

## 【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3月8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TOPIXインデックス（ダイワSMA専用） ダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用） 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） 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） ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用） ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用） ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用） ダイワJ-REITインデックス（ダイワSMA専用） ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用） ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）
【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100兆円を上限とします。
【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TOPIXインデックス（ダイワSMA専用）  
ダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）  
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）  
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）  
ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）  
ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）  
ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）  
ダイワJ-REITインデックス（ダイワSMA専用）  
ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）  
ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）

（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るものとします。

（注2）以下、上記の略称としてそれぞれ次を用いることがあります。

ダイワTOPIXインデックス （ダイワSMA専用）	： TOPIXインデックス
ダイワ日経225インデックス （ダイワSMA専用）	： 日経225インデックス
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）	： 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）
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）	： 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）
ダイワ日本債券インデックス （ダイワSMA専用）	： 日本債券インデックス
ダイワ外国債券インデックス （為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）	： 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）
ダイワ外国債券インデックス （為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）	： 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）
ダイワJ-REITインデックス （ダイワSMA専用）	： J-REITインデックス
ダイワ外国REITインデックス （為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）	： 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）
ダイワ外国REITインデックス （為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）	： 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）

### (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100兆円を上限とします。

### (4)【発行(売出)価格】

各ファンドについて1万口当たり次のとおりとします。

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

基準価額は、販売会社または下記にお問合せ下さい。

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。

### (6)【申込単位】

販売会社にお問合せ下さい。

**(7)【申込期間】**

2024年3月9日から2024年9月10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、特定の指数の動きに連動する投資成果をめざすマザーファンドを通じて、特定の有価証券に投資し、各市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

< TOPIXインデックス >

#### 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## &lt;日経225インデックス&gt;

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## &lt;外国株式インデックス（為替ヘッジあり）&gt;

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

<外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<日本債券インデックス>



## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

< 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） >

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

< J - R E I T インデックス >

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

< 外国REITインデックス（為替ヘッジあり） >

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

< 外国REITインデックス（為替ヘッジなし） >

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

## (注1) 商品分類の定義

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

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

(注2) 属性区分の定義

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



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

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

< 信託金の限度額 >

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

ファンド名	限度額
TOPIXインデックス	2,500億円
日経225インデックス	各ファンドについて 5,000億円
外国株式インデックス(為替ヘッジあり)	
外国株式インデックス(為替ヘッジなし)	
日本債券インデックス	
外国債券インデックス(為替ヘッジあり)	
外国債券インデックス(為替ヘッジなし)	
J-REITインデックス	各ファンドについて 1,000億円
外国REITインデックス(為替ヘッジあり)	
外国REITインデックス(為替ヘッジなし)	

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

< ファンドの特色 >

# 1 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 各ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて実質的な運用を行ないます。

- 各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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



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

## ●各ファンドの基本情報

特定の 有価証券	各ファンド	特定の指数	マザーファンド
わが国の 株式	TOPIXインデックス	東証株価指数（TOPIX）（配当込み）	トピックス・インデックス・マザーファンド
	日経225インデックス	日経平均トータルリターン・インデックス	ストックインデックス225・マザーファンド
海外の 株式	外国株式インデックス （為替ヘッジあり）	MSCIコクサイ指数 （配当込み、円ヘッジ・ベース）	外国株式インデックス 為替ヘッジ型マザーファンド
	外国株式インデックス （為替ヘッジなし）	MSCIコクサイ指数 （配当込み、円ベース）	外国株式インデックス マザーファンド
わが国の 債券	日本債券インデックス	ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数	日本債券インデックス マザーファンド
海外の 債券	外国債券インデックス （為替ヘッジあり）	FTSE世界国債インデックス （除く日本、円ヘッジ・円ベース）	外国債券インデックス （為替ヘッジあり） マザーファンド
	外国債券インデックス （為替ヘッジなし）	FTSE世界国債インデックス （除く日本、ヘッジなし・円ベース）	外国債券インデックス マザーファンド
わが国の リート	J-REITインデックス	東証REIT指数（配当込み）	ダイワJ-REIT マザーファンド
海外の リート	外国REITインデックス （為替ヘッジあり）	S&P先進国REIT指数（除く日本） （円ヘッジ・円ベース）	先進国リート・インデックス （為替ヘッジあり） マザーファンド
	外国REITインデックス （為替ヘッジなし）	S&P先進国REIT指数（除く日本） （円ベース）	ダイワ・グローバルREITインデックス・ マザーファンド
		—	先進国REITマザーファンド <sup>(注)</sup>

※各ファンド（「外国REITインデックス（為替ヘッジあり）」を除きます。）において、マザーファンドの受益証券の組入比率あるいは組入比率の合計は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

※特定の指数の内容については、後掲の「特定の指数について」をご参照下さい。

(注)「先進国REITマザーファンド」は、海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざすファンドです。

## ●各ファンドの運用方針

## TOPIXインデックス

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

◆東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とし、投資成果を東証株価指数（配当込み）の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行いません。

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

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

(c)株式の組入比率は、高位を保ちます。

◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル<sup>(注1)</sup>を用います。

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

## 日経225インデックス

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

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

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

投資成果を指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行いません。

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

(b)株式の組入比率は、高位を保ちます。

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

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

**外国株式インデックス（為替ヘッジあり）**

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

◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル<sup>(注1)</sup>を用います。

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

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

※マザーファンドにおいて、運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を利用することがあります。このため、株式の組入総額ならびに株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

**外国株式インデックス（為替ヘッジなし）**

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

◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル<sup>(注1)</sup>を用います。

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

**日本債券インデックス**

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

◆ポートフォリオの構築にあたっては、マルチファクターモデル<sup>(注2)</sup>を用いるとともに、残存年限別構成比率等をチェックします。

(注1) 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2) マルチファクターモデルは、ポートフォリオのリスク分析、ポートフォリオの構築を主目的としたモデルです。同モデルにより、イールドカーブファクター、スプレッドファクター、スペシフィックファクターなどについてリスクの計測、分析、推定を行ない、ポートフォリオを効率的に構築および管理します。

### 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

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

◆ファンドの通貨別構成比率を同インデックスに近づけ、リスクモデル<sup>(注3)</sup>を用い債券価格変動への連動をめざしてポートフォリオを構築します。また、同インデックスへの連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ないます。なお、保有外貨建資産については、同インデックスに連動させるため為替ヘッジを行ないます。

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

※マザーファンドにおいて、運用の効率化をはかるため、債券先物取引を利用することがあります。このため、債券の組入総額ならびに債券先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

### 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）

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

◆ファンドの通貨別構成比率を同インデックスに近づけ、リスクモデル<sup>(注3)</sup>を用い債券価格変動への連動をめざしてポートフォリオを構築します。また、同インデックスへの連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ないます。

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

### J-REITインデックス

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

◆組入銘柄は東証REIT指数の構成銘柄（採用予定を含みます。）とし、組入比率を高位に保ちます。組入銘柄それぞれの時価総額に応じた投資比率に基づきポートフォリオを構築することを基本とします。東証REIT指数への連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ない、連動性を維持するように運用を行ないます。

※マザーファンドにおいて、運用の効率化をはかるため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

(注3) リスクモデルでは、個別債券のキャッシュフロー（利金と償還金）や価格変化を分析することにより、債券価格変動が同インデックスの騰落に与える影響度とファンドの騰落に与える影響度とがほぼ等しくなるようなポートフォリオを構築することができます。

### 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）

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

◆主として、先進国（日本を除きます。）の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）または店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券に投資します。

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

◆保有外貨建資産については、S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させること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。

※運用の効率化をはかるため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

### 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）

海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。

◆投資先のマザーファンドおよび連動する投資成果をめざす指数は以下のとおりです。

マザーファンド	連動する投資成果をめざす指数
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）
先進国REITマザーファンド	—

※先進国REITマザーファンドにおいて、運用の効率化をはかるため、先進国のリートを対象としたリート指数先物取引を利用することがあります。このため、リートおよびETFの組入総額ならびにリート指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

※運用の効率化をはかるため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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



## ●特定の指数について

## ◆東証株価指数（TOPIX）

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

## ◆日経平均株価（日経225）

日本経済新聞社が発表している株価指標で、東京証券取引所に上場する市場を代表する225銘柄を対象に算出されます。

1950年から算出が開始された、わが国の株式市場全体の動向を示す代表的な指標の一つです。

## ◆MSCIコクサイ指数

MSCIコクサイ指数は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界主要国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。

## ◆ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数

ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスです。日本で発行されている確定利付公募債券で、残存額が50億円以上、残存期間が1年以上である国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債の時価総額加重方式による累積投資収益率指数です。

## ◆FTSE世界国債インデックス

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

## ◆東証REIT指数（配当込み）

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

## ◆S&amp;P先進国REIT指数

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

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

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

## 〈分配方針〉

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ②原則として、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、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
<p>●TOPIXインデックス</p> <p>●日経225インデックス</p> <p>①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>②株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>③外貨建資産への投資は、行ないません。</p>
<p>●外国株式インデックス（為替ヘッジあり／為替ヘッジなし）</p> <p>①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>②株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>③外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p>
<p>●日本債券インデックス</p> <p>①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>②株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使等により取得したものに限り、株式および株式を組入可能な投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> <p>③外貨建資産への投資は、行ないません。</p>
<p>●外国債券インデックス（為替ヘッジあり）</p> <p>①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>②株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使等により取得したものに限り、株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>③投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>④外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p>
<p>●外国債券インデックス（為替ヘッジなし）</p> <p>①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>②株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使等により取得したものに限り、株式および株式を組入可能な投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> <p>③外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p>

**●J-REITインデックス**

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

**●外国REITインデックス（為替ヘッジあり／なし）**

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

## ●基準価額の動きに関する留意点

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

\*「外国REITインデックス（為替ヘッジなし）」を除きます。

### TOPIXインデックス

### 日経225インデックス

### 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

### 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）

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

\*「TOPIXインデックス」および「日経225インデックス」を除きます。

### 日本債券インデックス

### 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

### 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）

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

\*「日本債券インデックス」を除きます。

### J-REITインデックス

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

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

### 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）

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

## ●各マザーファンドが連動対象とする指数の著作権等について

- ①配当込みTOPIXの指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。
- ②J P Xは、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止または同指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができます。
- ③J P Xは、同指数の指数値および同指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④J P Xは、同指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、J P Xは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ⑤本件商品は、J P Xにより提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑥J P Xは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ⑦J P Xは、当社または本件商品の購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。
- ⑧以上の項目に限らず、J P Xは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

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

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

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

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

- ①配当込み東証REIT指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。
- ②J P Xは、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止または同指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができます。
- ③J P Xは、同指数の指数値および同指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④J P Xは、同指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、J P Xは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ⑤本件商品は、J P Xにより提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑥J P Xは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ⑦J P Xは、当社または本件商品の購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。
- ⑧以上の項目に限らず、J P Xは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

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

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2017年2月16日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

2022年3月9日

<ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）> 商品分類の変更

## (3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金、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。 受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など
1	収益分配金、償還金など お申込金（ 3 ）	

委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2 ）の委託者であり、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
運用指図	2	損益 信託金（ 3 ）
受託会社	<p>&lt;日経225インデックス&gt; みずほ信託銀行株式会社 再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行</p>	<p>信託契約（ 2 ）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など</p>
受託会社	<p>&lt;上記以外の各ファンド&gt; 三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行</p>	<p>信託契約（ 2 ）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など</p>
		損益 投資
投資対象	<p>ファミリーファンド方式で運用を行ないます。</p> <p>&lt;TOPIXインデックス&gt; 東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。） など</p> <p>&lt;日経225インデックス&gt; わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均トータルリターン・インデックスに採用された銘柄 など</p> <p>&lt;外国株式インデックス（為替ヘッジあり/為替ヘッジなし）&gt; 外国の株式（DR（預託証券）を含みます。） など</p> <p>&lt;日本債券インデックス&gt; わが国の公社債 など</p> <p>&lt;外国債券インデックス（為替ヘッジあり/為替ヘッジなし）&gt; 外国の公社債 など</p> <p>&lt;J-REITインデックス&gt; わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券 など</p> <p>&lt;外国REITインデックス（為替ヘッジあり/為替ヘッジなし）&gt; 海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券 など</p>	

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收受します。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12月末日現在） >

・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

#### ・ 沿革

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

#### ・ 大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### 主要投資対象

ファンド名	主要投資対象
TOPIXインデックス	トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
日経225インデックス	ストックインデックス225・マザーファンドの受益証券
外国株式インデックス （為替ヘッジあり）	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの受益証券
外国株式インデックス （為替ヘッジなし）	外国株式インデックスマザーファンドの受益証券



日本債券インデックス	日本債券インデックスマザーファンドの受益証券
外国債券インデックス (為替ヘッジあり)	外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンドの 受益証券
外国債券インデックス (為替ヘッジなし)	外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
J - R E I Tインデック ス	ダイワJ - R E I Tマザーファンドの受益証券
外国R E I Tインデック ス(為替ヘッジあり)	先進国リート・インデックス(為替ヘッジあり)マザーファ ンド
外国R E I Tインデック ス(為替ヘッジなし)	ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンド の受益証券および先進国R E I Tマザーファンドの受益証券

以下、各ファンドにおいて「マザーファンド」といいます。

### 投資態度

#### < T O P I Xインデックス >

- イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の株式に投資し、投資成果を東証株価指数(T O P I X)(配当込み)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
- ロ．マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ハ．株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

#### < 日経225インデックス >

- イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の株式に投資し、投資成果を日経平均トータルリターン・インデックスの動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
- ロ．マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ハ．株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

#### < 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) >

- イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、外国の株式(D R(預託証券)を含みます。)に投資し、投資成果をM S C I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、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

ハ．マザーファンドにおいて、保有する外貨建資産については為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。

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。

#### <外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、外国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数（配当込み、円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

ニ．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。

#### <日本債券インデックス>

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の公社債に投資し、投資成果をダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

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

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

#### <外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

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

ロ．マザーファンドにおいて、運用の効率化を図るため、債券先物取引を利用することがあります。このため、マザーファンドにおいて、債券の組入総額および債券先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

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

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

#### <外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

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

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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。

#### < J - R E I T インデックス >

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

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

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

#### < 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジあり） >

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

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

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

ハ．運用の効率化をはかるため、リート指数先物取引を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額とリート指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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。

#### < 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジなし） >

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

ニ．運用の効率化をはかるため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

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

## (2)【投資対象】

- < T O P I X インデックス >
- < 日経 2 2 5 インデックス >
- < 外国株式インデックス (為替ヘッジあり) >
- < 外国株式インデックス (為替ヘッジなし) >
- < 日本債券インデックス >
- < 外国債券インデックス (為替ヘッジあり) >
- < 外国債券インデックス (為替ヘッジなし) >
- < 外国 R E I T インデックス (為替ヘッジあり) >
- < 外国 R E I T インデックス (為替ヘッジなし) >

当ファンドにおいて投資の対象とする資産(「T O P I X インデックス」、「日経 2 2 5 インデックス」および「日本債券インデックス」は本邦通貨表示のものに限ります。)の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、「日経 2 2 5 インデックス」は、みずほ信託銀行株式会社、「日経 2 2 5 インデックス」以外の各ファンドは三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された各マザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができます。

- < T O P I X インデックス >
- < 日経 2 2 5 インデックス >
- < 外国株式インデックス (為替ヘッジあり) >
- < 外国株式インデックス (為替ヘッジなし) >
- < 外国 R E I T インデックス (為替ヘッジあり) >
- < 外国 R E I T インデックス (為替ヘッジなし) >

1. 株券または新株引受権証書

- < 日本債券インデックス >

<外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

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

<TOPIXインデックス>

<日経225インデックス>

<外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<日本債券インデックス>

<外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)

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

18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

19. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）

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

21. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前19.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

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。

<外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）

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

7. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

12. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）

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

14. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

15. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
16. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
17. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前15.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

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

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

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

#### < J - R E I T インデックス >

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

1. 次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。)
  - イ. 有価証券
  - ロ. デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)に定めるものに限ります。)
  - ハ. 約束手形
  - ニ. 金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ. 為替手形

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

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券の性質を有するもの
3. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

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

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

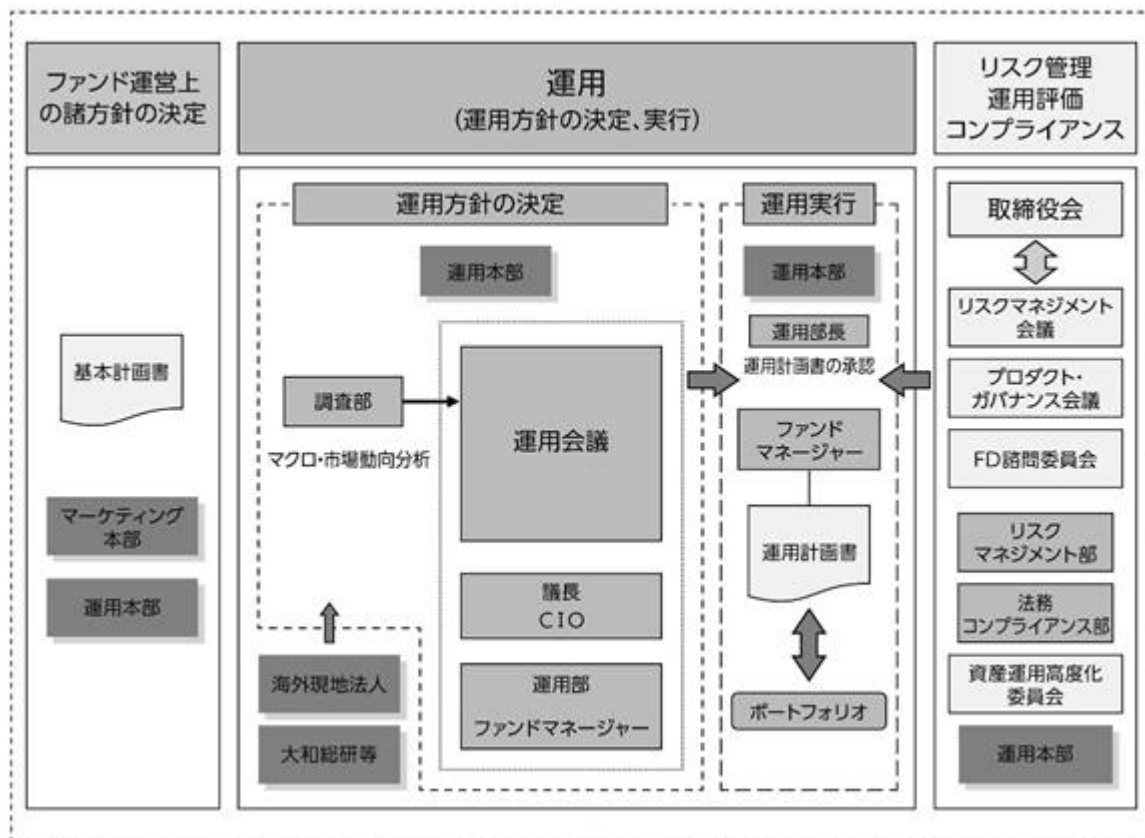
指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、〈ファンドの特色〉をご参照下さい。

### (3) 【運用体制】

〈各ファンド共通〉

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

#### イ．基本計画書の策定

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

#### ロ．基本的な運用方針の決定

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

#### ハ．運用計画書の作成・承認



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

#### 職務権限

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

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

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

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

##### ロ．Deputy-CIO(0~5名程度)

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

##### ハ．インベストメント・オフィサー(0~5名程度)

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

##### ニ．運用部長(各運用部に1名)

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

##### ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

##### ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

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

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

##### イ．リスクマネジメント会議

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

##### ロ．プロダクト・ガバナンス会議

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

##### ハ．FD諮問委員会

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

##### ニ．資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

#### 受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は2023年12月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

#### (4)【配分方針】

##### <各ファンド共通>

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

原則として、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

#### (5)【投資制限】

マザーファンドの受益証券(信託約款)

##### <各ファンド共通>

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

株式(信託約款)

##### <TOPIXインデックス>

##### <日経225インデックス>

##### <外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

##### <外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

##### <外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

##### <外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

##### <日本債券インデックス>

##### <外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

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

##### <外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

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

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

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

< J - R E I T インデックス >

株式への直接投資は、行ないません。

新株引受権証券等（信託約款）

< T O P I X インデックス >

< 日経 2 2 5 インデックス >

< 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） >

< 日本債券インデックス >

< 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） >

< 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジなし） >

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

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

< 上記以外の各ファンド >

（規定なし）

投資信託証券（信託約款）

< T O P I X インデックス >

< 日経 2 2 5 インデックス >

< 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） >

< 日本債券インデックス >

< 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） >

< 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジなし） >

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

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

## &lt; J - R E I Tインデックス &gt;

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

投資する株式等の範囲（信託約款）

## &lt; T O P I Xインデックス &gt;

## &lt; 日経 2 2 5 インデックス &gt;

## &lt; 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） &gt;

## &lt; 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） &gt;

## &lt; 日本債券インデックス &gt;

## &lt; 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） &gt;

## &lt; 外国 R E I Tインデックス（為替ヘッジあり） &gt;

## &lt; 外国 R E I Tインデックス（為替ヘッジなし） &gt;

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。

## &lt; 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） &gt;

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

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

## &lt; J - R E I Tインデックス &gt;

（規定なし）

同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

## &lt; T O P I Xインデックス &gt;

## &lt; 日経 2 2 5 インデックス &gt;

## &lt; 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） &gt;

## &lt; 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） &gt;

## &lt; 日本債券インデックス &gt;

## &lt; 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） &gt;

## &lt; 外国 R E I Tインデックス（為替ヘッジあり） &gt;

## &lt; 外国 R E I Tインデックス（為替ヘッジなし） &gt;

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

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

<上記以外の各ファンド>

（規定なし）

信用取引（信託約款）

< T O P I X インデックス >

< 日経 2 2 5 インデックス >

< 日本債券インデックス >

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

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てします。

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

<上記以外の各ファンド>

（規定なし）

先物取引等（信託約款）

< T O P I X インデックス >

< 日経 2 2 5 インデックス >

< 日本債券インデックス >

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

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

< 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） >

< 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） >

<外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

ロ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引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。

<J-REITインデックス>

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

スワップ取引(信託約款)

<TOPIXインデックス>

<日経225インデックス>

<日本債券インデックス>

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

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

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

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

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

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

<外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

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

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

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

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

<J-REITインデックス>

(規定なし)

金利先渡取引(信託約款)

<TOPIXインデックス>

<日経225インデックス>

<日本債券インデックス>

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

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

ハ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下本八.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産にかかる保有金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同

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

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

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

ヘ.委託会社は、金利先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、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。

<上記以外の各ファンド>

(規定なし)

金利先渡取引および為替先渡取引(信託約款)

<外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

<外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

<外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

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

ニ.前八.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の



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

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

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

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

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

#### <上記以外の各ファンド>

（規定なし）

直物為替先渡取引（信託約款）

#### <外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

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

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

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

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

#### <上記以外の各ファンド>

（規定なし）

デリバティブ取引等（信託約款）

#### <各ファンド共通>

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

## 有価証券の貸付け（信託約款）

< T O P I X インデックス >

< 日経 2 2 5 インデックス >

< 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） >

< 日本債券インデックス >

< 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） >

< 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジなし） >

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

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

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

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

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

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

< J - R E I T インデックス >

（規定なし）

## 外貨建資産（信託約款）

< T O P I X インデックス >

< 日経 2 2 5 インデックス >

< 日本債券インデックス >

外貨建資産への投資は、行ないません。

< 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） >

< 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） >

< 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジなし） >

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

< J - R E I T インデックス >

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

## 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

< 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） >

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

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

<上記以外の各ファンド>

(規定なし)

外国為替予約取引(信託約款)

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

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

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

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

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。

<上記以外の各ファンド>

(規定なし)

信用リスク集中回避(信託約款)

<各ファンド共通>

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

## 資金の借入れ（信託約款）

## &lt;各ファンド共通&gt;

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、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．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

## &lt;参考&gt; マザーファンドの概要

## トピックス・インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、東証株価指数（配当込み）をモデルとして運用を行ないます。
主要投資対象	東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。
投資態度	投資成果を東証株価指数（配当込み）の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。 イ．上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行ないます。 ロ．ポートフォリオは、東証株価指数（配当込み）における業種別、銘柄別時価構成比率等を参考に、東証株価指数（配当込み）との連動性を維持するよう構築します。 ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

<p>主な投資制限</p>	<p>株式 株式への投資には、制限を設けません。</p> <p>先物取引等 イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>ロ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>スワップ取引 イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。</p> <p>ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。</p> <p>ニ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。</p> <p>ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。</p>
---------------	--

ストックインデックス225・マザーファンド

<p>運用の基本方針</p>	<p>わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、日経平均トータルリターン・インデックスをモデルとして運用を行ないます。</p>
<p>主要投資対象</p>	<p>わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均トータルリターン・インデックスに採用された銘柄を主要投資対象とします。</p>

投資態度	<p>イ．投資成果を日経平均トータルリターン・インデックスの動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。</p> <p>1．上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、等株数投資を行ないます。</p> <p>2．株式の組入比率は、高位を保ちます。</p> <p>ロ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、日経平均トータルリターン・インデックスが改廃されたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>先物取引等</p> <p>イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。（以下同じ。）</p> <p>ロ．委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>スワップ取引</p> <p>イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。</p> <p>ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。</p> <p>ニ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。</p> <p>ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。</p>

#### 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

運用の基本方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

投資態度	<p>主として海外の株式(預託証券を含みます。)に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数(配当込み、円ヘッジ・ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。</p> <p>保有外貨建資産については、MSCIコクサイ指数(配当込み、円ヘッジ・ベース)の動きに連動させることをめざして為替ヘッジを行ないます。</p> <p>運用の効率化を図るため、株式指数先物取引等を利用することがあります。このため、株式等の組入総額ならびに株式指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>
------	--

主な投資制限	<p>株式</p> <p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券等</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>投資信託証券</p> <p>投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債等</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものへの投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>先物取引等</p> <p>イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。</p> <p>ロ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>ハ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>スワップ取引</p> <p>イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。</p> <p>ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。</p>
--------	--



	<p>ニ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうもの とします。</p> <p>ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要 と認めたときは、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。 金利先渡取引および為替先渡取引</p> <p>イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡 取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日 が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信 託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。</p> <p>ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想 定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信 託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、 金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとな った場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の 一部の解約を指図するものとします。</p> <p>ニ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想 定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、 信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少し て、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えること となった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡 取引の一部の解約を指図するものとします。</p> <p>ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出し た価額で行なうものとします。</p> <p>ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供 あるいは受入れが必要と認めたときは、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。</p>
--	---

## 外国株式インデックスマザーファンド

運用の基本方針	投資成果をMSCIコクサイ指数（配当込み、円ベース）の動きに連動させるこ とをめざして運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	外国の株式（預託証券を含みます。）を主要投資対象とします。
投資態度	<p>イ．主として外国の株式（預託証券を含みます。）に投資し、投資成果をMSCI コクサイ指数（配当込み、円ベース）の動きに連動させることをめざして運 用を行なうことを基本とします。</p> <p>ロ．保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行 ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、配当金等の受取りま たは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。</p> <p>ハ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な 変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模に よっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p>

## 日本債券インデックスマザーファンド

運用の基本方針	投資成果をダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数の動きに連動させ ることをめざして運用を行なうことを基本とします。
---------	--

主要投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>イ．主としてわが国の公社債に投資し、投資成果をダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。</p> <p>ロ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限り、株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行ないません。</p>

## 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

運用の基本方針	投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	外国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>イ．主として、外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。</p> <p>ロ．運用の効率化を図るため、債券先物取引を利用することがあります。このため、債券の組入総額および債券先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ハ．投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させるため、外貨建資産については為替ヘッジを行ないます。</p> <p>ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>

## 株式

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

す。株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

## 投資信託証券

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

## 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

## 先物取引等

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

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

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

## スワップ取引

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

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

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

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

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

## 金利先渡取引および為替先渡取引

主な投資制限

	<p>イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。</p> <p>ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。</p> <p>ニ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。</p> <p>ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。</p> <p>ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。</p>
--	---

#### 外国債券インデックスマザーファンド

運用の基本方針	投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	外国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>イ．主として外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。</p> <p>ロ．保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。</p> <p>ハ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限りません。</p> <p>株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p>

#### ダイワJ-REITマザーファンド

運用の基本方針	「東証REIT指数」（配当込み、以下同じ。）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
---------	---

主要投資対象	<p>わが国の金融商品取引所( )上場(上場予定を含みます。以下同じ。)の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券(以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。)を主要投資対象とします。</p> <p>金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下当マザーファンドについて同じ。</p>
投資態度	<p>イ。「東証REIT指数」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</p> <p>ロ.投資成果を「東証REIT指数」の動きにできるだけ連動させるため、組入銘柄は「東証REIT指数」の構成銘柄(採用予定を含みます。)とし、組入比率を高位に保ちます。</p> <p>ハ.運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ニ.当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、「東証REIT指数」が改廃されたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>
主な投資制限	<p>株式 株式への直接投資は、行ないません。</p> <p>投資信託証券 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券 同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、当該同一銘柄の「東証REIT指数」における時価の構成割合が30%を超える場合には、当該指数における構成割合の範囲で組入れることができるものとします。</p> <p>外貨建資産 外貨建資産への直接投資は、行ないません。</p> <p>先物取引 委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。)および外国の金融商品取引所におけるこの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。</p>

## 先進国リート・インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド

運用の基本方針	S&P先進国REIT指数(除く日本)(円ヘッジ・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	<p>イ.先進国(日本を除きます。以下同じ。)の金融商品取引所上場(上場予定を含みます。以下同じ。)または店頭登録(登録予定を含みます。以下同じ。)の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券(以下総称して「リート」といいます。)</p> <p>ロ.先進国のリート指数との連動をめざすETF(上場投資信託証券)</p> <p>ハ.先進国のリートを対象としたリート指数先物取引</p>

投資態度	<p>イ．主として、先進国の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、投資成果をベンチマーク（S&amp;P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース））の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。</p> <p>効率性の観点から先進国のリート指数との連動をめざすETF（上場投資信託証券）に投資する場合があります。</p> <p>ロ．運用の効率化を図るため、先進国のリートを対象としたリート指数先物取引を利用することがあります。このため、リートの組入総額とリート指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ハ．保有外貨建資産については、S&amp;P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして為替ヘッジを行ないます。</p> <p>ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>先物取引</p> <p>わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。</p>

#### ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

運用の基本方針	<p>S &amp; P 先進国 REIT 指数（除く日本）（円ベース）に連動した投資成果をめざして運用を行ないます。</p>
主要投資対象	<p>海外の金融商品取引所（ ）上場（上場予定を含みます。以下同じ。）および店頭登録（登録予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。</p> <p>金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下当マザーファンドについて同じ。</p>
投資態度	<p>イ．主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券に投資し、ベンチマーク（S &amp; P 先進国 REIT 指数（除く日本）（円ベース））をいいます。以下同じ。）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</p> <p>ロ．組入銘柄はベンチマーク構成銘柄とし、不動産投資信託証券の組入比率を高位に保ちます。</p> <p>ハ．運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ニ．保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。</p> <p>ホ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>

主な投資制限	<p>株式への直接投資は、行ないません。</p> <p>投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、「投資態度」で定めた指数における時価の構成割合が30%を超える場合には、当該指数における構成割合の範囲で組入れることができるものとします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>先物取引</p> <p>委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。）および外国の金融商品取引所におけるこの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。</p>
--------	--

## 先進国REITマザーファンド

運用の基本方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	<p>イ．先進国（日本を除きます。以下同じ。）の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）または店頭登録（登録予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「リート」といいます。）</p> <p>ロ．先進国のリート指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）</p> <p>ハ．先進国のリートを対象としたリート指数先物取引</p> <p>ニ．国内の債券</p>
投資態度	<p>イ．主として、先進国のリート、先進国のリート指数を対象指数としたETF、先進国のリートを対象としたリート指数先物取引および残存期間の短いわが国の債券に投資し、先進国のリート市場の中長期的な値動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行ないます。</p> <p>一部日本のリートを含む指数を対象とするETFを組入れる場合があります。</p> <p>ロ．運用の効率化を図るため、先進国のリートを対象としたリート指数先物取引を利用することがあります。このため、リートおよびETFの組入総額ならびにリート指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。</p> <p>ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>

主な投資制限	<p>株式</p> <p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>投資信託証券</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>先物取引等</p> <p>イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。</p> <p>ロ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>ハ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>スワップ取引</p> <p>イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。</p> <p>ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。</p> <p>ニ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。</p> <p>ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。</p> <p>金利先渡取引および為替先渡取引</p> <p>イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。</p>
	64/768



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

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

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

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

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

### 3【投資リスク】

#### (1)価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

<TOPIXインデックス>

<日経225インデックス>

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

## その他

- イ．解約申込みがあった場合には、解約資金を手当てするため組入証券を売却しなければならないことがあります。その際、市場規模や市場動向によっては市場実勢を押下げ、当初期待される価格で売却できないこともあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。
- ロ．ファンド資産をコール・ローン、譲渡性預金証書等の短期金融資産で運用する場合、債務不履行により損失が発生することがあります（信用リスク）。この場合、基準価額が下落する要因となります。

