
	ROCHE HOLDING AG-BR	515	253.000	130,295.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	89	620.000	55,180.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	3,178	41.300	131,251.400	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	8,798	237.600	2,090,404.800	
	SIKA AG-REG	1,895	235.400	446,083.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	108,400.000	108,400.000	
	ABB LTD-REG	19,850	33.780	670,533.000	
	SWISS RE AG	3,723	99.980	372,225.540	
	NESTLE SA-REG	34,164	98.990	3,381,894.360	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	256	1,126.000	288,256.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	560	193.200	108,192.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	2,684	55.720	149,552.480	
	SGS SA-REG	2,472	73.800	182,433.600	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	467	185.500	86,628.500	
	TEMENOS AG - REG	793	69.320	54,970.760	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	471	123.600	58,215.600	
	VAT GROUP AG	339	378.600	128,345.400	
	BKW AG	250	155.900	38,975.000	
	ALCON INC	6,230	62.480	389,250.400	
	SIG GROUP N AG	3,400	20.960	71,264.000	

	SWATCH GROUP AG/THE-BR	377	236.000	88,972.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,917	437.000	837,729.000	
	BALOISE HOLDING AG - REG	550	131.300	72,215.000	
	CLARIANT AG-REG	2,552	13.350	34,069.200	
	NOVARTIS AG-REG	25,541	84.100	2,147,998.100	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	41	1,485.000	60,885.000	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	390	71.600	27,924.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	6,641	112.600	747,776.600	
	SWISSCOM AG-REG	324	509.000	164,916.000	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	357	101.600	36,271.200	
	GEBERIT AG-REG	491	476.400	233,912.400	
	GIVAUDAN-REG	124	3,229.000	400,396.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,709	119.950	204,994.550	
	SONOVA HOLDING AG-REG	613	232.100	142,277.300	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	1,797	75.540	135,745.380	
	LONZA GROUP AG-REG	1,005	355.000	356,775.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	450	44.750	20,137.500	
	HOLCIM LTD	6,754	61.760	417,127.040	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	416	577.600	240,281.600	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	640	246.400	157,696.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	946	85.000	80,410.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	8	10,850.000	86,800.000	
スイス・フラン 小計				16,775,324.600 (2,838,720,429)	
スウェーデン・クローナ	SAGAX CLASS B	2,020	232.900	470,458.000	
	VOLVO CAR CLASS B	7,177	36.290	260,453.330	
	ERICSSON LM-B SHS	37,689	52.210	1,967,742.690	
	VOLVO AB-B SHS	18,942	232.700	4,407,803.400	
	SKF AB-B SHARES	4,000	190.000	760,000.000	
	TELE2 AB-B SHS	7,026	81.400	571,916.400	
	GETINGE AB-B SHS	2,869	219.200	628,884.800	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	21,549	126.200	2,719,483.800	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	19,635	98.500	1,934,047.500	
	SWEDBANK AB - A SHARES	10,821	184.350	1,994,851.350	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	8,485	167.840	1,424,122.400	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	7,320	161.700	1,183,644.000	
	SKANSKA AB-B SHS	3,709	166.600	617,919.400	
	SANDVIK AB	17,746	202.300	3,590,015.800	

	INVESTOR AB-B SHS	26,419	211.350	5,583,655.650	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	37,273	159.100	5,930,134.300	
	VOLVO AB-A SHS	4,359	239.400	1,043,544.600	
	HOLMEN AB-B SHARES	1,114	429.800	478,797.200	
	SECURITAS AB-B SHS	4,905	89.880	440,861.400	
	TELIA CO AB	29,088	24.160	702,766.080	
	ALFA LAVAL AB	3,803	381.500	1,450,844.500	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	20,329	136.800	2,781,007.200	
	ASSA ABLOY AB-B	14,180	263.500	3,736,430.000	
	SAAB AB-B	800	555.800	444,640.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	2,638	304.300	802,743.400	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	6,420	61.880	397,269.600	
	INDUTRADE AB	3,600	225.600	812,160.000	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	1,911	242.800	463,990.800	
	LUNDBERGS AB-B SHS	948	480.000	455,040.000	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	2,048	220.000	450,560.000	
	LIFCO AB-B SHS	2,924	226.100	661,116.400	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	21,251	65.400	1,389,815.400	
	BEIJER REF AB	3,500	121.100	423,850.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	8,503	255.500	2,172,516.500	
	BOLIDEN AB	3,171	294.800	934,810.800	
	EPIROC AB-A	9,930	191.550	1,902,091.500	
	EPIROC AB-B	4,015	161.900	650,028.500	
	HUSQVARNA AB-B SHS	5,400	78.640	424,656.000	
	NORDEA BANK ABP	40,060	120.400	4,823,224.000	
	EQT AB	6,318	247.600	1,564,336.800	
	EVOLUTION AB	2,638	1,068.200	2,817,911.600	
	HEXAGON AB-B SHS	27,767	101.850	2,828,068.950	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	1,216	304.000	369,664.000	
スウェーデン・クローナ 小計				69,467,878.050 (989,917,262)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	44,030	694.300	30,570,029.000	
	DANSKE BANK A/S	10,351	177.400	1,836,267.400	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	39	10,210.000	398,190.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	13,340	177.640	2,369,717.600	
	CARLSBERG AS-B	1,206	848.600	1,023,411.600	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	2,464	360.000	887,040.000	
	COLOPLAST-B	1,922	745.400	1,432,658.800	

	DSV PANALPINA A/S	2,686	1,085.000	2,914,310.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	98	1,655.500	162,239.000	
	DEMANT A/S	1,814	275.300	499,394.200	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	58	10,310.000	597,980.000	
	TRYG A/S	4,074	143.050	582,785.700	
	PANDORA A/S	1,128	921.400	1,039,339.200	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,262	547.200	690,566.400	
	GENMAB A/S	877	2,217.000	1,944,309.000	
	ORSTED A/S	2,966	312.800	927,764.800	
デンマーク・クローネ 小計				47,876,002.700 (1,049,920,739)	
ニュージーランド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	15,000	5.000	75,000.000	
	MERCURY NZ LTD	12,380	6.050	74,899.000	
	EBOS GROUP LTD	2,056	38.600	79,361.600	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	23,635	5.025	118,765.870	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	25,418	7.730	196,481.140	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	7,238	21.970	159,018.860	
ニュージーランド・ドル 小計				703,526.470 (63,289,241)	
ノルウェー・クローネ	DNB BANK	14,464	203.500	2,943,424.000	
	NORSK HYDRO ASA	20,813	64.900	1,350,763.700	
	ORKLA ASA	11,618	77.860	904,577.480	
	TELENOR ASA	8,746	113.150	989,609.900	
	EQUINOR ASA	11,378	349.000	3,970,922.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,112	373.100	787,987.200	
	MOWI ASA	4,677	186.350	871,558.950	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,000	176.700	353,400.000	
	AKER BP ASA	3,655	307.800	1,125,009.000	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	1,203	466.800	561,560.400	
	SALMAR ASA	728	576.000	419,328.000	
	ADEVINTA ASA	3,382	108.900	368,299.800	
ノルウェー・クローネ 小計				14,646,440.430 (203,146,130)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	10,023	23.970	240,251.310	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	6,557	29.190	191,398.830	
	EXOR NV	1,300	86.360	112,268.000	
	DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	1,320	90.920	120,014.400	

CORPORACION ACCIONA ENERGIAS RENOV	781	27.140	21,196.340	
DSM FIRMENICH AG	2,300	91.880	211,324.000	
FERROVIAL	7,127	30.260	215,663.020	
LOTUS BAKERIES NV	5	7,530.000	37,650.000	
BAYER AG-REG	12,176	41.450	504,695.200	
EVONIK INDUSTRIES AG	2,431	18.495	44,961.340	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	27,996	11.172	312,771.310	
COMMERZBANK AG	14,830	11.185	165,873.550	
VOLKSWAGEN AG	341	120.850	41,209.850	
VOLKSWAGEN AG-PREF	2,461	108.840	267,855.240	
SIEMENS AG-REG	9,057	148.460	1,344,602.220	
E.ON SE	33,559	11.555	387,774.240	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	3,913	95.200	372,517.600	
GEA GROUP AG	1,908	34.980	66,741.840	
CONTINENTAL AG	1,272	68.860	87,589.920	
BASF SE	10,278	44.285	455,161.230	
ALLIANZ SE-REG	4,649	228.500	1,062,296.500	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	2,690	71.280	191,743.200	
RHEINMETALL AG	502	279.100	140,108.200	
RWE AG	9,074	38.340	347,897.160	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	6,613	7.999	52,897.380	
BRENNTAG SE	2,259	76.260	172,271.340	
FRESENIUS SE & CO KGAA	6,857	27.320	187,333.240	
SAP SE	12,328	137.220	1,691,648.160	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,535	377.900	580,076.500	
ZALANDO SE	2,514	23.060	57,972.840	
HEIDELBERG MATERIALS AG	1,641	71.280	116,970.480	
COVESTRO AG	3,161	48.000	151,728.000	
RATIONAL AG	74	609.000	45,066.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	279	273.800	76,390.200	
TALANX AG	804	63.950	51,415.800	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	1,740	46.150	80,301.000	
DELIVERY HERO SE	2,666	32.895	87,698.070	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	560	86.620	48,507.200	
BECHTLE AG	819	47.130	38,599.470	
NEMETSCHEK SE	789	79.380	62,630.820	
SCOUT24 AG	1,083	63.160	68,402.280	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	3,230	50.040	161,629.200	

KNORR-BREMSE AG	926	55.720	51,596.720	
HELLOFRESH SE	1,814	16.030	29,078.420	
SIEMENS ENERGY AG	8,767	11.680	102,398.560	
BEIERSDORF AG	1,147	124.650	142,973.550	
MERCK KGAA	1,752	156.950	274,976.400	
ADIDAS AG	1,921	179.640	345,088.440	
PUMA SE	1,295	52.900	68,505.500	
HENKEL AG & CO KGAA	1,311	62.880	82,435.680	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	38,429	21.555	828,337.090	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	2,341	35.840	83,901.440	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	9,297	58.600	544,804.200	
QIAGEN N.V.	2,521	36.080	90,957.680	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	15,800	33.580	530,564.000	
HANNOVER RUECK SE	942	208.900	196,783.800	
DHL GROUP	12,271	40.515	497,159.560	
DEUTSCHE BOERSE AG	2,381	168.750	401,793.750	
MTU AERO ENGINES AG	763	186.000	141,918.000	
WACKER CHEMIE AG	232	120.800	28,025.600	
SYMRISE AG	2,068	97.040	200,678.720	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	14,105	2.348	33,118.540	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	733	87.000	63,771.000	
VONOVIA SE	10,839	25.190	273,034.410	
LEG IMMOBILIEN SE	869	70.580	61,334.020	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	13,952	19.388	270,501.370	
NN GROUP NV	3,860	32.080	123,828.800	
ARCELORMITTAL	7,558	21.925	165,709.150	
HEINEKEN NV	3,689	83.220	306,998.580	
AEGON LTD	26,133	4.963	129,698.070	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	12,486	26.625	332,439.750	
AKZO NOBEL N.V.	2,168	68.840	149,245.120	
WOLTERS KLUWER	3,604	122.500	441,490.000	
ING GROEP NV	40,674	12.754	518,756.190	
KONINKLIJKE KPN NV	53,893	3.167	170,679.130	
ASML HOLDING NV	4,758	628.700	2,991,354.600	
ABN AMRO BANK NV-CVA	4,030	12.695	51,160.850	
IMCD NV	715	134.300	96,024.500	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	987	119.800	118,242.600	
ASR NEDERLAND NV	2,047	36.800	75,329.600	
ADYEN NV	226	1,037.600	234,497.600	

PROSUS NV	17,556	30.240	530,893.440	
JDE PEET'S NV	1,476	25.560	37,726.560	
ASM INTERNATIONAL NV	697	465.400	324,383.800	
RANDSTAD NV	1,490	53.500	79,715.000	
HEINEKEN HOLDING NV	2,285	71.000	162,235.000	
OCI NV	1,197	21.230	25,412.310	
TOTALENERGIES SE	25,799	61.810	1,594,636.190	
MICHELIN (CGDE)	8,584	29.650	254,515.600	
AIR LIQUIDE SA	6,141	170.260	1,045,566.660	
KERING	827	404.300	334,356.100	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	6,333	166.020	1,051,404.660	
BOUYGUES SA	2,721	34.830	94,772.430	
BNP PARIBAS	12,231	56.730	693,864.630	
THALES SA	1,605	138.150	221,730.750	
DANONE	8,082	57.540	465,038.280	
CARREFOUR SA	8,563	17.015	145,699.440	
VIVENDI	8,930	8.794	78,530.420	
L'OREAL	2,876	423.950	1,219,280.200	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	6,956	58.370	406,021.720	
LEGRAND SA	3,791	87.560	331,939.960	
PERNOD RICARD SA	2,569	167.350	429,922.150	
EURAZEO SE	400	59.050	23,620.000	
SOCIETE GENERALE SA	9,002	22.605	203,490.210	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	3,412	711.600	2,427,979.200	
ACCOR SA	1,850	31.370	58,034.500	
CAPGEMINI SE	2,223	177.900	395,471.700	
VALEO SA	2,245	13.495	30,296.270	
PUBLICIS GROUPE	2,918	73.900	215,640.200	
BUREAU VERITAS SA	3,227	22.120	71,381.240	
EIFFAGE	945	90.740	85,749.300	
SODEXO SA	1,085	101.350	109,964.750	
IPSEN	640	107.300	68,672.000	
AMUNDI SA	1,005	55.600	55,878.000	
TELEPERFORMANCE	745	135.100	100,649.500	
EURONEXT NV	929	73.350	68,142.150	
EUROFINS SCIENTIFIC	2,589	52.640	136,284.960	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	314	200.200	62,862.800	
SEB SA	216	101.300	21,880.800	
ESSILORLUXOTTICA	3,554	179.380	637,516.520	