## &lt;外国株式インデックス（為替ヘッジあり）&gt;

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

（TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの と同内容）

外国証券への投資に伴うリスク

## イ．為替リスク

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

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

## ロ．カンントリー・リスク

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

## その他

（TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの と同内容）

## &lt;外国株式インデックス（為替ヘッジなし）&gt;

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

（TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの と同内容）

外国証券への投資に伴うリスク

## イ．為替リスク

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

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

## ロ．カンントリー・リスク

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

その他

(TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの と同内容)

#### <日本債券インデックス>

公社債の価格変動(価格変動リスク・信用リスク)

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

その他

(TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの と同内容)

#### <外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

公社債の価格変動(価格変動リスク・信用リスク)

(日本債券インデックスの と同内容)

外国証券への投資に伴うリスク

(外国株式インデックス(為替ヘッジあり)の と同内容)

その他

(TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの と同内容)

#### <外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

公社債の価格変動(価格変動リスク・信用リスク)

(日本債券インデックスの と同内容)

外国証券への投資に伴うリスク

(外国株式インデックス(為替ヘッジなし)の と同内容)

その他

(TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの と同内容)

#### <J-REITインデックス>

リート(不動産投資信託)への投資に伴うリスク

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

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

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

ロ. リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

- ・リートの収益は、所有する不動産から得られる賃料収入がその大半を占めます。したがって、賃料水準や入居率の低下等により賃料収入が減少した場合には、リートの収益が悪化し、価格や配当が下落することが考えられます。
  - ・リートの資産価値は、所有する不動産の評価等により変動します。市況の悪化、不動産の老朽化等によってリートの資産価値が低下した場合には、価格が下落することがあります。なお、実物資産である不動産には、人的災害、自然災害等に伴って大きな損害が発生する可能性もあり、このような場合、リートの価格が大幅に下落することも想定されます。
  - ・リートでは、投資資金を調達するために金融機関等から借入れを行なうことがあります。したがって、金利上昇局面において金利負担等が増加し、収益の悪化要因となることが考えられます。
  - ・法人形態のリートでは、経営陣の運営如何によっては収益や財務内容が著しく悪化する可能性があります。リートが倒産等に陥り、投資資金が回収できなくなることもありえます。
- 八．リートに関する法制度(税制、会計制度等)が変更となった場合、リートの価格や配当に影響を与えることが想定されます。
- ・その他、不動産を取巻く法制度や規制(建築規制、環境規制等)に変更があった場合も、リートの価格や配当に影響を受けることが考えられます。
  - ・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。
- 二．組入リートの市場価格が下落した場合、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。
- その他  
(TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの と同内容)

<外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

リート(不動産投資信託)への投資に伴うリスク

(J-REITインデックスの と同内容)

外国証券への投資に伴うリスク

(外国株式インデックス(為替ヘッジあり)の と同内容)

その他

(TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの と同内容)

<外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

リート(不動産投資信託)への投資に伴うリスク

(J-REITインデックスの と同内容)

外国証券への投資に伴うリスク

(外国株式インデックス(為替ヘッジなし)の と同内容)

その他

(TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの と同内容)

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止(「TOPIXインデックス」、「日経225インデックス」、「日本債券インデックス」および「J-REITインデックス」を除きま

す。)その他やむを得ない事情が発生した場合には、お買付けの申込みの受付けを中止すること、すでに受付けたお買付けの申込みを取消すことがあります。

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(「TOPIXインデックス」、「日経225インデックス」、「日本債券インデックス」および「J-REITインデックス」を除きます。)その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付けを中止することがあります。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。

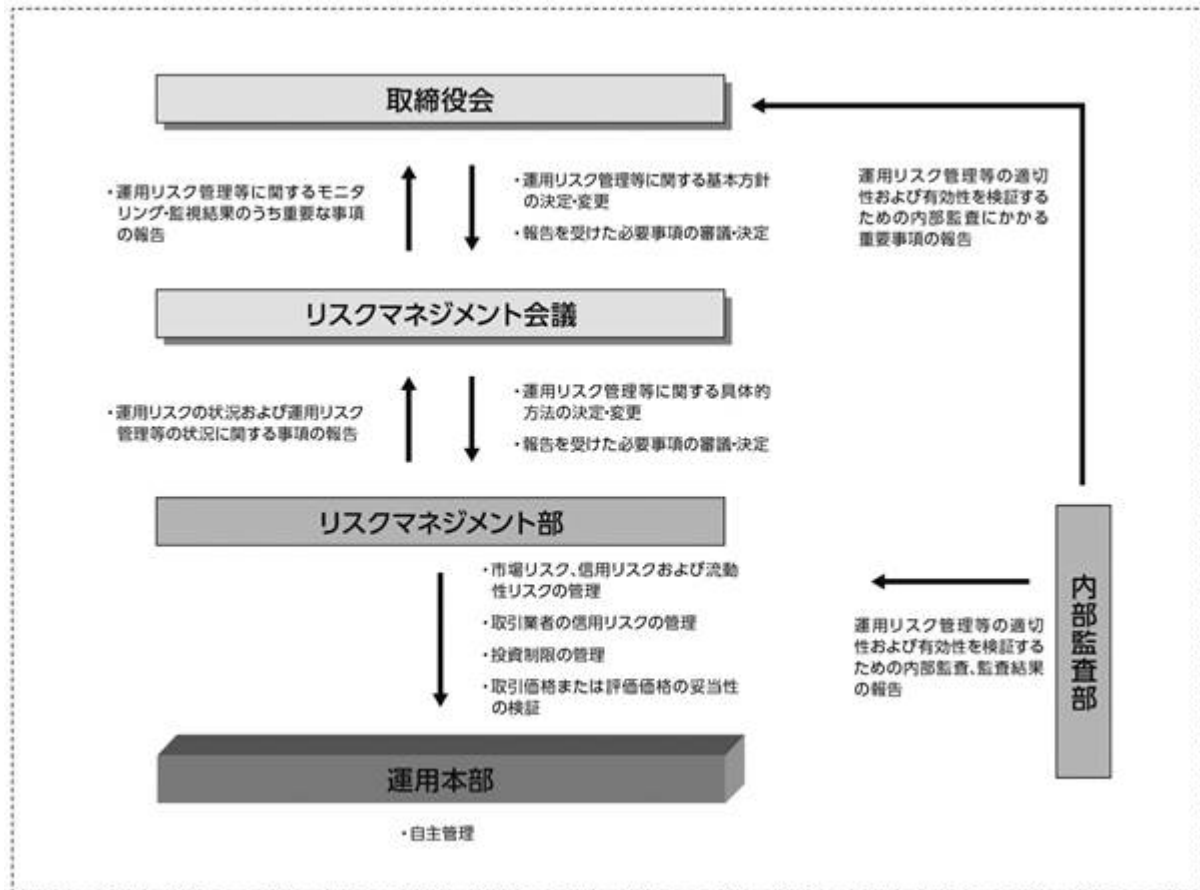
#### 流動性リスクに関する事項

- ・ 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・検証などを行いません。
- ・ 取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

## 参考情報

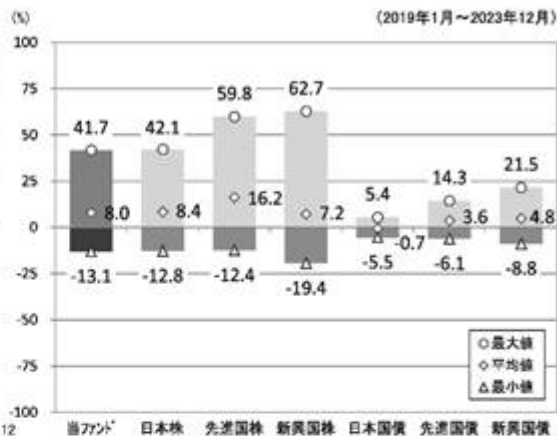
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間に於ける年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間に於ける年間騰落率の推移を表示しています。

### ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

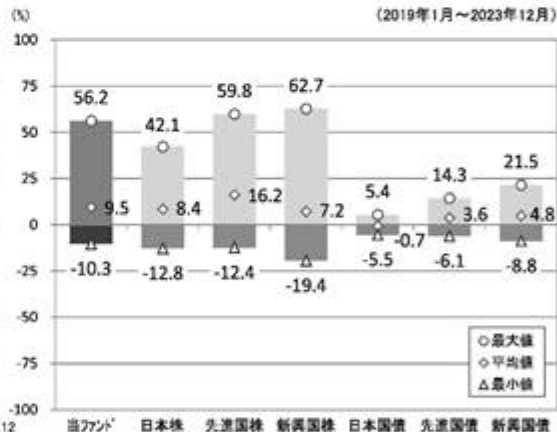
#### [TOPIXインデックス]



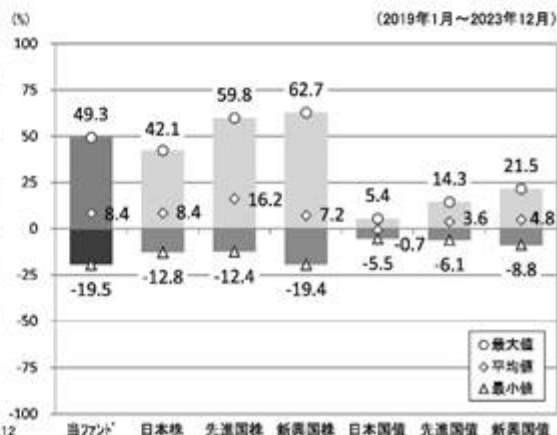
### 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



#### [日経225インデックス]



#### [外国株式インデックス（為替ヘッジあり）]

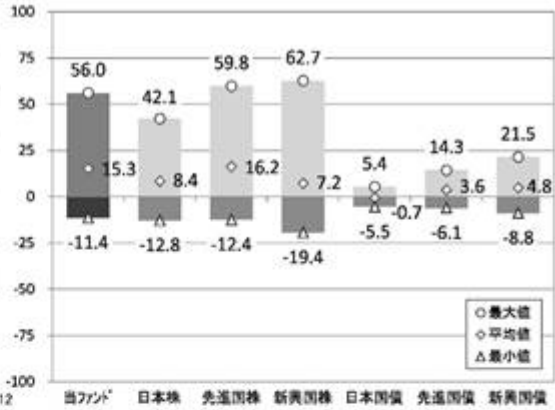


## 【外国株式インデックス（為替ヘッジなし）】

(円) (2019年1月～2023年12月) (%)

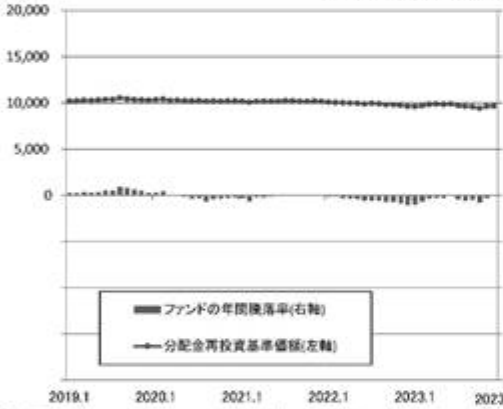


(2019年1月～2023年12月)

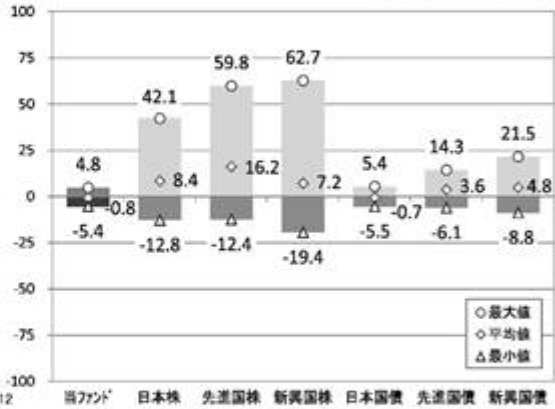


## 【日本債券インデックス】

(円) (2019年1月～2023年12月) (%)

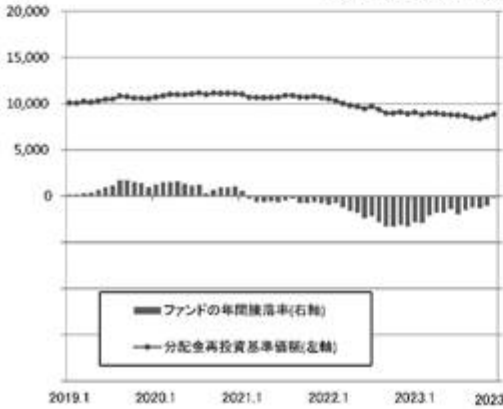


(2019年1月～2023年12月)

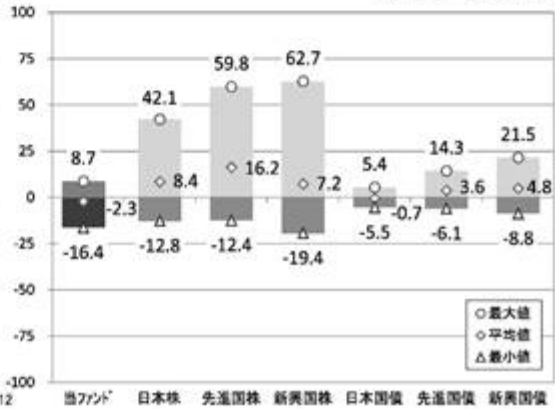


## 【外国債券インデックス（為替ヘッジあり）】

(円) (2019年1月～2023年12月) (%)



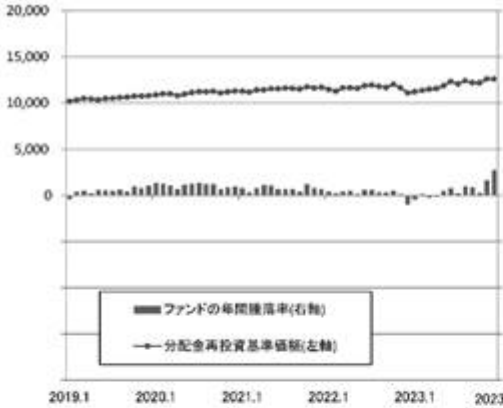
(2019年1月～2023年12月)



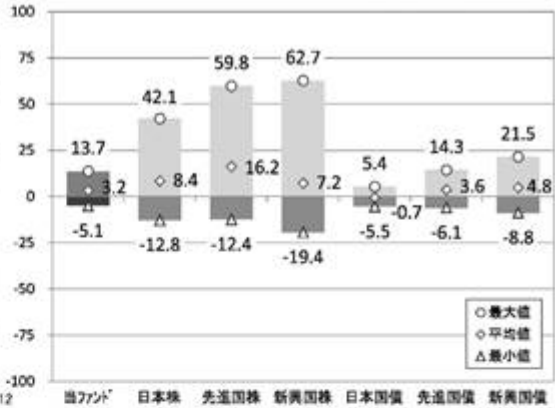


## 【外国債券インデックス（為替ヘッジなし）】

(円) (2019年1月～2023年12月)

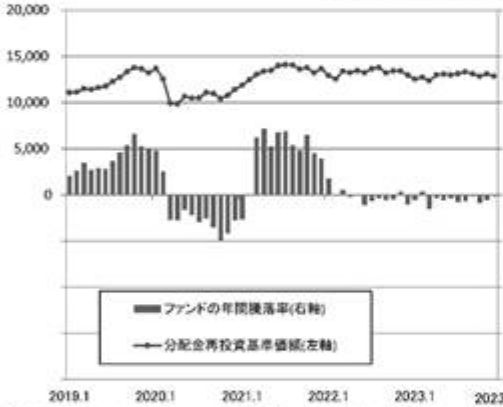


(2019年1月～2023年12月)

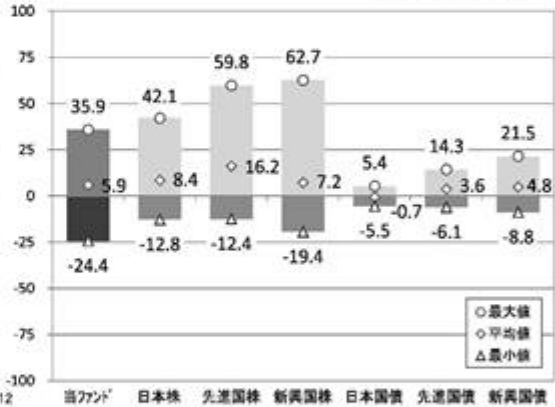


## 【J-REITインデックス】

(円) (2019年1月～2023年12月)

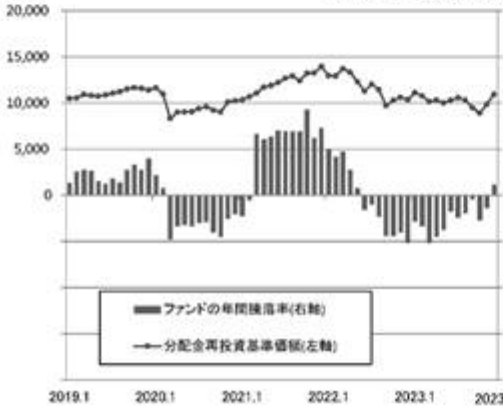


(2019年1月～2023年12月)

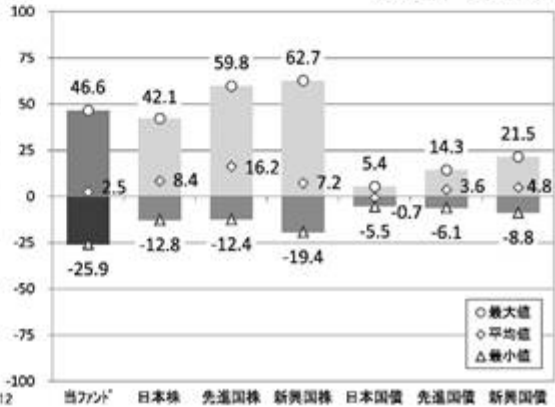


## 【外国REITインデックス（為替ヘッジあり）】

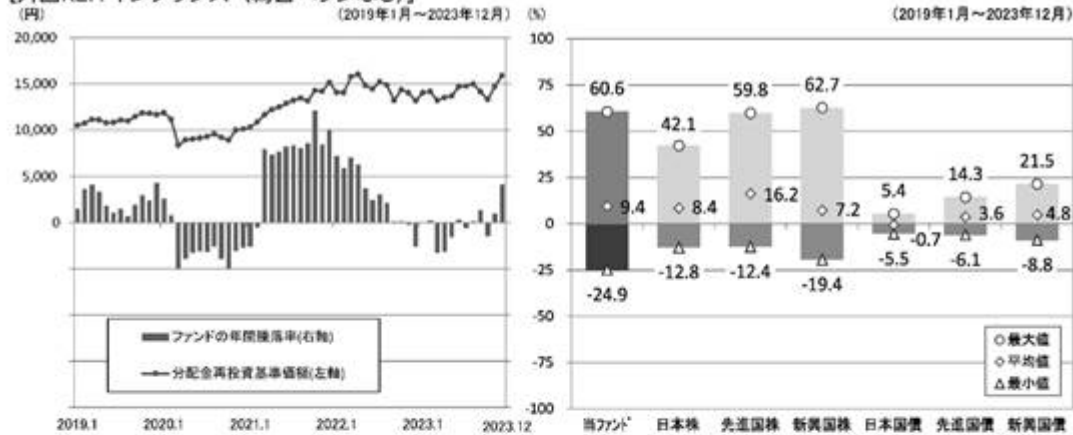
(円) (2019年1月～2023年12月)



(2019年1月～2023年12月)



## 【外国REITインデックス（為替ヘッジなし）】



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

## ※資産クラスについて

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

## ※指数について

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

## (2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

## (3)【信託報酬等】

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

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

( ) 毎月10日(休業日の場合翌営業日)(当初設定日から2017年3月10日(休業日の場合翌営業日)までの期間については当初設定日の前営業日)における新発10年国債の利回り(日本相互証券株式会社発表の終値)に応じて、純資産総額に対して以下の率とします。

(新発10年国債利回りが)

イ. 1%未満の場合 ..... 年率0.1485% (税抜0.135%)

ロ. 1%以上の場合 ..... 年率0.3355% (税抜0.305%)

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

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

< TOPIXインデックス >

< 日経225インデックス >

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

< 外国株式インデックス(為替ヘッジあり) >

< 外国株式インデックス(為替ヘッジなし) >

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

< 日本債券インデックス >

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

<外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

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

< J - R E I Tインデックス >

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

<外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

#### (4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

< マザーファンドより支弁する手数料等 >

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります（「TOPIXインデックス」および「日経225インデックス」のみ。））を選択することもできます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」について

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

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

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

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

法人の投資者に対する課税

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

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

#### <注1> 個別元本について

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

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

ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせ下さい。

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。

#### <注2> 収益分配金の課税について

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

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

- ( ) 外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- ( ) 上記は、2023年12月末日現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- ( ) 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

## 【ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）】

## (1)【投資状況】（2023年12月29日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	10,508,973,901	99.99
内 日本	10,508,973,901	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	538,997	0.01
純資産総額	10,509,512,898	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12月29日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	6,181,022,175	1.6447 10,165,933,376	1.7002 10,508,973,901	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.99%
合計	99.99%

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	4,156,052	4,168,187	1.0274	1.0304
第2計算期間末 (2018年6月15日)	99,679,256	100,618,182	1.1678	1.1788
第3計算期間末 (2019年6月17日)	1,892,823,205	1,898,380,433	1.0218	1.0248
第4計算期間末 (2020年6月15日)	5,083,506,949	5,183,291,476	1.0189	1.0389
第5計算期間末 (2021年6月15日)	2,958,666,170	3,001,224,765	1.3209	1.3399
第6計算期間末 (2022年6月15日)	2,264,818,646	2,314,133,579	1.2400	1.2670
2022年12月末日	2,729,173,744	-	1.2798	-
2023年1月末日	2,982,543,751	-	1.3359	-
2月末日	3,172,030,224	-	1.3481	-
3月末日	3,924,438,799	-	1.3706	-
4月末日	4,785,250,811	-	1.4072	-
5月末日	5,004,059,433	-	1.4572	-
第7計算期間末 (2023年6月15日)	5,633,831,264	5,710,268,303	1.5478	1.5688
6月末日	5,864,551,239	-	1.5459	-
7月末日	6,270,132,037	-	1.5685	-
8月末日	8,848,928,042	-	1.5747	-
9月末日	9,269,569,714	-	1.5826	-
10月末日	9,784,954,216	-	1.5346	-
11月末日	10,385,950,219	-	1.6173	-
12月末日	10,509,512,898	-	1.6134	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0030



第2計算期間	0.0110
第3計算期間	0.0030
第4計算期間	0.0200
第5計算期間	0.0190
第6計算期間	0.0270
第7計算期間	0.0210
2023年6月16日～ 2023年12月15日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	3.0
第2計算期間	14.7
第3計算期間	12.2
第4計算期間	1.7
第5計算期間	31.5
第6計算期間	4.1
第7計算期間	26.5
2023年6月16日～ 2023年12月15日	2.6

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	3,045,067	0
第2計算期間	81,311,932	0
第3計算期間	2,042,744,740	275,692,237
第4計算期間	20,581,650,630	17,444,833,751
第5計算期間	8,768,488,999	11,517,789,316
第6計算期間	1,305,791,488	1,719,238,551
第7計算期間	2,192,695,557	379,315,522
2023年6月16日～ 2023年12月15日	3,865,661,289	1,306,151,714

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況 (2023年12月29日現在)

## 投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		277,485,192,200	96.71
	内 日本	277,485,192,200	96.71
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		9,449,690,623	3.29
純資産総額		286,934,882,823	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)		9,440,340,000	3.29
	内 日本	9,440,340,000	3.29

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

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

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

## (2) 投資資産 (2023年12月29日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	4,533,800	2,876.73 13,042,539,717	2,590.50 11,744,808,900	4.09
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	584,000	12,808.89 7,480,396,692	13,410.00 7,831,440,000	2.73
3	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	5,094,300	1,323.05 6,740,060,153	1,211.50 6,171,744,450	2.15
4	キーエンス	日本	株式	電気機器	82,600	57,683.61 4,764,666,474	62,120.00 5,131,112,000	1.79
5	信越化学	日本	株式	化学	750,000	4,632.00 3,474,003,957	5,917.00 4,437,750,000	1.55
6	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	174,800	20,765.47 3,629,805,085	25,255.00 4,414,574,000	1.54
7	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	24,635,400	180.88 4,456,210,950	172.30 4,244,679,420	1.48
8	日立	日本	株式	電気機器	405,600	9,929.40 4,027,366,640	10,170.00 4,124,952,000	1.44

9	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	578,500	7,595.45 4,393,970,772	6,880.00 3,980,080,000	1.39
10	三菱商事	日本	株式	卸売業	1,731,300	2,536.27 4,391,056,274	2,253.50 3,901,484,550	1.36
11	任天堂	日本	株式	その他製 品	521,300	6,447.28 3,360,970,130	7,359.00 3,836,246,700	1.34
12	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	628,400	5,053.85 3,175,845,316	5,963.00 3,747,149,200	1.31
13	三井物産	日本	株式	卸売業	658,200	5,790.66 3,811,413,072	5,298.00 3,487,143,600	1.22
14	伊藤忠	日本	株式	卸売業	587,300	5,724.76 3,362,153,833	5,767.00 3,386,959,100	1.18
15	武田薬品	日本	株式	医薬品	732,900	4,810.06 3,525,298,400	4,054.00 2,971,176,600	1.04
16	本田技研	日本	株式	輸送用機 器	2,013,700	1,796.18 3,616,984,342	1,466.00 2,952,084,200	1.03
17	HOYA	日本	株式	精密機器	164,000	16,074.47 2,636,213,812	17,625.00 2,890,500,000	1.01
18	KDDI	日本	株式	情報・通信 業	640,000	4,727.72 3,025,745,720	4,486.00 2,871,040,000	1.00
19	東京海上HD	日本	株式	保険業	801,900	3,581.39 2,871,921,106	3,529.00 2,829,905,100	0.99
20	第一三共	日本	株式	医薬品	721,400	4,055.46 2,925,610,840	3,872.00 2,793,260,800	0.97
21	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,098,500	2,678.40 2,942,232,972	2,412.50 2,650,131,250	0.92
22	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信 業	408,500	6,493.12 2,652,439,755	6,293.00 2,570,690,500	0.90
23	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	449,200	5,103.35 2,292,426,452	5,251.00 2,358,749,200	0.82
24	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信 業	1,332,400	1,757.90 2,342,237,633	1,759.50 2,344,357,800	0.82
25	ダイキン工業	日本	株式	機械	99,600	24,850.11 2,475,070,969	22,985.00 2,289,306,000	0.80
26	村田製作所	日本	株式	電気機器	751,300	2,758.30 2,072,311,750	2,993.00 2,248,640,900	0.78
27	SMC	日本	株式	機械	25,000	69,725.69 1,743,142,483	75,760.00 1,894,000,000	0.66
28	三菱電機	日本	株式	電気機器	928,300	1,912.98 1,775,825,503	1,999.00 1,855,671,700	0.65

29	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	494,200	3,391.37 1,676,016,473	3,645.00 1,801,359,000	0.63
30	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	301,100	6,057.63 1,823,955,016	5,595.00 1,684,654,500	0.59

(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	96.71%
合計	96.71%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.08%
鉱業	0.33%
建設業	2.05%
食料品	3.27%
繊維製品	0.39%
パルプ・紙	0.16%
化学	5.99%
医薬品	4.46%
石油・石炭製品	0.45%
ゴム製品	0.67%
ガラス・土石製品	0.66%
鉄鋼	0.93%
非鉄金属	0.65%
金属製品	0.51%
機械	5.16%
電気機器	16.98%
輸送用機器	7.92%
精密機器	2.29%
その他製品	2.29%
電気・ガス業	1.36%
陸運業	2.75%
海運業	0.81%
空運業	0.44%
倉庫・運輸関連業	0.14%
情報・通信業	7.45%

卸売業	6.77%
小売業	4.15%
銀行業	6.71%
証券、商品先物取引業	0.78%
保険業	2.32%
その他金融業	1.11%
不動産業	1.86%
サービス業	4.81%
合計	96.71%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX 先物 0603月	買建	399	9,349,929,450	9,440,340,000	3.29%

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

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

#### (参考情報) 運用実績

## ●TOPIXインデックス

2023年12月29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	16,134円
純資産総額	105億円

## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-0.2%
3カ月間	1.9%
6カ月間	4.4%
1年間	27.8%
3年間	39.7%
5年間	76.1%
設定来	75.5%



※上記の「基準価額の騰落率」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: 210円 設定来分配金合計額: 1,040円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期				
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月	22年6月	23年6月				
分配金	30円	110円	30円	200円	190円	270円	210円				

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

## 主要な資産の状況

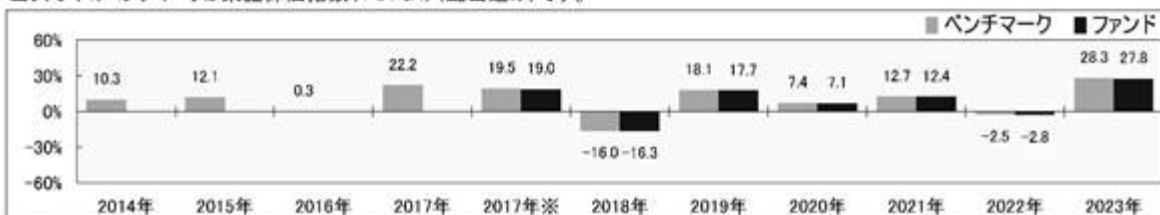
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	2,132	96.7%	電気機器	17.0%	トヨタ自動車	輸送用機器	4.1%
国内株式先物	1	3.3%	輸送用機器	7.9%	TOPIX 先物 0603月	-	3.3%
不動産投資信託等	-	-	情報・通信業	7.5%	ソニーグループ	電気機器	2.7%
コール・ローン、その他	-	3.3%	卸売業	6.8%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	2.2%
合計	2,133	-	銀行業	6.7%	キーエンス	電気機器	1.8%
株式 市場・上場別構成			化学	6.0%	信越化学	化学	1.5%
東証プライム市場		96.1%	機械	5.2%	東京エレクトロン	電気機器	1.5%
東証スタンダード市場		0.6%	サービス業	4.8%	日本電信電話	情報・通信業	1.5%
東証グロス市場		0.0%	医薬品	4.5%	日立	電気機器	1.4%
地方市場・その他		-	その他	30.5%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.4%
合計		96.7%	合計	96.7%	合計		21.4%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数(TOPIX)(配当込み)です。



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

・2017年※は設定日(2月16日)から年末、2023年は12月29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。

## 【ダイワ日経225インデックス(ダイワSMA専用)】

## (1) 【投資状況】(2023年12月29日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
---------	-------	---------

親投資信託受益証券	3,301,973,445	99.98
内 日本	3,301,973,445	99.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	535,650	0.02
純資産総額	3,302,509,095	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12月29日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ストックインデックス225・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	721,364,409	4.4028 3,176,081,226	4.5774 3,301,973,445	99.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.98%
合計	99.98%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

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

第1計算期間末 (2017年6月15日)	1,020,073	1,027,073	1.0201	1.0271
第2計算期間末 (2018年6月15日)	27,240,569	27,447,452	1.1850	1.1940
第3計算期間末 (2019年6月17日)	33,941,230	34,498,119	1.0971	1.1151
第4計算期間末 (2020年6月15日)	376,011,783	380,018,315	1.1262	1.1382
第5計算期間末 (2021年6月15日)	439,385,720	445,667,627	1.5388	1.5608
第6計算期間末 (2022年6月15日)	1,748,247,666	1,768,500,080	1.3812	1.3972
2022年12月末日	3,235,740,668	-	1.3823	-
2023年1月末日	3,407,869,842	-	1.4471	-
2月末日	1,767,476,909	-	1.4539	-
3月末日	2,770,231,008	-	1.4988	-
4月末日	1,774,685,565	-	1.5421	-
5月末日	1,922,978,876	-	1.6512	-
第7計算期間末 (2023年6月15日)	2,895,857,145	2,943,548,075	1.7609	1.7899
6月末日	2,051,463,407	-	1.7469	-
7月末日	2,927,962,681	-	1.7455	-
8月末日	2,718,709,920	-	1.7168	-
9月末日	2,356,150,848	-	1.6882	-
10月末日	2,382,003,799	-	1.6347	-
11月末日	2,689,355,081	-	1.7737	-
12月末日	3,302,509,095	-	1.7745	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0070
第2計算期間	0.0090
第3計算期間	0.0180
第4計算期間	0.0120
第5計算期間	0.0220
第6計算期間	0.0160
第7計算期間	0.0290
2023年6月16日 ~ 2023年12月15日	-



## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.7
第2計算期間	17.0
第3計算期間	5.9
第4計算期間	3.7
第5計算期間	38.6
第6計算期間	9.2
第7計算期間	29.6
2023年6月16日～ 2023年12月15日	0.8

## (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	0	0
第2計算期間	21,987,038	0
第3計算期間	816,750,378	808,799,125
第4計算期間	1,970,995,928	1,668,056,539
第5計算期間	762,009,014	810,345,465
第6計算期間	1,043,814,417	63,579,745
第7計算期間	6,874,274,786	6,495,535,854
2023年6月16日～ 2023年12月15日	3,806,000,158	3,589,431,040

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

ストックインデックス225・マザーファンド

## (1) 投資状況 (2023年12月29日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	270,319,851,190	98.65
内 日本	270,319,851,190	98.65
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,697,998,055	1.35
純資産総額	274,017,849,245	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	3,712,950,000	1.36
内 日本	3,712,950,000	1.36