DASSAULT AVIATION SA	220	187.600	41,272.000	
WORLDLINE SA	4,629	13.745	63,625.600	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	1,700	32.620	55,454.000	
AXA SA	20,577	28.385	584,078.140	
EDENRED	3,007	50.020	150,410.140	
RENAULT SA	2,861	35.560	101,737.160	
HERMES INTERNATIONAL	380	1,924.600	731,348.000	
STMICROELECTRONICS NV	9,921	41.925	415,937.920	
REMY COINTREAU	253	112.750	28,525.750	
DASSAULT SYSTEMES SE	9,565	42.050	402,208.250	
WENDEL	331	73.850	24,444.350	
ORANGE	27,156	11.076	300,779.850	
ALSTOM	3,668	12.365	45,354.820	
SANOFI	13,598	85.890	1,167,932.220	
VINCI SA	6,115	109.380	668,858.700	
AIRBUS SE	7,231	132.260	956,372.060	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	10,137	28.070	284,545.590	
CREDIT AGRICOLE SA	14,609	11.766	171,889.490	
BIOMERIEUX	457	95.860	43,808.020	
ENGIE	25,591	15.600	399,219.600	
SAFRAN SA	3,777	160.560	606,435.120	
ARKEMA	650	93.280	60,632.000	
ADP	350	115.800	40,530.000	
GETLINK SE	4,973	16.290	81,010.170	
BOLLORE	14,302	5.320	76,086.640	
UCB SA	1,550	68.520	106,206.000	
KBC GROUP NV	3,011	53.240	160,305.640	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,579	72.520	114,509.080	
SOLVAY SA	1,280	103.350	132,288.000	
UMICORE	2,270	23.290	52,868.300	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	10,500	56.230	590,415.000	
AGEAS	1,887	38.480	72,611.760	
D'IETEREN GROUP	296	155.800	46,116.800	
ELIA GROUP SA/NV	502	102.200	51,304.400	
SOFINA	146	200.200	29,229.200	
ARGENX SE	769	452.300	347,818.700	
PRYSMIAN SPA	2,949	35.760	105,456.240	
ASSICURAZIONI GENERALI	12,317	19.460	239,688.820	
MEDIOBANCA SPA	7,465	11.765	87,825.720	

TENARIS SA	3,992	15.665	62,534.680	
UNICREDIT SPA	21,313	25.035	533,570.950	
TELECOM ITALIA SPA	108,503	0.259	28,123.970	
INTESA SANPAOLO	200,712	2.684	538,811.360	
POSTE ITALIANE SPA	6,465	10.170	65,749.050	
MONCLER SPA	2,435	50.440	122,821.400	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	1,285	45.180	58,056.300	
ENI SPA	28,503	15.012	427,887.030	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	5,546	10.275	56,985.150	
DIASORIN SPA	277	88.760	24,586.520	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	3,308	10.700	35,395.600	
NEXI SPA	6,511	6.922	45,069.140	
AMPLIFON SPA	1,440	27.520	39,628.800	
ENEL SPA	99,775	6.405	639,058.870	
SNAM SPA	24,300	4.498	109,301.400	
TERNA SPA	22,841	7.520	171,764.320	
CNH INDUSTRIAL NV	14,178	9.368	132,819.500	
FINECOBANK SPA	8,077	12.300	99,347.100	
STELLANTIS NV	27,320	18.470	504,600.400	
FERRARI NV	1,599	329.600	527,030.400	
TELEFONICA SA	67,494	3.753	253,304.980	
ENDESA SA	3,760	19.590	73,658.400	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	72,670	8.284	601,998.280	
IBERDROLA SA	69,376	11.070	767,992.320	
REPSOL SA	20,298	13.795	280,010.910	
GRIFOLS SA	2,795	12.660	35,384.700	
BANCO SANTANDER SA	188,891	3.723	703,335.630	
AMADEUS IT GROUP SA	5,529	62.580	346,004.820	
NATURGY ENERGY GROUP SA	1,668	26.980	45,002.640	
CAIXABANK SA	63,259	4.049	256,135.690	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,953	35.890	105,983.170	
AENA SME SA	866	153.050	132,541.300	
CELLNEX TELECOM SA	8,685	32.530	282,523.050	
ACCIONA SA	291	129.100	37,568.100	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	11,547	35.660	411,766.020	
ENAGAS SA	3,218	16.170	52,035.060	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	6,658	15.110	100,602.380	
UPM-KYMMENE OYJ	7,936	33.000	261,888.000	
NOKIA OYJ	64,681	3.270	211,539.210	

	WARTSILA OYJ ABP	8,227	11.885	97,777.890	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	7,911	12.175	96,316.420	
	ELISA OYJ	2,212	41.920	92,727.040	
	SAMPO OYJ-A SHS	6,326	38.840	245,701.840	
	FORTUM OYJ	4,400	12.675	55,770.000	
	KESKO OYJ-B SHS	3,470	17.140	59,475.800	
	KONE OYJ-B	4,541	41.320	187,634.120	
	NESTE OYJ	5,441	34.480	187,605.680	
	ORION OYJ-CLASS B	1,315	37.630	49,483.450	
	METSO CORPORATION	8,414	9.054	76,180.350	
	VERBUND AG	876	85.350	74,766.600	
	OMV AG	2,056	40.830	83,946.480	
	ERSTE GROUP BANK AG	3,797	35.900	136,312.300	
	VOESTALPINE AG	1,323	26.200	34,662.600	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	2,693	31.750	85,502.750	
	AIB GROUP PLC	12,680	4.192	53,154.560	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	12,691	8.592	109,041.070	
	KINGSPAN GROUP PLC	2,272	69.040	156,858.880	
	JERONIMO MARTINS	2,900	21.760	63,104.000	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	42,061	4.279	179,979.010	
	GALP ENERGIA SGPS SA	6,135	13.465	82,607.770	
	EDP RENOVAVEIS SA	3,029	16.325	49,448.420	
	KERRY GROUP PLC-A	2,525	72.860	183,971.500	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,108	145.000	305,660.000	
ユーロ 小計				57,794,697.250 (9,451,744,788)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	17,500	39.800	696,500.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	27,000	43.100	1,163,700.000	
	MTR CORP	23,500	29.600	695,600.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	18,000	78.650	1,415,700.000	
	SINO LAND CO	54,000	8.080	436,320.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	48,552	40.200	1,951,790.400	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	5,000	50.100	250,500.000	
	CLP HOLDINGS LTD	23,000	59.550	1,369,650.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	18,565	21.850	405,645.250	
	HONG KONG & CHINA GAS	138,027	5.510	760,528.770	
	HANG SENG BANK LTD	9,000	89.400	804,600.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	15,500	15.260	236,530.000	
	WH GROUP LTD	89,500	4.690	419,755.000	

	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	15,900	285.400	4,537,860.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	27,000	11.020	297,540.000	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	22,000	9.390	206,580.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	10,000	15.260	152,600.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	23,552	38.400	904,396.800	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	5,500	38.200	210,100.000	
	AIA GROUP LTD	163,400	72.900	11,911,860.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	12,000	12.260	147,120.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	20,000	26.500	530,000.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	19,200	15.220	292,224.000	
	ESR CAYMAN LTD	22,000	10.080	221,760.000	
	SANDS CHINA LTD	53,000	21.400	1,134,200.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	17,000	81.150	1,379,550.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	43,000	21.300	915,900.000	
香港・ドル 小計				33,448,510.220 (643,214,852)	
合計				100,349,289,740 [100,349,289,740]	

(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	1,960	331,318.400	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	4,043	491,952.240	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,658	91,322.640	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	1,365	319,014.150	
		EQUITY RESIDENTIAL	4,626	256,419.180	
		EQUINIX INC	1,186	918,723.040	
		AMERICAN TOWER CORP	6,057	1,197,711.180	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	7,895	136,267.700	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	4,367	157,736.040	
		KIMCO REALTY CORP	7,054	132,615.200	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	5,382	76,693.500	

		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	3,000	136,230.000	
		INVITATION HOMES INC	7,588	254,425.640	
		VICI PROPERTIES INC	12,388	354,049.040	
		VENTAS INC	5,394	240,248.760	
		WEYERHAEUSER CO	9,311	297,207.120	
		CROWN CASTLE INTL CORP	5,583	580,185.360	
		IRON MOUNTAIN INC	4,072	253,400.560	
		SUN COMMUNITIES INC	1,887	231,534.900	
		PROLOGIS INC	11,937	1,313,905.590	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,237	232,021.640	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,049	91,630.150	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,008	212,708.160	
		WELLTOWER INC	6,555	573,496.950	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	7,752	127,675.440	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,236	150,075.120	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,666	185,393.640	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	5,245	93,413.450	
		REALTY INCOME CORP	8,286	438,412.260	
		PUBLIC STORAGE	2,101	541,427.700	
		REGENCY CENTERS CORP	1,761	108,829.800	
		UDR INC	4,880	160,161.600	
		WP CAREY INC	2,562	144,855.480	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,672	493,994.160	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	2,689	344,891.140	
	アメリカ・ドル 小計			11,669,946.930 (1,749,908,542)	
	イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	7,946	51,919.160	
		SEGRO PLC	17,001	139,816.220	
	イギリス・ポンド 小計			191,735.380 (35,795,078)	
	オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	12,537	89,639.550	
		LENDLEASE GROUP	6,942	47,552.700	
		TRANSURBAN GROUP	40,110	521,028.900	
		APA GROUP	24,008	200,226.720	
		SCENTRE GROUP	64,017	170,285.220	

		GPT GROUP	21,774	90,579.840	
		MIRVAC GROUP	43,513	89,201.650	
		STOCKLAND	40,622	162,081.780	
		GOODMAN GROUP	19,586	453,024.180	
		VICINITY CENTRES	50,371	93,186.350	
	オーストラリア・ドル 小計			1,916,806.890 (187,022,849)	
	カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	831	37,519.650	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	925	16,206.000	
	カナダ・ドル 小計			53,725.650 (5,869,527)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	47,500	133,000.000	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	82,826	154,056.360	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	30,000	47,400.000	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	37,600	51,888.000	
	シンガポール・ドル 小計			386,344.360 (43,104,440)	
	ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,507	82,463.040	
		GECINA SA	578	57,626.600	
		KLEPIERRE	2,394	55,277.460	
		COVIVIO	353	15,708.500	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	1,846	47,183.760	
	ユーロ 小計			258,259.360 (42,235,735)	
	香港・ドル	LINK REIT	37,000	1,474,450.000	
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	36,000	297,000.000	
	香港・ドル 小計			1,771,450.000 (34,064,984)	
投資証券 合計				2,098,001,155 [2,098,001,155]	
合計				2,098,001,155 [2,098,001,155]	

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 604銘柄 投資証券 35銘柄	97.7%	-%	2.3%	74.7%
イギリス・ポンド	株式 81銘柄 投資証券 2銘柄	99.2%	-%	0.8%	4.3%
イスラエル・シュケル	株式 8銘柄	100%	-%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 48銘柄 投資証券 10銘柄	91.2%	-%	8.8%	2.1%
カナダ・ドル	株式 86銘柄 新株予約権証券 1銘柄 投資証券 2銘柄	99.8%	0.0%	0.2%	3.3%
シンガポール・ドル	株式 16銘柄 投資証券 4銘柄	89.1%	-%	10.9%	0.4%
スイス・フラン	株式 45銘柄	100%	-%	-%	2.8%
スウェーデン・クローナ	株式 43銘柄	100%	-%	-%	1.0%
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	100%	-%	-%	1.0%
ニュージーランド・ドル	株式 6銘柄	100%	-%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 12銘柄	100%	-%	-%	0.2%
ユーロ	株式 222銘柄 投資証券 5銘柄	99.6%	-%	0.4%	9.3%
香港・ドル	株式 27銘柄 投資証券 2銘柄	95%	-%	5.0%	0.7%

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。

【ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(2022年11月22日から2023年11月20日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2022年11月21日現在	第2期 2023年11月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	12,214	64,181
親投資信託受益証券	15,977,305	60,874,425
未収入金	400	600
流動資産合計	15,989,919	60,939,206
資産合計	15,989,919	60,939,206
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	799	4,319
未払委託者報酬	10,050	53,354
その他未払費用	169	1,006
流動負債合計	11,018	58,679
負債合計	11,018	58,679
純資産の部		
元本等		
元本	※1 14,899,480	※1 46,591,602
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,079,421	14,288,925
（分配準備積立金）	335,789	6,697,232
元本等合計	15,978,901	60,880,527
純資産合計	15,978,901	60,880,527
負債純資産合計	15,989,919	60,939,206

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　2022年2月18日 至　2022年11月21日	第2期 自　2022年11月22日 至　2023年11月20日
営業収益		
有価証券売買等損益	375,517	6,939,050
営業収益合計	375,517	6,939,050
営業費用		
受託者報酬	923	6,529
委託者報酬	12,561	80,875
その他費用	349	1,486
営業費用合計	13,833	88,890
営業利益又は営業損失（△）	361,684	6,850,160
経常利益又は経常損失（△）	361,684	6,850,160
当期純利益又は当期純損失（△）	361,684	6,850,160
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（△）	25,895	436,820
期首剰余金又は期首欠損金（△）	-	1,079,421
剰余金増加額又は欠損金減少額	771,300	7,195,787
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	771,300	7,195,787
剰余金減少額又は欠損金増加額	27,668	399,623
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	27,668	399,623
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,079,421	14,288,925

(3)【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	第1期 2022年11月21日現在	第2期 2023年11月20日現在
1．　※1 期首元本額	1,000,000円	14,899,480円
期中追加設定元本額	14,966,956円	35,880,884円
期中一部解約元本額	1,067,476円	4,188,762円
2．　計算期間末日における受益権の総数	14,899,480口	46,591,602口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第1期 自2022年2月18日 至2022年11月21日	第2期 自2022年11月22日 至2023年11月20日

※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（335,789円）、投資信託約款に規定される収益調整金（743,632円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は1,079,421円（1万口当たり724.47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（6,413,340円）、投資信託約款に規定される収益調整金（7,591,693円）及び分配準備積立金（283,892円）より分配対象額は14,288,925円（1万口当たり3,066.85円）であり、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

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

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	第2期 2023年11月20日現在

1．　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (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1期 2022年11月21日現在	第2期 2023年11月20日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	365,995	6,647,697
合計	365,995	6,647,697

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第1期 2022年11月21日現在	第2期 2023年11月20日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第2期 自2022年11月22日 至2023年11月20日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第1期 2022年11月21日現在	第2期 2023年11月20日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0724円 (10,724円)	1.3067円 (13,067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	11,431,817	60,874,425	
親投資信託受益証券 合計			60,874,425	
合計			60,874,425	

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

	2022年11月21日現在 金 額（円）	2023年11月20日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,919,228,599	4,116,981,735

コール・ローン	12,752,480,603	19,983,630,148
株式	270,397,636,749	377,551,523,209
投資証券	6,572,871,715	7,869,563,596
派生商品評価勘定	632,822,264	672,565,965
未収入金	1,187,581	2,407,299
未収配当金	340,864,287	466,617,266
差入委託証拠金	3,700,645,069	7,793,960,594
流動資産合計	296,317,736,867	418,457,249,812
資産合計	296,317,736,867	418,457,249,812
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	701,674,377	202,011,253
未払金	5,559,550	-
未払解約金	73,925,400	547,530,000
流動負債合計	781,159,327	749,541,253
負債合計	781,159,327	749,541,253
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	67,823,053,477	78,442,419,761
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	227,713,524,063	339,265,288,798
元本等合計	295,536,577,540	417,707,708,559
純資産合計	295,536,577,540	417,707,708,559
負債純資産合計	296,317,736,867	418,457,249,812

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2022年11月22日 至2023年11月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2022年11月21日現在	2023年11月20日現在
1. ※1 期首	2022年2月18日	2022年11月22日
期首元本額	62,854,201,776円	67,823,053,477円
期中追加設定元本額	9,586,482,571円	14,900,819,162円
期中一部解約元本額	4,617,630,870円	4,281,452,878円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国株式インデックスＶＡ	307,550,193円	254,311,551円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	3,459,588円	2,431,213円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	39,042,034円	27,113,381円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	6,474,561円	4,226,482円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	182,847,618円	137,273,658円
外国株式インデックスファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	67,536,852円	100,771,106円
ダイワバランスファンド2023-01（適格機関投資家専用）	-円	90,561,111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）	506,839,931円	742,555,622円

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	2,965,336,460円	4,503,970,579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）	638,076,417円	567,608,743円
Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	17,930,035円	20,953,697円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	45,366,336円	53,914,742円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	5,870,847,009円	7,572,508,105円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,346,306,577円	1,485,222,214円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	249,638,620円	321,612,558円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	-円	3,022,319円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	43,461,020,632円	47,235,047,472円
ダイワ・ライフ・バランス３０	523,088,723円	509,492,668円
ダイワ・ライフ・バランス５０	1,000,565,561円	1,075,649,458円
ダイワ・ライフ・バランス７０	817,851,072円	1,029,409,746円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,887,610,203円	2,016,982,238円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	12,229,493円	12,425,264円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	12,045,619円	13,022,994円
ダイワつみたてインデックス外国株式	1,345,442,282円	2,093,091,834円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	1,859,726円	2,059,357円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	2,206,144円	2,504,278円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	4,628,137円	5,297,204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）	3,666,622円	11,431,817円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	72,721,941円	54,927,679円

ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	53,797,340円	34,472,185円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	1,222,816,635円	938,935,265円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	63,485,953円	50,190,763円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	173,081,567円	140,584,660円
ダイワ・インデックスセレクト外国株式	1,137,042,173円	1,392,857,775円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	421,701,589円	427,727,246円
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	387,377,608円	2,315,930,824円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,884,606,287円	3,021,534,859円
ダイワライフスタイル２５	10,488,247円	8,848,847円
ダイワライフスタイル５０	43,399,577円	39,431,241円
ダイワライフスタイル７５	33,068,115円	32,853,007円
ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	-円	89,653,999円
計	67,823,053,477円	78,442,419,761円
2. 期末日における受益権の総数	67,823,053,477口	78,442,419,761口

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2022年11月22日 至2023年11月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年11月20日現在
1．　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (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	2022年11月21日現在 当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	2023年11月20日現在 当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	△40,056,037,257	37,622,410,299
投資証券	△1,576,429,600	△540,081,071
合計	△41,632,466,857	37,082,329,228

（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	2022年11月21日現在				2023年11月20日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	22,067,857,264	-	22,468,357,751	400,500,487	31,773,079,447	-	32,231,348,299	458,268,852
合計	22,067,857,264	-	22,468,357,751	400,500,487	31,773,079,447	-	32,231,348,299	458,268,852

（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	2022年11月21日現在				2023年11月20日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)

市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	16,541,320,240	-	16,071,967,640	△469,352,600	19,701,395,260	-	19,713,681,120	12,285,860
アメリカ・ドル	11,553,219,870	-	11,153,081,520	△400,138,350	13,670,607,390	-	13,579,439,640	△91,167,750
イギリス・ポンド	811,342,900	-	798,499,140	△12,843,760	1,061,238,760	-	1,080,008,140	18,769,380
オーストラリア・ドル	548,809,920	-	541,035,600	△7,774,320	610,735,640	-	623,142,400	12,406,760
カナダ・ドル	796,180,560	-	774,286,420	△21,894,140	1,193,889,890	-	1,198,882,300	4,992,410
スイス・フラン	770,639,220	-	764,781,160	△5,858,060	946,799,360	-	963,649,410	16,850,050
ユーロ	2,061,127,770	-	2,040,283,800	△20,843,970	2,218,124,220	-	2,268,559,230	50,435,010
合計	16,541,320,240	-	16,071,967,640	△469,352,600	19,701,395,260	-	19,713,681,120	12,285,860

（注）　1．時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2．換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2022年11月21日現在	2023年11月20日現在
１口当たり純資産額	4.3575円	5.3250円
（1万口当たり純資産額）	(43,575円)	(53,250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	5,700	182.700	1,041,390.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	14,800	247.590	3,664,332.000	
	FIRST SOLAR INC	4,900	155.020	759,598.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	8,600	133.180	1,145,348.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	6,200	126.820	786,284.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,100	120.560	373,736.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	21,100	29.880	630,468.000	
	ABBOTT LABORATORIES	84,066	99.550	8,368,770.300	
	HOWMET AEROSPACE INC	18,983	51.470	977,055.010	
	VERISK ANALYTICS INC	7,100	237.120	1,683,552.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	16,600	49.080	814,728.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	28,800	89.700	2,583,360.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,200	540.020	1,188,044.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	28,700	54.670	1,569,029.000	
	QORVO INC	4,820	94.080	453,465.600	
	AFLAC INC	27,800	81.770	2,273,206.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	5,900	155.860	919,574.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	7,900	89.600	707,840.000	
	ADOBE INC	22,020	602.660	13,270,573.200	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	9,400	77.460	728,124.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	5,600	422.440	2,365,664.000	
	GARMIN LTD	7,400	119.510	884,374.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	10,700	269.990	2,888,893.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	32,200	191.210	6,156,962.000	
	WR BERKLEY CORP	10,142	70.210	712,069.820	
	AUTOZONE INC	920	2,627.050	2,416,886.000	
	DOLLAR TREE INC	10,271	115.000	1,181,165.000	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	58,300	9.050	527,615.000	
	CELANESE CORP	4,950	129.930	643,153.500	
	DR HORTON INC	14,916	128.060	1,910,142.960	
	DENTSPLY SIRONA INC	10,300	29.690	305,807.000	
	AUTODESK INC	10,300	217.330	2,238,499.000	
	MOODY'S CORP	8,000	356.670	2,853,360.000	

DEVON ENERGY CORP	31,000	45.360	1,406,160.000	
ALBEMARLE CORP	5,700	127.390	726,123.000	
ATMOS ENERGY CORP	7,000	113.900	797,300.000	
ALLIANT ENERGY CORP	12,200	49.230	600,606.000	
CITIGROUP INC	94,173	45.360	4,271,687.280	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	20,000	229.390	4,587,800.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	24,900	77.390	1,927,011.000	
DOMINO'S PIZZA INC	1,730	372.420	644,286.600	
HESS CORP	13,400	144.450	1,935,630.000	
DAVITA INC	2,750	96.160	264,440.000	
DANAHER CORP	33,950	207.780	7,054,131.000	
FORTIVE CORP	17,100	68.100	1,164,510.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	27,100	111.400	3,018,940.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	26,300	73.960	1,945,148.000	
TE CONNECTIVITY LTD	15,195	131.460	1,997,534.700	
APPLE INC	760,400	189.690	144,240,276.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	12,400	86.380	1,071,112.000	
BOEING CO/THE	27,700	208.040	5,762,708.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,615	100.890	768,277.350	
BECTON DICKINSON AND CO	13,699	233.270	3,195,565.730	
LEIDOS HOLDINGS INC	6,300	105.260	663,138.000	
NISOURCE INC	20,000	26.080	521,600.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,500	82.600	454,300.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	37,571	47.200	1,773,351.200	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	203,404	36.230	7,369,326.920	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	62,750	358.930	22,522,857.500	
ANSYS INC	4,200	299.460	1,257,732.000	
TRUIST FINANCIAL CORP	64,417	31.970	2,059,411.490	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	34,200	104.960	3,589,632.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	101,600	50.840	5,165,344.000	
JPMORGAN CHASE & CO	141,270	152.820	21,588,881.400	
T ROWE PRICE GROUP INC	10,900	97.790	1,065,911.000	
LKQ CORP	12,900	45.530	587,337.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	15,012	58.510	878,352.120	
CADENCE DESIGN SYS INC	13,200	268.270	3,541,164.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,000	347.830	1,739,150.000	
DOLLAR GENERAL CORP	10,600	121.110	1,283,766.000	
SERVICENOW INC	9,900	654.360	6,478,164.000	
CATERPILLAR INC	24,900	253.070	6,301,443.000	

BROWN & BROWN INC	11,700	73.010	854,217.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	12,100	35.570	430,397.000	
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,500	189.040	472,600.000	
CMS ENERGY CORP	14,100	57.400	809,340.000	
MOSAIC CO/THE	16,100	36.150	582,015.000	
DELTA AIR LINES INC	7,800	36.060	281,268.000	
CORNING INC	39,100	28.480	1,113,568.000	
CISCO SYSTEMS INC	197,050	47.755	9,410,122.750	
MORGAN STANLEY	60,552	80.280	4,861,114.560	
DECKERS OUTDOOR CORP	1,300	620.510	806,663.000	
MSCI INC	3,900	521.420	2,033,538.000	
FAIR ISAAC CORP	1,200	1,042.270	1,250,724.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,500	405.610	608,415.000	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	3,200	221.860	709,952.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	10,800	55.000	594,000.000	
BROADCOM INC	19,912	977.730	19,468,559.760	
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,300	228.940	526,562.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	3,100	118.080	366,048.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,000	163.730	982,380.000	
ARAMARK	12,000	27.710	332,520.000	
DTE ENERGY COMPANY	10,000	103.600	1,036,000.000	
CENTENE CORP	26,507	72.610	1,924,673.270	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,100	176.660	900,966.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	23,400	27.770	649,818.000	
DARLING INGREDIENTS INC	7,500	43.560	326,700.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	10,400	245.450	2,552,680.000	
GARTNER INC	3,850	417.610	1,607,798.500	
SPLUNK INC	7,600	151.010	1,147,676.000	
DOMINION ENERGY INC	40,441	46.760	1,891,021.160	
MONSTER BEVERAGE CORP	38,000	54.790	2,082,020.000	
SMITH (A.O.) CORP	6,000	76.380	458,280.000	
DEERE & CO	13,500	384.150	5,186,025.000	
QUANTA SERVICES INC	7,000	183.110	1,281,770.000	
POOL CORP	1,900	350.220	665,418.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	12,684	112.050	1,421,242.200	
VMWARE INC-CLASS A	11,500	149.620	1,720,630.000	
BURLINGTON STORES INC	3,100	136.000	421,600.000	
NASDAQ INC	16,600	53.480	887,768.000	
VAIL RESORTS INC	1,900	225.440	428,336.000	

TARGA RESOURCES CORP	10,400	86.020	894,608.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,400	109.160	371,144.000	
WESTLAKE CORP	1,800	129.990	233,982.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	16,800	91.360	1,534,848.000	
COGNEX CORP	8,400	36.940	310,296.000	
WEBSTER FINANCIAL CORP	8,500	43.180	367,030.000	
TELEFLEX INC	2,300	212.790	489,417.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,000	178.080	712,320.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,600	342.750	1,233,900.000	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,100	299.360	329,296.000	
CATALENT INC	8,700	39.870	346,869.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	7,000	176.540	1,235,780.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,800	353.310	989,268.000	
CARLISLE COS INC	2,500	273.260	683,150.000	
IDEX CORP	3,700	198.010	732,637.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	38,100	75.580	2,879,598.000	
ROLLINS INC	11,607	39.440	457,780.080	
AECOM	6,400	86.980	556,672.000	
WATSCO INC	1,600	389.980	623,968.000	
GRACO INC	8,000	80.590	644,720.000	
AMETEK INC	11,200	155.660	1,743,392.000	
TORO CO	4,900	85.330	418,117.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,800	92.400	1,090,320.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,850	51.480	404,118.000	
HEICO CORP	2,100	169.970	356,937.000	
GENERAC HOLDINGS INC	3,000	114.120	342,360.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,800	457.340	823,212.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	12,600	97.230	1,225,098.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,000	411.340	822,680.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	21,360	577.150	12,327,924.000	
EPAM SYSTEMS INC	2,800	258.240	723,072.000	
RPM INTERNATIONAL INC	6,200	101.920	631,904.000	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	2,800	272.420	762,776.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,300	2,162.220	2,810,886.000	
CUMMINS INC	6,800	225.500	1,533,400.000	
CDW CORP/DE	6,500	215.290	1,399,385.000	
COSTAR GROUP INC	19,800	82.730	1,638,054.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,800	399.900	1,919,520.000	
MERCADOLIBRE INC	2,190	1,448.000	3,171,120.000	

JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,500	152.300	533,050.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	12,816	168.290	2,156,804.640	
DEXCOM INC	18,700	104.970	1,962,939.000	
NORDSON CORP	2,490	233.460	581,315.400	
COPART INC	41,500	50.220	2,084,130.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	8,300	156.150	1,296,045.000	
SEAGEN INC	6,800	212.000	1,441,600.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,500	206.640	723,240.000	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,800	224.460	852,948.000	
TRANSDIGM GROUP INC	2,690	957.630	2,576,024.700	
BIO-TECHNE CORP	7,620	61.050	465,201.000	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,600	108.940	501,124.000	
KINDER MORGAN INC	97,481	16.960	1,653,277.760	
HCA HEALTHCARE INC	10,200	246.380	2,513,076.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,800	228.180	410,724.000	
COTERRA ENERGY INC	36,600	26.750	979,050.000	
T-MOBILE US INC	26,027	147.710	3,844,448.170	
ZILLOW GROUP INC - C	7,450	39.090	291,220.500	
COCA-COLA CO/THE	198,750	57.260	11,380,425.000	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	10,700	60.080	642,856.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,350	118.980	874,503.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	14,000	24.270	339,780.000	
CSX CORP	99,100	31.620	3,133,542.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	4,300	211.720	910,396.000	
EXPEDIA GROUP INC	6,825	136.380	930,793.500	
AMAZON.COM INC	446,700	145.180	64,851,906.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	29,300	66.900	1,960,170.000	
EXXON MOBIL CORP	195,505	104.960	20,520,204.800	
AES CORP	32,400	17.010	551,124.000	
EVEREST GROUP LTD	2,100	396.300	832,230.000	
EOG RESOURCES INC	28,300	124.000	3,509,200.000	
EQT CORP	17,500	40.370	706,475.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	7,300	112.370	820,301.000	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	500	1,460.110	730,055.000	
CENCORA INC	8,300	195.000	1,618,500.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	14,300	113.150	1,618,045.000	
FORD MOTOR CO	190,123	10.270	1,952,563.210	
EXACT SCIENCES CORP	8,700	66.300	576,810.000	
ENTEGRIS INC	7,200	102.860	740,592.000	