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

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

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

## (2) 投資資産 (2023年12月29日現在)

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	807,000	34,689.40 27,994,349,100	34,990.00 28,236,930,000	10.30
2	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	807,000	20,784.00 16,772,689,620	25,255.00 20,380,785,000	7.44
3	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	2,152,000	4,012.25 8,634,363,280	4,797.00 10,323,144,000	3.77
4	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信 業	1,614,000	6,484.51 10,466,005,920	6,293.00 10,156,902,000	3.71
5	信越化学	日本	株式	化学	1,345,000	4,641.64 6,243,016,100	5,917.00 7,958,365,000	2.90
6	KDDI	日本	株式	情報・通信 業	1,614,000	4,723.56 7,623,833,040	4,486.00 7,240,404,000	2.64
7	ダイキン工業	日本	株式	機械	269,000	24,822.32 6,677,205,040	22,985.00 6,182,965,000	2.26
8	ファナック	日本	株式	電気機器	1,345,000	4,044.50 5,439,858,000	4,147.00 5,577,715,000	2.04
9	T D K	日本	株式	電気機器	807,000	5,685.72 4,588,378,860	6,717.00 5,420,619,000	1.98
10	テルモ	日本	株式	精密機器	1,076,000	4,317.21 4,645,318,560	4,622.00 4,973,272,000	1.81
11	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	807,000	5,050.98 4,076,143,740	5,963.00 4,812,141,000	1.76
12	京セラ	日本	株式	電気機器	2,152,000	1,936.21 4,166,725,200	2,058.00 4,428,816,000	1.62

13	中外製薬	日本	株式	医薬品	807,000	4,476.90 3,612,863,820	5,342.00 4,310,994,000	1.57
14	レーザーテック	日本	株式	電気機器	107,600	23,518.16 2,530,554,592	37,170.00 3,999,492,000	1.46
15	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	269,000	12,805.53 3,444,689,360	13,410.00 3,607,290,000	1.32
16	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	1,345,000	2,869.11 3,858,959,300	2,590.50 3,484,222,500	1.27
17	第一三共	日本	株式	医薬品	807,000	4,054.79 3,272,219,760	3,872.00 3,124,704,000	1.14
18	日東電工	日本	株式	化学	269,000	10,146.46 2,729,397,900	10,550.00 2,837,950,000	1.04
19	セコム	日本	株式	サービス業	269,000	10,385.23 2,793,627,180	10,155.00 2,731,695,000	1.00
20	NTTデータグループ	日本	株式	情報・通信業	1,345,000	2,141.48 2,880,297,500	1,999.00 2,688,655,000	0.98
21	HOYA	日本	株式	精密機器	134,500	16,082.20 2,163,056,100	17,625.00 2,370,562,500	0.87
22	本田技研	日本	株式	輸送用機器	1,614,000	1,793.17 2,894,191,200	1,466.00 2,366,124,000	0.86
23	キッコーマン	日本	株式	食料品	269,000	8,467.61 2,277,788,400	8,634.00 2,322,546,000	0.85
24	デンソー	日本	株式	輸送用機器	1,076,000	2,558.19 2,752,619,560	2,127.00 2,288,652,000	0.84
25	パンダイナムコHLDGS	日本	株式	その他製品	807,000	3,250.06 2,622,802,380	2,826.50 2,280,985,500	0.83
26	富士フイルムHLDGS	日本	株式	化学	269,000	9,096.97 2,447,087,420	8,473.00 2,279,237,000	0.83
27	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	1,345,000	2,185.39 2,939,351,800	1,686.00 2,267,670,000	0.83
28	豊田通商	日本	株式	卸売業	269,000	9,148.49 2,460,946,360	8,308.00 2,234,852,000	0.82
29	オリンパス	日本	株式	精密機器	1,076,000	2,079.12 2,237,141,200	2,040.50 2,195,578,000	0.80
30	SMC	日本	株式	機械	26,900	69,509.87 1,869,815,748	75,760.00 2,037,944,000	0.74

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
-----------	------

株式	98.65%
合計	98.65%

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.07%
鉱業	0.07%
建設業	1.65%
食料品	3.43%
繊維製品	0.10%
パルプ・紙	0.07%
化学	6.96%
医薬品	6.10%
石油・石炭製品	0.21%
ゴム製品	0.73%
ガラス・土石製品	0.71%
鉄鋼	0.08%
非鉄金属	0.68%
金属製品	0.02%
機械	4.83%
電気機器	26.65%
輸送用機器	4.44%
精密機器	3.70%
その他製品	2.27%
電気・ガス業	0.16%
陸運業	1.33%
海運業	0.44%
空運業	0.30%
倉庫・運輸関連業	0.21%
情報・通信業	9.97%
卸売業	3.12%
小売業	12.26%
銀行業	0.65%
証券、商品先物取引業	0.16%
保険業	0.89%
その他金融業	0.81%
不動産業	1.13%
サービス業	4.47%

合計	98.65%
----	--------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	NK225 先物 0603月	買建	111	3,670,381,050	3,712,950,000	1.36%

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

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

#### (参考情報) 運用実績

## ●日経225インデックス

2023年12月29日現在  
基準価額・純資産の推移

※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	17,745円
純資産総額	33億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.0%
3カ月間	5.1%
6カ月間	1.6%
1年間	30.5%
3年間	27.9%
5年間	81.4%
設定来	92.9%

※上記の「基準価額の騰落率」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: 290円 設定来分配金合計額: 1,130円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期				
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月	22年6月	23年6月				
分配金	70円	90円	180円	120円	220円	160円	290円				

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

## 主要な資産の状況

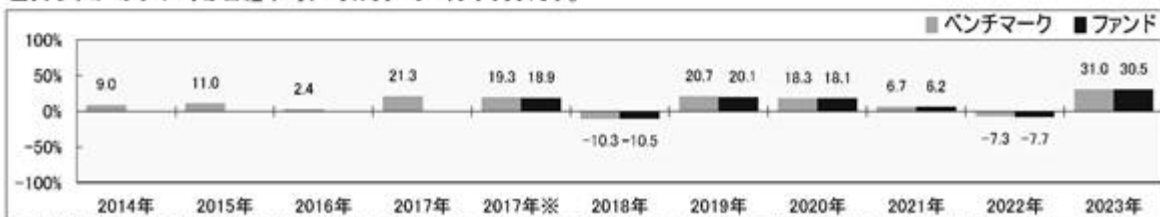
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	225	98.6%	電気機器	26.6%	ファーストリテイリング	小売業	10.3%
国内株式先物	1	1.4%	小売業	12.3%	東京エレクトロン	電気機器	7.4%
不動産投資信託等	-	-	情報・通信業	10.0%	アドバンテスト	電気機器	3.8%
コール・ローン、その他	-	1.4%	化学	7.0%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	3.7%
合計	226	-	医薬品	6.1%	信越化学	化学	2.9%
株式市場・上場別構成			機械	4.8%	KDDI	情報・通信業	2.6%
東証プライム市場		98.6%	サービス業	4.5%	ダイキン工業	機械	2.3%
東証スタンダード市場		-	輸送用機器	4.4%	ファナック	電気機器	2.0%
東証グロス市場		-	精密機器	3.7%	TDK	電気機器	2.0%
地方市場・その他		-	その他	19.3%	テルモ	精密機器	1.8%
合計		98.6%	合計	98.6%	合計		38.8%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは日経平均トータルリターン・インデックスです。



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

・2017年※は設定日(2月16日)から年末、2023年は12月29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。

## 【ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)】

## (1) 【投資状況】(2023年12月29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		22,749,012,052	99.99
	内 日本	22,749,012,052	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		3,408,746	0.01
純資産総額		22,752,420,798	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12月29日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	外国株式インデックス為替ヘッジ型マ ザーファンド	日本	親投資信 託受益証 券	7,931,182,949	2.7167 21,547,341,702	2.8683 22,749,012,052	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.99%
合計	99.99%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

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

第1計算期間末 (2017年6月15日)	3,609,633	3,630,431	1.0413	1.0473
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,333,520,140	1,345,180,653	1.1436	1.1536
第3計算期間末 (2019年6月17日)	3,003,717,900	3,053,452,707	1.1475	1.1665
第4計算期間末 (2020年6月15日)	7,959,510,896	8,070,496,281	1.1475	1.1635
第5計算期間末 (2021年6月15日)	11,208,379,177	11,357,996,884	1.5732	1.5942
第6計算期間末 (2022年6月15日)	9,983,749,975	10,101,554,505	1.3560	1.3720
2022年12月末日	5,936,490,909	-	1.3799	-
2023年1月末日	6,262,109,066	-	1.4441	-
2月末日	6,586,803,296	-	1.4334	-
3月末日	11,768,510,618	-	1.4414	-
4月末日	12,439,057,373	-	1.4660	-
5月末日	12,433,716,466	-	1.4735	-
第7計算期間末 (2023年6月15日)	12,818,618,455	12,972,128,839	1.5031	1.5211
6月末日	12,809,142,990	-	1.5043	-
7月末日	16,268,574,742	-	1.5565	-
8月末日	17,909,629,841	-	1.5238	-
9月末日	18,025,022,936	-	1.4553	-
10月末日	21,085,413,512	-	1.4002	-
11月末日	21,956,038,753	-	1.5122	-
12月末日	22,752,420,798	-	1.5798	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0060
第2計算期間	0.0100
第3計算期間	0.0190
第4計算期間	0.0160
第5計算期間	0.0210
第6計算期間	0.0160
第7計算期間	0.0180
2023年6月16日～ 2023年12月15日	-



## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	4.7
第2計算期間	10.8
第3計算期間	2.0
第4計算期間	1.4
第5計算期間	38.9
第6計算期間	12.8
第7計算期間	12.2
2023年6月16日～ 2023年12月15日	4.1

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	2,466,456	0
第2計算期間	1,162,584,923	0
第3計算期間	3,354,512,466	1,902,942,421
第4計算期間	12,869,207,903	8,550,242,735
第5計算期間	5,926,265,855	5,738,199,717
第6計算期間	3,696,975,613	3,458,845,184
第7計算期間	5,497,831,929	4,332,260,406
2023年6月16日～ 2023年12月15日	7,889,486,739	1,962,388,270

(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12月29日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	100,880,052,071	90.91
内 香港	633,427,370	0.57
内 シンガポール	386,032,387	0.35
内 イスラエル	195,432,672	0.18
内 ノルウェー	202,505,092	0.18
内 スウェーデン	1,007,098,286	0.91

内 デンマーク	1,039,735,031	0.94
内 イギリス	4,368,078,173	3.94
内 アイルランド	151,149,662	0.14
内 オランダ	1,342,135,546	1.21
内 ベルギー	270,435,351	0.24
内 フランス	3,420,293,108	3.08
内 ドイツ	2,458,768,549	2.22
内 スイス	2,890,882,417	2.61
内 ポルトガル	62,330,557	0.06
内 スペイン	763,894,927	0.69
内 イタリア	752,398,852	0.68
内 フィンランド	321,740,278	0.29
内 オーストリア	52,009,691	0.05
内 カナダ	3,440,338,376	3.10
内 アメリカ	74,965,160,657	67.55
内 オーストラリア	2,088,239,841	1.88
内 ニュージーランド	67,965,248	0.06
投資証券	2,222,974,342	2.00
内 香港	35,471,816	0.03
内 シンガポール	45,202,867	0.04
内 イギリス	37,844,891	0.03
内 ベルギー	8,330,050	0.01
内 フランス	38,145,465	0.03
内 カナダ	6,189,273	0.01
内 アメリカ	1,856,120,915	1.67
内 オーストラリア	195,669,065	0.18
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	7,866,126,051	7.09
純資産総額	110,969,152,464	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)	4,514,500,928	4.07
内 イギリス	97,961,986	0.09
内 ドイツ	819,557,242	0.74
内 カナダ	217,688,621	0.20
内 アメリカ	3,323,986,385	3.00
内 オーストラリア	55,306,694	0.05
為替予約取引(売建)	100,699,499,884	90.75

内 日本	100,699,499,884	90.75
------	-----------------	-------

(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12月29日現在）

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	200,579	19,359.79 3,883,191,430	27,455.45 5,506,986,986	4.96
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	90,566	34,046.71 3,083,485,937	53,225.96 4,820,462,511	4.34
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	119,197	13,090.05 1,560,296,236	21,753.88 2,592,997,878	2.34
4	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	31,495	26,729.84 841,858,126	70,237.05 2,212,115,972	1.99
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	13,049.06 989,380,724	19,888.82 1,507,970,401	1.36
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	28,517	21,417.74 610,770,959	50,820.52 1,449,248,929	1.31
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	66,996	13,128.63 879,566,330	20,037.74 1,342,448,590	1.21
8	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	36,442	19,987.67 728,394,211	35,908.51 1,308,578,264	1.18
9	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	5,696	88,864.57 506,172,946	159,191.41 906,754,273	0.82

10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	37,266	19,548.28 728,489,927	24,153.64 900,109,884	0.81
11	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	11,842	69,678.80 825,136,610	74,446.56 881,596,246	0.79
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	アメリカ	株式	金融	16,759	45,051.16 755,013,265	50,714.15 849,918,492	0.77
13	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	10,282	51,352.10 528,003,178	82,381.95 847,051,266	0.76
14	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	20,662	31,238.76 645,456,806	36,932.53 763,099,976	0.69
15	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	51,553	15,406.00 794,232,132	14,209.94 732,565,434	0.66
16	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	30,620	24,467.51 749,198,336	22,207.74 680,001,042	0.61
17	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	10,791	52,533.26 566,887,311	60,464.96 652,477,444	0.59
18	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	株式	ヘルスケア	44,030	10,444.99 459,893,490	14,718.05 648,036,006	0.58
19	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	12,800	44,593.76 570,800,555	49,266.06 630,605,681	0.57
20	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需 品	30,040	21,461.29 644,701,407	20,668.88 620,893,332	0.56
21	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需 品	34,164	18,638.46 636,770,171	16,283.94 556,324,854	0.50
22	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需 品	5,640	68,903.99 388,619,005	94,047.47 530,427,748	0.48
23	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	4,858	92,477.84 449,257,980	107,768.60 523,539,898	0.47
24	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	32,296	15,550.24 502,213,141	15,426.84 498,225,519	0.45
25	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	22,438	22,688.26 509,079,337	21,948.19 492,473,543	0.44
26	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	5,811	50,824.49 295,341,683	84,462.60 490,812,178	0.44
27	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	23,100	24,500.42 565,960,135	21,241.87 490,687,407	0.44
28	SALESFORCE.COM INC	アメリカ	株式	情報技術	12,434	21,994.85 273,484,398	37,667.21 468,354,107	0.42

29	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	91,878	4,698.11 431,661,402	4,805.20 441,492,202	0.40
30	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	52,398	8,809.91 461,623,697	8,332.51 436,606,990	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	90.91%
投資証券	2.00%
合計	92.91%

(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	4.40%
素材	3.79%
資本財・サービス	9.65%
一般消費財・サービス	9.61%
生活必需品	6.34%
ヘルスケア	11.45%
金融	14.29%
情報技術	21.90%
コミュニケーション・サービス	6.67%
公益事業	2.49%
不動産	0.32%
合計	90.91%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 EMINI MAR 24	買建	97	3,233,053,690	3,323,986,385	3.00%

	イギリス	FTSE 100 INDEX MAR 24	買建	7	96,368,253	97,961,986	0.09%
	オーストラリア	SPI 200 MAR 24	買建	3	54,086,558	55,306,694	0.05%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX MAR 24	買建	8	212,391,608	217,688,621	0.20%
	ドイツ	SWISS MKT IX MAR 24	買建	8	149,473,164	148,293,466	0.13%
		EURO STOXX 50 MAR 24	買建	94	677,798,240	671,263,776	0.60%
為替予約取引	日本	ユーロ売/円買 2024年1月	売建	61,032,000	9,792,008,602	9,574,248,523	8.63%
		香港ドル売/円買 2024年1月	売建	34,724,000	653,099,409	629,077,346	0.57%
		英ポンド売/円買 2024年1月	売建	24,205,400	4,496,336,813	4,364,601,541	3.93%
		シンガポール・ドル売/円買 2024年1月	売建	3,535,300	389,413,295	379,381,174	0.34%
		スイス・フラン売/円買 2024年1月	売建	17,252,700	2,912,102,128	2,900,496,319	2.61%
		ノルウェー・クローネ売/円買 2024年1月	売建	14,935,400	203,484,937	207,524,395	0.19%
		ニュージーランド・ドル売/円買 2024年1月	売建	729,100	66,083,436	65,418,862	0.06%
		デンマーク・クローネ売/円買 2024年1月	売建	47,983,000	1,032,666,134	1,010,070,939	0.91%
		カナダ・ドル売/円買 2024年1月	売建	31,756,400	3,445,915,812	3,399,163,771	3.06%
		スウェーデン・クローネ売/円買 2024年1月	売建	70,984,900	996,848,865	1,008,624,443	0.91%
		イスラエル・シュケル売/円買 2024年1月	売建	3,189,900	125,713,959	124,433,533	0.11%
		豪ドル売/円買 2024年1月	売建	22,454,300	2,184,081,062	2,173,048,563	1.96%
		米ドル売/円買 2024年1月	売建	528,933,600	77,690,554,086	74,863,410,475	67.46%

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

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

(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

## ●外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

2023年12月29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	15,798円
純資産総額	227億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	4.5%
3カ月間	8.6%
6カ月間	5.0%
1年間	15.9%
3年間	17.1%
5年間	68.0%
設定来	71.4%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 180円 設定来分配金合計額: 1,060円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月	第5期 21年6月	第6期 22年6月	第7期 23年6月				
分配金	60円	100円	190円	160円	210円	160円	180円				

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	株式業種別構成	比率	組入上位10銘柄	国・地域名	比率
外国株式・先物	1,203	95.0%	日本円	95.3%	情報技術	21.9%	APPLE INC	アメリカ	5.0%
外国リート	55	1.9%	米ドル	3.7%	金融	14.3%	MICROSOFT CORP	アメリカ	4.3%
外国投資証券	3	0.1%	ユーロ	0.3%	ヘルスケア	11.4%	S&P500 EMINI MAR 24	アメリカ	3.0%
外国ワラント	1	0.0%	豪ドル	0.2%	資本財・サービス	9.6%	AMAZON.COM INC	アメリカ	2.3%
コール・ローン、その他		7.1%	英ポンド	0.2%	一般消費財・サービス	9.6%	NVIDIA CORP	アメリカ	2.0%
合計	1,262	-	カナダ・ドル	0.1%	コミュニケーション・サービス	6.7%	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.4%
国・地域別構成			スウェーデン・クローネ	0.1%	生活必需品	6.3%	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	1.3%
アメリカ		72.2%	スイス・フラン	0.1%	エネルギー	4.4%	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.2%
イギリス		4.1%	デンマーク・クローネ	0.0%	素材	3.8%	TESLA INC	アメリカ	1.2%
その他		20.7%	その他	0.0%	公益事業、他	2.8%	BROADCOM INC	アメリカ	0.8%
合計		97.0%	合計	100.0%	合計	90.9%	合計		22.5%

※株式業種別構成は、原則としてS&PとMSCI Incが共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。  
 ※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Incが提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。  
 ※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは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。  
 ・2017年注は設定日(2月16日)から年末、2023年は12月29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。

## 【ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）】

## (1) 【投資状況】（2023年12月29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	12,526,975,485	99.99
内 日本	12,526,975,485	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,254,233	0.01
純資産総額	12,528,229,718	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12月29日現在)

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,332,248,936	4.9725 11,597,265,318	5.3712 12,526,975,485	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.99%
合計	99.99%

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】



	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	1,009,377	1,019,377	1.0094	1.0194
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,127,308	1,149,308	1.1273	1.1493
第3計算期間末 (2019年6月17日)	16,536,717	16,580,596	1.1306	1.1336
第4計算期間末 (2020年6月15日)	223,479,606	223,479,606	1.1489	1.1489
第5計算期間末 (2021年6月15日)	10,845,036,190	10,935,990,992	1.6693	1.6833
第6計算期間末 (2022年6月15日)	6,056,649,872	6,123,398,054	1.7240	1.7430
2022年12月末日	5,143,801,882	-	1.7663	-
2023年1月末日	5,434,998,373	-	1.8323	-
2月末日	5,519,297,869	-	1.8961	-
3月末日	6,209,407,518	-	1.8860	-
4月末日	7,036,488,549	-	1.9371	-
5月末日	7,155,041,095	-	2.0266	-
第7計算期間末 (2023年6月15日)	7,477,554,139	7,556,218,515	2.0912	2.1132
6月末日	7,708,181,701	-	2.1624	-
7月末日	8,719,162,788	-	2.1945	-
8月末日	10,220,865,364	-	2.2320	-
9月末日	10,882,357,118	-	2.1775	-
10月末日	11,267,426,112	-	2.1034	-
11月末日	12,135,842,410	-	2.2675	-
12月末日	12,528,229,718	-	2.3071	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0100
第2計算期間	0.0220
第3計算期間	0.0030
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0140
第6計算期間	0.0190

第7計算期間	0.0220
2023年6月16日～ 2023年12月15日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.9
第2計算期間	13.9
第3計算期間	0.6
第4計算期間	1.6
第5計算期間	46.5
第6計算期間	4.4
第7計算期間	22.6
2023年6月16日～ 2023年12月15日	9.2

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	0	0
第2計算期間	0	0
第3計算期間	13,626,454	0
第4計算期間	15,442,007,002	15,262,119,439
第5計算期間	9,570,631,213	3,268,373,640
第6計算期間	2,411,536,407	5,395,245,779
第7計算期間	3,888,370,778	3,825,779,521
2023年6月16日～ 2023年12月15日	2,649,355,967	872,796,674

(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12月29日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	394,204,531,174	92.30
内 香港	2,478,864,666	0.58
内 シンガポール	1,465,370,783	0.34

内 イスラエル	836,418,929	0.20
内 ノルウェー	830,771,149	0.19
内 スウェーデン	3,892,504,824	0.91
内 デンマーク	4,079,520,711	0.96
内 イギリス	16,810,304,680	3.94
内 アイルランド	592,238,049	0.14
内 オランダ	5,230,997,386	1.22
内 ベルギー	1,023,783,141	0.24
内 フランス	13,390,343,353	3.14
内 ドイツ	9,649,448,173	2.26
内 スイス	10,793,662,024	2.53
内 ポルトガル	252,009,198	0.06
内 スペイン	3,006,959,366	0.70
内 イタリア	2,962,573,922	0.69
内 フィンランド	1,239,523,665	0.29
内 オーストリア	206,763,584	0.05
内 カナダ	12,875,365,191	3.01
内 アメリカ	294,867,980,404	69.04
内 オーストラリア	7,474,772,261	1.75
内 ニュージーランド	244,355,715	0.06
投資証券	8,742,184,936	2.05
内 香港	137,624,462	0.03
内 シンガポール	178,472,346	0.04
内 イギリス	141,184,137	0.03
内 ベルギー	36,501,502	0.01
内 フランス	154,805,472	0.04
内 カナダ	33,596,897	0.01
内 アメリカ	7,356,706,279	1.72
内 オーストラリア	703,293,841	0.16
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	24,137,310,650	5.65
純資産総額	427,084,026,760	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)	24,057,701,579	5.63
内 イギリス	1,007,608,997	0.24
内 ドイツ	4,392,552,485	1.03
内 カナダ	1,632,664,656	0.38

	内 アメリカ	15,900,306,006	3.72
	内 オーストラリア	1,124,569,435	0.26
為替予約取引(買建)		12,655,814,230	2.96
	内 日本	12,655,814,230	2.96

(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12月29日現在）

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	787,200	26,861.18 21,145,133,453	27,455.45 21,612,931,342	5.06
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	355,500	53,732.57 19,101,969,051	53,225.96 18,921,829,633	4.43
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	467,800	20,751.14 9,707,391,813	21,753.88 10,176,467,590	2.38
4	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	124,480	68,198.95 8,489,407,966	70,237.05 8,743,108,308	2.05
5	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	298,800	19,132.15 5,716,718,692	19,888.82 5,942,779,685	1.39
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	112,000	47,084.01 5,273,409,596	50,820.52 5,691,898,867	1.33
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	262,840	19,335.68 5,082,208,289	20,037.74 5,266,720,212	1.23

8	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	143,950	34,602.40 4,981,020,385	35,908.51 5,169,031,368	1.21
9	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	22,412	133,199.07 2,985,260,102	159,191.41 3,567,797,888	0.84
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	146,370	21,895.85 3,204,910,583	24,153.64 3,535,369,604	0.83
11	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	46,666	75,969.11 3,545,179,373	74,446.56 3,474,123,496	0.81
12	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	40,685	83,938.68 3,415,046,152	82,381.95 3,351,709,860	0.78
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	アメリカ	株式	金融	65,950	50,882.07 3,355,673,618	50,714.15 3,344,598,397	0.78
14	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	80,950	36,069.07 2,919,791,876	36,932.53 2,989,688,465	0.70
15	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネル ギー	201,705	14,516.58 2,928,084,846	14,209.94 2,866,217,501	0.67
16	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	121,300	21,588.08 2,618,640,053	22,207.74 2,693,799,032	0.63
17	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	42,400	58,144.91 2,465,345,508	60,464.96 2,563,714,541	0.60
18	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	株式	ヘルスケア	170,516	14,537.06 2,478,803,958	14,718.05 2,509,664,037	0.59
19	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	50,450	44,124.44 2,226,081,844	49,266.06 2,485,473,171	0.58
20	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需 品	118,767	21,448.38 2,547,376,961	20,668.88 2,454,781,572	0.57
21	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	19,799	98,816.85 1,956,476,939	107,768.60 2,133,710,670	0.50
22	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需 品	22,360	83,407.10 1,864,985,018	94,047.47 2,102,901,496	0.49
23	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需 品	127,771	16,678.97 2,131,102,535	16,283.94 2,080,616,524	0.49
24	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	127,821	14,350.92 1,834,354,579	15,426.84 1,971,875,279	0.46
25	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	88,972	19,666.43 1,749,764,085	21,948.19 1,952,774,583	0.46
26	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	23,020	87,525.13 2,014,829,576	84,462.60 1,944,329,089	0.46

27	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	91,418	20,409.05 1,865,757,252	21,241.87 1,941,890,104	0.45
28	SALESFORCE.COM INC	アメリカ	株式	情報技術	49,066	32,801.30 1,609,434,235	37,667.21 1,848,179,395	0.43
29	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	360,201	4,299.86 1,548,817,400	4,805.20 1,730,837,989	0.41
30	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	206,950	8,259.89 1,709,406,430	8,332.51 1,724,413,462	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	92.30%
投資証券	2.05%
合計	94.35%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該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	4.41%
素材	3.79%
資本財・サービス	9.77%
一般消費財・サービス	9.80%
生活必需品	6.47%
ヘルスケア	11.65%
金融	14.40%
情報技術	22.34%
コミュニケーション・サービス	6.79%
公益事業	2.53%
不動産	0.34%
合計	92.30%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 EMINI MAR 24	買建	464	15,461,349,063	15,900,306,006	3.72%
	イギリス	FTSE 100 INDEX MAR 24	買建	72	993,499,334	1,007,608,997	0.24%
	オーストラ リア	SPI 200 MAR 24	買建	61	1,100,334,386	1,124,569,435	0.26%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX MAR 24	買建	60	1,590,070,000	1,632,664,656	0.38%
	ドイツ	SWISS MKT IX MAR 24	買建	69	1,288,757,474	1,279,031,141	0.30%
		EURO STOXX 50 MAR 24	買建	436	3,144,708,250	3,113,521,344	0.73%
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2024年 1月	買建	2,300,000	423,202,530	414,724,960	0.10%
		スイス・フラン買/円売 2024年1月	買建	5,300,000	892,415,060	891,027,520	0.21%
		ユーロ買/円売 2024年1 月	買建	10,500,000	1,671,754,730	1,647,162,300	0.39%
		豪ドル買/円売 2024年1 月	買建	7,300,000	708,673,740	706,468,450	0.17%
		カナダ・ドル買/円売 2024年1月	買建	10,000,000	1,082,909,540	1,070,387,000	0.25%
		米ドル買/円売 2024年1 月	買建	56,000,000	8,131,196,240	7,926,044,000	1.86%

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

(注2) 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

## ●外国株式インデックス（為替ヘッジなし）

2023年12月29日現在

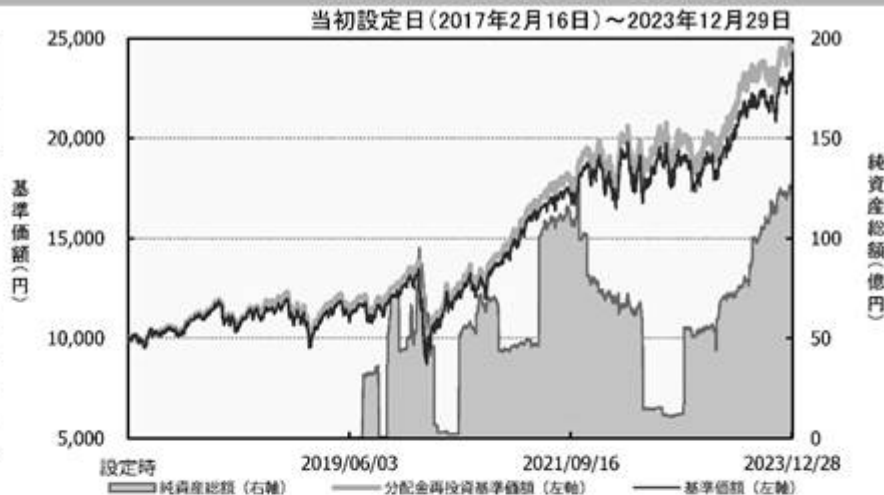
※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	23,071円
純資産総額	125億円

## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	1.7%
3カ月間	6.0%
6カ月間	6.7%
1年間	32.0%
3年間	71.6%
5年間	139.4%
設定来	145.4%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 220円 設定来分配金合計額: 900円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期				
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月	22年6月	23年6月				
分配金	100円	220円	30円	0円	140円	190円	220円				

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	株式業種別構成	比率	租入上位10銘柄	国・地域名	比率
外国株式・先物	1,203	97.9%	米ドル	74.6%	情報技術	22.3%	APPLE INC	アメリカ	5.1%
外国リート	55	2.0%	ユーロ	9.5%	金融	14.4%	MICROSOFT CORP	アメリカ	4.4%
外国投資証券	3	0.1%	英ポンド	4.2%	ヘルスケア	11.6%	S&P500 EMINI MAR 24	アメリカ	3.7%
			カナダドル	3.4%	一般消費財・サービス	9.8%	AMAZON.COM INC	アメリカ	2.4%
コール・ローン、その他		5.7%	スイス・フラン	2.8%	資本財・サービス	9.8%	NVIDIA CORP	アメリカ	2.0%
合計	1,261	-	豪ドル	2.2%	コミュニケーション・サービス	6.8%	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.4%
国・地域別構成			スウェーデン・クローネ	1.0%	生活必需品	6.5%	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	1.3%
アメリカ		74.5%	デンマーク・クローネ	1.0%	エネルギー	4.4%	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.2%
イギリス		4.2%	香港ドル	0.6%	素材	3.8%	TESLA INC	アメリカ	1.2%
その他		21.3%	その他	0.7%	公益事業、他	2.9%	BROADCOM INC	アメリカ	0.8%
合計		100.0%	合計	100.0%	合計	92.3%	合計		23.6%

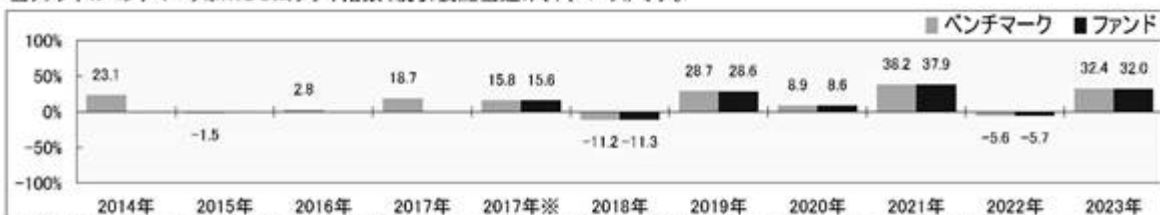
※株式業種別構成は、原則としてS&P&MSCI Inc.が共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

※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ロウサイ指数(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。

・2017年※は設定日(2月16日)から年末、2023年は12月29日までの騰落率を表示しています。

・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。

## 【ダイワ日本債券インデックス(ダイワSMA専用)】

## (1) 【投資状況】(2023年12月29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		18,569,204,074	99.90
	内 日本	18,569,204,074	99.90
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		18,556,206	0.10
純資産総額		18,587,760,280	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12月29日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	13,762,101,886	1.3719 18,881,047,535	1.3493 18,569,204,074	99.90

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.90%
合計	99.90%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