AERCAP HOLDINGS NV	8,200	68.590	562,438.000	
FORTINET INC	32,300	51.260	1,655,698.000	
MARKEL CORP	610	1,403.480	856,122.800	
NEXTERA ENERGY INC	97,880	57.370	5,615,375.600	
FREEPORT-MCMORAN INC	69,308	36.000	2,495,088.000	
INSULET CORP	3,400	174.060	591,804.000	
US BANCORP	74,100	37.640	2,789,124.000	
UNITED RENTALS INC	3,300	480.980	1,587,234.000	
F5 NETWORKS INC	2,900	163.080	472,932.000	
SUPER MICRO COMPUTER INC	2,500	288.590	721,475.000	
FASTENAL CO	27,600	60.750	1,676,700.000	
FISERV INC	29,833	124.080	3,701,678.640	
GENERAL ELECTRIC CO	52,706	119.930	6,321,030.580	
AXON ENTERPRISE INC	3,400	223.480	759,832.000	
PAYLOCITY HOLDING CORP	2,200	152.540	335,588.000	
GENERAL MOTORS CO	67,300	28.030	1,886,419.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	11,300	244.690	2,764,997.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	16,150	339.190	5,477,918.500	
FIRST HORIZON CORP	25,700	12.350	317,395.000	
ALPHABET INC-CL A	287,300	135.310	38,874,563.000	
ALPHABET INC-CL C	255,440	136.940	34,979,953.600	
OWENS CORNING	4,400	131.370	578,028.000	
GENERAL MILLS INC	28,300	64.760	1,832,708.000	
FIRSTENERGY CORP	26,318	37.180	978,503.240	
GENUINE PARTS CO	6,850	137.410	941,258.500	
FIFTH THIRD BANCORP	33,000	27.560	909,480.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	9,250	185.690	1,717,632.500	
HALLIBURTON CO	43,600	37.990	1,656,364.000	
REPLIGEN CORP	2,600	150.600	391,560.000	
HOME DEPOT INC	48,650	307.270	14,948,685.500	
ASSURANT INC	2,650	161.280	427,392.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	69,800	11.080	773,384.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,910	236.750	452,192.500	
HERSHEY CO/THE	7,100	196.000	1,391,600.000	
HUMANA INC	6,000	498.090	2,988,540.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	12,600	200.940	2,531,844.000	
HENRY SCHEIN INC	6,300	68.750	433,125.000	
HP INC	47,300	28.310	1,339,063.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	62,500	15.930	995,625.000	

ARCH CAPITAL GROUP LTD	18,000	83.600	1,504,800.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	41,803	33.660	1,407,088.980	
ENPHASE ENERGY INC	6,600	92.860	612,876.000	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	43,900	152.890	6,711,871.000	
HUBBELL INC	2,600	300.860	782,236.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	16,000	33.380	534,080.000	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	6,100	67.240	410,164.000	
ZOETIS INC	22,400	174.800	3,915,520.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	10,999	228.620	2,514,591.380	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	6,800	58.070	394,876.000	
CHENIERE ENERGY INC	11,700	173.500	2,029,950.000	
HYATT HOTELS CORP - CL A	2,300	115.330	265,259.000	
ALLEGION PLC	4,350	106.350	462,622.500	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	6,800	133.590	908,412.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	12,973	17.470	226,638.310	
WASTE CONNECTIONS INC	12,537	134.840	1,690,489.080	
JUNIPER NETWORKS INC	15,600	26.990	421,044.000	
JM SMUCKER CO/THE	5,000	111.690	558,450.000	
JOHNSON & JOHNSON	116,500	149.790	17,450,535.000	
ABBVIE INC	85,272	138.300	11,793,117.600	
HOLOGIC INC	11,900	71.870	855,253.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	16,300	121.200	1,975,560.000	
KROGER CO	33,000	42.440	1,400,520.000	
KLA CORP	6,600	544.540	3,593,964.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	11,000	444.680	4,891,480.000	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,400	232.810	791,554.000	
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	10,500	29.360	308,280.000	
LOWE'S COS INC	28,300	203.700	5,764,710.000	
ELI LILLY & CO	38,985	591.710	23,067,814.350	
LAM RESEARCH CORP	6,480	700.340	4,538,203.200	
LOEWS CORP	9,400	67.000	629,800.000	
MCDONALD'S CORP	35,350	275.750	9,747,762.500	
3M CO	26,690	95.340	2,544,624.600	
META PLATFORMS INC CLASS A	107,000	335.040	35,849,280.000	
S&P GLOBAL INC	15,939	408.120	6,505,024.680	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,000	462.060	1,386,180.000	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	2,720	78.990	214,852.800	

PHILLIPS 66	22,200	116.370	2,583,414.000	
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	7,300	184.990	1,350,427.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	16,050	39.800	638,790.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	12,100	66.360	802,956.000	
METLIFE INC	31,500	62.550	1,970,325.000	
MARVELL TECHNOLOGY INC	41,600	55.580	2,312,128.000	
ARISTA NETWORKS INC	12,700	214.630	2,725,801.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8,098	318.250	2,577,188.500	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,100	1,049.050	1,153,955.000	
BAKER HUGHES CO	49,023	33.710	1,652,565.330	
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,600	275.260	1,541,456.000	
MERCK & CO. INC.	122,721	101.750	12,486,861.750	
DUPONT DE NEMOURS INC	22,551	71.220	1,606,082.220	
MASCO CORP	10,900	60.110	655,199.000	
M & T BANK CORP	7,999	126.730	1,013,713.270	
MARSH & MCLENNAN COS	23,870	197.860	4,722,918.200	
HEICO CORP-CLASS A	3,620	136.150	492,863.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	12,402	205.770	2,551,959.540	
WORKDAY INC-CLASS A	10,000	231.660	2,316,600.000	
BLOCK INC CLASS A	26,312	58.190	1,531,095.280	
TRANSUNION	9,300	58.300	542,190.000	
VISTRA CORP	17,600	34.860	613,536.000	
NETAPP INC	10,300	77.520	798,456.000	
NIKE INC -CL B	59,600	105.960	6,315,216.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	11,000	211.040	2,321,440.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	26,300	83.530	2,196,839.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,605	104.320	1,001,993.600	
ALLY FINANCIAL INC	14,200	27.510	390,642.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,000	464.170	3,249,190.000	
APTIV PLC	13,700	81.180	1,112,166.000	
NEWMONT CORP	38,411	36.350	1,396,239.850	
MCKESSON CORP	6,500	450.200	2,926,300.000	
XYLEM INC	11,600	101.160	1,173,456.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	75,100	91.950	6,905,445.000	
NUCOR CORP	12,200	156.760	1,912,472.000	
GODADDY INC - CLASS A	7,000	92.110	644,770.000	
EVERGY INC	11,150	50.390	561,848.500	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	33,524	60.960	2,043,623.040	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,250	280.010	350,012.500	

OKTA INC	7,500	70.220	526,650.000	
LIBERTY BROADBAND-C	5,800	83.330	483,314.000	
WIX.COM LTD	2,810	96.790	271,979.900	
EQUITABLE HOLDINGS INC	16,800	28.380	476,784.000	
KKR & CO INC	29,200	66.920	1,954,064.000	
PAYCHEX INC	15,700	117.520	1,845,064.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,900	968.550	2,808,795.000	
ALTRIA GROUP INC	86,300	40.820	3,522,766.000	
P G & E CORP	92,000	17.920	1,648,640.000	
PFIZER INC	273,113	29.920	8,171,540.960	
CIGNA CORP	14,300	282.560	4,040,608.000	
DELL TECHNOLOGIES -C	12,401	73.600	912,713.600	
XCEL ENERGY INC	26,600	60.560	1,610,896.000	
STERIS PLC	4,800	200.230	961,104.000	
SEA LTD-ADR	19,000	37.570	713,830.000	
FOX CORP - CLASS B	6,533	28.430	185,733.190	
FOX CORP - CLASS A	13,699	30.360	415,901.640	
STRYKER CORP	16,480	288.380	4,752,502.400	
DOW INC	34,218	51.700	1,769,070.600	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	5,300	93.420	495,126.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	11,500	64.120	737,380.000	
PARKER HANNIFIN CORP	6,200	432.640	2,682,368.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	88,100	54.440	4,796,164.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	11,300	238.160	2,691,208.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	113,967	151.070	17,216,994.690	
EXELON CORP	48,122	38.950	1,874,351.900	
INGERSOLL-RAND INC	19,608	70.320	1,378,834.560	
NVR INC	160	6,298.000	1,007,680.000	
CONOCOPHILLIPS	58,502	114.590	6,703,744.180	
TWILIO INC - A	8,300	63.110	523,813.000	
DOCUSIGN INC	9,800	42.950	420,910.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,500	177.500	443,750.000	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	7,100	69.290	491,959.000	
PEPSICO INC	66,600	166.760	11,106,216.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,220	189.270	420,179.400	
DROPBOX INC-CLASS A	12,600	27.140	341,964.000	
MONGODB INC	3,400	392.570	1,334,738.000	
SNAP INC - A	49,700	11.890	590,933.000	
CORTEVA INC	34,368	47.320	1,626,293.760	

PRUDENTIAL FINANCIAL INC	17,600	95.750	1,685,200.000	
AMCOR PLC	71,100	9.370	666,207.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	10,800	207.090	2,236,572.000	
ROKU INC	6,000	92.970	557,820.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,400	132.100	1,241,740.000	
ACCENTURE PLC-CL A	30,500	327.830	9,998,815.000	
PENTAIR PLC	7,975	62.940	501,946.500	
QUALCOMM INC	53,900	129.470	6,978,433.000	
INVESCO LTD	16,700	13.840	231,128.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	11,800	72.540	855,972.000	
DATADOG INC - CLASS A	12,200	109.540	1,336,388.000	
PINTEREST INC- CLASS A	28,700	31.490	903,763.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,200	802.430	4,172,636.000	
REPUBLIC SERVICES INC	10,700	158.720	1,698,304.000	
BOOKING HOLDINGS INC	1,800	3,135.250	5,643,450.000	
ROSS STORES INC	16,500	128.820	2,125,530.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,330	155.310	672,492.300	
RESMED INC	7,100	148.940	1,057,474.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	5,430	134.890	732,452.700	
ROBERT HALF INTL INC	5,200	80.850	420,420.000	
MODERNA INC	15,700	76.440	1,200,108.000	
HUBSPOT INC	2,280	468.620	1,068,453.600	
REVVITY INC	6,100	87.970	536,617.000	
CARRIER GLOBAL CORP	40,387	53.220	2,149,396.140	
OTIS WORLDWIDE CORP	20,038	84.540	1,694,012.520	
BILL HOLDINGS INC	4,500	63.720	286,740.000	
AVANTOR INC	32,700	19.340	632,418.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	10,200	31.850	324,870.000	
DYNATRACE INC	12,200	51.200	624,640.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	21,500	66.470	1,429,105.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	45,385	16.410	744,767.850	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	13,200	13.420	177,144.000	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	18,400	26.600	489,440.000	
MATCH GROUP INC	13,500	32.430	437,805.000	
CHEVRON CORP	87,818	144.460	12,686,188.280	
ZSCALER INC	4,200	187.470	787,374.000	
EDISON INTERNATIONAL	18,500	65.930	1,219,705.000	
ETSY INC	6,000	72.530	435,180.000	
TESLA INC	137,950	234.300	32,321,685.000	

SNOWFLAKE INC-CLASS A	12,600	161.850	2,039,310.000	
GEN DIGITAL INC	27,900	20.660	576,414.000	
UNITY SOFTWARE INC	11,300	29.200	329,960.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,402	91.760	679,207.520	
SYNOPSYS INC	7,400	534.780	3,957,372.000	
CHEWY INC - CLASS A	5,750	20.520	117,990.000	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	13,300	72.690	966,777.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	5,005	407.700	2,040,538.500	
VIATRIS INC	58,021	9.450	548,298.450	
DOORDASH INC - A	12,250	95.230	1,166,567.500	
ROBLOX CORP -CLASS A	20,300	37.910	769,573.000	
AIRBNB INC-CLASS A	19,900	127.150	2,530,285.000	
CBRE GROUP INC - A	15,000	78.140	1,172,100.000	
SOUTHERN CO/THE	52,700	69.770	3,676,879.000	
SYSCO CORP	24,500	70.890	1,736,805.000	
TRAVELERS COS INC/THE	11,203	171.820	1,924,899.460	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,900	59.570	172,753.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,300	57.990	307,347.000	
STEEL DYNAMICS INC	8,150	110.930	904,079.500	
SCHLUMBERGER LTD	68,952	52.850	3,644,113.200	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,400	32.620	241,388.000	
AT&T INC	345,891	15.900	5,499,666.900	
APA CORP	14,900	36.870	549,363.000	
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,950	24.810	172,429.500	
ON SEMICONDUCTOR CORP	20,900	70.030	1,463,627.000	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	10,400	45.910	477,464.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	11,900	270.280	3,216,332.000	
SEMPRA ENERGY	30,400	72.260	2,196,704.000	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	10,500	52.890	555,345.000	
CLARIVATE PLC	17,500	7.210	126,175.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	87,700	20.490	1,796,973.000	
UIPATH INC - CLASS A	17,500	18.270	319,725.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	8,850	75.880	671,538.000	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	8,100	99.050	802,305.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	43,900	154.620	6,787,818.000	
SALESFORCE.COM INC	46,966	221.220	10,389,818.520	
WESTROCK CO	12,400	37.910	470,084.000	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	19,209	86.840	1,668,109.560	

JOHNSON CONTROLS INTERNATION	33,234	52.240	1,736,144.160	
TERADYNE INC	7,500	92.090	690,675.000	
UNION PACIFIC CORP	29,480	219.210	6,462,310.800	
MARATHON OIL CORP	29,900	25.560	764,244.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	22,188	147.900	3,281,605.200	
RTX CORP	70,679	79.680	5,631,702.720	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	35,100	147.980	5,194,098.000	
IQVIA HOLDINGS INC	9,004	204.790	1,843,929.160	
AMEREN CORPORATION	12,700	77.120	979,424.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	44,966	536.290	24,114,816.140	
TOAST INC CLASS A	14,400	14.400	207,360.000	
VERISIGN INC	4,500	210.120	945,540.000	
LUCID GROUP INC	44,900	4.250	190,825.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	30,900	16.700	516,030.000	
ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	22,200	8.100	179,820.000	
VALERO ENERGY CORP	17,642	124.110	2,189,548.620	
ULTA BEAUTY INC	2,400	409.270	982,248.000	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	12,488	45.050	562,584.400	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,130	135.960	425,554.800	
ELEVANCE HEALTH INC	11,500	462.950	5,323,925.000	
WALT DISNEY CO/THE	88,362	94.150	8,319,282.300	
WELLS FARGO & CO	177,122	42.960	7,609,161.120	
WASTE MANAGEMENT INC	19,700	170.550	3,359,835.000	
WILLIAMS COS INC	58,900	35.430	2,086,827.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,300	202.610	1,073,833.000	
WHIRLPOOL CORP	2,700	112.490	303,723.000	
WALMART INC	71,600	155.350	11,123,060.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10,100	111.670	1,127,867.000	
WYNN RESORTS LTD	5,000	86.870	434,350.000	
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	97,400	3.310	322,394.000	
WABTEC CORP	8,711	115.510	1,006,207.610	
TJX COMPANIES INC	55,600	88.840	4,939,504.000	
WATERS CORP	2,900	261.880	759,452.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,500	218.020	545,050.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	35,500	21.220	753,310.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,063	242.030	1,225,397.890	
WESTERN DIGITAL CORP	15,500	46.620	722,610.000	

WEC ENERGY GROUP INC	15,300	81.740	1,250,622.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	24,100	63.750	1,536,375.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	78,250	249.560	19,528,070.000	
PPL CORP	35,700	26.090	931,413.000	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	15,724	121.690	1,913,453.560	
PULTEGROUP INC	10,850	88.300	958,055.000	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	111,853	10.710	1,197,945.630	
PPG INDUSTRIES INC	11,400	135.870	1,548,918.000	
NORTHERN TRUST CORP	10,100	75.380	761,338.000	
FERGUSON PLC	9,900	166.480	1,648,152.000	
NVIDIA CORP	119,480	492.980	58,901,250.400	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	19,313	130.260	2,515,711.380	
DRAFTKINGS INC CLASS A	21,600	38.370	828,792.000	
ASPEN TECHNOLOGY CORP	1,400	183.660	257,124.000	
TYSON FOODS INC-CL A	13,800	48.740	672,612.000	
NETFLIX INC	21,490	465.910	10,012,405.900	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	18,700	466.420	8,722,054.000	
NRG ENERGY INC	11,150	48.080	536,092.000	
GLOBE LIFE INC	4,255	118.300	503,366.500	
TEXTRON INC	9,800	77.400	758,520.000	
NEWS CORP - CLASS A	17,887	21.030	376,163.610	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	350	1,652.000	578,200.000	
OMNICOM GROUP	9,700	79.060	766,882.000	
JACOBS SOLUTIONS INC	6,120	135.320	828,158.400	
ORACLE CORP	78,833	115.360	9,094,174.880	
MASTERCARD INC - A	40,900	400.300	16,372,270.000	
ONEOK INC	21,600	66.630	1,439,208.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,200	524.720	2,728,544.000	
U HAUL NON VOTING SERIES N	4,600	53.150	244,490.000	
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	7,800	107.080	835,224.000	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	5,500	81.580	448,690.000	
HF SINCLAIR CORP	7,300	53.680	391,864.000	
OVINTIV INC	12,100	45.000	544,500.000	
YUM! BRANDS INC	13,600	127.660	1,736,176.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	8,200	154.390	1,265,998.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	9,200	59.380	546,296.000	
BANK OF AMERICA CORP	346,801	29.980	10,397,093.980	

TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,300	390.490	898,127.000	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,100	87.520	796,432.000	
AMERICAN EXPRESS CO	30,600	162.560	4,974,336.000	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	20,035	73.000	1,462,555.000	
LINDE PLC	23,746	407.880	9,685,518.480	
ANALOG DEVICES INC	24,191	183.050	4,428,162.550	
ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	15,400	21.010	323,554.000	
MONDAYCOM LTD	1,100	169.700	186,670.000	
ADVANCED MICRO DEVICES	77,927	120.620	9,399,554.740	
LIBERTY MEDIA LIBERTY SIRIUSXM COR	8,028	25.980	208,567.440	
LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER	9,600	63.860	613,056.000	
CONFLUENT INC CLASS A	8,500	19.010	161,585.000	
KENVUE INC	74,100	19.680	1,458,288.000	
GLOBAL E ONLINE LTD	4,700	30.520	143,444.000	
VERALTO CORP	11,316	70.990	803,322.840	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	34,972	64.480	2,254,994.560	
BUNGE GLOBAL LTD	7,300	106.800	779,640.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,700	94.200	725,340.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,100	105.540	1,171,494.000	
AVERY DENNISON CORP	3,930	189.960	746,542.800	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	24,500	69.530	1,703,485.000	
EMERSON ELECTRIC CO	27,600	89.270	2,463,852.000	
AON PLC-CLASS A	9,900	329.740	3,264,426.000	
AMGEN INC	25,800	265.390	6,847,062.000	
EATON CORP PLC	19,336	227.800	4,404,740.800	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,000	235.630	1,885,040.000	
APPLIED MATERIALS INC	40,600	148.590	6,032,754.000	
CME GROUP INC	17,400	213.420	3,713,508.000	
ECOLAB INC	12,400	184.350	2,285,940.000	
EQUIFAX INC	5,900	205.210	1,210,739.000	
GILEAD SCIENCES INC	60,300	75.450	4,549,635.000	
KEURIG DR PEPPER INC	44,100	31.730	1,399,293.000	
HORMEL FOODS CORP	14,500	32.520	471,540.000	
STATE STREET CORP	16,713	70.190	1,173,085.470	
SCHWAB (CHARLES) CORP	72,740	56.780	4,130,177.200	
BAXTER INTERNATIONAL INC	24,400	35.460	865,224.000	

CAMPBELL SOUP CO	9,400	40.880	384,272.000	
CROWN HOLDINGS INC	5,780	83.590	483,150.200	
CARDINAL HEALTH INC	12,300	103.390	1,271,697.000	
FEDEX CORP	11,500	255.950	2,943,425.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	18,454	107.680	1,987,126.720	
FMC CORP	6,050	53.650	324,582.500	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	12,313	73.940	910,423.220	
INTEL CORP	201,700	43.810	8,836,477.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	18,700	30.340	567,358.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	15,050	76.540	1,151,927.000	
WOLFSPEED INC	5,800	36.710	212,918.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	14,700	239.920	3,526,824.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	38,600	5.080	196,088.000	
ILLUMINA INC	7,600	94.320	716,832.000	
SEALED AIR CORP	6,700	33.300	223,110.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	17,000	305.280	5,189,760.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,850	142.360	690,446.000	
SNAP-ON INC	2,600	277.760	722,176.000	
CARMAX INC	7,700	63.970	492,569.000	
DUKE ENERGY CORP	37,328	90.010	3,359,893.280	
TARGET CORP	22,300	129.890	2,896,547.000	
DOVER CORP	6,800	137.790	936,972.000	
WW GRAINGER INC	2,200	802.200	1,764,840.000	
JABIL INC	6,800	131.390	893,452.000	
CINTAS CORP	4,400	547.970	2,411,068.000	
CONAGRA BRANDS INC	23,100	28.180	650,958.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	7,000	95.800	670,600.000	
CLOROX COMPANY	6,000	139.170	835,020.000	
ENTERGY CORP	10,200	99.110	1,010,922.000	
MICROSOFT CORP	341,600	369.850	126,340,760.000	
INCYTE CORP	9,200	54.270	499,284.000	
CVS HEALTH CORP	61,969	68.810	4,264,086.890	
MEDTRONIC PLC	64,298	74.760	4,806,918.480	
MICRON TECHNOLOGY INC	53,000	77.560	4,110,680.000	
BLACKROCK INC	7,200	716.860	5,161,392.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	30,500	27.800	847,900.000	
HASBRO INC	6,400	45.150	288,960.000	
KELLOGG CO	13,300	52.800	702,240.000	
KEYCORP	45,300	12.320	558,096.000	

	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	65,911	70.630	4,655,293.930	
	COOPER COS INC/THE	2,400	337.120	809,088.000	
	CHUBB LTD	19,999	222.630	4,452,377.370	
	ARROW ELECTRONICS INC	2,900	123.490	358,121.000	
	ALLSTATE CORP	12,700	134.190	1,704,213.000	
	EBAY INC	25,900	40.140	1,039,626.000	
	PAYPAL HOLDINGS INC	51,250	56.540	2,897,675.000	
	EASTMAN CHEMICAL CO	5,800	81.520	472,816.000	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	11,200	123.810	1,386,672.000	
	TRIMBLE INC	12,000	43.330	519,960.000	
	LENNAR CORP-A	12,200	127.490	1,555,378.000	
	LEAR CORP	2,900	134.190	389,151.000	
	PROGRESSIVE CORP	28,300	157.570	4,459,231.000	
	PACCAR INC	25,255	91.360	2,307,296.800	
	BIOGEN INC	7,000	228.000	1,596,000.000	
	IDEXX LABORATORIES INC	4,000	463.690	1,854,760.000	
	STARBUCKS CORP	55,400	105.570	5,848,578.000	
	PTC INC	5,400	153.940	831,276.000	
	EVERSOURCE ENERGY	16,900	58.510	988,819.000	
	INTUIT INC	13,480	560.160	7,550,956.800	
	BORGWARNER INC	11,400	34.420	392,388.000	
	BEST BUY CO INC	9,550	68.220	651,501.000	
	BALL CORP	15,204	52.360	796,081.440	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	69,497	54.340	3,776,466.980	
	ELECTRONIC ARTS INC	12,800	133.700	1,711,360.000	
	VULCAN MATERIALS CO	6,400	212.350	1,359,040.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,500	350.500	4,381,250.000	
	VF CORP	16,000	17.210	275,360.000	
	PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	27,125	13.190	357,778.750	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	2,500	84.300	210,750.000	
	CARNIVAL CORP	48,700	14.790	720,273.000	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	25,000	16.990	424,750.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	200,990	42.420	8,525,995.800	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,700	39.800	346,260.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	57,600	3.290	189,504.000	
アメリカ・ドル 小計				1,890,052,849.640 (283,413,424,803)	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	316,434	26.085	8,254,180.890	

HALEON PLC	264,482	3.268	864,459.410	
WISE PLC CLASS A	30,273	7.146	216,330.850	
BP PLC	818,883	4.777	3,911,804.090	
UNILEVER PLC	119,031	38.160	4,542,222.960	
BARCLAYS PLC	736,615	1.428	1,051,886.220	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	398,738	2.440	972,920.720	
PRUDENTIAL PLC	130,355	9.450	1,231,854.750	
NATWEST GROUP PLC	275,393	2.078	572,266.650	
JOHNSON MATTHEY PLC	8,388	15.240	127,833.120	
BAE SYSTEMS PLC	144,309	10.555	1,523,181.490	
AVIVA PLC	127,014	4.222	536,253.100	
GSK	193,876	14.106	2,734,814.850	
INFORMA PLC	66,343	7.490	496,909.070	
MELROSE INDUSTRIES PLC	70,266	5.220	366,788.520	
AUTO TRADER GROUP PLC	43,578	7.068	308,009.300	
DCC PLC	4,696	53.480	251,142.080	
OCADO GROUP PLC	27,677	5.606	155,157.260	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,502	89.400	313,078.800	
HALMA PLC	18,019	20.530	369,930.070	
ENTAIN PLC	30,469	8.558	260,753.700	
JD SPORTS FASHION PLC	123,236	1.387	170,989.950	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	35,703	4.905	175,123.210	
M&G PLC	104,504	2.052	214,442.200	
ENDEAVOUR MINING PLC	9,141	17.270	157,865.070	
RELX PLC	89,622	29.840	2,674,320.480	
DIAGEO PLC	106,361	28.095	2,988,212.290	
RIO TINTO PLC	53,307	54.460	2,903,099.220	
STANDARD CHARTERED PLC	112,254	6.600	740,876.400	
TESCO PLC	338,702	2.760	934,817.520	
SMITH & NEPHEW PLC	41,344	10.245	423,569.280	
GLENCORE PLC	497,895	4.676	2,328,405.960	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	16,956	7.256	123,032.730	
SMITHS GROUP PLC	16,614	16.525	274,546.350	
PEARSON PLC	30,619	9.524	291,615.350	
SAINSBURY (J) PLC	78,274	2.663	208,443.660	
NEXT PLC	5,620	77.140	433,526.800	
TAYLOR WIMPEY PLC	167,629	1.257	210,709.650	
WHITBREAD PLC	9,218	33.420	308,065.560	
BUNZL PLC	15,999	29.450	471,170.550	

VODAFONE GROUP PLC	1,145,592	0.750	859,766.790	
CRODA INTERNATIONAL PLC	6,627	45.980	304,709.460	
KINGFISHER PLC	85,779	2.332	200,036.620	
WPP PLC	50,889	7.130	362,838.570	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	32,280	10.840	349,915.200	
SEVERN TRENT PLC	11,946	26.970	322,183.620	
RENTOKIL INITIAL PLC	119,317	4.637	553,272.920	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	33,978	53.960	1,833,452.880	
ST JAMES'S PLACE PLC	26,055	6.874	179,102.070	
SCHRODERS PLC	39,815	4.071	162,086.860	
SSE PLC	51,622	17.950	926,614.900	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	46,260	4.840	223,898.400	
ASTRAZENECA PLC	73,382	102.600	7,528,993.200	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	283,052	2.296	649,887.390	
3I GROUP PLC	46,084	21.710	1,000,483.640	
ASHTEAD GROUP PLC	20,746	52.440	1,087,920.240	
SAGE GROUP PLC/THE	48,536	9.844	477,788.380	
NATIONAL GRID PLC	174,349	10.160	1,771,385.840	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,016,079	0.433	1,308,224.260	
IMPERIAL BRANDS PLC	40,812	18.520	755,838.240	
CRH PLC	33,942	48.200	1,636,004.400	
CENTRICA PLC	279,988	1.517	424,881.790	
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	4,918	45.210	222,342.780	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	100,593	25.215	2,536,452.490	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,469	23.800	391,962.200	
HSBC HOLDINGS PLC	934,951	6.154	5,753,688.450	
ANGLO AMERICAN PLC	60,164	22.340	1,344,063.760	
MONDI PLC	22,986	13.910	319,735.260	
COMPASS GROUP PLC	82,031	20.920	1,716,088.520	
PERSIMMON PLC	15,188	12.400	188,331.200	
BT GROUP PLC	345,300	1.189	410,561.700	
COCA-COLA HBC AG-DI	10,136	21.170	214,579.120	
BURBERRY GROUP PLC	17,870	15.645	279,576.150	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	8,005	60.960	487,984.800	
INTERTEK GROUP PLC	7,660	38.090	291,769.400	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	18,886	85.500	1,614,753.000	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,866	17.605	138,480.930	
ADMIRAL GROUP PLC	9,779	25.990	254,156.210	