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

第1計算期間末 (2017年6月15日)	24,087,488	24,087,488	1.0065	1.0065
第2計算期間末 (2018年6月15日)	279,326,560	279,326,560	1.0124	1.0124
第3計算期間末 (2019年6月17日)	5,116,892,737	5,116,892,737	1.0363	1.0363
第4計算期間末 (2020年6月15日)	18,594,655,554	18,594,655,554	1.0235	1.0235
第5計算期間末 (2021年6月15日)	5,774,922,588	5,774,922,588	1.0197	1.0197
第6計算期間末 (2022年6月15日)	18,663,790,166	18,663,790,166	0.9848	0.9848
2022年12月末日	30,440,035,510	-	0.9625	-
2023年1月末日	30,902,421,340	-	0.9597	-
2月末日	31,247,477,372	-	0.9704	-
3月末日	24,140,319,149	-	0.9838	-
4月末日	24,700,280,311	-	0.9863	-
5月末日	24,515,456,228	-	0.9852	-
第7計算期間末 (2023年6月15日)	24,860,789,334	24,873,399,848	0.9857	0.9862
6月末日	25,007,445,621	-	0.9869	-
7月末日	16,620,917,196	-	0.9715	-
8月末日	18,508,904,141	-	0.9643	-
9月末日	18,175,186,076	-	0.9573	-
10月末日	18,118,792,165	-	0.9418	-
11月末日	18,633,570,104	-	0.9617	-
12月末日	18,587,760,280	-	0.9655	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0005
2023年6月16日～ 2023年12月15日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.7
第2計算期間	0.6
第3計算期間	2.4
第4計算期間	1.2
第5計算期間	0.4
第6計算期間	3.4
第7計算期間	0.1
2023年6月16日～ 2023年12月15日	2.5

## (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	22,931,206	0
第2計算期間	251,969,341	0
第3計算期間	8,652,065,532	3,990,278,317
第4計算期間	32,014,941,813	18,784,692,054
第5計算期間	8,663,614,937	21,168,152,589
第6計算期間	14,231,839,472	943,254,247
第7計算期間	20,573,676,151	14,304,632,814
2023年6月16日～ 2023年12月15日	4,194,320,372	10,109,451,278

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

日本債券インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況 (2023年12月29日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	94,998,040,520	84.47
内 日本	94,998,040,520	84.47
地方債証券	6,141,102,900	5.46
内 日本	6,141,102,900	5.46
特殊債券	2,699,013,000	2.40
内 日本	2,699,013,000	2.40

社債券		8,117,039,800	7.22
	内 日本	8,117,039,800	7.22
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		503,124,860	0.45
純資産総額		112,458,321,080	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12月29日現在)

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	143 5年国債	日本	国債証券	2,270,000,000	100.16 2,273,671,600	100.14 2,273,268,800	0.100000 2025/03/20	2.02
2	145 5年国債	日本	国債証券	1,770,000,000	100.17 1,773,026,700	100.15 1,772,708,100	0.100000 2025/09/20	1.58
3	147 5年国債	日本	国債証券	1,630,000,000	99.91 1,628,679,700	99.94 1,629,087,200	0.005000 2026/03/20	1.45
4	144 5年国債	日本	国債証券	1,500,000,000	100.16 1,502,548,000	100.14 1,502,175,000	0.100000 2025/06/20	1.34
5	148 5年国債	日本	国債証券	1,280,000,000	99.87 1,278,424,000	99.92 1,279,052,800	0.005000 2026/06/20	1.14
6	349 10年国債	日本	国債証券	1,250,000,000	99.71 1,246,475,000	99.92 1,249,012,500	0.100000 2027/12/20	1.11
7	146 5年国債	日本	国債証券	1,180,000,000	100.15 1,181,802,400	100.15 1,181,840,800	0.100000 2025/12/20	1.05
8	370 10年国債	日本	国債証券	1,190,000,000	98.80 1,175,731,800	99.30 1,181,670,000	0.500000 2033/03/20	1.05
9	363 10年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	97.16 1,165,920,000	97.68 1,172,232,000	0.100000 2031/06/20	1.04
10	347 10年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	99.91 1,099,021,000	100.06 1,100,748,000	0.100000 2027/06/20	0.98
11	348 10年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	99.82 1,048,204,500	100.00 1,050,000,000	0.100000 2027/09/20	0.93
12	150 5年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	99.75 1,047,438,000	99.85 1,048,446,000	0.005000 2026/12/20	0.93
13	353 10年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	99.13 1,040,892,900	99.38 1,043,553,000	0.100000 2028/12/20	0.93

14	366 10年国債	日本	国債証券	1,020,000,000	97.18 991,274,300	97.67 996,264,600	0.200000 2032/03/20	0.89
15	360 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	97.94 979,480,000	98.49 984,900,000	0.100000 2030/09/20	0.88
16	364 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	96.85 968,500,000	97.39 973,920,000	0.100000 2031/09/20	0.87
17	345 10年国債	日本	国債証券	950,000,000	100.04 950,427,500	100.14 951,396,500	0.100000 2026/12/20	0.85
18	365 10年国債	日本	国債証券	950,000,000	96.60 917,738,000	97.12 922,678,000	0.100000 2031/12/20	0.82
19	350 10年国債	日本	国債証券	900,000,000	99.59 896,355,000	99.74 897,741,000	0.100000 2028/03/20	0.80
20	367 10年国債	日本	国債証券	900,000,000	96.94 872,487,000	97.40 876,663,000	0.200000 2032/06/20	0.78
21	149 5年国債	日本	国債証券	860,000,000	99.83 858,555,200	99.89 859,062,600	0.005000 2026/09/20	0.76
22	151 5年国債	日本	国債証券	850,000,000	99.66 847,181,000	99.80 848,368,000	0.005000 2027/03/20	0.75
23	344 10年国債	日本	国債証券	780,000,000	100.09 780,756,600	100.16 781,263,600	0.100000 2026/09/20	0.69
24	343 10年国債	日本	国債証券	780,000,000	100.11 780,889,200	100.15 781,240,200	0.100000 2026/06/20	0.69
25	346 10年国債	日本	国債証券	780,000,000	99.98 779,867,400	100.12 780,990,600	0.100000 2027/03/20	0.69
26	362 10年国債	日本	国債証券	790,000,000	97.42 769,641,700	97.96 773,939,300	0.100000 2031/03/20	0.69
27	340 10年国債	日本	国債証券	760,000,000	100.71 765,411,200	100.66 765,061,600	0.400000 2025/09/20	0.68
28	153 5年国債	日本	国債証券	750,000,000	99.57 746,812,500	99.72 747,930,000	0.005000 2027/06/20	0.67
29	357 10年国債	日本	国債証券	750,000,000	98.63 739,762,500	99.03 742,740,000	0.100000 2029/12/20	0.66
30	371 10年国債	日本	国債証券	750,000,000	97.73 733,026,500	98.16 736,245,000	0.400000 2033/06/20	0.65

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	84.47%
地方債証券	5.46%

特殊債券	2.40%
社債券	7.22%
合計	99.55%

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### (参考情報) 運用実績

## ●日本債券インデックス

2023年12月29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	9,655円
純資産総額	185億円

## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.4%
3カ月間	0.9%
6カ月間	-2.2%
1年間	0.4%
3年間	-5.3%
5年間	-4.9%
設定来	-3.4%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

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

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

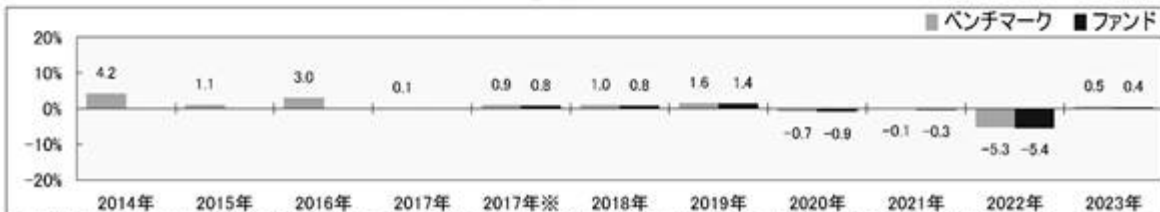
資産別構成	銘柄数	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	利率(%)	償還日	比率	
国内債券	392	99.5%	直接利回り(%)	143 5年国債	0.100	2025/03/20	2.0%	
国内債券先物	-	-	最終利回り(%)	145 5年国債	0.100	2025/09/20	1.6%	
コール・ローン、その他		0.5%	修正デュレーション	147 5年国債	0.005	2026/03/20	1.4%	
合計	392	100.0%	残存年数	144 5年国債	0.100	2025/06/20	1.3%	
債券種別構成		比率	格付別構成	比率	148 5年国債	0.005	2026/06/20	1.1%
国債		84.2%	AAA	86.6%	349 10年国債	0.100	2027/12/20	1.1%
事業債		8.0%	AA	7.1%	146 5年国債	0.100	2025/12/20	1.0%
地方債		6.4%	A	3.8%	370 10年国債	0.500	2033/03/20	1.0%
政府保証債		0.6%	BBB	-	363 10年国債	0.100	2031/06/20	1.0%
その他		0.3%	BB以下・無格付	2.5%	347 10年国債	0.100	2027/06/20	1.0%
合計		99.5%	合計	100.0%	合計			12.7%

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.5%保有しております。

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

## 年間収益率の推移

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



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

※2017年※は設定日(2月16日)から年末、2023年は12月29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。

## 【ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)】

## (1) 【投資状況】(2023年12月29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	20,809,264,468	99.71
内 日本	20,809,264,468	99.71
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	59,656,428	0.29
純資産総額	20,868,920,896	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12月29日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	23,976,569,269	0.8574 20,558,312,738	0.8679 20,809,264,468	99.71

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.71%
合計	99.71%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

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



第1計算期間末 (2017年6月15日)	20,274,657	20,274,657	1.0212	1.0212
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,398,757,675	1,398,757,675	0.9966	0.9966
第3計算期間末 (2019年6月17日)	12,750,079,921	12,750,079,921	1.0418	1.0418
第4計算期間末 (2020年6月15日)	22,300,327,697	22,300,327,697	1.0992	1.0992
第5計算期間末 (2021年6月15日)	8,180,398,456	8,180,398,456	1.0724	1.0724
第6計算期間末 (2022年6月15日)	16,292,732,543	16,507,053,334	0.9122	0.9242
2022年12月末日	15,775,498,701	-	0.8800	-
2023年1月末日	16,041,937,415	-	0.8932	-
2月末日	15,537,936,425	-	0.8716	-
3月末日	15,932,076,108	-	0.8865	-
4月末日	15,890,044,090	-	0.8825	-
5月末日	15,506,515,342	-	0.8747	-
第7計算期間末 (2023年6月15日)	15,393,229,356	15,393,229,356	0.8698	0.8698
6月末日	15,456,389,262	-	0.8683	-
7月末日	18,995,764,920	-	0.8637	-
8月末日	19,785,901,558	-	0.8566	-
9月末日	19,344,569,044	-	0.8331	-
10月末日	19,991,580,027	-	0.8283	-
11月末日	20,611,397,469	-	0.8514	-
12月末日	20,868,920,896	-	0.8747	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0120
第7計算期間	0.0000
2023年6月16日～ 2023年12月15日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.1
第2計算期間	2.4
第3計算期間	4.5
第4計算期間	5.5
第5計算期間	2.4
第6計算期間	13.8
第7計算期間	4.6
2023年6月16日～ 2023年12月15日	0.1

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	18,852,947	0
第2計算期間	1,383,614,307	0
第3計算期間	14,932,722,296	4,098,050,663
第4計算期間	31,728,087,266	23,677,730,208
第5計算期間	7,679,681,362	20,339,945,076
第6計算期間	11,384,539,682	1,152,705,931
第7計算期間	11,600,215,353	11,762,616,828
2023年6月16日～ 2023年12月15日	7,968,385,188	1,742,056,266

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド

## (1) 投資状況 (2023年12月29日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	123,846,079,702	94.08
内 ユーロ	41,752,447,187	31.72
内 中国	9,501,644,997	7.22
内 シンガポール	567,493,115	0.43
内 マレーシア	670,703,406	0.51
内 イスラエル	383,472,143	0.29

内 ルウェー	193,804,755	0.15
内 スウェーデン	293,415,995	0.22
内 デンマーク	377,425,119	0.29
内 イギリス	6,503,650,436	4.94
内 ポーランド	612,542,131	0.47
内 カナダ	2,591,633,543	1.97
内 アメリカ	57,170,354,735	43.43
内 メキシコ	1,041,968,514	0.79
内 オーストラリア	1,954,546,273	1.48
内 ニュージーランド	230,977,353	0.18
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	7,799,360,789	5.92
純資産総額	131,645,440,491	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
債券先物取引(買建)	1,949,823,044	1.48
内 ドイツ	146,255,152	0.11
内 アメリカ	1,803,567,892	1.37
為替予約取引(売建)	123,271,772,713	93.64
内 日本	123,271,772,713	93.64

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

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

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

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

## (2) 投資資産 (2023年12月29日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	15,800,000	96.21 2,156,117,814	97.63 2,187,938,793	2.500000 2025/01/31	1.66
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	15,300,000	95.24 2,066,750,447	96.78 2,100,233,532	2.125000 2025/05/15	1.60
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	14,000,000	92.86 1,843,906,300	94.29 1,872,399,947	2.250000 2027/08/15	1.42

4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	12,850,000	92.85 1,692,296,767	94.49 1,722,204,246	2.000000 2026/11/15	1.31
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,950,000	108.10 1,372,210,852	107.83 1,368,796,224	6.125000 2027/11/15	1.04
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,500,000	93.00 1,253,068,050	94.71 1,276,216,124	1.625000 2026/02/15	0.97
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,800,000	94.82 1,183,452,212	96.27 1,201,662,050	2.250000 2025/11/15	0.91
8	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	99.88 1,133,381,162	101.10 1,147,132,386	5.000000 2025/10/31	0.87
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	92.78 1,052,800,686	93.59 1,061,966,308	0.250000 2025/07/31	0.81
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	89.37 1,014,118,539	91.54 1,038,740,227	0.625000 2026/07/31	0.79
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,500,000	92.95 988,806,848	94.20 1,002,060,861	2.625000 2029/02/15	0.76
12	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	99.22 985,131,235	100.47 997,535,775	4.000000 2028/06/30	0.76
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	93.14 924,782,658	94.80 941,183,880	1.875000 2026/06/30	0.71
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,865,000	92.52 900,901,117	94.30 918,242,054	1.625000 2026/05/15	0.70
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,000,000	90.94 773,889,721	92.74 789,266,930	1.500000 2027/01/31	0.60
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,300,000	86.08 769,149,763	88.12 787,422,431	0.750000 2028/01/31	0.60
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,750,000	91.75 748,298,980	93.55 762,921,298	1.500000 2026/08/15	0.58
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	95.53 745,219,496	97.02 756,842,464	2.000000 2025/02/15	0.57
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,550,000	93.53 736,298,318	94.97 747,625,500	2.375000 2027/05/15	0.57
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,300,000	79.80 713,036,142	81.23 725,867,218	0.625000 2030/08/15	0.55
21	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,400,000	78.26 664,078,207	82.47 699,757,488	- 2032/05/25	0.53
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	87.80 684,943,873	89.65 699,359,475	1.250000 2028/03/31	0.53
23	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	5,300,000	92.74 697,155,720	92.94 698,681,669	2.875000 2032/05/15	0.53

24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,400,000	87.96 673,731,077	89.35 684,384,496	1.750000 2029/11/15	0.52
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,000,000	93.37 662,168,812	94.90 673,040,082	2.250000 2027/02/15	0.51
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,820,000	94.65 647,060,570	96.19 657,581,491	2.000000 2025/08/15	0.50
27	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,270,000	121.63 624,939,222	126.18 648,290,632	4.750000 2034/07/04	0.49
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,000,000	87.44 620,144,583	89.08 631,725,003	1.625000 2029/08/15	0.48
29	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,500,000	94.15 600,929,367	96.29 614,594,775	3.375000 2033/05/15	0.47
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,300,000	95.60 583,077,454	96.61 589,224,934	3.125000 2028/11/15	0.45

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	94.08%
合計	94.08%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
債券先物取引	アメリカ	US LONG BOND MAR 24	買建	2	32,557,528	35,492,958	0.03%
		US 10YR NOTE MAR 24	買建	10	154,155,949	160,112,781	0.12%
		US 5YR NOTE MAR 24	買建	15	225,483,171	231,227,222	0.18%
		US 2YR NOTE MAR 24	買建	40	1,155,001,342	1,167,482,495	0.89%
		US ULTRA T-BOND MAR 24	買建	11	187,976,210	209,252,436	0.16%
	ドイツ	EURO-SCHATZ MAR 24	買建	5	83,452,245	83,752,816	0.06%

		EURO-OAT MAR 24	買建	3	60,594,459	62,502,336	0.05%
為替予約取引	日本	ポーランド・ズロチ売/ 円買 2024年1月	売建	18,121,000	666,401,587	653,876,351	0.50%
		ユーロ売/円買 2024年1 月	売建	262,592,000	42,171,277,350	41,198,479,027	31.30%
		英ポンド売/円買 2024年 1月	売建	36,536,000	6,798,615,226	6,589,019,155	5.01%
		シンガポール・ドル売/ 円買 2024年1月	売建	5,499,000	606,443,467	590,181,274	0.45%
		オフショア人民元売/円 買 2024年1月	売建	491,682,000	10,144,186,351	9,784,422,631	7.43%
		マレーシア・リンギット 売/円買 2024年1月	売建	21,280,000	653,296,000	653,764,160	0.50%
		ノルウェー・クローネ 売/円買 2024年1月	売建	15,164,000	206,924,911	210,731,075	0.16%
		メキシコ・ペソ売/円買 2024年1月	売建	132,056,000	1,109,917,474	1,097,860,761	0.83%
		ニュージーランド・ドル 売/円買 2024年1月	売建	3,057,000	277,490,004	274,334,262	0.21%
		デンマーク・クローネ 売/円買 2024年1月	売建	25,693,000	553,594,224	540,912,159	0.41%
		カナダ・ドル売/円買 2024年1月	売建	24,996,000	2,710,641,228	2,675,926,783	2.03%
		スウェーデン・クローネ 売/円買 2024年1月	売建	20,945,000	294,254,210	297,641,017	0.23%
		イスラエル・シケル 売/円買 2024年1月	売建	12,208,000	482,237,974	476,296,340	0.36%
		豪ドル売/円買 2024年1 月	売建	20,413,000	1,991,206,498	1,975,753,857	1.50%
米ドル売/円買 2024年1 月	売建	397,379,000	58,389,082,055	56,252,573,861	42.73%		

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

## ●外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

2023年12月29日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	8,747円
純資産総額	208億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	2.7%
3か月間	5.0%
6か月間	0.7%
1年間	-0.6%
3年間	-20.1%
5年間	-11.7%
設定来	-11.4%



※上記の「基準価額の騰落率」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: 120円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期			
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月	22年6月	23年6月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	120円	0円			

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	償還日	比率
外国債券・先物	648	95.3%	日本円	97.1%	直接利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2025/01/31	1.7%
			米ドル	1.4%	最終利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2025/05/15	1.6%
コール・ローン、その他		6.2%	ユーロ	1.1%	修正デュレーション	United States Treasury Note/Bond	2027/08/15	1.4%
合計	648	-	英ポンド	0.2%	残存年数	United States Treasury Note/Bond	2026/11/15	1.3%
債券種別構成			カナダ・ドル	0.1%	格付別構成	United States Treasury Note/Bond	2027/11/15	1.0%
国債		93.8%	豪ドル	0.0%	AAA	United States Treasury Note/Bond	2026/02/15	1.0%
			オフショア人民元	0.0%	AA	United States Treasury Note/Bond	2025/11/15	0.9%
			マレーシア・リンギット	0.0%	A	US 2YR NOTE MAR 24	-	0.9%
			デンマーク・クローネ	0.0%	BBB	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2025/10/31	0.9%
			その他	0.0%	BB	United States Treasury Note/Bond	2025/07/31	0.8%
合計		93.8%	合計	100.0%	合計	合計		11.4%

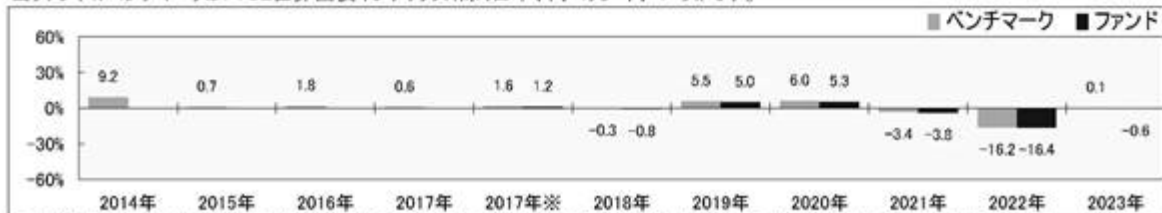
※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

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



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

※2017年※は設定日(2月16日)から年末、2023年は12月29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。

## 【ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)】

## (1) 【投資状況】(2023年12月29日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
---------	-------	---------

親投資信託受益証券		11,029,329,494	99.72
	内 日本	11,029,329,494	99.72
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		31,508,239	0.28
純資産総額		11,060,837,733	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12月29日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信 託受益証 券	3,211,428,341	3.2716 10,506,654,031	3.4344 11,029,329,494	99.72

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.72%
合計	99.72%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

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



第1計算期間末 (2017年6月15日)	1,006,543	1,009,043	1.0065	1.0090
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,002,760	1,014,760	1.0028	1.0148
第3計算期間末 (2019年6月17日)	11,002,175	11,110,214	1.0184	1.0284
第4計算期間末 (2020年6月15日)	55,667,910	55,667,910	1.0764	1.0764
第5計算期間末 (2021年6月15日)	5,570,659,890	5,580,511,300	1.1309	1.1329
第6計算期間末 (2022年6月15日)	7,907,633,750	8,029,900,681	1.0995	1.1165
2022年12月末日	5,242,727,765	-	1.0641	-
2023年1月末日	5,338,323,002	-	1.0762	-
2月末日	5,333,676,851	-	1.0890	-
3月末日	7,505,626,963	-	1.1022	-
4月末日	7,930,815,268	-	1.1099	-
5月末日	8,111,570,619	-	1.1381	-
第7計算期間末 (2023年6月15日)	7,912,131,124	8,132,324,719	1.1139	1.1449
6月末日	8,242,193,677	-	1.1509	-
7月末日	9,564,865,168	-	1.1257	-
8月末日	11,079,538,212	-	1.1559	-
9月末日	11,008,439,983	-	1.1384	-
10月末日	10,595,260,120	-	1.1366	-
11月末日	10,934,626,032	-	1.1759	-
12月末日	11,060,837,733	-	1.1769	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0025
第2計算期間	0.0120
第3計算期間	0.0100
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0020
第6計算期間	0.0170
第7計算期間	0.0310
2023年6月16日～ 2023年12月15日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.9
第2計算期間	0.8
第3計算期間	2.6
第4計算期間	5.7
第5計算期間	5.2
第6計算期間	1.3
第7計算期間	4.1
2023年6月16日～ 2023年12月15日	4.8

## (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	0	0
第2計算期間	0	0
第3計算期間	83,995,237	74,191,315
第4計算期間	9,243,518,976	9,202,608,333
第5計算期間	15,970,263,749	11,096,272,833
第6計算期間	3,239,365,115	972,898,169
第7計算期間	4,176,709,431	4,265,862,658
2023年6月16日～ 2023年12月15日	3,818,013,994	1,568,526,298

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

外国債券インデックスマザーファンド

## (1) 投資状況 (2023年12月29日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	277,280,751,671	97.37
内 ユーロ	93,118,066,871	32.70
内 中国	20,011,925,551	7.03
内 シンガポール	1,098,663,028	0.39
内 マレーシア	1,316,498,709	0.46
内 イスラエル	765,436,630	0.27

内 ノルウェー	481,659,493	0.17
内 スウェーデン	558,993,343	0.20
内 デンマーク	772,676,567	0.27
内 イギリス	14,451,072,324	5.07
内 ポーランド	1,344,339,405	0.47
内 カナダ	5,310,603,365	1.86
内 アメリカ	131,127,579,614	46.05
内 メキシコ	2,351,544,698	0.83
内 オーストラリア	3,940,779,343	1.38
内 ニュージーランド	630,912,730	0.22
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	7,494,665,935	2.63
純資産総額	284,775,417,606	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	1,918,672,847	0.67
内 日本	1,918,672,847	0.67
為替予約取引(売建)	205,774,480	0.07
内 日本	205,774,480	0.07

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

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

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

## (2) 投資資産 (2023年12月29日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,700,000	98.77 1,358,870,535	101.97 1,402,880,809	4.125000 2032/11/15	0.49
2	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,400,000	83.48 1,231,445,215	86.22 1,271,861,092	1.875000 2032/02/15	0.45
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	81.06 1,230,272,565	83.62 1,269,077,111	1.125000 2031/02/15	0.45
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	88.86 1,197,380,627	91.86 1,237,802,177	2.750000 2032/08/15	0.43
5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,300,000	90.04 1,187,657,897	92.94 1,225,988,589	2.875000 2032/05/15	0.43

6	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	80.39 1,174,405,728	82.97 1,212,154,066	1.250000 2031/08/15	0.43
7	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	60,000,000	99.79 1,193,027,685	100.24 1,198,440,855	2.390000 2026/11/15	0.42
8	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	80.62 1,143,476,009	83.27 1,181,032,593	1.375000 2031/11/15	0.41
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	79.93 1,110,988,145	82.31 1,144,165,870	0.875000 2030/11/15	0.40
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	94.06 1,067,265,076	97.29 1,103,936,641	3.500000 2033/02/15	0.39
11	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,800,000	93.03 1,029,177,764	96.29 1,065,297,611	3.375000 2033/05/15	0.37
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,700,000	83.35 1,028,485,492	85.96 1,060,777,205	1.625000 2031/05/15	0.37
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	93.37 1,023,580,550	94.30 1,033,808,134	1.625000 2026/05/15	0.36
14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	96.81 961,159,217	100.23 995,133,175	3.875000 2033/08/15	0.35
15	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,899,000	100.18 928,556,285	102.07 946,120,109	2.750000 2027/10/25	0.33
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	78.86 894,833,836	81.23 921,736,150	0.625000 2030/08/15	0.32
17	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	91.11 904,598,831	92.22 915,648,806	1.125000 2026/10/31	0.32
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	94.06 893,815,496	95.68 909,238,232	2.875000 2028/08/15	0.32
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	94.30 869,365,422	95.89 884,041,991	2.875000 2028/05/15	0.31
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	92.33 864,299,538	94.20 881,813,558	2.625000 2029/02/15	0.31
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	86.57 859,475,617	88.12 874,913,812	0.750000 2028/01/31	0.31
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	93.09 858,201,274	93.86 865,318,303	0.250000 2025/06/30	0.30
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,400,000	93.70 850,598,760	94.97 862,126,703	2.375000 2027/05/15	0.30
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,350,000	94.06 847,195,691	95.59 860,984,191	2.750000 2028/02/15	0.30
25	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	99.80 849,278,040	100.66 856,656,036	4.375000 2026/08/15	0.30

26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	91.60 844,465,038	92.74 855,039,174	1.500000 2027/01/31	0.30
27	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,087,000	98.67 788,687,112	101.79 813,648,297	2.500000 2030/05/25	0.29
28	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	92.53 787,471,362	94.51 804,303,747	2.750000 2029/05/31	0.28
29	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	40,000,000	99.73 794,879,971	100.49 800,897,260	2.670000 2033/05/25	0.28
30	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,400,000	91.92 779,918,855	94.15 798,873,183	0.750000 2028/05/25	0.28

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.37%
合計	97.37%

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2024年1月	買建	2,801,000	398,026,351	396,574,102	0.14%
		ニュージーランド・ドル買/円売 2024年1月	買建	284,000	25,779,248	25,486,074	0.01%
		メキシコ・ペソ買/円売 2024年1月	買建	5,564,000	46,764,863	46,256,870	0.02%
		ポーランド・ズロチ買/円売 2024年1月	買建	2,820,000	102,405,360	101,848,975	0.04%
		ユーロ買/円売 2024年1月	買建	1,778,000	276,941,970	278,990,606	0.10%

英ポンド買/円売 2024年1月	買建	172,000	31,130,871	31,019,029	0.01%
シンガポール・ドル買/円売 2024年1月	買建	177,000	19,520,002	18,996,560	0.01%
オフショア人民元買/円売 2024年1月	買建	50,715,000	1,046,331,594	1,009,223,428	0.35%
カナダ・ドル買/円売 2024年1月	買建	96,000	10,070,572	10,277,203	0.00%
メキシコ・ペソ売/円買 2024年1月	売建	24,696,000	205,967,356	205,774,480	0.07%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

## ●外国債券インデックス（為替ヘッジなし）

2023年12月29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	11,769円
純資産総額	110億円

## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.1%
3カ月間	3.4%
6カ月間	2.3%
1年間	13.7%
3年間	11.7%
5年間	22.9%
設定来	26.1%



※上記の「基準価額の騰落率」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: 310円 設定来分配金合計額: 745円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期				
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月	22年6月	23年6月				
分配金	25円	120円	100円	0円	20円	170円	310円				

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

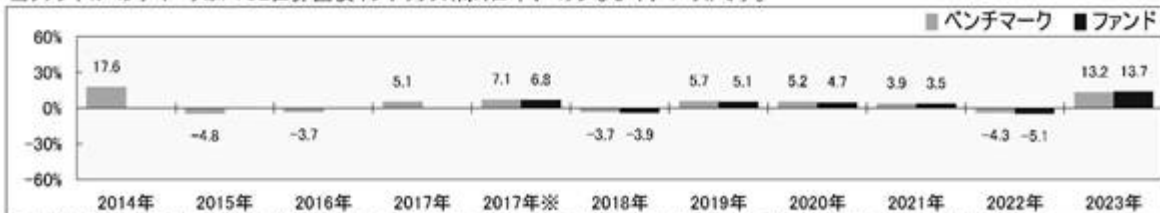
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	相上位10銘柄	償還日	比率
外国債券	972	97.1%	米ドル	46.6%	直接利回り(%)	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2032/11/15	0.5%
			ユーロ	33.3%	最終利回り(%)	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2032/02/15	0.4%
コール・ローン、その他		2.9%	オフショア人民元	7.5%	修正デュレーション	United States Treasury Note/Bond	2031/02/15	0.4%
合計	972	100.0%	英ポンド	5.3%	残存年数	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2032/08/15	0.4%
債券種別構成			カナダ・ドル	2.0%	格付別構成	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2032/05/15	0.4%
国債		97.1%	豪ドル	1.4%	AAA	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2031/08/15	0.4%
			メキシコ・ペソ	0.9%	AA	CHINA GOVERNMENT BOND	2026/11/15	0.4%
			ポーランド・ズロチ	0.5%	A	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2031/11/15	0.4%
			マレーシア・リンギット	0.5%	BBB	United States Treasury Note/Bond	2030/11/15	0.4%
			その他	2.0%	BB	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2033/02/15	0.4%
合計		97.1%	合計	100.0%	合計	合計		4.3%

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

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

## 年間収益率の推移

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



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

・2017年※は設定日(2月16日)から年末、2023年は12月29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J-REITインデックス(ダイワSMA専用)】

## (1) 【投資状況】(2023年12月29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		1,728,203,924	99.95
	内 日本	1,728,203,924	99.95
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		791,959	0.05
純資産総額		1,728,995,883	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12月29日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	531,591,487	3.2846 1,746,072,920	3.2510 1,728,203,924	99.95

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.95%
合計	99.95%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

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



第1計算期間末 (2017年6月15日)	3,456,480	3,474,147	0.9782	0.9832
第2計算期間末 (2018年6月15日)	321,051,059	322,484,783	1.0077	1.0122
第3計算期間末 (2019年6月17日)	1,249,306,029	1,280,156,651	1.1339	1.1619
第4計算期間末 (2020年6月15日)	569,353,890	587,148,598	0.9599	0.9899
第5計算期間末 (2021年6月15日)	1,329,867,898	1,362,116,299	1.2784	1.3094
第6計算期間末 (2022年6月15日)	1,133,538,419	1,163,781,811	1.1244	1.1544
2022年12月末日	1,194,856,243	-	1.1548	-
2023年1月末日	1,181,082,097	-	1.1177	-
2月末日	1,244,318,174	-	1.1350	-
3月末日	1,211,801,753	-	1.1017	-
4月末日	1,298,984,425	-	1.1578	-
5月末日	1,305,174,286	-	1.1649	-
第7計算期間末 (2023年6月15日)	1,291,290,049	1,332,713,587	1.1222	1.1582
6月末日	1,317,359,305	-	1.1213	-
7月末日	1,356,008,220	-	1.1340	-
8月末日	1,784,790,879	-	1.1505	-
9月末日	1,836,133,525	-	1.1322	-
10月末日	1,790,632,635	-	1.1084	-
11月末日	1,794,577,458	-	1.1297	-
12月末日	1,728,995,883	-	1.1108	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0050
第2計算期間	0.0045
第3計算期間	0.0280
第4計算期間	0.0300
第5計算期間	0.0310
第6計算期間	0.0300
第7計算期間	0.0360
2023年6月16日～ 2023年12月15日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.7
第2計算期間	3.5
第3計算期間	15.3
第4計算期間	12.7
第5計算期間	36.4
第6計算期間	9.7
第7計算期間	3.0
2023年6月16日～ 2023年12月15日	1.2

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	2,533,441	0
第2計算期間	315,071,967	0
第3計算期間	1,083,924,855	300,722,332
第4計算期間	3,863,471,660	4,372,122,644
第5計算期間	633,413,235	186,299,155
第6計算期間	1,050,973,291	1,083,131,246
第7計算期間	276,978,902	134,438,138
2023年6月16日～ 2023年12月15日	482,959,970	77,546,555