	ANTOFAGASTA PLC	18,717	13.790	258,107.430	
	ABRDN PLC	90,862	1.722	156,464.360	
	EXPERIAN PLC	43,565	29.330	1,277,761.450	
イギリス・ポンド 小計				85,870,755.010 (16,031,211,252)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	64,314	18.160	1,167,942.240	
	AZRIELI GROUP LTD	2,207	195.000	430,365.000	
	ICL GROUP LTD	38,090	19.250	733,232.500	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,383	742.000	1,026,186.000	
	BANK HAPOALIM BM	66,050	30.020	1,982,821.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	79,801	26.870	2,144,252.870	
	NICE LTD	3,290	721.500	2,373,735.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,029	130.000	1,043,770.000	
イスラエル・シュケル 小計				10,902,304.610 (439,673,591)	
オーストラリア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	100,640	4.560	458,918.400	
	TELSTRA GROUP LTD	182,347	3.840	700,212.480	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	135,560	24.070	3,262,929.200	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	124,781	3.550	442,972.550	
	BHP GROUP LTD	228,501	46.610	10,650,431.610	
	SOUTH32 LTD	205,649	3.170	651,907.330	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	85,646	31.400	2,689,284.400	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	76,385	25.220	1,926,429.700	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	141,629	27.730	3,927,372.170	
	WESTPAC BANKING CORP	158,275	21.100	3,339,602.500	
	SANTOS LTD	144,925	6.990	1,013,025.750	
	RIO TINTO LTD	16,744	125.620	2,103,381.280	
	ORIGIN ENERGY LTD	75,281	8.600	647,416.600	
	AURIZON HOLDINGS LTD	83,843	3.640	305,188.520	
	PILBARA MINERALS LTD	122,421	3.560	435,818.760	
	XERO LTD	6,482	101.240	656,237.680	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	10,388	33.480	347,790.240	
	COLES GROUP LTD	60,347	15.420	930,550.740	
	WISETECH GLOBAL LTD	7,381	67.250	496,372.250	
	IDP EDUCATION LTD	11,169	23.790	265,710.510	
	IGO LTD	30,405	8.900	270,604.500	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	51,949	11.760	610,920.240	
	REECE LTD	10,500	19.450	204,225.000	

	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	64,915	4.920	319,381.800	
	SEEK LTD	16,268	23.180	377,092.240	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	30,976	10.610	328,655.360	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	75,526	102.470	7,739,149.220	
	AMPOL LTD	10,454	33.550	350,731.700	
	ORICA LTD	19,499	15.750	307,109.250	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	67,299	15.020	1,010,830.980	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	54,970	35.320	1,941,540.400	
	QANTAS AIRWAYS LTD	39,082	5.240	204,789.680	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	19,914	48.110	958,062.540	
	MACQUARIE GROUP LTD	16,561	167.420	2,772,642.620	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	26,526	40.230	1,067,140.980	
	CSL LTD	21,758	258.610	5,626,836.380	
	WESFARMERS LTD	51,174	53.000	2,712,222.000	
	COCHLEAR LTD	2,968	259.750	770,938.000	
	BLUESCOPE STEEL LTD	20,666	20.440	422,413.040	
	SUNCORP GROUP LTD	57,284	13.360	765,314.240	
	ASX LTD	8,754	57.130	500,116.020	
	COMPUTERSHARE LTD	25,169	23.650	595,246.850	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	110,468	5.860	647,342.480	
	SONIC HEALTHCARE LTD	19,599	29.480	577,778.520	
	BRAMBLES LTD	62,638	13.170	824,942.460	
	MINERAL RESOURCES LTD	7,602	63.460	482,422.920	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	8,291	51.600	427,815.600	
	REA GROUP LTD	2,395	158.410	379,391.950	
オーストラリア・ドル 小計				68,447,209.640 (6,678,394,244)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	35,800	78.240	2,800,992.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	16,181	46.060	745,296.860	
	IMPERIAL OIL LTD	9,500	79.110	751,545.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	900	3,154.170	2,838,753.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	13,587	97.530	1,325,140.110	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	20,900	62.710	1,310,639.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	8,150	209.040	1,703,676.000	
	BCE INC	4,930	54.190	267,156.700	
	FRANCO-NEVADA CORP	8,800	165.160	1,453,408.000	
	SUNCOR ENERGY INC	60,630	46.330	2,808,987.900	

METRO INC/CN	10,700	70.160	750,712.000	
NATIONAL BANK OF CANADA	15,500	91.340	1,415,770.000	
BANK OF NOVA SCOTIA	54,800	61.090	3,347,732.000	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	41,700	54.220	2,260,974.000	
TORONTO-DOMINION BANK	84,600	84.780	7,172,388.000	
GREAT-WEST LIFECO INC	12,500	42.710	533,875.000	
ROYAL BANK OF CANADA	63,750	120.490	7,681,237.500	
TOURMALINE OIL CORP	14,800	66.340	981,832.000	
TC ENERGY CORP	46,850	50.340	2,358,429.000	
PEMBINA PIPELINE CORP	25,329	44.470	1,126,380.630	
BARRICK GOLD CORP	80,700	21.550	1,739,085.000	
CAE INC	14,200	28.840	409,528.000	
THOMSON REUTERS CORP	7,241	188.360	1,363,914.760	
EMPIRE CO LTD 'A'	7,100	38.610	274,131.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,500	104.900	367,150.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	6,950	58.280	405,046.000	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	17,600	20.900	367,840.000	
HYDRO ONE LTD	15,200	38.370	583,224.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	7,360	121.760	896,153.600	
STANTEC INC	5,800	96.440	559,352.000	
NORTHLAND POWER INC	11,200	22.520	252,224.000	
WSP GLOBAL INC	5,700	190.240	1,084,368.000	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,700	113.730	420,801.000	
PARKLAND CORP	6,600	43.590	287,694.000	
QUEBECOR INC -CL B	6,800	30.990	210,732.000	
EMERA INC	12,600	49.090	618,534.000	
TFI INTERNATIONAL INC	3,500	155.360	543,760.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	6,100	31.280	190,808.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	16,300	58.670	956,321.000	
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,600	102.830	164,528.000	
IVANHOE MINES LTD-CL A	26,700	11.010	293,967.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	22,617	66.370	1,501,090.290	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	29,300	8.180	239,674.000	
AIR CANADA	7,600	17.890	135,964.000	
KINROSS GOLD CORP	56,100	7.300	409,530.000	
BANK OF MONTREAL	32,800	112.030	3,674,584.000	
POWER CORP OF CANADA	26,600	36.630	974,358.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	55,200	93.870	5,181,624.000	
NUTRIEN LTD	23,119	77.570	1,793,340.830	

	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,300	35.600	224,280.000	
	CAMECO CORP	20,000	61.190	1,223,800.000	
	FIRSTSERVICE CORP	1,800	209.780	377,604.000	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	10,800	41.360	446,688.000	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,600	26.940	70,044.000	
	TELUS CORP	10,800	24.220	261,576.000	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	20,900	49.400	1,032,460.000	
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,400	147.820	354,768.000	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	50,900	91.280	4,646,152.000	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,000	1,198.560	1,198,560.000	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	12,500	76.890	961,125.000	
	WESTON (GEORGE) LTD	3,137	164.440	515,848.280	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	17,000	19.640	333,880.000	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	3,800	111.240	422,712.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	27,000	69.480	1,875,960.000	
	ENBRIDGE INC	93,100	46.220	4,303,082.000	
	BROOKFIELD CORP	64,725	46.450	3,006,476.250	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	84,600	26.290	2,224,134.000	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	42,820	98.390	4,213,059.800	
	IA FINANCIAL CORP INC	4,700	87.330	410,451.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	8,300	48.970	406,451.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	25,950	158.140	4,103,733.000	
	CGI INC - CLASS A	9,700	138.890	1,347,233.000	
	ONEX CORPORATION	3,200	88.640	283,648.000	
	IGM FINANCIAL INC	3,600	33.840	121,824.000	
	TMX GROUP LTD	12,500	28.980	362,250.000	
	OPEN TEXT CORP	12,100	53.140	642,994.000	
	SAPUTO INC	11,700	27.010	316,017.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	27,100	15.310	414,901.000	
	FORTIS INC	22,300	56.460	1,259,058.000	
	RB GLOBAL INC	8,400	84.480	709,632.000	
	LUNDIN MINING CORP	30,400	8.980	272,992.000	
	CENOVUS ENERGY INC	65,900	24.800	1,634,320.000	
	DOLLARAMA INC	12,800	98.570	1,261,696.000	
	ALTAGAS LTD	13,000	27.500	357,500.000	
	KEYERA CORP	10,200	32.140	327,828.000	
	ARC RESOURCES LTD	28,600	21.400	612,040.000	
カナダ・ドル 小計				112,071,028.510 (12,243,759,866)	

シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	135,300	3.090	418,077.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	65,700	27.350	1,796,895.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	94,200	32.690	3,079,398.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,375	6.240	482,820.000	
	KEPPEL CORP LTD	75,700	6.470	489,779.000	
	UOL GROUP LTD	22,900	6.150	140,835.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	24,600	6.180	152,028.000	
	SEATRIUM	2,306,022	0.107	246,744.350	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,100	29.770	151,827.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	176,100	12.970	2,284,017.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	314,400	0.935	293,964.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	429,350	2.330	1,000,385.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	81,200	3.870	314,244.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	46,500	5.090	236,685.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	44,600	9.540	425,484.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	99,900	3.680	367,632.000	
シンガポール・ドル 小計				11,880,814.850 (1,325,542,512)	
スイス・フラン	SANDOZ GROUP AG	18,940	25.540	483,727.600	
	AVOLTA AG	4,854	31.690	153,823.260	
	UBS GROUP AG-REG	152,627	23.140	3,531,788.780	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,447	253.000	366,091.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	326	620.000	202,120.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	7,458	41.300	308,015.400	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	32,581	237.600	7,741,245.600	
	SIKA AG-REG	6,789	235.400	1,598,130.600	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	108,400.000	542,000.000	
	ABB LTD-REG	74,342	33.780	2,511,272.760	
	SWISS RE AG	13,988	99.980	1,398,520.240	
	NESTLE SA-REG	123,371	98.990	12,212,495.290	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,052	1,126.000	1,184,552.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,893	193.200	365,727.600	
	JULIUS BAER GROUP LTD	9,536	55.720	531,345.920	
	SGS SA-REG	6,925	73.800	511,065.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,091	185.500	202,380.500	
	TEMENOS AG - REG	2,973	69.320	206,088.360	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	1,828	123.600	225,940.800	
	VAT GROUP AG	1,255	378.600	475,143.000	

	BKW AG	942	155.900	146,857.800	
	ALCON INC	23,173	62.480	1,447,849.040	
	SIG GROUP N AG	14,178	20.960	297,170.880	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,342	236.000	316,712.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,977	437.000	3,048,949.000	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,134	131.300	280,194.200	
	CLARIANT AG-REG	9,678	13.350	129,201.300	
	NOVARTIS AG-REG	94,701	84.100	7,964,354.100	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	159	1,485.000	236,115.000	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,575	71.600	112,770.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	24,207	112.600	2,725,708.200	
	SWISSCOM AG-REG	1,201	509.000	611,309.000	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,344	101.600	136,550.400	
	GEBERIT AG-REG	1,559	476.400	742,707.600	
	GIVAUDAN-REG	428	3,229.000	1,382,012.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	5,176	119.950	620,861.200	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,415	232.100	560,521.500	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	7,619	75.540	575,539.260	
	LONZA GROUP AG-REG	3,453	355.000	1,225,815.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,269	44.750	101,537.750	
	HOLCIM LTD	24,669	61.760	1,523,557.440	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,372	577.600	792,467.200	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,519	246.400	620,681.600	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,575	85.000	303,875.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	44	10,850.000	477,400.000	
スイス・フラン 小計				61,132,190.180 (10,344,789,223)	
スウェーデン・クローナ	SAGAX CLASS B	10,255	232.900	2,388,389.500	
	VOLVO CAR CLASS B	28,514	36.290	1,034,773.060	
	ERICSSON LM-B SHS	152,246	52.210	7,948,763.660	
	VOLVO AB-B SHS	78,458	232.700	18,257,176.600	
	SKF AB-B SHARES	17,719	190.000	3,366,610.000	
	TELE2 AB-B SHS	26,333	81.400	2,143,506.200	
	GETINGE AB-B SHS	11,892	219.200	2,606,726.400	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	82,504	126.200	10,412,004.800	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	75,834	98.500	7,469,649.000	
	SWEDBANK AB - A SHARES	43,333	184.350	7,988,438.550	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	34,946	167.840	5,865,336.640	

	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	31,500	161.700	5,093,550.000	
	SKANSKA AB-B SHS	17,689	166.600	2,946,987.400	
	SANDVIK AB	55,435	202.300	11,214,500.500	
	INVESTOR AB-B SHS	89,989	211.350	19,019,175.150	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	139,653	159.100	22,218,792.300	
	VOLVO AB-A SHS	10,411	239.400	2,492,393.400	
	HOLMEN AB-B SHARES	4,877	429.800	2,096,134.600	
	SECURITAS AB-B SHS	25,570	89.880	2,298,231.600	
	TELIA CO AB	122,866	24.160	2,968,442.560	
	ALFA LAVAL AB	15,043	381.500	5,738,904.500	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	81,153	136.800	11,101,730.400	
	ASSA ABLOY AB-B	52,111	263.500	13,731,248.500	
	SAAB AB-B	3,943	555.800	2,191,519.400	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	6,768	304.300	2,059,502.400	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	30,192	61.880	1,868,280.960	
	INDUTRADE AB	13,454	225.600	3,035,222.400	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	10,125	242.800	2,458,350.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,951	480.000	1,896,480.000	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,843	220.000	1,505,460.000	
	LIFCO AB-B SHS	12,120	226.100	2,740,332.000	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	78,793	65.400	5,153,062.200	
	BEIJER REF AB	20,012	121.100	2,423,453.200	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	31,669	255.500	8,091,429.500	
	BOLIDEN AB	14,220	294.800	4,192,056.000	
	EPIROC AB-A	34,263	191.550	6,563,077.650	
	EPIROC AB-B	19,202	161.900	3,108,803.800	
	HUSQVARNA AB-B SHS	19,395	78.640	1,525,222.800	
	NORDEA BANK ABP	167,488	120.400	20,165,555.200	
	EQT AB	18,489	247.600	4,577,876.400	
	EVOLUTION AB	9,528	1,068.200	10,177,809.600	
	HEXAGON AB-B SHS	107,944	101.850	10,994,096.400	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,028	304.000	2,440,512.000	
スウェーデン・クローナ 小計				267,569,567.230 (3,812,866,333)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	164,716	694.300	114,362,318.800	
	DANSKE BANK A/S	35,861	177.400	6,361,741.400	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	153	10,210.000	1,562,130.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	52,505	177.640	9,326,988.200	