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

ダイワJ-REITマザーファンド

## (1) 投資状況 (2023年12月29日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	393,057,788,500	97.52
内 日本	393,057,788,500	97.52
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,009,844,123	2.48
純資産総額	403,067,632,623	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	10,012,800,000	2.48
内 日本	10,012,800,000	2.48

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

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

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

## (2) 投資資産 (2023年12月29日現在)

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	44,547	610,028.57 27,174,942,784	611,000.00 27,218,217,000	6.75
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	39,224	595,835.44 23,371,049,381	584,000.00 22,906,816,000	5.68
3	野村不動産マスターF	日本	投資証券	123,486	171,250.58 21,147,049,215	165,000.00 20,375,190,000	5.06
4	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	183,037	96,916.80 17,739,361,452	101,900.00 18,651,470,300	4.63
5	GLP投資法人	日本	投資証券	128,989	137,793.64 17,773,864,157	140,500.00 18,122,954,500	4.50
6	日本プロロジスリート	日本	投資証券	66,522	277,438.99 18,455,796,555	271,400.00 18,054,070,800	4.48
7	KDX不動産投資法人	日本	投資証券	109,891	170,271.91 18,711,351,203	160,800.00 17,670,472,800	4.38
8	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	57,560	263,967.98 15,193,997,209	251,700.00 14,487,852,000	3.59
9	オリックス不動産投資	日本	投資証券	76,086	178,246.95 13,562,098,098	166,500.00 12,668,319,000	3.14
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	85,420	156,631.25 13,379,442,117	144,100.00 12,309,022,000	3.05
11	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	37,466	335,833.79 12,582,348,791	316,000.00 11,839,256,000	2.94
12	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	184,888	60,404.02 11,167,979,099	61,000.00 11,278,168,000	2.80

13	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	26,115	371,892.70 9,711,978,077	350,000.00 9,140,250,000	2.27
14	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	114,746	85,349.81 9,793,549,848	77,100.00 8,846,916,600	2.19
15	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	127,830	76,004.92 9,715,709,744	69,200.00 8,845,836,000	2.19
16	産業ファンド	日本	投資証券	58,264	146,604.69 8,541,776,114	139,600.00 8,133,654,400	2.02
17	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	13,185	634,787.17 8,369,668,945	604,000.00 7,963,740,000	1.98
18	API投資法人	日本	投資証券	20,033	414,877.91 8,311,249,294	388,500.00 7,782,820,500	1.93
19	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	48,813	145,821.99 7,118,008,878	152,000.00 7,419,576,000	1.84
20	三井不ロジパーク	日本	投資証券	15,883	483,292.21 7,676,130,261	457,500.00 7,266,472,500	1.80
21	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	24,460	296,678.13 7,256,747,098	286,000.00 6,995,560,000	1.74
22	イオンリート投資	日本	投資証券	46,841	147,257.93 6,897,709,010	141,400.00 6,623,317,400	1.64
23	森ヒルズリート	日本	投資証券	44,904	146,640.31 6,584,736,815	140,200.00 6,295,540,800	1.56
24	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	14,168	469,785.96 6,655,927,564	433,000.00 6,134,744,000	1.52
25	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	18,777	333,387.93 6,260,025,324	317,000.00 5,952,309,000	1.48
26	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	56,233	115,564.38 6,498,532,298	104,300.00 5,865,101,900	1.46
27	森トラストリート投資法人	日本	投資証券	73,605	73,694.83 5,424,308,387	72,500.00 5,336,362,500	1.32
28	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	35,727	162,707.89 5,813,064,893	149,200.00 5,330,468,400	1.32
29	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	7,911	667,992.12 5,284,485,730	665,000.00 5,260,815,000	1.31
30	三菱地所物流REIT	日本	投資証券	13,186	386,386.04 5,094,886,418	374,500.00 4,938,157,000	1.23

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
-----------	------

投資証券	97.52%
合計	97.52%

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指数先物取引	日本	TREIT 先物 0603月	買建	5,600	10,019,296,000	10,012,800,000	2.48%

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

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

#### (参考情報) 運用実績

## ●J-REITインデックス

2023年12月29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	11,108円
純資産総額	17億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	-1.7%
3か月間	-1.9%
6か月間	-0.9%
1年間	-0.7%
3年間	12.6%
5年間	21.5%
設定来	28.6%



※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: 360円 設定来分配金合計額: 1,645円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期				
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月	22年6月	23年6月				
分配金	50円	45円	280円	300円	310円	300円	360円				

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

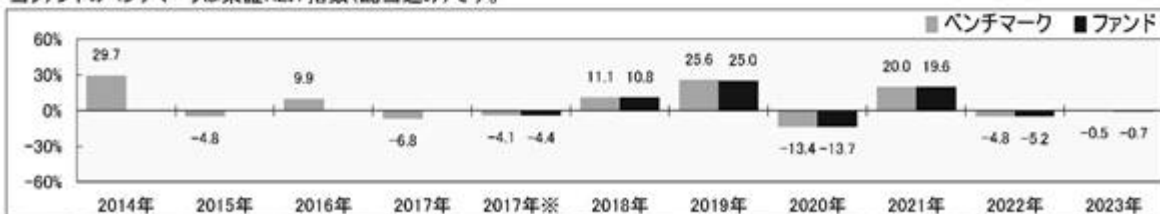
資産別構成	銘柄数	比率	種別構成	比率	組入上位10銘柄	種別名	比率
国内リート	58	97.5%	各種不動産投資信託	30.1%	日本ビルファンド	オフィス不動産投資信託	6.7%
国内リート 先物	1	2.5%	オフィス不動産投資信託	24.4%	ジャパンリアルエステイト	オフィス不動産投資信託	5.7%
			工業用不動産投資信託	19.3%	野村不動産マスターF	各種不動産投資信託	5.1%
			店舗用不動産投資信託	8.6%	日本都市ファンド投資法人	店舗用不動産投資信託	4.6%
			集合住宅用不動産投資信託	8.5%	GLP投資法人	工業用不動産投資信託	4.5%
			ホテル・リゾート不動産投資信託	6.3%	日本プロジスリート	工業用不動産投資信託	4.5%
			ヘルスケア不動産投資信託	0.3%	KDX不動産投資法人	各種不動産投資信託	4.4%
					大和ハウスリート投資法人	各種不動産投資信託	3.6%
					オリックス不動産投資	オフィス不動産投資信託	3.1%
コール・ローン、その他		2.5%			ユナイテッド・アーバン投資法人	各種不動産投資信託	3.1%
合計	59	-	合計	97.5%	合計		45.2%

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

※先物の鍵玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証REIT指数(配当込み)です。



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

※2017年※は設定日(2月16日)から年末、2023年は12月29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。

## 【ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)】

## (1) 【投資状況】(2023年12月29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	1,292,650,098	100.01
内 日本	1,292,650,098	100.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	93,324	0.01
純資産総額	1,292,556,774	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12月29日現在）

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	先進国リート・インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,448,672,082	0.8429 1,221,097,115	0.8923 1,292,650,098	100.01

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	100.01%
合計	100.01%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

### 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	10,195,310	10,275,310	1.0195	1.0275
第2計算期間末 (2018年6月15日)	279,933,693	283,060,364	0.9848	0.9958
第3計算期間末 (2019年6月17日)	695,159,967	714,215,108	1.0580	1.0870
第4計算期間末 (2020年6月15日)	134,966,460	134,966,460	0.8945	0.8945
第5計算期間末 (2021年6月15日)	3,546,416,313	3,594,317,836	1.1846	1.2006
第6計算期間末 (2022年6月15日)	2,194,549,819	2,242,959,745	0.9973	1.0193
2022年12月末日	1,656,563,369	-	0.9534	-
2023年1月末日	1,784,950,679	-	1.0253	-
2月末日	1,788,729,215	-	0.9919	-
3月末日	2,812,764,263	-	0.9364	-
4月末日	2,863,936,412	-	0.9508	-
5月末日	2,771,427,050	-	0.9232	-
第7計算期間末 (2023年6月15日)	2,791,144,777	2,863,213,916	0.9295	0.9535
6月末日	2,784,485,053	-	0.9257	-
7月末日	2,966,912,343	-	0.9495	-
8月末日	3,345,322,089	-	0.9275	-
9月末日	3,231,765,859	-	0.8524	-
10月末日	1,034,029,789	-	0.7999	-
11月末日	1,166,616,951	-	0.8861	-
12月末日	1,292,556,774	-	0.9817	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0080
第2計算期間	0.0110
第3計算期間	0.0290
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0160
第6計算期間	0.0220



第7計算期間	0.0240
2023年6月16日～ 2023年12月15日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.8
第2計算期間	2.3
第3計算期間	10.4
第4計算期間	15.5
第5計算期間	34.2
第6計算期間	14.0
第7計算期間	4.4
2023年6月16日～ 2023年12月15日	5.0

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	0	0
第2計算期間	275,571,977	1,329,127
第3計算期間	644,244,585	271,413,599
第4計算期間	4,068,922,456	4,575,108,293
第5計算期間	3,792,473,085	949,515,894
第6計算期間	2,073,516,186	2,866,910,155
第7計算期間	1,781,193,842	978,764,230
2023年6月16日～ 2023年12月15日	959,507,512	2,645,775,223

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

先進国リート・インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド

## (1) 投資状況 (2023年12月29日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	420,042,366	1.71
内 アメリカ	420,042,366	1.71
投資証券	22,552,145,349	91.89

内 ガーンジー	64,832,846	0.26
内 韓国	43,031,857	0.18
内 香港	270,026,082	1.10
内 シンガポール	830,801,649	3.39
内 イスラエル	29,475,196	0.12
内 イギリス	1,108,411,408	4.52
内 アイルランド	7,743,053	0.03
内 オランダ	35,704,142	0.15
内 ベルギー	232,686,682	0.95
内 フランス	367,785,276	1.50
内 ドイツ	7,545,174	0.03
内 スペイン	88,678,880	0.36
内 イタリア	2,427,568	0.01
内 カナダ	349,959,835	1.43
内 アメリカ	17,421,944,467	70.99
内 オーストラリア	1,619,319,695	6.60
内 ニュージーランド	71,771,539	0.29
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,570,023,476	6.40
純資産総額	24,542,211,191	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	817,291,578	3.33
内 ドイツ	178,702,003	0.73
内 アメリカ	638,589,575	2.60
為替予約取引(売建)	21,114,078,902	86.03
内 日本	21,114,078,902	86.03

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

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

(注3) 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12月29日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	104,595	17,512.03 1,831,677,763	19,173.99 2,005,504,289	8.17

2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	10,628	109,261.43 1,161,231,660	115,462.38 1,227,134,225	5.00
3	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	62,653	11,958.53 749,246,364	12,929.22 810,054,596	3.30
4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	17,914	40,170.08 719,609,277	43,655.27 782,040,578	3.19
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	36,931	16,870.82 623,058,471	20,463.23 755,727,636	3.08
6	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	81,949	8,176.07 670,027,684	8,308.40 680,865,186	2.77
7	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	34,283	17,293.89 592,887,227	19,305.89 661,864,156	2.70
8	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	23,917	18,454.21 441,369,938	22,999.15 550,070,738	2.24
9	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	117,110	4,351.06 509,558,214	4,564.08 534,500,510	2.18
10	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	206,683	1,945.39 402,093,283	2,443.85 505,103,779	2.06
11	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	16,076	25,922.26 416,726,624	26,890.96 432,299,202	1.76
12	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	33,120	11,391.07 377,274,475	12,682.43 420,042,366	1.71
13	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	39,144	9,186.04 359,584,125	8,864.37 346,987,095	1.41
14	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	33,121	8,549.51 283,170,338	10,013.19 331,647,131	1.35
15	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	45,665	6,078.40 277,573,943	7,226.23 329,986,181	1.34
16	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	17,673	16,978.18 300,057,620	18,281.88 323,095,789	1.32
17	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	65,282	4,889.30 319,183,709	4,921.50 321,285,428	1.31
18	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	14,120	17,569.75 248,086,564	19,165.48 270,616,689	1.10
19	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	7,284	33,978.35 247,498,839	35,847.53 261,113,427	1.06
20	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	13,241	20,209.35 267,593,221	19,366.88 256,436,944	1.04
21	LINK REIT	香港	投資証券	307,000	695.74 213,599,041	795.87 244,334,393	1.00

22	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	24,754	9,137.25 226,184,141	9,315.39 230,593,273	0.94
23	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	140,676	1,321.85 185,953,256	1,621.06 228,044,371	0.93
24	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	79,856	2,296.36 183,382,789	2,789.79 222,781,957	0.91
25	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	70,349	2,861.42 201,308,971	3,091.89 217,511,651	0.89
26	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	21,140	9,579.62 202,515,388	10,157.86 214,737,258	0.87
27	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	アメリカ	投資証券	30,227	6,722.45 203,202,831	7,044.69 212,940,029	0.87
28	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	アメリカ	投資証券	23,896	7,446.64 177,946,100	8,081.47 193,114,888	0.79
29	UDR INC	アメリカ	投資証券	34,400	5,534.91 190,404,531	5,498.74 189,156,969	0.77
30	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	アメリカ	投資証券	36,089	5,122.33 184,862,581	5,148.42 185,801,654	0.76

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	1.71%
投資証券	91.89%
合計	93.60%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	アメリカ	DOW JONES US REAL ESTATE MAR 24	買建	125	593,589,930	638,589,575	2.60%

	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE MAR 24	買建	168	169,526,170	178,702,003	0.73%
為替予約取引	日本	米ドル売/円買 2024年1 月	売建	115,413,300	16,950,143,438	16,335,194,534	66.56%
		ニュージーランド・ドル 売/円買 2024年1月	売建	800,700	72,578,410	71,843,207	0.29%
		ユーロ売/円買 2024年1 月	売建	4,653,600	746,678,749	730,022,331	2.97%
		英ポンド売/円買 2024年 1月	売建	6,132,000	1,139,318,539	1,105,692,805	4.51%
		シンガポール・ドル売/ 円買 2024年1月	売建	6,981,400	769,028,123	749,190,090	3.05%
		カナダ・ドル売/円買 2024年1月	売建	3,188,900	346,047,119	341,335,709	1.39%
		イスラエル・シケル 売/円買 2024年1月	売建	846,800	33,372,388	33,032,482	0.13%
		豪ドル売/円買 2024年1 月	売建	15,280,300	1,486,632,616	1,478,773,952	6.03%
		香港ドル売/円買 2024年 1月	売建	14,848,000	279,235,216	268,993,792	1.10%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

## ●外国REITインデックス（為替ヘッジあり）

2023年12月29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	9,817円
純資産総額	12億円

## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	10.8%
3カ月間	15.2%
6カ月間	6.0%
1年間	5.6%
3年間	6.8%
5年間	15.0%
設定未	9.2%



※上記の「基準価額の騰落率」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: 240円 設定来分配金合計額: 1,100円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期				
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月	22年6月	23年6月				
分配金	80円	110円	290円	0円	160円	220円	240円				

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

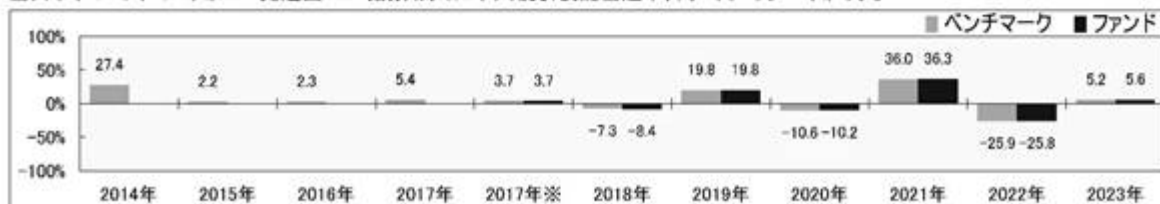
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	305	95.2%	日本円	89.6%	小売	18.2%	PROLOGIS INC	産業用	アメリカ	8.2%
外国投資信託等	3	1.8%	米ドル	8.2%	産業用	16.5%	EQUINIX INC	データセンター	アメリカ	5.0%
コール・ローン、その他		6.4%	豪ドル	0.7%	住宅	13.6%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	3.3%
合計	308	-	ユーロ	0.5%	倉庫	8.3%	PUBLIC STORAGE	倉庫	アメリカ	3.2%
国・地域別構成			韓国ウォン	0.3%	ヘルスケア	8.2%	SIMON PROPERTY GROUP INC	小売	アメリカ	3.1%
アメリカ		75.3%	英ポンド	0.2%	データセンター	7.9%	REALTY INCOME CORP	小売	アメリカ	2.8%
オーストラリア		6.8%	シンガポール・ドル	0.2%	ダイバーシファイド	6.9%	DIGITAL REALTY TRUST INC	データセンター	アメリカ	2.7%
イギリス		4.5%	カナダ・ドル	0.1%	オフィススペース	5.9%	DOW JONES US REAL ESTATE MAR 24	-	アメリカ	2.6%
シンガポール		3.4%	香港ドル	0.1%	特殊	3.7%	EXTRA SPACE STORAGE INC	倉庫	アメリカ	2.2%
その他		7.1%	その他	0.0%	その他	2.8%	VICI PROPERTIES INC	特殊	アメリカ	2.2%
合計		96.9%	合計	100.0%	合計	91.8%	合計			35.2%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

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



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

・2017年※は設定日(2月16日)から年末、2023年は12月29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。

## 【ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)】

## (1) 【投資状況】(2023年12月29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	46,420,767	99.99
内 日本	46,420,767	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,466	0.01
純資産総額	46,424,233	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12月29日現在)

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	13,063,393	3.2623 42,616,747	3.5535 46,420,767	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.99%
合計	99.99%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	9,896,754	9,996,754	0.9897	0.9997
第2計算期間末 (2018年6月15日)	9,693,791	10,023,791	0.9694	1.0024
第3計算期間末 (2019年6月17日)	518,637,200	534,240,737	1.0304	1.0614
第4計算期間末 (2020年6月15日)	424,828,364	439,928,561	0.8440	0.8740
第5計算期間末 (2021年6月15日)	1,290,025,686	1,308,743,688	1.1716	1.1886
第6計算期間末 (2022年6月15日)	11,992,308	12,107,308	1.1992	1.2107
2022年12月末日	11,542,649	-	1.1543	-
2023年1月末日	12,316,743	-	1.2317	-
2月末日	12,428,300	-	1.2428	-
3月末日	11,572,674	-	1.1573	-
4月末日	11,840,112	-	1.1840	-
5月末日	12,000,967	-	1.2001	-
第7計算期間末 (2023年6月15日)	12,131,636	12,531,636	1.2132	1.2532
6月末日	12,465,268	-	1.2465	-
7月末日	12,529,843	-	1.2530	-
8月末日	12,714,832	-	1.2715	-
9月末日	41,284,338	-	1.1993	-
10月末日	38,885,264	-	1.1296	-
11月末日	42,978,621	-	1.2485	-
12月末日	46,424,233	-	1.3486	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0100
第2計算期間	0.0330
第3計算期間	0.0310
第4計算期間	0.0300
第5計算期間	0.0170
第6計算期間	0.0115



第7計算期間	0.0400
2023年6月16日～ 2023年12月15日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.0
第2計算期間	1.3
第3計算期間	9.5
第4計算期間	15.2
第5計算期間	40.8
第6計算期間	3.3
第7計算期間	4.5
2023年6月16日～ 2023年12月15日	10.5

## (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	0	0
第2計算期間	0	0
第3計算期間	493,339,911	0
第4計算期間	0	0
第5計算期間	597,719,068	0
第6計算期間	0	1,091,058,979
第7計算期間	0	0
2023年6月16日～ 2023年12月15日	24,423,063	0

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

## (参考) マザーファンド

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

## (1) 投資状況 (2023年12月29日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	1,166,784,351	3.15
内 アメリカ	1,166,784,351	3.15
投資証券	34,713,442,369	93.84

内 ガーンジー	98,060,392	0.27
内 韓国	62,583,675	0.17
内 香港	416,386,775	1.13
内 シンガポール	1,284,741,751	3.47
内 イスラエル	44,790,574	0.12
内 イギリス	1,735,311,490	4.69
内 アイルランド	11,288,231	0.03
内 オランダ	54,821,026	0.15
内 ベルギー	365,335,247	0.99
内 フランス	572,531,224	1.55
内 ドイツ	11,500,730	0.03
内 スペイン	137,697,221	0.37
内 イタリア	2,509,780	0.01
内 カナダ	534,405,633	1.44
内 アメリカ	26,765,834,729	72.36
内 オーストラリア	2,510,086,488	6.79
内 ニュージーランド	105,557,403	0.29
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,110,516,223	3.00
純資産総額	36,990,742,943	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	1,104,594,304	2.99
内 ドイツ	287,199,648	0.78
内 アメリカ	817,394,656	2.21
為替予約取引(買建)	177,051,767	0.48
内 日本	177,051,767	0.48

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

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

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

## (2) 投資資産 (2023年12月29日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	160,756	16,032.46 2,577,314,654	19,173.99 3,082,335,174	8.33

2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	16,346	114,642.60 1,873,948,059	115,462.38 1,887,348,140	5.10
3	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	96,347	12,509.40 1,205,243,740	12,929.22 1,245,691,829	3.37
4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	27,579	36,577.95 1,008,783,476	43,655.27 1,203,968,802	3.25
5	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	92,000	11,705.37 1,076,900,355	12,682.43 1,166,784,351	3.15
6	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	56,853	17,411.05 989,870,471	20,463.23 1,163,396,152	3.15
7	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	125,888	7,617.68 958,982,263	8,308.40 1,045,928,035	2.83
8	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	52,776	19,600.90 1,034,457,415	19,305.89 1,018,888,157	2.75
9	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	36,812	18,371.23 676,282,083	22,999.15 846,644,813	2.29
10	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	179,928	4,203.55 756,344,551	4,564.08 821,207,478	2.22
11	GOODMAN GROUP	オーストラ リア	投資証券	322,195	2,260.73 728,424,629	2,443.85 787,398,635	2.13
12	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	24,712	24,228.81 598,742,573	26,890.96 664,529,601	1.80
13	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	60,145	8,024.74 482,648,072	8,864.37 533,147,834	1.44
14	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	50,823	8,975.00 456,136,547	10,013.19 508,900,762	1.38
15	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	70,011	6,440.50 450,905,867	7,226.23 505,916,184	1.37
16	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	27,245	15,460.88 421,231,902	18,281.88 498,090,011	1.35
17	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	100,119	4,674.71 468,027,971	4,921.50 492,735,759	1.33
18	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	21,712	18,154.24 394,164,859	19,165.48 416,121,073	1.12
19	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	11,243	30,100.58 338,420,831	35,847.53 403,033,808	1.09
20	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	20,391	17,567.06 358,209,998	19,366.88 394,910,183	1.07
21	LINK REIT	香港	投資証券	477,600	707.55 337,932,237	795.87 380,111,094	1.03

22	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	222,169	1,482.29 329,320,825	1,621.06 360,149,491	0.97
23	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	37,970	8,824.23 335,057,249	9,315.39 353,705,525	0.96
24	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	122,771	2,473.51 303,675,935	2,789.79 342,506,057	0.93
25	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	107,895	2,697.60 291,058,264	3,091.89 333,599,903	0.90
26	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	32,445	9,940.86 322,531,355	10,157.86 329,571,917	0.89
27	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	アメリカ	投資証券	46,385	6,508.86 301,914,202	7,044.69 326,768,229	0.88
28	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	アメリカ	投資証券	36,663	6,917.75 253,630,826	8,081.47 296,291,059	0.80
29	UDR INC	アメリカ	投資証券	52,658	4,721.52 248,625,837	5,498.74 289,553,130	0.78
30	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	アメリカ	投資証券	55,372	5,076.09 281,073,571	5,148.42 285,078,811	0.77

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	3.15%
投資証券	93.84%
合計	97.00%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	アメリカ	DOW JONES US REAL ESTATE MAR 24	買建	160	759,824,157	817,394,656	2.21%

	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE MAR 24	買建	270	271,148,677	287,199,648	0.78%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2024年1 月	買建	730,000	107,228,605	103,321,645	0.28%
		ユーロ買/円売 2024年1 月	買建	470,000	75,405,578	73,730,122	0.20%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

## ●外国REITインデックス（為替ヘッジなし）

2023年12月29日現在

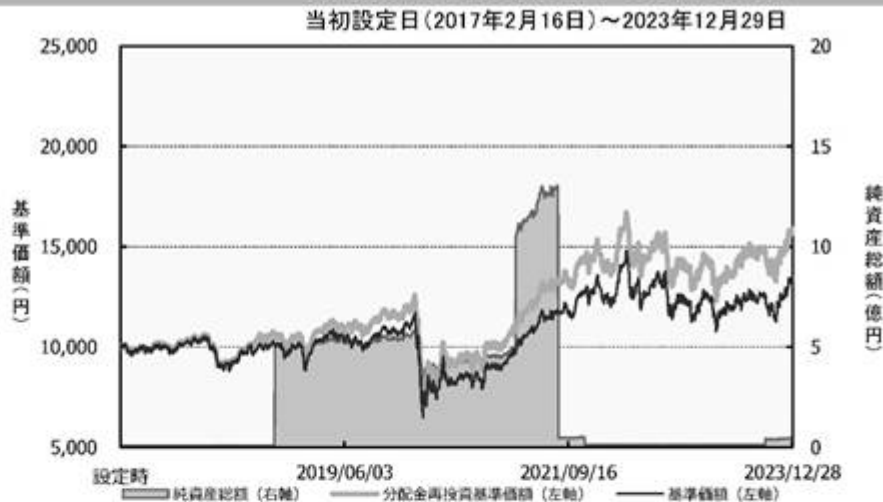
※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	13,486円
純資産総額	46百万円

## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	8.0%
3カ月間	12.4%
6カ月間	8.2%
1年間	20.7%
3年間	57.3%
5年間	65.3%
設定来	59.0%



※上記の「基準価額の騰落率」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: 400円 設定来分配金合計額: 1,725円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期				
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月	22年6月	23年6月				
分配金	100円	330円	310円	300円	170円	115円	400円				

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

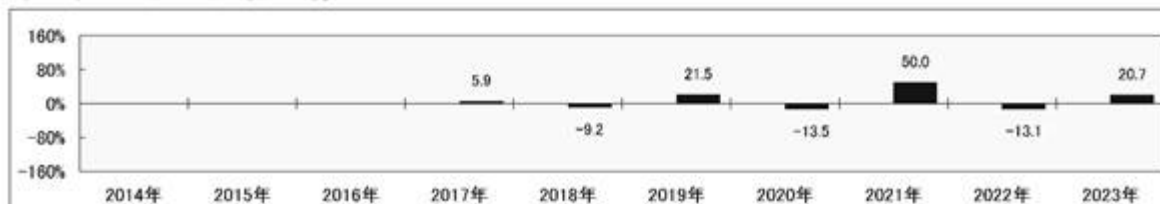
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	306	96.7%	米ドル	77.5%	小売	18.6%	PROLOGIS INC	産業用	アメリカ	8.3%
外国投資信託等	3	3.2%	豪ドル	6.9%	産業用	16.9%	EQUINIX INC	データセンター	アメリカ	5.1%
コール・ローン、その他		3.0%	英ポンド	5.0%	住宅	13.8%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	3.4%
合計	309	-	ユーロ	3.8%	倉庫	8.5%	PUBLIC STORAGE	倉庫	アメリカ	3.3%
国・地域別構成			シンガポール・ドル	3.3%	ヘルスケア	8.4%	VANGUARD REAL ESTATE ETF	-	アメリカ	3.2%
アメリカ		77.7%	カナダ・ドル	1.6%	データセンター	8.0%	SIMON PROPERTY GROUP INC	小売	アメリカ	3.1%
オーストラリア		6.8%	香港ドル	1.2%	ダイバーシファイド	7.0%	REALTY INCOME CORP	小売	アメリカ	2.8%
イギリス		4.7%	ニュージーランド・ドル	0.4%	オフィススペース	6.0%	DIGITAL REALTY TRUST INC	データセンター	アメリカ	2.8%
シンガポール		3.5%	韓国ウォン	0.2%	特殊	3.8%	EXTRA SPACE STORAGE INC	倉庫	アメリカ	2.3%
その他		7.3%	その他	0.2%	その他	2.8%	VICI PROPERTIES INC	特殊	アメリカ	2.2%
合計		100.0%	合計	100.0%	合計	93.8%	合計			36.4%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2017年は設定日(2月16日)から年末、2023年は12月29日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## (参考情報) ファンドの総経費率

	総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
ダイワTOPIXインデックス (ダイワSMA専用)	0.35%	0.34%	0.01%
ダイワ日経225インデックス (ダイワSMA専用)	0.35%	0.34%	0.01%
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)	0.48%	0.45%	0.03%
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)	0.47%	0.45%	0.03%
ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)	0.15%	0.15%	0.01%
ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)	0.44%	0.42%	0.02%
ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	0.44%	0.42%	0.02%
ダイワJ-REITインデックス (ダイワSMA専用)	0.35%	0.34%	0.01%
ダイワ外国REITインデックス (為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)	0.48%	0.43%	0.05%
ダイワ外国REITインデックス (為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	0.48%	0.43%	0.05%

※対象期間は2022年6月16日～2023年6月15日です。

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

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

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

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

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。申込手数料には、消費税等が課されます。

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

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止（「TOPIXインデックス」、「日経225インデックス」、「日本債券インデックス」および「J-REITインデックス」を除きます。）その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受け付けを中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消することができるものとします。

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

### 2【換金（解約）手続等】

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

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

#### <一部解約>

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



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

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

解約価額は、各ファンドについて後掲の別表Bに掲げる価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額(基準価額)は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止(「TOPIXインデックス」、「日経225インデックス」、「日本債券インデックス」および「J-REITインデックス」を除きます。)その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受けたものとして、上記に準じて算出した価額とします。

一部解約金は、販売会社の営業所等において、各ファンドについて原則として一部解約の実行の請求受付日から起算して次の日から受益者に支払います。

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

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

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

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

[別表A]

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

## [ 別表 B ]

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

## 3【資産管理等の概要】

## (1)【資産の評価】

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

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

\*「J-REITインデックス」を除きます。

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

なお、外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。))、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。また、予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします(「TOPIXインデックス」、「日経225インデックス」、「日本債券インデックス」および「J-REITインデックス」を除きます。)

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

## (2)【保管】

該当事項はありません。

## (3)【信託期間】

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

## (4)【計算期間】

毎年6月16日から翌年6月15日までとします。ただし、第1計算期間は、2017年2月16日から2017年6月15日までとします。

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

## (5)【その他】

## 信託の終了

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

## 信託約款の変更等

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

3. 前2.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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であっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前7.までの規定にしたがいます。

#### 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

#### 運用報告書

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

・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

#### 公告

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

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

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

#### 関係法人との契約の更改

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

#### 4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

##### < 収益分配金および償還金にかかる請求権 >

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

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

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TOPIXインデックス(ダイワSMA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7期計算期間(2022年6月16日から2023年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### 1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 2022年6月15日現在	第7期 2023年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	4,309,981	6,868,625
親投資信託受益証券	2,313,970,921	5,709,868,997
未収入金	109,530,000	120,000
流動資産合計	2,427,810,902	5,716,857,622
資産合計	2,427,810,902	5,716,857,622
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	49,314,933	76,437,039
未払解約金	109,495,807	-
未払受託者報酬	265,454	418,342
未払委託者報酬	3,849,762	6,066,459
その他未払費用	66,300	104,518
流動負債合計	162,992,256	83,026,358
負債合計	162,992,256	83,026,358
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,826,479,001	3,639,859,036
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	438,339,645	1,993,972,228
（分配準備積立金）	37,157,504	792,728,611
元本等合計	2,264,818,646	5,633,831,264
純資産合計	2,264,818,646	5,633,831,264
負債純資産合計	2,427,810,902	5,716,857,622



## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第6期		第7期	
	自	2021年6月16日 至 2022年6月15日	自	2022年6月16日 至 2023年6月15日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		36,125,893		994,038,076
<b>営業収益合計</b>		<b>36,125,893</b>		<b>994,038,076</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		531		1,179
受託者報酬		589,152		675,095
委託者報酬		8,543,999		9,790,114
その他費用		147,149		168,622
<b>営業費用合計</b>		<b>9,280,831</b>		<b>10,635,010</b>
営業利益又は営業損失( )		45,406,724		983,403,066
経常利益又は経常損失( )		45,406,724		983,403,066
当期純利益又は当期純損失( )		45,406,724		983,403,066
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( )		43,955,765		28,199,846
期首剰余金又は期首欠損金( )		718,740,106		438,339,645
剰余金増加額又は欠損金減少額		405,355,647		776,454,376
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		405,355,647		776,454,376
剰余金減少額又は欠損金増加額		547,078,686		99,587,974
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		547,078,686		99,587,974
分配金		1 49,314,933		1 76,437,039
期末剰余金又は期末欠損金( )		438,339,645		1,993,972,228

## (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7期
	自2022年6月16日 至2023年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1. 1 期首元本額	2,239,926,064円	1,826,479,001円
期中追加設定元本額	1,305,791,488円	2,192,695,557円
期中一部解約元本額	1,719,238,551円	379,315,522円
2. 計算期間末日における受益権の 総数	1,826,479,001口	3,639,859,036口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第6期	第7期
	自2021年6月16日 至2022年6月15日	自2022年6月16日 至2023年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（49,628,040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（401,182,141円）及び分配準備積立金（36,844,397円）より分配対象額は487,654,578円（1万口当たり2,669.92円）であり、うち49,314,933円（1万口当たり270円）を分配金額としております。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（79,072,855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（758,698,841円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,201,243,617円）及び分配準備積立金（31,393,954円）より分配対象額は2,070,409,267円（1万口当たり5,688.16円）であり、うち76,437,039円（1万口当たり210円）を分配金額としております。</p>
------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第7期 自2022年6月16日 至2023年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第7期
	2023年6月15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6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15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	83,050,858	969,266,348
合計	83,050,858	969,266,348