	CARLSBERG AS-B	5,120	848.600	4,344,832.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	10,634	360.000	3,828,240.000	
	COLOPLAST-B	6,177	745.400	4,604,335.800	
	DSV PANALPINA A/S	9,678	1,085.000	10,500,630.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	426	1,655.500	705,243.000	
	DEMANT A/S	5,239	275.300	1,442,296.700	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	252	10,310.000	2,598,120.000	
	TRYG A/S	17,729	143.050	2,536,133.450	
	PANDORA A/S	4,341	921.400	3,999,797.400	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,484	547.200	3,000,844.800	
	GENMAB A/S	3,433	2,217.000	7,610,961.000	
	ORSTED A/S	9,835	312.800	3,076,388.000	
デンマーク・クローネ 小計				179,861,000.550 (3,944,351,742)	
ニュージーランド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	67,152	5.000	335,760.000	
	MERCURY NZ LTD	34,143	6.050	206,565.150	
	EBOS GROUP LTD	7,660	38.600	295,676.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	92,147	5.025	463,038.670	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	65,088	7.730	503,130.240	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	30,125	21.970	661,846.250	
ニュージーランド・ドル 小計				2,466,016.310 (221,842,828)	
ノルウェー・クローネ	DNB BANK	48,122	203.500	9,792,827.000	
	NORSK HYDRO ASA	68,982	64.900	4,476,931.800	
	ORKLA ASA	39,050	77.860	3,040,433.000	
	TELENOR ASA	36,380	113.150	4,116,397.000	
	EQUINOR ASA	46,908	349.000	16,370,892.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	8,608	373.100	3,211,644.800	
	MOWI ASA	22,853	186.350	4,258,656.550	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	10,398	176.700	1,837,326.600	
	AKER BP ASA	16,430	307.800	5,057,154.000	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	4,573	466.800	2,134,676.400	
	SALMAR ASA	3,573	576.000	2,058,048.000	
	ADEVINTA ASA	13,944	108.900	1,518,501.600	
ノルウェー・クローネ 小計				57,873,488.750 (802,705,288)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	38,360	23.970	919,489.200	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	23,124	29.190	674,989.560	

EXOR NV	5,095	86.360	440,004.200	
DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	5,338	90.920	485,330.960	
CORPORACION ACCIONA ENERGIAS RENOV	2,938	27.140	79,737.320	
DSM FIRMENICH AG	8,774	91.880	806,155.120	
FERROVIAL	24,640	30.260	745,606.400	
LOTUS BAKERIES NV	21	7,530.000	158,130.000	
BAYER AG-REG	46,056	41.450	1,909,021.200	
EVONIK INDUSTRIES AG	9,486	18.495	175,443.570	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	90,946	11.172	1,016,048.710	
COMMERZBANK AG	49,895	11.185	558,075.570	
VOLKSWAGEN AG	1,304	120.850	157,588.400	
VOLKSWAGEN AG-PREF	9,657	108.840	1,051,067.880	
SIEMENS AG-REG	35,631	148.460	5,289,778.260	
E.ON SE	105,252	11.555	1,216,186.860	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	14,909	95.200	1,419,336.800	
GEA GROUP AG	7,218	34.980	252,485.640	
CONTINENTAL AG	5,168	68.860	355,868.480	
BASF SE	41,885	44.285	1,854,877.220	
ALLIANZ SE-REG	18,907	228.500	4,320,249.500	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	7,926	71.280	564,965.280	
RHEINMETALL AG	2,042	279.100	569,922.200	
RWE AG	29,664	38.340	1,137,317.760	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27,029	7.999	216,204.970	
BRENNTAG SE	6,969	76.260	531,455.940	
FRESENIUS SE & CO KGAA	19,800	27.320	540,936.000	
SAP SE	48,954	137.220	6,717,467.880	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,379	377.900	2,410,624.100	
ZALANDO SE	10,553	23.060	243,352.180	
HEIDELBERG MATERIALS AG	6,804	71.280	484,989.120	
COVESTRO AG	9,078	48.000	435,744.000	
RATIONAL AG	242	609.000	147,378.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,210	273.800	331,298.000	
TALANX AG	3,119	63.950	199,460.050	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	7,194	46.150	332,003.100	
DELIVERY HERO SE	8,246	32.895	271,252.170	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,894	86.620	164,058.280	
BECHTLE AG	3,626	47.130	170,893.380	

NEMETSCHEK SE	2,557	79.380	202,974.660	
SCOUT24 AG	3,600	63.160	227,376.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	13,218	50.040	661,428.720	
KNORR-BREMSE AG	3,413	55.720	190,172.360	
HELLOFRESH SE	7,177	16.030	115,047.310	
SIEMENS ENERGY AG	23,742	11.680	277,306.560	
BEIERSDORF AG	4,725	124.650	588,971.250	
MERCK KGAA	6,059	156.950	950,960.050	
ADIDAS AG	7,575	179.640	1,360,773.000	
PUMA SE	4,969	52.900	262,860.100	
HENKEL AG & CO KGAA	4,883	62.880	307,043.040	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	151,948	21.555	3,275,239.140	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	9,650	35.840	345,856.000	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	38,764	58.600	2,271,570.400	
QIAGEN N.V.	10,690	36.080	385,695.200	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	61,222	33.580	2,055,834.760	
HANNOVER RUECK SE	2,826	208.900	590,351.400	
DHL GROUP	46,385	40.515	1,879,288.270	
DEUTSCHE BOERSE AG	8,907	168.750	1,503,056.250	
MTU AERO ENGINES AG	2,524	186.000	469,464.000	
WACKER CHEMIE AG	899	120.800	108,599.200	
SYMRISE AG	6,224	97.040	603,976.960	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	41,312	2.348	97,000.570	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	2,686	87.000	233,682.000	
VONOVIA SE	34,542	25.190	870,112.980	
LEG IMMOBILIEN SE	3,501	70.580	247,100.580	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	43,515	19.388	843,668.820	
NN GROUP NV	12,086	32.080	387,718.880	
ARCELORMITTAL	25,700	21.925	563,472.500	
HEINEKEN NV	13,649	83.220	1,135,869.780	
AEGON LTD	77,429	4.963	384,280.120	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	46,015	26.625	1,225,149.370	
AKZO NOBEL N.V.	7,841	68.840	539,774.440	
WOLTERS KLUWER	12,073	122.500	1,478,942.500	
ING GROEP NV	169,586	12.754	2,162,899.840	
KONINKLIJKE KPN NV	151,671	3.167	480,342.050	
ASML HOLDING NV	18,899	628.700	11,881,801.300	
ABN AMRO BANK NV-CVA	18,975	12.695	240,887.620	
IMCD NV	2,678	134.300	359,655.400	

BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	4,008	119.800	480,158.400	
ASR NEDERLAND NV	8,311	36.800	305,844.800	
ADYEN NV	1,018	1,037.600	1,056,276.800	
PROSUS NV	78,572	30.240	2,376,017.280	
JDE PEET'S NV	5,785	25.560	147,864.600	
ASM INTERNATIONAL NV	2,201	465.400	1,024,345.400	
RANDSTAD NV	5,275	53.500	282,212.500	
HEINEKEN HOLDING NV	6,143	71.000	436,153.000	
OCI NV	4,987	21.230	105,874.010	
TOTALENERGIES SE	109,487	61.810	6,767,391.470	
MICHELIN (CGDE)	31,804	29.650	942,988.600	
AIR LIQUIDE SA	24,554	170.260	4,180,564.040	
KERING	3,490	404.300	1,411,007.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	25,520	166.020	4,236,830.400	
BOUYGUES SA	9,572	34.830	333,392.760	
BNP PARIBAS	50,023	56.730	2,837,804.790	
THALES SA	4,927	138.150	680,665.050	
DANONE	30,195	57.540	1,737,420.300	
CARREFOUR SA	28,025	17.015	476,845.370	
VIVENDI	31,166	8.794	274,073.800	
L'OREAL	11,309	423.950	4,794,450.550	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	22,086	58.370	1,289,159.820	
LEGRAND SA	12,508	87.560	1,095,200.480	
PERNOD RICARD SA	9,578	167.350	1,602,878.300	
EURAZEO SE	1,981	59.050	116,978.050	
SOCIETE GENERALE SA	35,528	22.605	803,110.440	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	12,945	711.600	9,211,662.000	
ACCOR SA	8,355	31.370	262,096.350	
CAPGEMINI SE	7,730	177.900	1,375,167.000	
VALEO SA	9,148	13.495	123,452.260	
PUBLICIS GROUPE	10,730	73.900	792,947.000	
BUREAU VERITAS SA	13,862	22.120	306,627.440	
EIFFAGE	3,675	90.740	333,469.500	
SODEXO SA	4,157	101.350	421,311.950	
IPSEN	1,706	107.300	183,053.800	
AMUNDI SA	2,888	55.600	160,572.800	
TELEPERFORMANCE	2,771	135.100	374,362.100	
EURONEXT NV	3,876	73.350	284,304.600	
EUROFINS SCIENTIFIC	6,342	52.640	333,842.880	

SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,302	200.200	260,660.400	
SEB SA	1,182	101.300	119,736.600	
ESSILORLUXOTTICA	13,842	179.380	2,482,977.960	
DASSAULT AVIATION SA	1,108	187.600	207,860.800	
WORLDLINE SA	11,265	13.745	154,837.420	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	4,944	32.620	161,273.280	
AXA SA	86,016	28.385	2,441,564.160	
EDENRED	11,699	50.020	585,183.980	
RENAULT SA	9,048	35.560	321,746.880	
HERMES INTERNATIONAL	1,485	1,924.600	2,858,031.000	
STMICROELECTRONICS NV	32,041	41.925	1,343,318.920	
REMY COINTREAU	1,009	112.750	113,764.750	
DASSAULT SYSTEMES SE	31,420	42.050	1,321,211.000	
WENDEL	1,124	73.850	83,007.400	
ORANGE	87,788	11.076	972,339.880	
ALSTOM	14,107	12.365	174,433.050	
SANOFI	53,273	85.890	4,575,617.970	
VINCI SA	24,919	109.380	2,725,640.220	
AIRBUS SE	27,790	132.260	3,675,505.400	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	31,858	28.070	894,254.060	
CREDIT AGRICOLE SA	56,733	11.766	667,520.470	
BIOMERIEUX	1,852	95.860	177,532.720	
ENGIE	85,625	15.600	1,335,750.000	
SAFRAN SA	16,024	160.560	2,572,813.440	
ARKEMA	2,829	93.280	263,889.120	
ADP	1,343	115.800	155,519.400	
GETLINK SE	19,411	16.290	316,205.190	
BOLLORE	39,141	5.320	208,230.120	
UCB SA	5,940	68.520	407,008.800	
KBC GROUP NV	11,734	53.240	624,718.160	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,383	72.520	317,855.160	
SOLVAY SA	3,489	103.350	360,588.150	
UMICORE	9,840	23.290	229,173.600	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	40,720	56.230	2,289,685.600	
AGEAS	7,499	38.480	288,561.520	
D'IETEREN GROUP	1,036	155.800	161,408.800	
ELIA GROUP SA/NV	1,462	102.200	149,416.400	
SOFINA	670	200.200	134,134.000	
ARGENX SE	2,624	452.300	1,186,835.200	

PRYSMIAN SPA	12,378	35.760	442,637.280	
ASSICURAZIONI GENERALI	48,878	19.460	951,165.880	
MEDIOBANCA SPA	26,230	11.765	308,595.950	
TENARIS SA	22,187	15.665	347,559.350	
UNICREDIT SPA	86,265	25.035	2,159,644.270	
TELECOM ITALIA SPA	434,374	0.259	112,589.740	
INTESA SANPAOLO	721,438	2.684	1,936,700.310	
POSTE ITALIANE SPA	24,593	10.170	250,110.810	
MONCLER SPA	9,654	50.440	486,947.760	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	4,912	45.180	221,924.160	
ENI SPA	110,008	15.012	1,651,440.090	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	24,606	10.275	252,826.650	
DIASORIN SPA	1,144	88.760	101,541.440	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,810	10.700	169,167.000	
NEXI SPA	27,866	6.922	192,888.450	
AMPLIFON SPA	5,632	27.520	154,992.640	
ENEL SPA	381,294	6.405	2,442,188.070	
SNAM SPA	94,744	4.498	426,158.510	
TERNA SPA	65,948	7.520	495,928.960	
CNH INDUSTRIAL NV	47,963	9.368	449,317.380	
FINECOBANK SPA	28,693	12.300	352,923.900	
STELLANTIS NV	103,531	18.470	1,912,217.570	
FERRARI NV	5,909	329.600	1,947,606.400	
TELEFONICA SA	242,511	3.753	910,143.780	
ENDESA SA	14,367	19.590	281,449.530	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	279,358	8.284	2,314,201.670	
IBERDROLA SA	285,848	11.070	3,164,337.360	
REPSOL SA	60,600	13.795	835,977.000	
GRIFOLS SA	14,039	12.660	177,733.740	
BANCO SANTANDER SA	757,556	3.723	2,820,759.760	
AMADEUS IT GROUP SA	21,119	62.580	1,321,627.020	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,300	26.980	277,894.000	
CAIXABANK SA	195,084	4.049	789,895.110	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	10,306	35.890	369,882.340	
AENA SME SA	3,515	153.050	537,970.750	
CELLNEX TELECOM SA	26,497	32.530	861,947.410	
ACCIONA SA	1,117	129.100	144,204.700	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	51,138	35.660	1,823,581.080	
ENAGAS SA	11,714	16.170	189,415.380	

	RED ELECTRICA CORPORACION SA	19,067	15.110	288,102.370	
	UPM-KYMMENE OYJ	25,022	33.000	825,726.000	
	NOKIA OYJ	251,161	3.270	821,422.050	
	WARTSILA OYJ ABP	22,236	11.885	264,274.860	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	26,320	12.175	320,446.000	
	ELISA OYJ	6,414	41.920	268,874.880	
	SAMPO OYJ-A SHS	21,514	38.840	835,603.760	
	FORTUM OYJ	21,078	12.675	267,163.650	
	KESKO OYJ-B SHS	12,355	17.140	211,764.700	
	KONE OYJ-B	15,931	41.320	658,268.920	
	NESTE OYJ	19,834	34.480	683,876.320	
	ORION OYJ-CLASS B	4,846	37.630	182,354.980	
	METSO CORPORATION	31,351	9.054	283,851.950	
	VERBUND AG	3,205	85.350	273,546.750	
	OMV AG	6,920	40.830	282,543.600	
	ERSTE GROUP BANK AG	16,116	35.900	578,564.400	
	VOESTALPINE AG	5,480	26.200	143,576.000	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	12,188	31.750	386,969.000	
	AIB GROUP PLC	67,931	4.192	284,766.750	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	49,516	8.592	425,441.470	
	KINGSPAN GROUP PLC	7,249	69.040	500,470.960	
	JERONIMO MARTINS	13,330	21.760	290,060.800	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	148,083	4.279	633,647.150	
	GALP ENERGIA SGPS SA	23,118	13.465	311,283.870	
	EDP RENOVAVEIS SA	14,554	16.325	237,594.050	
	KERRY GROUP PLC-A	7,471	72.860	544,337.060	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	8,275	145.000	1,199,875.000	
ユーロ 小計				218,991,685.810 (35,813,900,297)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	72,000	39.800	2,865,600.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	114,000	43.100	4,913,400.000	
	MTR CORP	81,000	29.600	2,397,600.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	75,500	78.650	5,938,075.000	
	SINO LAND CO	182,000	8.080	1,470,560.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	139,669	40.200	5,614,693.800	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	24,000	50.100	1,202,400.000	
	CLP HOLDINGS LTD	85,500	59.550	5,091,525.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	75,507	21.850	1,649,827.950	
	HONG KONG & CHINA GAS	582,475	5.510	3,209,437.250	