## (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6期	第7期
2022年6月15日現在	2023年6月15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7期
自2022年6月16日
至2023年6月15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6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1口当たり純資産額	1,240円	1,547円
(1万口当たり純資産額)	(12,400円)	(15,478円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	トピックス・インデックス・マザーファンド	3,507,075,117	5,709,868,997	
親投資信託受益証券 合計			5,709,868,997	
合計			5,709,868,997	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

## 「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2022年6月15日現在 金額 (円)	2023年6月15日現在 金額 (円)
資産の部		

流動資産			
コール・ローン		8,230,806,548	9,847,640,355
株式	2 3	181,589,336,570	246,890,055,590
派生商品評価勘定		85,050	158,655,300
未収入金		-	43,048
未収配当金		1,553,974,549	1,741,868,748
未収利息		266,286	219,298
前払金		113,100,000	-
その他未収収益	4	21,518,346	33,476,156
流動資産合計		191,509,087,349	258,671,958,495
資産合計		191,509,087,349	258,671,958,495
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		158,435,700	44,400
前受金		-	174,345,000
未払解約金		175,195,940	117,376,660
受入担保金		6,201,448,165	5,397,399,408
流動負債合計		6,535,079,805	5,689,165,468
負債合計		6,535,079,805	5,689,165,468
純資産の部			
元本等			
元本	1	144,235,597,142	155,385,420,480
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		40,738,410,402	97,597,372,547
元本等合計		184,974,007,544	252,982,793,027
純資産合計		184,974,007,544	252,982,793,027
負債純資産合計		191,509,087,349	258,671,958,495

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2022年6月16日 至2023年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1. 1 期首	2021年6月16日	2022年6月16日
期首元本額	136,188,256,579円	144,235,597,142円
期中追加設定元本額	22,302,544,819円	24,516,960,234円
期中一部解約元本額	14,255,204,256円	13,367,136,896円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
トピックス・インデックスファンド	2,959,635,810円	2,763,331,050円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA	5,194,200,289円	4,549,268,951円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドVA2	920,771円	914,313円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	23,273,435円	15,842,998円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	330,188,566円	232,173,822円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	21,795,176円	14,489,300円

ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	632,779,466円	458,537,106円
日本株式インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	349,235,167円	582,804,567円
D-I's TOPIXインデックス	32,293,095円	13,712,330円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	197,307,863円	229,391,516円
iFree TOPIXインデックス	5,757,358,366円	6,660,285,892円
iFree 8資産バランス	3,906,830,420円	4,433,279,381円
iFree 年金バランス	677,734,898円	853,672,461円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	-円	33,003円
DCダイワ日本株式インデックス	68,636,503,469円	69,999,592,782円
ダイワ・ライフ・バランス30	3,235,070,346円	3,190,866,818円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,563,138,048円	4,808,803,528円
ダイワ・ライフ・バランス70	4,448,846,181円	5,092,334,666円
年金ダイワ日本株式インデックス	6,458,323,592円	7,112,802,899円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	58,672,093円	52,526,177円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	64,569,771円	71,291,017円
ダイワつみたてインデックス日本株式	2,078,783,183円	3,604,211,746円
ダイワつみたてインデックスバランス30	11,942,293円	12,632,163円
ダイワつみたてインデックスバランス50	9,836,532円	10,199,775円
ダイワつみたてインデックスバランス70	24,153,161円	30,561,440円
ダイワ国内株式インデックス(ラップ専用)	163,023,260円	5,506,825,594円
ダイワ世界バランスファンド40VA	85,987,356円	68,265,420円
ダイワ世界バランスファンド60VA	97,123,951円	24,867,151円
ダイワ・バランスファンド35VA	5,590,450,708円	4,335,922,285円



	ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	510,036,783円	414,580,439円
	ダイワ国内バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専用)	73,437,877円	59,675,537円
	ダイワ国内バランスファンド3 0VA(適格機関投資家専用)	117,645,774円	91,079,592円
	ダイワ・ノーロードTOPIX ファンド	214,978,027円	209,652,121円
	ダイワファンドラップTOPI Xインデックス	11,370,096,367円	12,213,848,138円
	ダイワTOPIXインデックス (ダイワSMA専用)	1,804,406,520円	3,507,075,117円
	ダイワファンドラップオンライ ンTOPIXインデックス	3,235,449,119円	3,544,218,031円
	ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,201,985,990円	1,174,135,074円
	ダイワライフスタイル25	139,631,194円	116,204,199円
	ダイワライフスタイル50	572,086,028円	519,385,919円
	ダイワライフスタイル75	436,660,665円	418,052,331円
	DC・ダイワ・トピックス・イ ンデックス(確定拠出年金専用 ファンド)	8,949,205,532円	8,388,073,831円
計		144,235,597,142円	155,385,420,480円
2.	期末日における受益権の総数	144,235,597,142口	155,385,420,480口
3.	2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以 下のとおり有価証券の貸付を 行っております。 株式 5,795,665,380円	株券貸借取引契約により、以 下のとおり有価証券の貸付を 行っております。 株式 5,180,231,870円
4.	3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 株式 821,220,000円	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 株式 1,143,110,000円
5.	4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相 当額の未入金分が含まれてお ります。	貸付有価証券に係る配当金相 当額の未入金分が含まれてお ります。

(金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2022年6月16日 至2023年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年6月15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6月15日現在	2023年6月15日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	19,044,812,219	36,794,494,621
合計	19,044,812,219	36,794,494,621

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

種類	2022年6月15日現在				2023年6月15日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超				1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買建	3,547,410,000	-	3,389,160,000	158,250,000	5,846,285,000	-	6,005,040,000	158,755,000
合計	3,547,410,000	-	3,389,160,000	158,250,000	5,846,285,000	-	6,005,040,000	158,755,000

## (注)

## 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

## 2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## 3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

## 4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1口当たり純資産額	1.2824円	1.6281円

(1万口当たり純資産額)	(12,824円)	(16,281円)
--------------	-----------	-----------

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極 洋	4,000	3,650.00	14,600,000	
ニッスイ	105,600	646.00	68,217,600	
マルハニチロ	15,700	2,489.00	39,077,300	
雪国まいたけ	9,000	951.00	8,559,000	
カネコ種苗	3,300	1,473.00	4,860,900	
サカタのタネ	12,000	4,060.00	48,720,000	貸付株式数 4,400株
ホクト	9,600	1,861.00	17,865,600	
ホクリヨウ	1,200	831.00	997,200	貸付株式数 400株
ショーボンドHD	14,400	5,825.00	83,880,000	
ミライト・ワン	34,900	1,801.50	62,872,350	
タマホーム	6,600	3,220.00	21,252,000	貸付株式数 2,600株 (100株)
サンヨーホームズ	1,000	715.00	715,000	貸付株式数 300株
日本アクア	3,400	863.00	2,934,200	
ファーストコーポレーション	2,300	761.00	1,750,300	貸付株式数 800株
ベステラ	1,700	1,262.00	2,145,400	貸付株式数 600株
キャンディル	1,500	570.00	855,000	貸付株式数 700株
住石ホールディングス	12,600	368.00	4,636,800	貸付株式数 5,000株
日鉄鉱業	4,300	4,125.00	17,737,500	
三井松島HLDGS	4,800	2,532.00	12,153,600	貸付株式数 1,800株
INPEX	390,800	1,597.00	624,107,600	
石油資源開発	12,200	4,290.00	52,338,000	
K&Oエナジーグループ	4,800	2,409.00	11,563,200	
ダイセキ環境ソリューション	1,700	1,045.00	1,776,500	
第一カッター興業	2,700	1,386.00	3,742,200	貸付株式数 100株
明豊ファシリティワークス	3,000	740.00	2,220,000	
安藤・間	61,200	1,089.00	66,646,800	
東急建設	30,000	734.00	22,020,000	
コムシスホールディングス	36,000	2,813.00	101,268,000	

ビーアールホールディングス	16,700	388.00	6,479,600	
高松コンストラクショング P	6,800	2,447.00	16,639,600	
東建コーポレーション	3,100	7,200.00	22,320,000	
ソネック	900	980.00	882,000	貸付株式数 200株
ヤマウラ	5,500	1,177.00	6,473,500	貸付株式数 1,200株
オリエンタル白石	37,800	305.00	11,529,000	
大成建設	69,100	4,739.00	327,464,900	
大 林 組	264,000	1,182.50	312,180,000	
清水建設	221,900	886.70	196,758,730	
飛鳥建設	8,200	1,270.00	10,414,000	
長谷工コーポレーション	76,200	1,714.00	130,606,800	
松井建設	7,100	684.00	4,856,400	
銭 高 組	700	3,065.00	2,145,500	
鹿島建設	163,700	2,100.50	343,851,850	
不動テトラ	5,300	1,807.00	9,577,100	
大末建設	2,100	1,286.00	2,700,600	
鉄建建設	5,300	1,998.00	10,589,400	
西松建設	12,400	3,501.00	43,412,400	貸付株式数 1,000株
三井住友建設	59,400	366.00	21,740,400	
大豊建設	3,000	3,825.00	11,475,000	貸付株式数 700株
佐田建設	3,600	448.00	1,612,800	
ナカノフドー建設	4,000	372.00	1,488,000	
奥 村 組	12,000	4,060.00	48,720,000	
東鉄工業	10,100	2,549.00	25,744,900	
イチケン	1,300	1,904.00	2,475,200	
富士ピー・エス	2,500	442.00	1,105,000	貸付株式数 500株
浅沼組	5,800	3,215.00	18,647,000	
戸田建設	90,700	811.90	73,639,330	
熊 谷 組	12,300	3,155.00	38,806,500	
北野建設	1,100	2,971.00	3,268,100	
植 木 組	1,600	1,341.00	2,145,600	
矢作建設	9,900	1,149.00	11,375,100	
ピーエス三菱	9,200	740.00	6,808,000	
日本ハウスHLDGS	14,500	378.00	5,481,000	
大東建託	27,100	14,230.00	385,633,000	
新日本建設	10,500	1,130.00	11,865,000	
東亜道路	2,900	4,405.00	12,774,500	
日本道路	1,500	8,900.00	13,350,000	

東亜建設	6,300	3,030.00	19,089,000	貸付株式数	2,400株
日本国土開発	21,800	593.00	12,927,400		
若築建設	3,200	3,100.00	9,920,000		
東洋建設	23,600	1,033.00	24,378,800	貸付株式数	9,400株
五洋建設	104,700	773.30	80,964,510		
世紀東急	9,400	1,295.00	12,173,000		
福田組	2,800	4,790.00	13,412,000	貸付株式数	800株
日本ドライケミカル	1,400	1,662.00	2,326,800	貸付株式数	200株
住友林業	56,700	3,409.00	193,290,300		
日本基礎技術	3,400	514.00	1,747,600		
巴コーポレーション	6,400	461.00	2,950,400	貸付株式数	500株
大和ハウス	206,300	3,763.00	776,306,900		
ライト工業	13,600	1,940.00	26,384,000		
積水ハウス	224,000	2,747.00	615,328,000		
日特建設	7,100	1,016.00	7,213,600		
北陸電気工事	5,100	892.00	4,549,200		
ユアテック	16,200	849.00	13,753,800		
日本リーテック	6,400	1,364.00	8,729,600		
四電工	3,100	2,172.00	6,733,200		
中電工	11,300	2,250.00	25,425,000		
関電工	40,300	1,110.00	44,733,000		
きんでん	51,800	1,954.00	101,217,200	貸付株式数	300株
東京エネシス	7,400	996.00	7,370,400		
トーエネック	2,400	3,670.00	8,808,000		
住友電設	7,000	2,995.00	20,965,000		
日本電設工業	12,100	1,864.00	22,554,400		
エクシオグループ	34,200	2,816.50	96,324,300		
新日本空調	4,000	2,227.00	8,908,000	貸付株式数	700株
日本工営	4,600	3,800.00	17,480,000		
九電工	17,900	4,090.00	73,211,000		
三機工業	16,200	1,507.00	24,413,400		
日揮ホールディングス	73,100	1,870.50	136,733,550		
中外炉工業	2,400	2,041.00	4,898,400		
ヤマト	4,700	917.00	4,309,900		
太平電業	4,600	4,390.00	20,194,000		
高砂熱学	17,800	2,424.00	43,147,200		
三晃金属	700	4,270.00	2,989,000		
NECネッツエスアイ	25,200	1,989.00	50,122,800		
朝日工業社	3,000	2,277.00	6,831,000		
明星工業	12,600	979.00	12,335,400		

大 氣 社	8,600	3,995.00	34,357,000	
ダイダン	4,900	2,685.00	13,156,500	
日比谷総合設備	6,400	2,184.00	13,977,600	
ニッポン	19,800	1,838.00	36,392,400	
日清製粉G本社	68,500	1,852.50	126,896,250	
日東富士製粉	1,300	4,760.00	6,188,000	
昭和産業	6,400	2,705.00	17,312,000	
鳥越製粉	4,900	619.00	3,033,100	貸付株式数 200株
中部飼料	10,600	1,089.00	11,543,400	
フィード・ワン	10,700	730.00	7,811,000	
東洋精糖	1,100	1,422.00	1,564,200	
日本甜菜糖	4,300	1,835.00	7,890,500	
DM三井製糖ホールディ	7,300	2,669.00	19,483,700	
塩水港精糖	6,800	204.00	1,387,200	貸付株式数 1,500株
ウェルネオシュガー	3,800	1,943.00	7,383,400	貸付株式数 1,400株
L I F U L L	26,200	275.00	7,205,000	
M I X I	17,600	2,764.00	48,646,400	
ジェイエイシーリクルート メント	7,000	2,500.00	17,500,000	
日本M&Aセンターホール デ	132,900	1,086.00	144,329,400	
メンバーズ	2,300	1,585.00	3,645,500	貸付株式数 800株
中広	800	403.00	322,400	貸付株式数 400株
UTグループ	11,400	2,993.00	34,120,200	
アイティメディア	3,000	1,320.00	3,960,000	貸付株式数 1,100株
E・Jホールディングス	4,600	1,566.00	7,203,600	貸付株式数 1,400株
オープンアップグループ	23,200	2,166.00	50,251,200	
コシダカホールディングス	23,100	1,182.00	27,304,200	貸付株式数 9,100株
アルトナー	1,400	1,718.00	2,405,200	
パソナグループ	9,500	1,718.00	16,321,000	
C D S	1,500	1,797.00	2,695,500	貸付株式数 200株
リンクアンドモチベーショ ン	22,100	438.00	9,679,800	貸付株式数 8,800株
エス・エム・エス	29,500	3,010.00	88,795,000	
サニーサイドアップG	1,800	661.00	1,189,800	貸付株式数 800株
パーソルホールディングス	85,400	2,763.00	235,960,200	
リニカル	3,400	840.00	2,856,000	
クックパッド	20,900	181.00	3,782,900	貸付株式数 8,300株
エスクリ	2,400	360.00	864,000	貸付株式数 1,200株

アイ・ケイ・ケイホールディング	2,900	600.00	1,740,000	貸付株式数	1,300株
森永製菓	13,500	4,612.00	62,262,000		
中村屋	1,900	3,065.00	5,823,500	貸付株式数	600株
江崎グリコ	21,200	3,838.00	81,365,600		
名糖産業	2,900	1,621.00	4,700,900	貸付株式数	1,200株
井村屋グループ	4,100	2,272.00	9,315,200	貸付株式数	100株
不二家	5,000	2,495.00	12,475,000	貸付株式数	1,900株
山崎製パン	49,500	2,017.50	99,866,250		
第一屋製パン	1,400	387.00	541,800	貸付株式数	300株
モロゾフ	2,400	3,620.00	8,688,000	貸付株式数	900株
亀田製菓	4,700	4,210.00	19,787,000		
寿スピリッツ	7,900	10,810.00	85,399,000		
カルビー	33,900	2,793.50	94,699,650		
森永乳業	13,400	4,970.00	66,598,000		
六甲バター	5,600	1,332.00	7,459,200	貸付株式数	2,000株
ヤクルト	53,000	9,080.00	481,240,000		
明治ホールディングス	90,800	3,220.00	292,376,000		
雪印メグミルク	17,800	1,936.00	34,460,800		
プリマハム	9,900	2,179.00	21,572,100		
日本ハム	28,900	4,007.00	115,802,300		
林兼産業	1,700	480.00	816,000	貸付株式数	600株
丸大食品	7,600	1,492.00	11,339,200		
S Foods	8,100	3,250.00	26,325,000		
柿安本店	2,900	2,302.00	6,675,800	貸付株式数	800株
伊藤ハム米久HLDGS	56,000	724.00	40,544,000	貸付株式数	4,500株
学情	3,500	1,776.00	6,216,000	貸付株式数	300株
スタジオアリス	3,900	2,175.00	8,482,500	貸付株式数	1,500株
クロスキャット	4,300	1,142.00	4,910,600	貸付株式数	1,600株
シミックホールディングス	3,800	1,978.00	7,516,400	貸付株式数	1,400株
エプロ	1,300	761.00	989,300	貸付株式数	600株
システナ	127,400	314.00	40,003,600		
NJS	1,700	2,702.00	4,593,400	貸付株式数	600株
デジタルアーツ	4,800	6,200.00	29,760,000		
日鉄ソリューションズ	12,900	4,145.00	53,470,500		
総合警備保障	28,700	3,999.00	114,771,300		
キューブシステム	4,400	1,243.00	5,469,200	貸付株式数	1,600株 (200株)
いちご	85,200	268.00	22,833,600		
日本駐車場開発	78,000	235.00	18,330,000		



コア	3,400	1,714.00	5,827,600	貸付株式数	600株
カカクコム	56,800	2,036.50	115,673,200		
アイロムグループ	2,800	1,890.00	5,292,000	貸付株式数	1,000株
セントケア・ホールディング	4,900	755.00	3,699,500		
サイネックス	1,000	619.00	619,000		
ルネサンス	5,300	901.00	4,775,300	貸付株式数	2,100株
ディップ	13,600	3,490.00	47,464,000	貸付株式数	4,000株
SBSホールディングス	6,700	3,260.00	21,842,000		
デジタルホールディングス	6,000	1,059.00	6,354,000		
新日本科学	8,200	2,145.00	17,589,000	貸付株式数	3,200株
キャリアデザインセンター	1,200	1,480.00	1,776,000	貸付株式数	400株
ベネフィット・ワン	35,800	1,626.50	58,228,700		
エムスリー	153,000	3,253.00	497,709,000		
ツカダ・グローバルHOLD	3,800	488.00	1,854,400	貸付株式数	1,500株
プラス	700	1,047.00	732,900		
アウトソーシング	46,100	1,378.50	63,548,850		
ウェルネット	4,500	616.00	2,772,000		
ワールドホールディングス	3,500	2,780.00	9,730,000	貸付株式数	400株
ディー・エヌ・エー	31,000	1,899.00	58,869,000		
博報堂DYHLDGS	98,700	1,523.50	150,369,450	貸付株式数	30,000株
ぐるなび	14,400	372.00	5,356,800	貸付株式数	5,500株
タカミヤ	10,400	505.00	5,252,000		
ジャパンベストレスキュー	3,800	701.00	2,663,800		
ファンコミュニケーションズ	15,000	400.00	6,000,000		
ライク	2,800	1,617.00	4,527,600	貸付株式数	1,100株
ビジネス・ブレークスルー	2,200	436.00	959,200		
エスプール	22,300	532.00	11,863,600		
WDBホールディングス	4,000	2,206.00	8,824,000		
手間いらず	1,300	3,810.00	4,953,000	貸付株式数	400株
ティア	3,800	438.00	1,664,400	貸付株式数	1,100株
CDG	600	1,401.00	840,600	貸付株式数	200株
アドウェイズ	10,600	680.00	7,208,000		
バリューコマース	5,700	1,441.00	8,213,700		
インフォマート	80,800	295.00	23,836,000		
サッポロホールディングス	24,300	3,750.00	91,125,000		

アサヒグループホールディングン	171,300	5,752.00	985,317,600	
キリンHD	334,400	2,145.50	717,455,200	
宝ホールディングス	50,700	1,075.00	54,502,500	
オエノンホールディングス	22,100	365.00	8,066,500	
養命酒	2,400	1,842.00	4,420,800	貸付株式数 700株
コカ・コーラボトラーズJHD	58,300	1,580.50	92,143,150	
サントリー食品インター	52,200	5,432.00	283,550,400	
ダイドーグループHD	4,200	5,090.00	21,378,000	貸付株式数 1,600株
伊藤園	25,100	4,139.00	103,888,900	
キーコーヒー	8,300	2,067.00	17,156,100	
ユニカフェ	1,900	907.00	1,723,300	貸付株式数 700株
ジャパンフーズ	900	1,095.00	985,500	
日清オイリオグループ	10,400	3,445.00	35,828,000	
不二製油グループ	17,400	2,027.00	35,269,800	
かどや製油	700	3,450.00	2,415,000	貸付株式数 100株
J-オイルミルズ	7,600	1,596.00	12,129,600	
ローソン	19,800	6,244.00	123,631,200	
サンエー	6,000	4,560.00	27,360,000	貸付株式数 1,300株
カワチ薬品	6,200	2,176.00	13,491,200	
エービーシー・マート	11,600	7,966.00	92,405,600	
ハードオフコーポレーション	2,400	1,358.00	3,259,200	
高千穂交易	2,200	3,040.00	6,688,000	貸付株式数 1,000株
アスクル	16,500	1,904.00	31,416,000	貸付株式数 6,500株
ゲオホールディングス	7,800	1,649.00	12,862,200	
アダストリア	9,600	2,980.00	28,608,000	貸付株式数 3,600株
ジーフット	4,100	271.00	1,111,100	貸付株式数 1,700株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	800	494.00	395,200	
オルバヘルスケアHLDGS	900	1,978.00	1,780,200	貸付株式数 400株 (100株)
伊藤忠食品	1,800	5,140.00	9,252,000	
くら寿司	9,300	3,050.00	28,365,000	貸付株式数 3,600株
キャンドウ	2,800	2,430.00	6,804,000	貸付株式数 1,200株
エレマテック	7,100	1,775.00	12,602,500	
IKホールディングス	1,900	370.00	703,000	貸付株式数 800株
パルグループHLDGS	7,800	3,705.00	28,899,000	
エディオン	31,500	1,392.00	43,848,000	貸付株式数 12,400株

あらた	6,100	4,630.00	28,243,000	
サーラコーポレーション	17,000	768.00	13,056,000	
ワッツ	3,000	703.00	2,109,000	貸付株式数 1,200株
トーメンデバイス	1,100	5,810.00	6,391,000	貸付株式数 400株
ハローズ	3,700	3,450.00	12,765,000	貸付株式数 700株
J Pホールディングス	22,100	339.00	7,491,900	貸付株式数 1,200株
フジオフードG本社	8,700	1,512.00	13,154,400	貸付株式数 3,400株 (100株)
あみやき亭	1,900	3,500.00	6,650,000	貸付株式数 600株
東京エレクトロニクスデバイス	2,900	10,990.00	31,871,000	
ひらまつ	13,100	265.00	3,471,500	貸付株式数 5,200株
円谷フィールズホールディ	13,700	2,852.00	39,072,400	貸付株式数 5,300株
双日	79,400	3,158.00	250,745,200	
アルフレッサホールディン グス	80,000	2,151.00	172,080,000	
大黒天物産	2,400	5,080.00	12,192,000	貸付株式数 600株
ハニーズホールディングス	6,400	1,483.00	9,491,200	貸付株式数 2,100株
ファーマライズHD	1,300	616.00	800,800	貸付株式数 500株
キッコーマン	49,100	8,416.00	413,225,600	
味の素	179,000	5,734.00	1,026,386,000	
ブルドックソ - ス	3,900	1,995.00	7,780,500	貸付株式数 1,500株
キューピー	39,700	2,342.00	92,977,400	
ハウス食品G本社	22,500	3,231.00	72,697,500	
カゴメ	34,400	3,392.00	116,684,800	貸付株式数 13,600株
焼津水産化工	2,200	817.00	1,797,400	
アリアケジャパン	6,400	5,239.00	33,529,600	
ピエトロ	800	1,811.00	1,448,800	貸付株式数 100株
エバラ食品工業	2,000	2,956.00	5,912,000	貸付株式数 200株
やまみ	600	1,360.00	816,000	貸付株式数 200株
ニチレイ	33,900	3,118.00	105,700,200	
横浜冷凍	21,400	1,167.00	24,973,800	貸付株式数 3,500株
東洋水産	37,400	6,377.00	238,499,800	
イトアンドHLDGS	3,200	2,203.00	7,049,600	貸付株式数 1,200株
大冷	700	1,936.00	1,355,200	
ヨシムラ・フード・HLD GS	4,600	876.00	4,029,600	貸付株式数 1,800株
日清食品HD	26,100	12,080.00	315,288,000	
永谷園ホールディングス	3,600	2,103.00	7,570,800	
一正蒲鉾	2,500	793.00	1,982,500	貸付株式数 1,000株
フジッコ	7,600	1,916.00	14,561,600	

ロックフィールド	8,400	1,496.00	12,566,400	貸付株式数	1,300株
日本たばこ産業	488,000	3,214.00	1,568,432,000		
ケンコーマヨネーズ	5,300	1,297.00	6,874,100		
わらべや日洋HD	5,400	2,237.00	12,079,800		
なとり	4,600	1,968.00	9,052,800	貸付株式数	200株
イフジ産業	1,000	1,047.00	1,047,000	貸付株式数	300株
ファーマフーズ	10,600	1,858.00	19,694,800	貸付株式数	4,200株
北の達人コーポ	31,800	296.00	9,412,800	貸付株式数	12,300株 (1,100株)
ユーグレナ	48,100	889.00	42,760,900	貸付株式数	18,900株
紀文食品	5,700	966.00	5,506,200	貸付株式数	2,300株
ビックルスホールディングス	4,300	1,278.00	5,495,400	貸付株式数	1,600株
スター・マイカ・HLDGS	6,700	645.00	4,321,500		
SREホールディングス	3,600	4,175.00	15,030,000	貸付株式数	100株
ADワークスグループ	14,300	208.00	2,974,400	貸付株式数	2,800株
片倉工業	6,900	1,670.00	11,523,000	貸付株式数	2,600株
グンゼ	5,300	4,505.00	23,876,500		
ヒューリック	173,400	1,237.00	214,495,800		
神栄	800	1,098.00	878,400		
ラサ商事	2,800	1,430.00	4,004,000	貸付株式数	900株
アルペン	6,600	1,989.00	13,127,400	貸付株式数	2,600株
ハブ	2,000	792.00	1,584,000	貸付株式数	900株
ラクーンホールディングス	6,400	749.00	4,793,600	貸付株式数	2,400株
クオールホールディングス	10,900	1,818.00	19,816,200		
アルコニックス	10,300	1,374.00	14,152,200		
神戸物産	61,600	3,716.00	228,905,600	貸付株式数	400株
ソリトンシステムズ	3,900	1,174.00	4,578,600	貸付株式数	1,400株
ジンスホールディングス	4,700	3,125.00	14,687,500	貸付株式数	1,800株
ビックカメラ	42,500	1,070.00	45,475,000	貸付株式数	20,600株
DCMホールディングス	46,200	1,236.00	57,103,200	貸付株式数	17,100株
ペッパーフードサービス	19,100	130.00	2,483,000	貸付株式数	7,200株
ハイパー	1,100	438.00	481,800	貸付株式数	400株
Monotaro	112,900	1,880.50	212,308,450		
東京一番フーズ	1,400	495.00	693,000	貸付株式数	600株
DDグループ	3,900	1,318.00	5,140,200	貸付株式数	1,300株
あいホールディングス	12,700	2,365.00	30,035,500		
ディーブイエックス	1,700	926.00	1,574,200	貸付株式数	200株

きちりホールディングス	1,400	891.00	1,247,400	貸付株式数	700株
アークランドサービスHD	6,400	2,929.00	18,745,600	貸付株式数	2,300株
J. フロント リテイリング	99,100	1,422.00	140,920,200		
ドトール・日レスHD	14,100	2,037.00	28,721,700		
マツキヨココカラ&カンパニー	48,300	8,091.00	390,795,300		
ブロンコビリー	4,300	2,916.00	12,538,800	貸付株式数	1,600株
Z O Z O	52,700	2,950.00	155,465,000		
トレジャー・ファクトリー	3,800	1,571.00	5,969,800	貸付株式数	1,600株
物語コーポレーション	13,300	3,435.00	45,685,500	貸付株式数	5,200株
三越伊勢丹HD	134,100	1,465.50	196,523,550		
東洋紡	32,900	1,021.50	33,607,350		
ユニチカ	23,100	242.00	5,590,200	貸付株式数	4,600株
富士紡ホールディングス	3,000	3,150.00	9,450,000		
日清紡ホールディングス	62,200	1,133.50	70,503,700		
倉敷紡績	5,600	2,230.00	12,488,000		
ダイワボウHD	32,400	2,878.00	93,247,200		
シキボウ	3,300	997.00	3,290,100		
日東紡績	8,500	2,661.00	22,618,500		
トヨタ紡織	31,700	2,595.00	82,261,500		
マクニカホールディングス	18,800	6,310.00	118,628,000		
H a m e e	2,900	1,156.00	3,352,400	貸付株式数	1,100株
マーケットエンタープライズ	600	1,368.00	820,800	貸付株式数	200株
ラクト・ジャパン	3,000	2,012.00	6,036,000	貸付株式数	500株
ウエルシアHD	41,300	2,912.00	120,265,600	貸付株式数	15,500株
クリエイトSDH	13,200	3,505.00	46,266,000	貸付株式数	5,200株
グリムス	3,300	2,844.00	9,385,200		
バイタルK S K HD	11,600	908.00	10,532,800		
八洲電機	6,400	1,369.00	8,761,600	貸付株式数	1,900株
メディアスホールディングス	5,100	923.00	4,707,300	貸付株式数	2,000株
レスターホールディングス	7,700	2,537.00	19,534,900		
ジュテックHD	1,400	1,146.00	1,604,400		
丸善CHI HD	7,200	351.00	2,527,200	貸付株式数	2,800株 (300株)
大光	2,600	576.00	1,497,600	貸付株式数	1,100株
OCHIホールディングス	1,400	1,234.00	1,727,600	貸付株式数	100株 (100株)

TO K A Iホールディングス	39,600	886.00	35,085,600		
黒谷	1,700	598.00	1,016,600	貸付株式数	700株
ミサワ	1,100	608.00	668,800		
ティーライフ	900	1,417.00	1,275,300	貸付株式数	100株
Cominix	1,200	785.00	942,000	貸付株式数	400株
エー・ピーホールディングス	1,300	736.00	956,800	貸付株式数	500株
三洋貿易	8,900	1,394.00	12,406,600		
チムニー	1,900	1,260.00	2,394,000	貸付株式数	700株
シュッピン	6,000	1,033.00	6,198,000	貸付株式数	2,300株
ビューティガレージ	1,300	4,255.00	5,531,500	貸付株式数	500株
オイシックス・ラ・大地	10,700	2,327.00	24,898,900	貸付株式数	4,200株
ウイン・パートナーズ	5,700	1,020.00	5,814,000	貸付株式数	1,500株
ネクステージ	18,200	2,873.00	52,288,600	貸付株式数	7,200株
ジョイフル本田	23,700	1,751.00	41,498,700	貸付株式数	9,300株
鳥貴族ホールディングス	2,900	2,683.00	7,780,700	貸付株式数	1,100株
ホットランド	6,000	1,722.00	10,332,000	貸付株式数	2,400株 (2,300株)
すかいらくHD	108,900	1,841.00	200,484,900	貸付株式数	43,000株
SFPホールディングス	4,300	2,012.00	8,651,600	貸付株式数	1,700株
綿半ホールディングス	6,100	1,370.00	8,357,000		
日本毛織	20,300	1,026.00	20,827,800	貸付株式数	8,000株
ダイトウボウ	9,400	93.00	874,200	貸付株式数	5,500株
トーア紡コーポレーション	2,200	404.00	888,800	貸付株式数	400株
ダイドーリミテッド	8,300	261.00	2,166,300	貸付株式数	3,800株 (100株)
ヨシックスホールディングス	1,200	2,270.00	2,724,000	貸付株式数	100株
ユナイテッド・スーパー マケ	25,600	1,105.00	28,288,000	貸付株式数	10,200株
三栄建築設計	3,500	1,533.00	5,365,500		
野村不動産HLDGS	46,300	3,507.00	162,374,100		
三重交通グループHD	15,700	572.00	8,980,400	貸付株式数	4,000株
サムティ	11,700	2,182.00	25,529,400	貸付株式数	4,600株
地主	5,700	1,963.00	11,189,100	貸付株式数	2,200株
プレサンスコーポレーション	11,700	1,947.00	22,779,900	貸付株式数	900株
フィル・カンパニー	1,300	903.00	1,173,900	貸付株式数	500株
ハウスコム	900	932.00	838,800		

J P M C	3,700	1,120.00	4,144,000		
サンセイランディック	1,700	872.00	1,482,400	貸付株式数	600株
エストラスト	700	638.00	446,600	貸付株式数	200株
フージャースHD	11,500	996.00	11,454,000		
オープンハウスグループ	27,200	5,451.00	148,267,200		
東急不動産HD	223,000	845.40	188,524,200		
飯田GH D	65,000	2,410.00	156,650,000	貸付株式数	23,500株
イーグランド	900	1,500.00	1,350,000	貸付株式数	400株
帝国繊維	8,500	1,651.00	14,033,500	貸付株式数	3,200株
日本コークス工業	68,700	108.00	7,419,600		
ゴルフダイジェスト・オン	3,600	840.00	3,024,000	貸付株式数	1,500株
ミタチ産業	1,500	1,413.00	2,119,500		
B E E N O S	3,400	1,798.00	6,113,200	貸付株式数	1,700株
あさひ	7,100	1,278.00	9,073,800		
日本調剤	5,400	1,145.00	6,183,000	貸付株式数	2,100株
コスモス薬品	7,900	13,830.00	109,257,000	貸付株式数	900株
シップヘルスケアHD	28,600	2,366.50	67,681,900	貸付株式数	10,600株
トーエル	2,900	744.00	2,157,600	貸付株式数	1,300株
ソフトクリエイトHD	6,200	1,711.00	10,608,200	貸付株式数	100株
セブン&アイ・H L D G S	274,600	6,158.00	1,690,986,800		
クリエイト・レストラン ツ・ホール	59,800	1,002.00	59,919,600	貸付株式数	23,600株
明治電機工業	2,900	1,374.00	3,984,600		
ツルハホールディングス	16,700	10,420.00	174,014,000		
デリカフーズH L D G S	2,400	583.00	1,399,200	貸付株式数	1,000株
スターティアホールディング ス	1,200	1,170.00	1,404,000	貸付株式数	500株
サンマルクホールディング ス	6,500	1,903.00	12,369,500		
フェリシモ	1,400	1,010.00	1,414,000	貸付株式数	400株
トリドールホールディング ス	19,800	2,951.00	58,429,800	貸付株式数	7,800株
帝 人	72,500	1,385.50	100,448,750		
東 レ	505,200	787.50	397,845,000		
ク ラ レ	119,900	1,389.50	166,601,050		
旭 化 成	471,500	972.90	458,722,350		
T O K Y O B A S E	8,100	380.00	3,078,000	貸付株式数	3,200株
稲葉製作所	4,100	1,635.00	6,703,500	貸付株式数	1,700株
宮地エンジニアリングG	2,100	3,890.00	8,169,000	貸付株式数	800株
トーカロ	21,400	1,425.00	30,495,000		

アルファCO	2,200	1,152.00	2,534,400	貸付株式数	800株
SUMCO	148,100	2,061.50	305,308,150		
川田テクノロジーズ	1,800	5,300.00	9,540,000		
RS TECHNOLOGIES	5,200	3,360.00	17,472,000		
ジェイテックコーポレーション	800	2,393.00	1,914,400		
信和	3,300	738.00	2,435,400	貸付株式数	1,300株
ビーロット	3,900	643.00	2,507,700	貸付株式数	2,000株
ファーストブラザーズ	1,100	926.00	1,018,600	貸付株式数	500株
AND DOホールディングス	4,500	1,155.00	5,197,500	貸付株式数	1,700株
シーアールイー	4,100	1,470.00	6,027,000	貸付株式数	1,100株
プロパティエージェント	700	1,149.00	804,300	貸付株式数	200株
ケイアイスター不動産	3,600	4,805.00	17,298,000	貸付株式数	1,300株 (400株)
アグレ都市デザイン	1,000	1,538.00	1,538,000	貸付株式数	400株
ジェイ・エス・ビー	1,800	4,885.00	8,793,000		
ロードスターキャピタル	4,300	1,590.00	6,837,000	貸付株式数	1,600株
テンポイノベーション	1,700	1,066.00	1,812,200	貸付株式数	400株
グローバルリンクマネジメント	1,100	1,379.00	1,516,900	貸付株式数	500株
フェイスネットワーク	1,600	1,405.00	2,248,000	貸付株式数	600株
住江織物	1,200	2,213.00	2,655,600	貸付株式数	400株
日本フェルト	3,300	412.00	1,359,600	貸付株式数	600株
イチカワ	700	1,353.00	947,100	貸付株式数	100株
エコナックホールディングス	10,200	93.00	948,600	貸付株式数	4,500株
日東製網	700	1,362.00	953,400	貸付株式数	100株
芦森工業	1,100	1,889.00	2,077,900		
アツギ	3,700	426.00	1,576,200		
ウイルプラスHLDGS	1,000	1,175.00	1,175,000	貸付株式数	500株
JMホールディングス	6,100	1,930.00	11,773,000		
コメダホールディングス	19,400	2,647.00	51,351,800	貸付株式数	7,300株
サツドラホールディングス	2,800	804.00	2,251,200	貸付株式数	1,300株
アレンザホールディングス	5,900	991.00	5,846,900	貸付株式数	900株
串カツ田中HLDGS	2,200	1,698.00	3,735,600		
パロックジャパン	5,100	848.00	4,324,800	貸付株式数	2,000株
クスリのアオキHLDGS	7,100	7,851.00	55,742,100		
ダイニック	1,700	725.00	1,232,500	貸付株式数	200株



共和レザー	3,300	546.00	1,801,800	
ピーバンドットコム	900	468.00	421,200	貸付株式数 300株
力の源HD	3,500	1,383.00	4,840,500	
FOOD & LIFE COMPANY	42,500	3,049.00	129,582,500	貸付株式数 17,200株
アセンテック	2,800	667.00	1,867,600	貸付株式数 100株
セーレン	14,500	2,386.00	34,597,000	貸付株式数 5,700株
ソトー	1,800	799.00	1,438,200	貸付株式数 100株
東海染工	600	1,128.00	676,800	貸付株式数 100株
小松マテーレ	11,100	681.00	7,559,100	
ワコールホールディングス	14,500	2,968.00	43,036,000	
ホギメディカル	10,100	3,210.00	32,421,000	
クラウディアHLDGS	1,300	667.00	867,100	貸付株式数 500株
T S Iホールディングス	25,200	685.00	17,262,000	
マツオカコーポレーション	1,600	1,118.00	1,788,800	貸付株式数 600株
ワールド	9,800	1,539.00	15,082,200	
T I S	82,600	3,619.00	298,929,400	
J N Sホールディングス	2,600	583.00	1,515,800	貸付株式数 1,000株
グリー	20,300	662.00	13,438,600	
GMOペパボ	1,100	1,749.00	1,923,900	貸付株式数 400株
コーエーテクモHD	47,300	2,374.50	112,313,850	貸付株式数 16,700株
三菱総合研究所	3,700	5,300.00	19,610,000	
ボルテージ	1,600	309.00	494,400	貸付株式数 800株
電算	700	1,623.00	1,136,100	貸付株式数 100株
A G S	2,400	731.00	1,754,400	貸付株式数 1,000株
ファインデックス	6,100	608.00	3,708,800	
ブレインパッド	5,800	912.00	5,289,600	貸付株式数 2,100株
K L a b	15,100	344.00	5,194,400	貸付株式数 5,900株
ポルトゥウィンホールディング	13,000	810.00	10,530,000	
ネクソン	195,600	2,923.50	571,836,600	
アイスタイル	21,900	714.00	15,636,600	貸付株式数 8,600株
エムアップホールディングス	9,300	1,229.00	11,429,700	貸付株式数 3,600株 (3,400株)
エイチーム	4,600	686.00	3,155,600	
エニグモ	9,700	400.00	3,880,000	
テクノスジャパン	4,800	613.00	2,942,400	貸付株式数 100株
e n i s h	4,400	775.00	3,410,000	貸付株式数 1,700株
コロプラ	29,200	675.00	19,710,000	

オルトプラス	4,600	217.00	998,200	貸付株式数	2,100株
ブロードリーフ	44,400	438.00	19,447,200	貸付株式数	2,000株
クロス・マーケティングG	3,500	743.00	2,600,500	貸付株式数	1,500株
デジタルハーツHLDGS	4,700	1,303.00	6,124,100		
システム情報	6,100	747.00	4,556,700	貸付株式数	800株
メディアドウ	3,100	1,488.00	4,612,800		
じげん	21,900	742.00	16,249,800		
バイキューブ	9,200	484.00	4,452,800	貸付株式数	3,500株 (100株)
エンカレッジ・テクノロジー	1,300	519.00	674,700	貸付株式数	600株
サイバーリンクス	1,900	683.00	1,297,700	貸付株式数	1,000株
ディー・エル・イー	4,300	332.00	1,427,600		
フィックスターズ	8,500	1,331.00	11,313,500		
CARTA HOLDINGS	3,500	1,317.00	4,609,500	貸付株式数	1,400株
オプティム	6,300	1,060.00	6,678,000	貸付株式数	600株
セレス	3,100	942.00	2,920,200	貸付株式数	1,200株
SHIFT	5,000	26,995.00	134,975,000		
特種東海製紙	3,500	3,290.00	11,515,000		
ティーガイア	7,800	1,769.00	13,798,200	貸付株式数	1,300株
セック	800	3,305.00	2,644,000		
テクマトリックス	13,800	1,813.00	25,019,400		
プロシップ	3,300	1,459.00	4,814,700	貸付株式数	1,200株
ガンホー・オンライン・エンター	22,100	2,907.00	64,244,700	貸付株式数	1,500株
GMOペイメントゲートウェイ	15,100	11,570.00	174,707,000		
ザッパラス	1,600	348.00	556,800	貸付株式数	1,000株
システムリサーチ	2,300	2,606.00	5,993,800	貸付株式数	200株
インターネットイニシアティブ	42,100	2,751.50	115,838,150		
さくらインターネット	8,500	706.00	6,001,000	貸付株式数	3,000株
ヴィンクス	1,700	1,458.00	2,478,600		
GMOグローバルサインHD	2,300	3,370.00	7,751,000	貸付株式数	900株
SRAホールディングス	3,800	3,255.00	12,369,000		
システムインテグレータ	1,700	448.00	761,600	貸付株式数	900株
朝日ネット	8,200	605.00	4,961,000		
eBASE	10,700	785.00	8,399,500		
アバントグループ	9,500	1,460.00	13,870,000		

アドソル日進	3,300	1,770.00	5,841,000	
ODKソリューションズ	1,300	558.00	725,400	貸付株式数 600株
フリービット	3,900	1,638.00	6,388,200	貸付株式数 1,500株
コムチュア	10,000	2,145.00	21,450,000	
サイバーコム	900	1,530.00	1,377,000	貸付株式数 400株
アステリア	5,800	755.00	4,379,000	貸付株式数 2,300株
アイル	3,500	2,769.00	9,691,500	貸付株式数 1,500株
王子ホールディングス	313,700	549.90	172,503,630	
日本製紙	38,900	1,239.00	48,197,100	
三菱製紙	7,000	555.00	3,885,000	
北越コーポレーション	47,400	881.00	41,759,400	貸付株式数 18,800株
中越パルプ	2,400	1,373.00	3,295,200	貸付株式数 300株
巴川製紙	1,800	663.00	1,193,400	貸付株式数 700株
大王製紙	33,200	1,125.00	37,350,000	
阿波製紙	1,400	570.00	798,000	貸付株式数 600株
マークラインズ	4,200	2,543.00	10,680,600	
メディカル・データ・ビジ	11,500	726.00	8,349,000	貸付株式数 4,400株
gumi	11,100	654.00	7,259,400	貸付株式数 4,300株
ショーケース	1,300	389.00	505,700	貸付株式数 600株
モバイルファクトリー	1,300	901.00	1,171,300	貸付株式数 500株
テラスカイ	3,300	2,777.00	9,164,100	貸付株式数 1,200株
デジタル・インフォメーション	4,300	1,571.00	6,755,300	
PCIホールディングス	2,400	1,036.00	2,486,400	貸付株式数 200株
アイピーシー	900	619.00	557,100	貸付株式数 400株
ネオジャパン	2,700	1,027.00	2,772,900	貸付株式数 900株
PR TIMES	1,900	1,407.00	2,673,300	貸付株式数 400株
ラクス	35,700	2,490.00	88,893,000	
ランドコンピュータ	1,400	1,324.00	1,853,600	
ダブルスタンダード	3,100	2,453.00	7,604,300	
オープンドア	5,300	1,201.00	6,365,300	貸付株式数 2,000株
マイネット	1,900	338.00	642,200	貸付株式数 700株
アカツキ	3,600	2,051.00	7,383,600	
ベネフィットジャパン	300	1,196.00	358,800	貸付株式数 200株
UBICOMホールディングス	2,300	1,730.00	3,979,000	
カナミックネットワーク	8,000	436.00	3,488,000	
ノムラシステムコーポレーション	5,400	118.00	637,200	貸付株式数 2,900株
レンゴー	68,600	864.20	59,284,120	

トモク	4,300	1,996.00	8,582,800	
ザ・バック	5,700	3,125.00	17,812,500	貸付株式数 2,100株
チェンジホールディングス	18,500	2,049.00	37,906,500	
シンクロ・フード	3,700	704.00	2,604,800	貸付株式数 200株
オークネット	3,800	1,676.00	6,368,800	貸付株式数 1,500株
キャピタル・アセット・プラン	1,100	738.00	811,800	貸付株式数 500株
セグエグループ	1,600	1,044.00	1,670,400	貸付株式数 700株
エイトレッド	1,000	1,375.00	1,375,000	貸付株式数 400株
マクロミル	14,900	857.00	12,769,300	
ビーグリー	1,100	1,155.00	1,270,500	
オロ	2,200	2,183.00	4,802,600	貸付株式数 800株
ユーザーローカル	2,700	3,045.00	8,221,500	貸付株式数 1,000株
テモナ	1,300	283.00	367,900	貸付株式数 500株
ニーズウェル	3,200	758.00	2,425,600	貸付株式数 1,400株
マネーフォワード	18,200	6,316.00	114,951,200	貸付株式数 100株
サインポスト	2,200	500.00	1,100,000	貸付株式数 900株
レゾナック・ホールディング	72,900	2,271.00	165,555,900	
住友化学	559,200	431.70	241,406,640	
住友精化	3,100	4,265.00	13,221,500	
日産化学	35,800	6,445.00	230,731,000	
ラサ工業	3,000	2,209.00	6,627,000	
クレハ	6,500	8,480.00	55,120,000	
多木化学	2,900	4,405.00	12,774,500	貸付株式数 1,100株
テイカ	5,000	1,276.00	6,380,000	
石原産業	13,700	1,303.00	17,851,100	
片倉コープアグリ	1,200	1,250.00	1,500,000	貸付株式数 400株
日本曹達	8,100	5,100.00	41,310,000	
東ソー	100,700	1,748.50	176,073,950	
トクヤマ	24,300	2,431.50	59,085,450	
セントラル硝子	12,100	3,260.00	39,446,000	
東亜合成	37,700	1,295.50	48,840,350	
大阪ソーダ	4,500	5,260.00	23,670,000	
関東電化	14,700	900.00	13,230,000	
SUN ASTERISK	5,300	1,172.00	6,211,600	貸付株式数 600株
デンカ	27,400	2,626.00	71,952,400	
イビデン	43,600	8,069.00	351,808,400	
信越化学	626,900	4,817.00	3,019,777,300	
日本カ-バイド	2,300	1,330.00	3,059,000	

電算システムHD	3,700	3,455.00	12,783,500	
堺化学	5,900	1,874.00	11,056,600	貸付株式数 1,700株
第一稀元素化学工	6,900	980.00	6,762,000	貸付株式数 800株
エア・ウォーター	70,900	1,893.00	134,213,700	
日本酸素HLDGS	73,100	3,142.00	229,680,200	
日本化学工業	2,600	1,858.00	4,830,800	
東邦アセチレン	1,200	1,370.00	1,644,000	
日本パ・カラライジング	37,300	1,081.00	40,321,300	
高圧ガス	10,800	734.00	7,927,200	貸付株式数 300株
チタン工業	700	1,410.00	987,000	貸付株式数 200株
四国化成ホールディング	8,900	1,493.00	13,287,700	
戸田工業	1,700	2,376.00	4,039,200	貸付株式数 600株
ステラケミファ	4,500	3,010.00	13,545,000	
保土谷化学	2,100	3,255.00	6,835,500	
日本触媒	11,500	5,497.00	63,215,500	
大日精化	5,300	1,968.00	10,430,400	
カネカ	17,300	3,944.00	68,231,200	貸付株式数 6,800株
協和キリン	91,100	2,702.50	246,197,750	
APPIER GROUP	28,700	1,790.00	51,373,000	
三菱瓦斯化学	56,400	2,117.50	119,427,000	
三井化学	62,300	3,991.00	248,639,300	
JSR	70,400	3,378.00	237,811,200	
東京応化工業	13,200	8,528.00	112,569,600	
大阪有機化学	5,700	2,548.00	14,523,600	
三菱ケミカルグループ	509,000	826.20	420,535,800	
KHネオケム	12,600	2,419.00	30,479,400	
ダイセル	110,600	1,291.00	142,784,600	
住友ベークライト	11,200	5,694.00	63,772,800	
積水化学	154,300	2,058.50	317,626,550	
日本ゼオン	45,200	1,390.00	62,828,000	
アイカ工業	19,100	3,079.00	58,808,900	貸付株式数 1,000株
UBE	38,700	2,453.00	94,931,100	
積水樹脂	11,100	2,283.00	25,341,300	
タキロンシーアイ	16,300	534.00	8,704,200	
旭有機材	5,000	4,375.00	21,875,000	
ニチバン	4,600	1,891.00	8,698,600	
リケンテクノス	16,100	625.00	10,062,500	
大倉工業	3,500	2,086.00	7,301,000	貸付株式数 1,300株
積水化成成品	10,400	426.00	4,430,400	
群栄化学	1,800	2,504.00	4,507,200	

タイガース ポリマー	2,600	566.00	1,471,600	
ミライアル	2,000	1,567.00	3,134,000	
ダイキアクシス	2,300	716.00	1,646,800	貸付株式数 800株
ダイキョーニシカワ	16,400	797.00	13,070,800	
竹本容器	2,000	824.00	1,648,000	貸付株式数 900株
森六ホールディングス	3,800	2,043.00	7,763,400	
恵和	4,800	1,111.00	5,332,800	貸付株式数 1,900株
日本化薬	57,800	1,262.00	72,943,600	
カーリットホールディングス	6,700	802.00	5,373,400	貸付株式数 100株
ソルクシーズ	4,800	437.00	2,097,600	貸付株式数 2,300株
C Lホールディングス	2,200	889.00	1,955,800	貸付株式数 800株
プレステージ・インター	32,900	660.00	21,714,000	
フェイス	1,600	503.00	804,800	貸付株式数 300株
プロトコーポレーション	9,400	1,106.00	10,396,400	
ハイマックス	2,300	1,451.00	3,337,300	
アミューズ	4,200	1,835.00	7,707,000	
野村総合研究所	150,400	3,786.00	569,414,400	
ドリームインキュベータ	2,300	2,894.00	6,656,200	貸付株式数 900株
サイバネットシステム	6,300	884.00	5,569,200	
クイック	5,900	2,098.00	12,378,200	
T A C	2,900	200.00	580,000	貸付株式数 900株
C Eホールディングス	3,300	580.00	1,914,000	
日本システム技術	2,400	2,565.00	6,156,000	
電通グループ	76,100	4,730.00	359,953,000	
インテージホールディングス	8,600	1,656.00	14,241,600	
テイクアンドギヴニーズ	2,300	1,186.00	2,727,800	貸付株式数 800株
東邦システムサイエンス	1,600	1,211.00	1,937,600	貸付株式数 700株
びあ	2,600	3,345.00	8,697,000	貸付株式数 1,000株
イオンファンタジー	3,300	3,390.00	11,187,000	貸付株式数 1,300株
ソースネクスト	38,300	200.00	7,660,000	貸付株式数 15,100株
シーティーエス	8,500	738.00	6,273,000	
ネクシーズグループ	1,800	660.00	1,188,000	
インフォコム	9,800	2,356.00	23,088,800	
メディカルシステムネットワーク	6,800	363.00	2,468,400	
日本精化	4,200	2,840.00	11,928,000	貸付株式数 1,600株
扶桑化学工業	7,000	4,050.00	28,350,000	
トリケミカル	10,100	2,688.00	27,148,800	

シンプレクスHD	12,900	2,514.00	32,430,600		
HEROZ	2,500	2,163.00	5,407,500	貸付株式数	1,000株
ラクスル	18,100	1,260.00	22,806,000	貸付株式数	7,200株
メルカリ	45,500	3,284.00	149,422,000		
IPS	2,500	2,230.00	5,575,000	貸付株式数	900株
FIG	6,700	277.00	1,855,900	貸付株式数	2,800株
システムサポート	2,900	2,126.00	6,165,400	貸付株式数	1,100株
ADEKA	26,400	2,583.00	68,191,200		
日油	23,300	6,277.00	146,254,100		
ミヨシ油脂	2,000	1,014.00	2,028,000		
新日本理化	8,000	252.00	2,016,000	貸付株式数	3,100株
ハリマ化成グループ	4,100	870.00	3,567,000		
イーソル	4,800	990.00	4,752,000	貸付株式数	1,800株
アルテリア・ネットワークス	6,900	1,968.00	13,579,200		
東海ソフト	900	1,025.00	922,500	貸付株式数	400株
ウイングアーク1ST	7,800	2,505.00	19,539,000		
ヒト・コミュニケーションズHD	2,000	1,537.00	3,074,000	貸付株式数	800株
サーバーワークス	1,500	3,340.00	5,010,000	貸付株式数	600株
東名	400	2,515.00	1,006,000	貸付株式数	200株
ヴィッツ	600	1,496.00	897,600	貸付株式数	200株
トピラスシステムズ	1,400	1,036.00	1,450,400	貸付株式数	600株
Sansan	24,700	1,815.50	44,842,850		
Link-U	1,400	1,228.00	1,719,200		
ギフトィ	8,200	1,750.00	14,350,000	貸付株式数	3,200株
花王	183,700	5,118.00	940,176,600		
第一工業製薬	2,800	1,787.00	5,003,600		
石原ケミカル	3,400	1,716.00	5,834,400		
日華化学	2,300	855.00	1,966,500	貸付株式数	800株
ニイタカ	1,100	2,075.00	2,282,500	貸付株式数	500株
三洋化成	4,600	4,265.00	19,619,000	貸付株式数	300株
メドレー	10,100	5,460.00	55,146,000		
ベース	2,600	5,470.00	14,222,000		
JMDC	12,400	5,985.00	74,214,000	貸付株式数	200株
武田薬品	668,300	4,537.00	3,032,077,100		
アステラス製薬	713,400	2,258.50	1,611,213,900		
住友ファーマ	56,000	631.90	35,386,400		
塩野義製薬	95,200	6,131.00	583,671,200		
わかもと製薬	5,600	230.00	1,288,000	貸付株式数	2,600株

日本新薬	17,800	6,378.00	113,528,400	
中外製薬	236,400	4,146.00	980,114,400	
科研製薬	12,900	3,601.00	46,452,900	貸付株式数 500株
エーザイ	91,800	9,527.00	874,578,600	
理研ビタミン	6,400	2,107.00	13,484,800	
ロート製薬	73,100	3,185.00	232,823,500	
小野薬品	145,700	2,675.00	389,747,500	貸付株式数 57,500株
久光製薬	16,800	3,541.00	59,488,800	貸付株式数 6,500株
有機合成薬品	4,200	309.00	1,297,800	貸付株式数 1,100株
持田製薬	8,700	3,225.00	28,057,500	
参天製薬	137,700	1,199.50	165,171,150	
扶桑薬品	2,400	2,009.00	4,821,600	
日本ケミファ	600	1,818.00	1,090,800	貸付株式数 200株
ツムラ	23,800	2,726.50	64,890,700	
テルモ	231,600	4,586.00	1,062,117,600	
HUグループHD	22,800	2,741.00	62,494,800	
キッセイ薬品工業	11,600	2,938.00	34,080,800	貸付株式数 400株
生化学工業	14,600	759.00	11,081,400	
栄研化学	12,400	1,518.00	18,823,200	
鳥居薬品	4,000	3,610.00	14,440,000	
JCRファーマ	25,500	1,319.00	33,634,500	貸付株式数 9,900株
東和薬品	11,700	1,763.00	20,627,100	
富士製薬工業	5,500	1,113.00	6,121,500	
ゼリア新薬工業	10,400	2,483.00	25,823,200	
そーせいグループ	25,900	2,840.00	73,556,000	
第一三共	657,800	4,800.00	3,157,440,000	
杏林製薬	16,200	1,741.00	28,204,200	
大幸薬品	14,700	377.00	5,541,900	貸付株式数 5,200株
ダイト	5,300	2,394.00	12,688,200	
大塚ホールディングス	172,800	5,539.00	957,139,200	
大正製薬HD	16,700	5,255.00	87,758,500	
ペプチドリーム	36,600	2,214.50	81,050,700	
大日本塗料	9,100	909.00	8,271,900	貸付株式数 3,100株
日本ペイントHOLD	333,500	1,234.00	411,539,000	
関西ペイント	69,100	2,199.50	151,985,450	
神東塗料	4,800	130.00	624,000	貸付株式数 1,800株
中国塗料	12,300	1,122.00	13,800,600	
日本特殊塗料	3,700	1,027.00	3,799,900	
藤倉化成	10,000	439.00	4,390,000	
太陽ホールディングス	11,600	2,587.00	30,009,200	貸付株式数 2,800株



D I C	29,500	2,621.00	77,319,500	
サカティンクス	16,800	1,235.00	20,748,000	貸付株式数 4,700株
東洋インキSCホールディングン	14,600	2,224.00	32,470,400	
T & K T O K A	6,600	1,251.00	8,256,600	
アルプス技研	6,700	2,961.00	19,838,700	貸付株式数 1,000株
サニックス	12,300	357.00	4,391,100	貸付株式数 5,000株 (5,000株)
日本空調サービス	8,200	766.00	6,281,200	
オリエンタルランド	409,600	5,447.00	2,231,091,200	
フォーカスシステムズ	5,500	1,085.00	5,967,500	
ダスキン	17,400	3,152.00	54,844,800	
パーク24	57,800	2,134.00	123,345,200	
明光ネットワークジャパン	9,700	645.00	6,256,500	貸付株式数 3,700株
ファルコホールディングス	3,500	1,863.00	6,520,500	貸付株式数 400株
クレスコ	5,900	2,039.00	12,030,100	
フジ・メディア・HD	72,200	1,358.50	98,083,700	
秀英予備校	1,300	405.00	526,500	貸付株式数 500株
田谷	1,000	461.00	461,000	
ラウンドワン	64,700	589.00	38,108,300	貸付株式数 24,700株
リゾートトラスト	30,700	2,185.00	67,079,500	貸付株式数 6,300株
オービック	25,200	23,655.00	596,106,000	
ジャストシステム	10,900	4,490.00	48,941,000	
T D C ソフト	6,300	1,714.00	10,798,200	貸付株式数 1,600株
Zホールディングス	1,074,200	362.00	388,860,400	
ビー・エム・エル	9,600	3,080.00	29,568,000	
トレンドマイクロ	43,600	7,382.00	321,855,200	
りらいあコミュニケーション	12,500	1,464.00	18,300,000	
I Dホールディングス	5,100	1,213.00	6,186,300	
リソー教育	35,300	286.00	10,095,800	
日本オラクル	14,400	11,295.00	162,648,000	
早稲田アカデミー	4,300	1,375.00	5,912,500	貸付株式数 1,600株
アルファシステムズ	2,300	3,610.00	8,303,000	貸付株式数 900株
フューチャー	18,800	1,821.00	34,234,800	
C A C H O L D I N G S	4,600	1,737.00	7,990,200	
S B テクノロジー	3,200	2,466.00	7,891,200	
トーセ	1,700	765.00	1,300,500	貸付株式数 100株
ユー・エス・エス	79,600	2,405.50	191,477,800	
オービックビジネスC	14,800	5,520.00	81,696,000	
伊藤忠テクノソリュー	40,500	3,647.00	147,703,500	

アイティフォー	9,800	1,113.00	10,907,400	
東京個別指導学院	9,100	530.00	4,823,000	貸付株式数 3,100株
東計電算	1,000	6,410.00	6,410,000	貸付株式数 300株
サイバーエージェント	171,200	1,046.50	179,160,800	
楽天グループ	464,400	518.50	240,791,400	貸付株式数 137,600株
エックスネット	800	1,027.00	821,600	貸付株式数 300株
クリーク・アンド・リバー社	4,600	1,978.00	9,098,800	
SBIグローバルアセット	12,500	503.00	6,287,500	
テー・オー・ダブリュー	15,800	323.00	5,103,400	貸付株式数 4,200株
大塚商会	42,800	5,690.00	243,532,000	
サイボウズ	10,400	2,359.00	24,533,600	
山田コンサルティングGP	3,900	1,698.00	6,622,200	貸付株式数 600株
セントラルスポーツ	2,900	2,427.00	7,038,300	貸付株式数 1,100株
パラカ	2,700	1,915.00	5,170,500	貸付株式数 1,000株
電通国際情報S	9,100	5,290.00	48,139,000	
ACCESS	8,800	989.00	8,703,200	
デジタルガレージ	13,400	3,845.00	51,523,000	
イーエムシステムズ	12,600	848.00	10,684,800	
ウェザーニューズ	2,300	6,680.00	15,364,000	貸付株式数 100株
CIJ	12,800	636.00	8,140,800	貸付株式数 100株
ビジネスエンジニアリング	1,200	3,430.00	4,116,000	貸付株式数 600株
日本エンタープライズ	6,900	135.00	931,500	貸付株式数 2,800株
WOWOW	6,000	1,116.00	6,696,000	貸付株式数 700株
スカラ	7,000	795.00	5,565,000	
インテリジェントウェイブ	3,100	788.00	2,442,800	貸付株式数 1,500株
フルキャストホールディングス	7,400	2,369.00	17,530,600	
エン・ジャパン	14,100	2,603.00	36,702,300	貸付株式数 5,500株
あすか製薬HD	7,800	1,308.00	10,202,400	
サワイグループHD	17,300	3,399.00	58,802,700	
富士フイルムHLDGS	144,900	8,813.00	1,277,003,700	
コニカミノルタ	169,700	468.70	79,538,390	
資生堂	157,700	6,756.00	1,065,421,200	
ライオン	90,600	1,378.00	124,846,800	
高砂香料	5,100	2,628.00	13,402,800	
マンダム	16,500	1,444.00	23,826,000	
ミルボン	11,200	5,128.00	57,433,600	貸付株式数 2,200株
ファンケル	33,000	2,382.50	78,622,500	

コーセー	15,400	14,050.00	216,370,000	
コタ	7,000	1,641.00	11,487,000	
シーボン	800	1,555.00	1,244,000	
ポーラ・オルビスHD	38,700	2,125.50	82,256,850	
ノエビアホールディングス	6,700	5,420.00	36,314,000	
アジュバンホールディング	1,400	928.00	1,299,200	貸付株式数 600株
新日本製薬	4,300	1,407.00	6,050,100	
アクシージア	3,800	1,379.00	5,240,200	貸付株式数 1,500株
エステー	5,800	1,523.00	8,833,400	
アグロカネショウ	3,000	1,682.00	5,046,000	貸付株式数 1,200株 (300株)
コニシ	12,600	2,226.00	28,047,600	
長谷川香料	14,400	3,280.00	47,232,000	
星光PMC	3,000	575.00	1,725,000	貸付株式数 100株
小林製薬	22,000	8,089.00	177,958,000	
荒川化学工業	6,300	1,013.00	6,381,900	
メック	6,200	3,395.00	21,049,000	貸付株式数 2,400株
日本高純度化学	1,900	2,639.00	5,014,100	
タカラバイオ	20,400	1,645.00	33,558,000	
JCU	8,400	3,620.00	30,408,000	
新田ゼラチン	3,600	736.00	2,649,600	貸付株式数 1,500株
OATアグリオ	2,400	1,891.00	4,538,400	貸付株式数 1,000株
デクセリアルズ	21,800	3,139.00	68,430,200	
アース製薬	6,900	5,150.00	35,535,000	貸付株式数 2,600株
北興化学	7,600	981.00	7,455,600	
大成ラミック	2,400	2,936.00	7,046,400	
クミアイ化学	30,200	1,094.00	33,038,800	
日本農薬	13,900	657.00	9,132,300	貸付株式数 1,100株
富士興産	1,400	1,404.00	1,965,600	
ニチレキ	9,000	1,766.00	15,894,000	
ユシロ化学	3,900	1,050.00	4,095,000	
ビーピー・カストロール	2,200	889.00	1,955,800	
富士石油	15,600	263.00	4,102,800	貸付株式数 6,000株
MORESCO	1,900	1,157.00	2,198,300	貸付株式数 700株
出光興産	83,900	2,902.50	243,519,750	
ENEOSホールディングス	1,277,600	483.70	617,975,120	
コスモエネルギーHLDGS	29,800	4,120.00	122,776,000	
テスホールディングス	8,000	1,034.00	8,272,000	貸付株式数 2,600株