	HANG SENG BANK LTD	39,800	89.400	3,558,120.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	79,500	15.260	1,213,170.000	
	WH GROUP LTD	433,500	4.690	2,033,115.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	62,600	285.400	17,866,040.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	97,000	11.020	1,068,940.000	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	87,000	9.390	816,930.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	60,800	15.260	927,808.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	102,669	38.400	3,942,489.600	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	30,000	38.200	1,146,000.000	
	AIA GROUP LTD	600,600	72.900	43,783,740.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	64,000	12.260	784,640.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	87,000	26.500	2,305,500.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	89,500	15.220	1,362,190.000	
	ESR CAYMAN LTD	113,800	10.080	1,147,104.000	
	SANDS CHINA LTD	126,400	21.400	2,704,960.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	71,500	81.150	5,802,225.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	192,500	21.300	4,100,250.000	
香港・ドル 小計				128,916,340.600 (2,479,061,230)	
合計				377,551,523,209 [377,551,523,209]	

(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	6,937	1,172,630.480	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	15,807	1,923,395.760	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,200	396,576.000	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	5,200	1,215,292.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	17,400	964,482.000	
		EQUINIX INC	4,508	3,492,077.120	
		AMERICAN TOWER CORP	22,500	4,449,150.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	34,443	594,486.180	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	15,700	567,084.000	
		KIMCO REALTY CORP	30,000	564,000.000	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	18,500	263,625.000	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	12,700	576,707.000	
		INVITATION HOMES INC	29,600	992,488.000	
		VICI PROPERTIES INC	48,600	1,388,988.000	

		VENTAS INC	19,400	864,076.000	
		WEYERHAEUSER CO	35,414	1,130,414.880	
		CROWN CASTLE INTL CORP	21,000	2,182,320.000	
		IRON MOUNTAIN INC	14,100	877,443.000	
		SUN COMMUNITIES INC	6,000	736,200.000	
		PROLOGIS INC	44,654	4,915,065.780	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,900	819,388.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	5,200	454,220.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,100	654,162.000	
		WELLTOWER INC	24,000	2,099,760.000	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	26,500	436,455.000	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,600	679,952.000	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,600	598,044.000	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	23,900	425,659.000	
		REALTY INCOME CORP	32,595	1,724,601.450	
		PUBLIC STORAGE	7,700	1,984,290.000	
		REGENCY CENTERS CORP	8,100	500,580.000	
		UDR INC	15,100	495,582.000	
		WP CAREY INC	10,300	582,362.000	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	14,100	1,896,873.000	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,500	1,346,730.000	
	アメリカ・ドル 小計			43,965,159.650 (6,592,575,690)	
	イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	33,482	218,771.380	
		SEGRO PLC	55,182	453,816.760	
	イギリス・ポンド 小計			672,588.140 (125,565,480)	
	オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	48,731	348,426.650	
		LENDLEASE GROUP	31,401	215,096.850	
		TRANSURBAN GROUP	138,948	1,804,934.520	
		APA GROUP	53,350	444,939.000	
		SCENTRE GROUP	235,284	625,855.440	
		GPT GROUP	86,791	361,050.560	
		MIRVAC GROUP	173,080	354,814.000	
		STOCKLAND	104,777	418,060.230	
		GOODMAN GROUP	76,496	1,769,352.480	

		VICINITY CENTRES	175,417	324,521.450	
	オーストラリア・ドル 小計			6,667,051.180 (650,504,184)	
	カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,800	171,570.000	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	6,900	120,888.000	
	カナダ・ドル 小計			292,458.000 (31,951,037)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	194,000	543,200.000	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	276,670	514,606.200	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	170,200	268,916.000	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	112,700	155,526.000	
	シンガポール・ドル 小計			1,482,248.200 (165,374,432)	
	ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	5,554	303,914.880	
		GECINA SA	2,164	215,750.800	
		KLEPIERRE	10,126	233,809.340	
		COVIVIO	2,399	106,755.500	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,389	188,862.840	
	ユーロ 小計			1,049,093.360 (171,568,728)	
	香港・ドル	LINK REIT	131,500	5,240,275.000	
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	197,000	1,625,250.000	
	香港・ドル 小計			6,865,525.000 (132,024,045)	
投資証券 合計				7,869,563,596 [7,869,563,596]	
合計				7,869,563,596 [7,869,563,596]	

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 604銘柄 投資証券 35銘柄	97.7%	2.3%	75.2%
イギリス・ポンド	株式 81銘柄 投資証券 2銘柄	99.2%	0.8%	4.2%
イスラエル・シュケル	株式 8銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 48銘柄 投資証券 10銘柄	91.1%	8.9%	1.9%
カナダ・ドル	株式 86銘柄 投資証券 2銘柄	99.7%	0.3%	3.2%
シンガポール・ドル	株式 16銘柄 投資証券 4銘柄	88.9%	11.1%	0.4%
スイス・フラン	株式 45銘柄	100%	-%	2.7%
スウェーデン・クローナ	株式 43銘柄	100%	-%	1.0%
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	100%	-%	1.0%
ニュージーランド・ドル	株式 6銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 12銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式 222銘柄 投資証券 5銘柄	99.5%	0.5%	9.3%
香港・ドル	株式 27銘柄 投資証券 2銘柄	94.9%	5.1%	0.7%

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。

2【ファンドの現況】

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）

【純資産額計算書】

2023年11月30日

Ⅰ	資産総額	1,674,218円
Ⅱ	負債総額	140円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,674,078円
Ⅳ	発行済数量	1,764,056口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9490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

2023年11月30日

Ⅰ	資産総額	107,365,067,632円
Ⅱ	負債総額	360,633,495円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	107,004,434,137円
Ⅳ	発行済数量	38,987,514,233口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.7446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）

純資産額計算書

2023年11月30日

Ⅰ	資産総額	59,990,119円
Ⅱ	負債総額	4,913円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	59,985,206円
Ⅳ	発行済数量	46,326,807口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2948円

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2023年11月30日

Ⅰ	資産総額	416,412,657,748円

Ⅱ　負債総額	**542,641,373円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**415,870,016,375円**
Ⅳ　発行済数量	**78,806,686,628口**
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**5.2771円**

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１　【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

2023年11月末日現在

資本金の額　　151億7,427万2,500円

発行可能株式総数　799万9,980株

発行済株式総数　　260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

ｂ．委託会社の機構

①　会社の意思決定機構

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

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

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

②　投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ．商品会議

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

ロ．商品担当役員

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

ハ．運用会議

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

ニ．運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ．リスクマネジメント会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年11月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

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

３【委託会社等の経理状況】

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

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

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

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

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

(1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

	前事業年度 （2022年３月31日）		当事業年度 （2023年３月31日）	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		3,168		1,982
有価証券		486		346
前払費用		332		393
未収委託者報酬		13,811		12,525
未収収益		52		47
関係会社短期貸付金		24,900		22,100
その他		45		59
流動資産計		42,799		37,455
固定資産				
有形固定資産	※1	203	※1	196
建物		4		3
器具備品		198		193
無形固定資産		1,770		1,482
ソフトウェア		1,738		1,351
ソフトウェア仮勘定		31		131
投資その他の資産		16,617		13,824

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

（単位:百万円）

	前事業年度 （2022年３月31日）	当事業年度 （2023年３月31日）
負債の部		
流動負債		
預り金	65	101
未払金	9,856	5,874
未払収益分配金	26	38
未払償還金	12	12
未払手数料	4,917	4,525
その他未払金	※2 4,900	※2 1,297
未払費用	4,246	3,987
未払法人税等	980	560
未払消費税等	1,016	327
賞与引当金	866	692
その他	2	2
流動負債計	17,033	11,545
固定負債		
退職給付引当金	2,399	2,276
役員退職慰労引当金	13	51
その他	1	0
固定負債計	2,415	2,329
負債合計	19,449	13,874
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495

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

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

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

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

（単位:百万円）

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）

（単位：百万円）

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

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

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物　　15～18年

器具備品　　４～20年

（２）無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

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

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

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

４．収益及び費用の計上基準

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

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

（重要な会計上の見積り）

該当事項はありません。

（会計方針の変更に関する注記）

（時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用）

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

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

（貸借対照表関係）

※１　有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 （2022年３月31日）	当事業年度 （2023年３月31日）

建物	37百万円	38百万円
器具備品	283百万円	296百万円

※２　関係会社項目

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

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

３　保証債務

前事業年度（2022年３月31日）

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

当事業年度（2023年３月31日）

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

２．配当に関する事項

（１）　配当金支払額

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

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

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

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

⑤効力発生日　　2022年６月24日

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

２．配当に関する事項

（１）　配当金支払額

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

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

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

①剰余金の配当の総額　　10,316百万円
②配当の原資　　利益剰余金
③１株当たり配当額　　3,955円
④基準日　　2023年３月31日
⑤効力発生日　　2023年６月27日

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

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

（２）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

運用に関係する業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

（３） 金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

（ｉ）為替変動リスクの管理

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

（ii）価格変動リスクの管理

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

②信用リスクの管理

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

２．金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

前事業年度（2022年３月31日）

（１）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

当事業年度（2023年３月31日）

（１）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

（２）時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

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

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

１．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（2022年３月31日）

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

当事業年度（2023年３月31日）

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

２．その他有価証券

前事業年度（2022年３月31日）

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

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

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

当事業年度（2023年３月31日）

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

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

３．売却したその他有価証券

前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

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

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

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

４．減損処理を行った有価証券

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

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

（退職給付関係）

１．採用している退職給付制度の概要

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

２．確定給付制度

(１)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(３)退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

（注）その他には、臨時に支払った割増退職金等を含んでおります。

３．確定拠出制度

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

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

（単位：百万円）

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

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

前事業年度（2022年３月31日）

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

当事業年度（2023年３月31日）

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

３．法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

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

（収益認識関係）

（１） 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

（２） 収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の４．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

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

［関連情報］

１.サービスごとの情報

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

２.地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３.主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関係内容		取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取（注）	17,100 0	関係会社短期貸付金 受取利息関係会社	22,100 0

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（イ）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（ウ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料（注2） 不動産の賃借料（注3）	15,348 1,062	未払手数料 長期差入保証金	3,028 1,054
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守（注4）	1,065	未払費用	91

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料（注2） 不動産の賃借料（注3）	13,072 1,062	未払手数料 長期差入保証金	2,663 1,054
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守（注4）	883	未払費用	81

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

２.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

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

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

(注２)１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

中間財務諸表

(１)中間貸借対照表

（単位:百万円）

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

（単位:百万円）

		当中間会計期間 （2023年９月30日）
負債の部		
流動負債		
未払金		5,255
未払費用		4,567
未払法人税等		2,453
賞与引当金		727
その他	※２	725
流動負債合計		13,864
固定負債		
退職給付引当金		2,228
役員退職慰労引当金		58
固定負債合計		2,287
負債合計		16,152
純資産の部		
株主資本		
資本金		15,174
資本剰余金		
資本準備金		11,495
資本剰余金合計		11,495
利益剰余金		
利益準備金		374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		6,594
利益剰余金合計		6,968
株主資本合計		33,638
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		973
評価・換算差額等合計		973
純資産合計		34,612
負債・純資産合計		50,764

(２)中間損益計算書

（単位:百万円）

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

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

(３)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自　2023年４月１日 至　2023年９月30日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	11,505	11,879	38,549
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△10,316	△10,316	△10,316
中間純利益	-	-	-	5,405	5,405	5,405
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-

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

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

注記事項
（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法
（１）子会社及び関連会社株式
移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券
市場価格のない株式等以外のもの
中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

市場価格のない株式等
移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法
（１）有形固定資産
定額法によっております。
なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。
建物　10～18年
器具備品　４～20年

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

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

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

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

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

４．収益及び費用の計上基準

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

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

５．グループ通算制度の適用

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

（中間貸借対照表関係）

※１　減価償却累計額

	当中間会計期間 （2023年９月30日現在）
有形固定資産	340百万円

※２　消費税等の取扱い

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

３　保証債務

当中間会計期間（2023年９月30日現在）

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

（中間損益計算書関係）

※１　減価償却実施額

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

※２　営業外収益の主要項目

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

※３　営業外費用の主要項目

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

※４　特別損失の項目

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

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自　2023年４月１日　至　2023年９月30日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項　　**（単位：千株）**

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

２．配当に関する事項

配当金支払額

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

（金融商品関係）

当中間会計期間（2023年９月30日）

金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

（１）時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

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

（２）時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

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

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

当中間会計期間（2023年９月30日）

１．子会社株式及び関連会社株式

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

２．その他有価証券

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

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

（収益認識関係）

（１） 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

（２） 収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の４．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

当中間会計期間（自　2023年４月１日　至　2023年９月30日）

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

［関連情報］

当中間会計期間（自　2023年４月１日　至　2023年９月30日）

１.サービスごとの情報

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

２.地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３.主要な顧客ごとの情報

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

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

当中間会計期間（自　2023年４月１日　至　2023年９月30日）

該当事項はありません。

［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］

当中間会計期間（自　2023年４月１日　至　2023年９月30日）

該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］

当中間会計期間（自　2023年４月１日　至　2023年９月30日）

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

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

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

（注２）　１株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

③ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。

④ 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

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

5 【その他】

ａ．定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

ｂ．訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

	①　名　称	②　資本金の額 (2023年03月末日現在)	③　事業の内容	④　備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	（注6）	
再信託受託会社	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円	（注6）	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	（注1）	

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

２【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

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

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

３【資本関係】

該当事項はありません。

第３【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

・金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。

・目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。

・委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

・詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

①委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等

②請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨

・使用開始日を記載することがあります。

・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。

①届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

②届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日

・次の事項を記載することがあります。

①投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨

②請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨

③「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載

・委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。

・ファンドの形態等を記載することがあります。

・図案を採用することがあります。

・ファンドの管理番号等を記載することがあります。

・委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。

・UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

2023年５月26日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年1月12日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用）の2022年11月22日から2023年11月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用）の2023年11月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年1月12日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人
東京事務所

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）の2022年11月22日から2023年11月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）の2023年11月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年11月27日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

中間監査意見

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

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

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。