インフロニアHD	77,400	1,327.00	102,709,800	
横浜ゴム	42,900	3,204.00	137,451,600	
TOYO TIRE	43,400	1,942.00	84,282,800	
ブリヂストン	241,100	6,033.00	1,454,556,300	
住友ゴム	74,100	1,342.50	99,479,250	
藤倉コンポジット	4,100	904.00	3,706,400	
オカモト	4,100	3,935.00	16,133,500	
アキレス	4,800	1,457.00	6,993,600	貸付株式数 600株
フコク	4,000	1,310.00	5,240,000	
ニッタ	7,600	3,110.00	23,636,000	
クリエートメディック	1,900	900.00	1,710,000	
住友理工	14,500	862.00	12,499,000	
三ツ星ベルト	11,000	4,290.00	47,190,000	貸付株式数 1,100株
バンドー化学	11,800	1,407.00	16,602,600	
AGC	76,800	5,274.00	405,043,200	
日本板硝子	38,300	629.00	24,090,700	
石塚硝子	900	1,571.00	1,413,900	貸付株式数 500株
有沢製作所	12,100	1,108.00	13,406,800	貸付株式数 4,700株
日本山村硝子	2,200	1,116.00	2,455,200	
日本電気硝子	30,700	2,619.00	80,403,300	
オハラ	3,600	1,613.00	5,806,800	貸付株式数 1,200株
住友大阪セメント	10,600	3,701.00	39,230,600	
太平洋セメント	48,100	2,843.00	136,748,300	
リソルホールディングス	500	4,675.00	2,337,500	貸付株式数 200株
日本ヒューム	6,500	775.00	5,037,500	
日本コンクリート	15,100	340.00	5,134,000	
三谷セキサン	3,200	5,120.00	16,384,000	
アジアパイルHD	11,700	610.00	7,137,000	
東海カーボン	63,400	1,248.00	79,123,200	貸付株式数 25,000株
日本カーボン	4,300	4,445.00	19,113,500	
東洋炭素	4,700	5,090.00	23,923,000	
ノリタケ	3,700	5,210.00	19,277,000	
TOTO	49,800	4,458.00	222,008,400	
日本碍子	87,800	1,787.00	156,898,600	
日本特殊陶業	57,500	2,771.50	159,361,250	
ダントーホールディングス	4,100	711.00	2,915,100	貸付株式数 2,000株
MARUWA	2,800	20,230.00	56,644,000	
品川リフラクトリーズ	2,100	5,130.00	10,773,000	
黒崎播磨	1,500	7,980.00	11,970,000	
ヨータイ	4,000	1,465.00	5,860,000	

東京窯業	5,300	332.00	1,759,600	貸付株式数	1,800株
ニッカトー	2,600	644.00	1,674,400	貸付株式数	700株
フジインコーポレーテッド	6,000	9,520.00	57,120,000	貸付株式数	2,300株
クニミネ工業	1,700	964.00	1,638,800	貸付株式数	900株
エーアンドエーマテリアル	1,100	1,066.00	1,172,600		
ニチアス	19,200	2,874.00	55,180,800		
日本製鉄	346,500	2,989.00	1,035,688,500		
神戸製鋼所	155,000	1,294.00	200,570,000	貸付株式数	1,500株
中山製鋼所	15,800	831.00	13,129,800		
合同製鐵	3,800	3,425.00	13,015,000		
J F Eホールディングス	206,600	2,029.50	419,294,700		
東京製鐵	21,500	1,477.00	31,755,500		
共英製鋼	8,700	2,079.00	18,087,300		
大和工業	12,600	5,967.00	75,184,200		
東京鐵鋼	3,600	2,838.00	10,216,800	貸付株式数	1,100株
大阪製鐵	3,500	1,394.00	4,879,000	貸付株式数	1,200株
淀川製鋼所	8,700	3,180.00	27,666,000		
中部鋼鈹	6,300	1,893.00	11,925,900		
丸一鋼管	23,300	3,303.00	76,959,900		
モリ工業	1,400	3,355.00	4,697,000		
大同特殊鋼	9,700	5,642.00	54,727,400		
日本高周波	2,000	337.00	674,000	貸付株式数	900株
日本冶金工	5,600	4,065.00	22,764,000		
山陽特殊製鋼	7,600	2,880.00	21,888,000		
愛知製鋼	4,400	2,895.00	12,738,000		
日本金属	1,300	887.00	1,153,100	貸付株式数	400株
大平洋金属	5,400	1,599.00	8,634,600		
新日本電工	45,700	286.00	13,070,200		
栗本鉄工所	3,600	2,023.00	7,282,800		
虹 技	700	1,199.00	839,300	貸付株式数	100株
日本鑄鉄管	600	1,029.00	617,400	貸付株式数	300株
日本製鋼所	20,900	3,038.00	63,494,200		
三菱製鋼	4,800	1,312.00	6,297,600		
日亜鋼業	6,000	314.00	1,884,000	貸付株式数	700株
日本精線	1,000	4,640.00	4,640,000	貸付株式数	100株
エンビプロHD	4,200	568.00	2,385,600	貸付株式数	1,900株
大紀アルミニウム	10,900	1,354.00	14,758,600		
日本軽金属HD	20,700	1,429.00	29,580,300		
三井金属	22,300	3,589.00	80,034,700		

東邦亜鉛	4,500	1,702.00	7,659,000	
三菱マテリアル	51,200	2,601.50	133,196,800	
住友鉱山	89,700	4,927.00	441,951,900	
DOWAホールディングス	17,200	4,589.00	78,930,800	貸付株式数 4,800株
古河機金	11,200	1,552.00	17,382,400	
エス・サイエンス	35,500	25.00	887,500	貸付株式数 15,200株
大阪チタニウム	11,300	3,010.00	34,013,000	貸付株式数 4,500株
東邦チタニウム	13,900	1,760.00	24,464,000	貸付株式数 5,500株
UACJ	10,700	2,727.00	29,178,900	
CKサンエツ	1,800	4,240.00	7,632,000	貸付株式数 100株
古河電工	25,900	2,502.50	64,814,750	貸付株式数 800株
住友電工	268,400	1,767.00	474,262,800	
フジクラ	83,300	1,178.00	98,127,400	
SWCC	8,700	1,871.00	16,277,700	
タツタ電線	15,600	715.00	11,154,000	貸付株式数 900株
カナレ電気	900	1,380.00	1,242,000	貸付株式数 300株
平河ヒューテック	4,400	1,473.00	6,481,200	貸付株式数 1,600株
いよぎんホールディング	87,700	746.80	65,494,360	貸付株式数 5,800株
しずおかフィナンシャル	167,100	1,014.00	169,439,400	
ちゅうぎんフィナンシャ	62,200	860.20	53,504,440	
楽天銀行	25,600	1,834.00	46,950,400	
リョービ	8,300	1,907.00	15,828,100	
アーレステイ	6,600	686.00	4,527,600	
アサヒHD	31,000	1,936.00	60,016,000	
東洋製罐グループHD	46,300	2,138.50	99,012,550	
ホッカンホールディングス	4,100	1,378.00	5,649,800	貸付株式数 1,400株
コロナ	4,400	892.00	3,924,800	
横河ブリッジHLDGS	9,800	2,422.00	23,735,600	
駒井ハルテック	1,000	1,851.00	1,851,000	
高田機工	500	2,755.00	1,377,500	
三和ホールディングス	71,600	1,836.50	131,493,400	
文化シヤッタ -	22,300	1,114.00	24,842,200	貸付株式数 8,900株
三協立山	8,900	675.00	6,007,500	
アルインコ	6,000	993.00	5,958,000	貸付株式数 1,600株
東洋シヤッタ -	1,400	621.00	869,400	貸付株式数 300株
LIXIL	113,200	1,888.50	213,778,200	
日本フィルコン	3,900	465.00	1,813,500	
ノーリツ	11,500	1,814.00	20,861,000	
長府製作所	8,000	2,484.00	19,872,000	
リンナイ	42,300	2,971.50	125,694,450	

ユニプレス	13,600	1,091.00	14,837,600	貸付株式数	1,500株
ダイニチ工業	3,000	726.00	2,178,000		
日東精工	11,400	593.00	6,760,200		
三洋工業	700	1,898.00	1,328,600	貸付株式数	200株
岡 部	12,300	789.00	9,704,700	貸付株式数	3,100株
ジーテクト	8,700	1,473.00	12,815,100		
東 プ レ	13,800	1,521.00	20,989,800		
高周波熱錬	12,100	981.00	11,870,100	貸付株式数	2,600株
東京製綱	4,600	1,112.00	5,115,200		
サンコール	5,300	519.00	2,750,700		
モリテックスチル	4,400	281.00	1,236,400	貸付株式数	2,300株
パイオラックス	10,600	2,101.00	22,270,600		
エイチワン	7,900	710.00	5,609,000		
日本発条	68,700	1,018.00	69,936,600		
中央発條	5,700	713.00	4,064,100		
アドバネクス	700	973.00	681,100	貸付株式数	400株
三浦工業	31,700	3,855.00	122,203,500		
タ ク マ	23,500	1,529.00	35,931,500		
テクノプロ・ホールディング グ	45,800	3,380.00	154,804,000		
アトラグループ	1,400	178.00	249,200	貸付株式数	600株
インターワークス	1,500	333.00	499,500	貸付株式数	800株
アイ・アールジャパンHD	4,000	1,611.00	6,444,000	貸付株式数	1,500株
K e e P e r 技研	4,800	5,080.00	24,384,000	貸付株式数	1,800株
ファーストロジック	700	961.00	672,700	貸付株式数	200株
三機サービス	900	1,073.00	965,700	貸付株式数	500株
G u n o s y	6,200	610.00	3,782,000	貸付株式数	2,400株
デザインワン・ジャパン	1,500	175.00	262,500	貸付株式数	200株
イー・ガーディアン	3,000	2,010.00	6,030,000		
リブセンス	2,800	259.00	725,200	貸付株式数	1,300株
ジャパンマテリアル	23,600	2,398.00	56,592,800		
ベクトル	12,200	1,345.00	16,409,000		
ウチヤマホールディングス	2,500	315.00	787,500	貸付株式数	200株
チャームケアコーポレー ション	6,500	1,295.00	8,417,500	貸付株式数	2,500株
キャリアリンク	2,800	2,923.00	8,184,400	貸付株式数	1,100株
I B J	4,700	650.00	3,055,000	貸付株式数	2,000株
アサンテ	3,800	1,659.00	6,304,200	貸付株式数	400株
バリューHR	6,700	1,402.00	9,393,400	貸付株式数	2,600株

M & Aキャピタルパートナー	6,300	3,350.00	21,105,000	
ライドオンエクスプレスHD	2,700	1,028.00	2,775,600	貸付株式数 900株
E R Iホールディングス	1,500	1,338.00	2,007,000	
アピスト	900	3,110.00	2,799,000	貸付株式数 400株
シグマクシス・ホールディング	11,700	1,243.00	14,543,100	
ウィルグループ	6,500	1,097.00	7,130,500	
エスクローAJ	7,600	143.00	1,086,800	貸付株式数 2,900株
メドピア	6,900	993.00	6,851,700	貸付株式数 2,600株
レアジョブ	1,100	961.00	1,057,100	貸付株式数 500株
リクルートホールディングス	573,100	4,885.00	2,799,593,500	
エラン	10,200	820.00	8,364,000	
ツガミ	17,000	1,395.00	23,715,000	
オークマ	7,700	7,484.00	57,626,800	
芝浦機械	7,600	4,930.00	37,468,000	
アマダ	121,600	1,410.50	171,516,800	
アイダエンジニア	15,400	925.00	14,245,000	
TAKISAWA	1,500	1,217.00	1,825,500	貸付株式数 600株
FUJI	33,200	2,573.50	85,440,200	貸付株式数 1,600株
牧野フライス	8,400	5,550.00	46,620,000	貸付株式数 400株
オーエスジー	36,400	2,016.50	73,400,600	
ダイジェット	600	866.00	519,600	貸付株式数 200株
旭ダイヤモンド	21,200	822.00	17,426,400	
DMG森精機	46,100	2,574.00	118,661,400	貸付株式数 17,700株
ソディック	21,200	709.00	15,030,800	
ディスコ	36,600	22,660.00	829,356,000	
日東工器	3,600	1,972.00	7,099,200	
日進工具	6,300	1,162.00	7,320,600	
パンチ工業	5,300	554.00	2,936,200	貸付株式数 2,000株
富士ダイス	2,700	684.00	1,846,800	貸付株式数 1,200株
土木管理総合試験	2,500	335.00	837,500	貸付株式数 100株
日本郵政	931,000	1,013.00	943,103,000	
ベルシステム24HLDGS	10,400	1,393.00	14,487,200	
鎌倉新書	8,800	723.00	6,362,400	貸付株式数 3,400株 (1,300株)
SMN	1,400	455.00	637,000	



一蔵	800	561.00	448,800	貸付株式数	400株
グローバルキッズCOMP	1,100	679.00	746,900		
エアトリ	5,600	2,722.00	15,243,200	貸付株式数	2,200株
アトラエ	4,700	743.00	3,492,100		
ストライク	3,300	3,330.00	10,989,000		
ソラスト	21,700	683.00	14,821,100		
セラク	2,300	1,497.00	3,443,100		
インソース	16,800	1,261.00	21,184,800		
豊田自動織機	55,000	9,837.00	541,035,000		
豊和工業	3,200	794.00	2,540,800	貸付株式数	1,200株
石川製作所	1,500	1,360.00	2,040,000	貸付株式数	700株
東洋機械金属	4,000	655.00	2,620,000		
津田駒工業	1,100	434.00	477,400	貸付株式数	500株
エンシュウ	1,200	701.00	841,200	貸付株式数	600株
島精機製作所	12,100	1,902.00	23,014,200		
オプトラン	11,200	2,445.00	27,384,000		
NCホールディングス	1,200	2,135.00	2,562,000		
イワキポンプ	5,000	1,434.00	7,170,000		
フリーー	8,000	1,047.00	8,376,000	貸付株式数	2,600株
ヤマシンフィルタ	18,200	312.00	5,678,400		
日阪製作所	7,300	878.00	6,409,400		
やまびこ	12,500	1,562.00	19,525,000		
野村マイクロ・サイエンス	2,600	6,560.00	17,056,000		
平田機工	3,600	8,290.00	29,844,000		
PEGASUS	8,400	564.00	4,737,600	貸付株式数	100株
マルマエ	3,400	1,766.00	6,004,400	貸付株式数	1,400株 (900株)
タツモ	4,100	2,610.00	10,701,000		
ナプテスコ	47,800	3,382.00	161,659,600		
三井海洋開発	9,500	1,418.00	13,471,000		
レオン自動機	8,000	1,455.00	11,640,000		
SMC	24,700	81,950.00	2,024,165,000		
ホソカワミクロン	5,400	2,945.00	15,903,000		
ユニオンツール	3,400	3,405.00	11,577,000		
オイレス工業	10,500	1,977.00	20,758,500	貸付株式数	4,000株
日精エーエスピー	3,000	4,070.00	12,210,000		
サト - ホールディングス	10,900	1,934.00	21,080,600		
技研製作所	7,200	2,026.00	14,587,200	貸付株式数	1,300株
日本エアータック	3,800	1,156.00	4,392,800	貸付株式数	1,200株
カワタ	1,700	1,250.00	2,125,000		

日精樹脂工業	5,600	988.00	5,532,800	貸付株式数	200株
オカダアイヨン	1,800	2,251.00	4,051,800	貸付株式数	800株
ワイエイシイホールディングス	2,500	3,205.00	8,012,500	貸付株式数	1,100株
小松製作所	356,300	3,865.00	1,377,099,500		
住友重機械	45,100	3,501.00	157,895,100		
日立建機	30,300	4,027.00	122,018,100		
日 工	11,100	642.00	7,126,200		
巴工業	3,200	2,837.00	9,078,400	貸付株式数	1,200株
井関農機	7,300	1,296.00	9,460,800		
TOWA	7,800	2,536.00	19,780,800		
丸山製作所	1,000	1,818.00	1,818,000		
北川鉄工所	3,000	1,184.00	3,552,000		
シンニッタン	6,400	247.00	1,580,800	貸付株式数	1,900株
ローツェ	4,000	11,920.00	47,680,000	貸付株式数	1,500株
タカキタ	1,600	441.00	705,600	貸付株式数	800株
クボタ	402,600	2,204.00	887,330,400		
荏原実業	3,600	3,195.00	11,502,000		
東洋エンジニア	9,700	616.00	5,975,200		
三菱化工機	2,500	2,744.00	6,860,000		
月島ホールディングス	10,400	1,207.00	12,552,800		
帝国電機製作所	5,300	2,489.00	13,191,700		
東京機械	1,400	484.00	677,600		
新東工業	15,200	1,056.00	16,051,200		
渋谷工業	7,200	2,729.00	19,648,800		
アイチ コーポレーション	10,500	845.00	8,872,500		
小森コーポレーション	17,600	950.00	16,720,000		
鶴見製作所	5,800	2,592.00	15,033,600		
日本ギア工業	1,900	371.00	704,900	貸付株式数	800株
酒井重工業	900	4,970.00	4,473,000		
荏原製作所	31,100	7,254.00	225,599,400		
石井鉄工所	700	2,470.00	1,729,000	貸付株式数	200株
西島製作所	6,500	1,714.00	11,141,000		
北越工業	7,600	1,343.00	10,206,800		
ダイキン工業	90,800	29,575.00	2,685,410,000		
オルガノ	10,400	4,040.00	42,016,000		
ト - ヨ - カネツ	2,900	3,485.00	10,106,500		
栗田工業	42,500	5,825.00	247,562,500		
椿本チエイン	10,800	3,695.00	39,906,000		
大同工業	2,400	728.00	1,747,200	貸付株式数	900株

日 機 装	17,500	909.00	15,907,500	
木村化工機	5,900	738.00	4,354,200	貸付株式数 2,200株
レイズネクスト	10,600	1,393.00	14,765,800	
アネスト岩田	13,000	1,132.00	14,716,000	貸付株式数 100株
ダイフク	117,700	3,052.00	359,220,400	
サムコ	2,000	6,440.00	12,880,000	貸付株式数 900株
加藤製作所	2,700	1,279.00	3,453,300	貸付株式数 1,000株
油研工業	900	2,010.00	1,809,000	
タダノ	40,200	1,135.00	45,627,000	貸付株式数 2,000株
フジテック	26,600	3,680.00	97,888,000	貸付株式数 10,200株
C K D	21,100	2,386.00	50,344,600	
平和	25,200	2,381.00	60,001,200	
理想科学工業	6,800	2,304.00	15,667,200	
S A N K Y O	14,900	5,819.00	86,703,100	
日本金銭機械	8,300	1,082.00	8,980,600	貸付株式数 3,200株
マースグループH L D G S	4,400	2,592.00	11,404,800	
フクシマガリレイ	5,600	5,660.00	31,696,000	
オーイズミ	2,200	485.00	1,067,000	貸付株式数 1,000株
ダイコク電機	4,100	2,937.00	12,041,700	貸付株式数 1,600株
竹内製作所	13,800	4,450.00	61,410,000	
ア マ ノ	21,600	2,991.00	64,605,600	
J U K I	11,800	589.00	6,950,200	
サンデン	8,700	198.00	1,722,600	貸付株式数 4,200株
ジャノメ	7,800	604.00	4,711,200	
ブラザー工業	101,700	2,200.00	223,740,000	
マックス	9,400	2,499.00	23,490,600	
モリタホールディングス	13,200	1,543.00	20,367,600	
グローリー	18,300	2,839.50	51,962,850	
新晃工業	7,600	2,106.00	16,005,600	
大和冷機工業	11,600	1,395.00	16,182,000	貸付株式数 3,200株
セガサミーホールディングス	61,100	2,926.00	178,778,600	
日本ピストンリング	2,000	1,453.00	2,906,000	
リ ケ ン	3,000	2,859.00	8,577,000	
T P R	8,900	1,541.00	13,714,900	
ツバキ・ナカシマ	18,500	888.00	16,428,000	
ホシザキ	48,900	5,256.00	257,018,400	
大豊工業	6,500	853.00	5,544,500	
日本精工	139,700	897.80	125,422,660	
N T N	150,400	297.80	44,789,120	貸付株式数 42,500株

ジェイテクト	67,800	1,304.00	88,411,200	
不二越	5,600	4,045.00	22,652,000	
ミネベアミツミ	132,400	2,805.50	371,448,200	
日本トムソン	18,700	584.00	10,920,800	
T H K	43,900	3,113.00	136,660,700	
ユーシン精機	5,900	706.00	4,165,400	
前澤給装工業	5,300	1,121.00	5,941,300	貸付株式数 1,000株
イーグル工業	8,300	1,696.00	14,076,800	
前澤工業	3,300	754.00	2,488,200	
日本ピラ - 工業	7,100	4,625.00	32,837,500	
キッツ	27,900	1,105.00	30,829,500	
日立	369,800	8,908.00	3,294,178,400	
東芝	146,300	4,521.00	661,422,300	
三菱電機	785,900	2,043.50	1,605,986,650	
富士電機	46,300	6,391.00	295,903,300	
東洋電機製造	1,900	950.00	1,805,000	
安川電機	90,100	6,732.00	606,553,200	
シンフォニアテクノロジー	8,300	1,702.00	14,126,600	
明電舎	11,700	1,940.00	22,698,000	
オリジン	1,300	1,243.00	1,615,900	
山洋電気	3,300	7,710.00	25,443,000	
デンヨー	5,900	2,008.00	11,847,200	
PHCホールディングス	10,600	1,470.00	15,582,000	
ソシオネクスト	10,400	25,410.00	264,264,000	貸付株式数 4,100株
ベイカレントコンサルティング	61,300	5,516.00	338,130,800	
ORCHESTRA HOLDINGS	1,600	1,290.00	2,064,000	
アイモバイル	3,400	1,157.00	3,933,800	貸付株式数 1,500株
キャリアインデックス	2,300	294.00	676,200	貸付株式数 200株
MS - Japan	1,900	1,021.00	1,939,900	貸付株式数 900株
船場	1,000	736.00	736,000	貸付株式数 200株
ジャパンエレベーターSHD	27,600	1,872.00	51,667,200	
フルテック	800	1,096.00	876,800	
グリーンズ	2,000	1,178.00	2,356,000	
ツナググループHLDGS	1,700	605.00	1,028,500	
GAMEWITH	1,900	384.00	729,600	貸付株式数 800株

MS&CONSULTING	700	609.00	426,300	貸付株式数	300株
ウェルビー	5,700	468.00	2,667,600	貸付株式数	2,200株
エル・ティー・エス	1,000	3,240.00	3,240,000	貸付株式数	300株
ミダックホールディングス	4,700	1,582.00	7,435,400	貸付株式数	1,800株
日総工産	6,000	913.00	5,478,000	貸付株式数	900株
キュービーネットHLDGS	3,700	1,408.00	5,209,600		
RPAホールディングス	10,300	417.00	4,295,100		
三桜工業	11,600	857.00	9,941,200		
マキタ	94,600	3,996.00	378,021,600		
東芝テック	11,300	4,240.00	47,912,000		
芝浦メカトロニクス	1,500	21,110.00	31,665,000	貸付株式数	200株
マブチモーター	18,800	3,956.00	74,372,800		
ニデック	185,100	7,753.00	1,435,080,300		
ユーエムシーエレクトロニクス	5,500	614.00	3,377,000		
トレックス・セミコンダクター	3,600	2,289.00	8,240,400	貸付株式数	1,400株
東光高岳	4,500	2,126.00	9,567,000		
ダブル・スコープ	24,900	1,258.00	31,324,200	貸付株式数	9,800株
宮越ホールディングス	3,300	857.00	2,828,100	貸付株式数	1,100株
ダイヘン	6,800	5,680.00	38,624,000		
ヤーマン	13,100	1,047.00	13,715,700	貸付株式数	5,200株
JVCケンウッド	69,200	514.00	35,568,800		
ミマキエンジニアリング	7,200	803.00	5,781,600		
I-PEX	4,300	1,421.00	6,110,300	貸付株式数	1,300株
大崎電気	18,000	559.00	10,062,000		
オムロン	69,700	9,218.00	642,494,600		
日東工業	10,200	3,465.00	35,343,000		
IDEC	11,200	3,245.00	36,344,000		
正興電機製作所	2,200	1,012.00	2,226,400	貸付株式数	300株
不二電機工業	1,200	1,156.00	1,387,200	貸付株式数	600株 (100株)
ジーエス・ユアサコーポ	25,000	2,840.50	71,012,500		
サクサホールディングス	1,200	1,806.00	2,167,200		
メルコホールディングス	1,900	3,195.00	6,070,500		
テクノメディカ	1,800	1,900.00	3,420,000	貸付株式数	500株
ダイヤモンドエレクトリックHD	2,500	768.00	1,920,000	貸付株式数	1,000株

日本電気	107,600	7,029.00	756,320,400	
富士通	75,800	19,085.00	1,446,643,000	
沖電気	34,400	888.00	30,547,200	
岩崎通信機	2,500	826.00	2,065,000	貸付株式数 200株
電気興業	3,100	2,278.00	7,061,800	
サンケン電気	7,100	12,830.00	91,093,000	
ナカヨ	900	1,156.00	1,040,400	貸付株式数 400株
アイホン	4,600	2,367.00	10,888,200	
ルネサスエレクトロニクス	496,100	2,672.50	1,325,827,250	貸付株式数 195,900株
セイコーエプソン	97,700	2,207.00	215,623,900	貸付株式数 38,500株
ワコム	57,900	616.00	35,666,400	貸付株式数 22,600株
アルバック	18,000	5,964.00	107,352,000	貸付株式数 7,100株
アクセル	2,200	1,585.00	3,487,000	貸付株式数 800株
E I Z O	5,500	4,760.00	26,180,000	
ジャパンディスプレイ	61,700	39.00	2,406,300	
日本信号	17,100	1,074.00	18,365,400	
京三製作所	15,700	448.00	7,033,600	
能美防災	10,200	1,842.00	18,788,400	
ホーチキ	5,600	1,750.00	9,800,000	
星和電機	2,300	481.00	1,106,300	貸付株式数 1,000株
エレコム	18,200	1,542.00	28,064,400	
パナソニック ホールディング	898,200	1,678.50	1,507,628,700	
シャープ	91,300	785.00	71,670,500	貸付株式数 36,100株
アンリツ	53,700	1,220.00	65,514,000	
富士通ゼネラル	21,500	3,249.00	69,853,500	
ソニーグループ	532,600	13,950.00	7,429,770,000	
T D K	120,500	5,693.00	686,006,500	
帝国通信工業	3,600	1,624.00	5,846,400	
タムラ製作所	32,600	688.00	22,428,800	貸付株式数 1,500株
アルプスアルパイン	68,000	1,273.50	86,598,000	
池上通信機	1,800	629.00	1,132,200	貸付株式数 700株
日本電波工業	9,100	1,299.00	11,820,900	貸付株式数 3,600株
鈴木	4,000	990.00	3,960,000	
メイコー	8,400	2,734.00	22,965,600	
日本トリム	1,700	2,898.00	4,926,600	
ローランド ディー . ジー .	4,100	3,435.00	14,083,500	
フオスタ - 電機	6,900	922.00	6,361,800	
S M K	1,800	2,321.00	4,177,800	

ヨコオ	6,100	1,742.00	10,626,200	
ティアック	10,300	120.00	1,236,000	
ホシデン	17,700	1,808.00	32,001,600	
ヒロセ電機	12,600	19,680.00	247,968,000	
日本航空電子	15,600	2,825.00	44,070,000	貸付株式数 6,100株
T O A	8,600	878.00	7,550,800	
マクセル	15,200	1,572.00	23,894,400	
古野電気	9,800	1,067.00	10,456,600	
スミダコーポレーション	6,900	1,320.00	9,108,000	
アイコム	2,900	2,980.00	8,642,000	貸付株式数 1,000株
リオン	3,200	1,842.00	5,894,400	
横河電機	83,200	2,745.50	228,425,600	
新電元工業	2,900	3,355.00	9,729,500	
アズビル	52,600	4,637.00	243,906,200	
東亜ディーケーケー	2,700	830.00	2,241,000	貸付株式数 1,100株
日本光電工業	34,700	3,937.00	136,613,900	
チノール	3,100	2,299.00	7,126,900	貸付株式数 1,100株
共和電業	5,400	352.00	1,900,800	
日本電子材料	5,100	1,708.00	8,710,800	
堀場製作所	16,800	8,256.00	138,700,800	
アドバンテスト	59,300	19,550.00	1,159,315,000	
小野測器	2,100	444.00	932,400	
エスベック	6,100	2,345.00	14,304,500	
キーエンス	75,300	70,970.00	5,344,041,000	
日置電機	3,900	9,110.00	35,529,000	
シスメックス	64,900	9,881.00	641,276,900	
日本マイクロニクス	12,400	1,865.00	23,126,000	
メガチップス	6,200	3,845.00	23,839,000	
OBARA GROUP	4,100	4,145.00	16,994,500	貸付株式数 1,600株
IMAGICA GROUP	6,400	602.00	3,852,800	貸付株式数 2,400株
澤藤電機	700	1,287.00	900,900	貸付株式数 300株
デンソー	155,300	9,660.00	1,500,198,000	
原田工業	2,500	805.00	2,012,500	貸付株式数 700株
コーセル	8,900	1,244.00	11,071,600	
イリソ電子工業	6,900	4,255.00	29,359,500	貸付株式数 2,700株
オプテックスグループ	13,800	2,052.00	28,317,600	
千代田インテグレ	2,600	2,400.00	6,240,000	
レーザーテック	34,500	21,925.00	756,412,500	
スタンレー電気	53,600	3,024.00	162,086,400	

ウシオ電機	38,100	1,898.50	72,332,850	
岡谷電機	4,500	270.00	1,215,000	貸付株式数 1,900株
ヘリオステクノH	5,300	610.00	3,233,000	貸付株式数 2,300株
エノモト	1,500	1,681.00	2,521,500	貸付株式数 600株
日本セラミック	7,700	2,607.00	20,073,900	
遠藤照明	2,600	1,183.00	3,075,800	
古河電池	5,500	1,060.00	5,830,000	
双信電機	2,300	357.00	821,100	貸付株式数 900株
山一電機	6,600	2,283.00	15,067,800	
函 研	6,600	3,625.00	23,925,000	
日本電子	18,900	5,309.00	100,340,100	
カ シ オ	56,300	1,208.00	68,010,400	貸付株式数 22,100株
ファナック	369,600	5,207.00	1,924,507,200	
日本シイエムケイ	16,100	527.00	8,484,700	
エンプラス	2,200	5,940.00	13,068,000	
大真空	9,300	648.00	6,026,400	貸付株式数 3,500株
ロ ー ム	34,800	13,450.00	468,060,000	
浜松ホトニクス	60,400	7,203.00	435,061,200	
三井ハイテック	7,800	9,320.00	72,696,000	貸付株式数 3,000株
新光電気工業	26,700	5,716.00	152,617,200	
京 セ ラ	117,000	7,972.00	932,724,000	
協栄産業	600	2,146.00	1,287,600	貸付株式数 200株
太陽誘電	36,700	4,301.00	157,846,700	
村田製作所	228,400	8,520.00	1,945,968,000	
双葉電子工業	14,300	503.00	7,192,900	
日東電工	54,800	10,840.00	594,032,000	
北陸電気工業	2,200	1,221.00	2,686,200	
東海理化電機	21,200	2,130.00	45,156,000	
ニチコン	15,400	1,461.00	22,499,400	
日本ケミコン	7,400	1,273.00	9,420,200	
K O A	11,400	1,785.00	20,349,000	貸付株式数 3,800株
三井E & S	21,700	485.00	10,524,500	
日立造船	62,400	918.00	57,283,200	貸付株式数 3,500株
三菱重工業	133,000	6,861.00	912,513,000	
川崎重工業	56,700	3,553.00	201,455,100	
I H I	47,900	3,926.00	188,055,400	
名村造船所	14,900	587.00	8,746,300	貸付株式数 7,200株
サノヤホールディングス	7,700	131.00	1,008,700	貸付株式数 3,600株
スプリックス	1,900	779.00	1,480,100	貸付株式数 100株 (100株)



マネジメントソリューションズ	4,300	3,740.00	16,082,000	貸付株式数	1,600株
プロレド・パートナーズ	2,000	526.00	1,052,000	貸付株式数	600株
AND FACTORY	1,700	396.00	673,200	貸付株式数	600株
テノ・ホールディングス	700	678.00	474,600	貸付株式数	300株
フロンティア・マネジメント	2,600	1,203.00	3,127,800		
ピアラ	1,000	503.00	503,000	貸付株式数	400株
コプロ・ホールディングス	1,000	2,225.00	2,225,000	貸付株式数	100株
ギークス	800	763.00	610,400	貸付株式数	500株
アンビスホールディングス	8,200	3,080.00	25,256,000		
カープスホールディングス	21,100	724.00	15,276,400	貸付株式数	6,100株
フォーラムエンジニアリング	4,500	1,168.00	5,256,000		
FAST FITNESS JAP	2,600	1,233.00	3,205,800		
日本車輛	2,900	2,058.00	5,968,200	貸付株式数	300株
三菱ロジスネクスト	11,900	1,239.00	14,744,100		
近畿車輛	800	1,462.00	1,169,600	貸付株式数	300株
一家ホールディングス	1,400	625.00	875,000	貸付株式数	600株
フルサト・マルカHD	7,900	2,462.00	19,449,800	貸付株式数	1,500株
ヤマエグループHD	4,500	2,912.00	13,104,000		
ジャパクラフトホールディ	1,800	558.00	1,004,400	貸付株式数	900株
FPG	25,100	1,195.00	29,994,500		
島根銀行	2,500	480.00	1,200,000	貸付株式数	800株
じもとホールディングス	5,500	383.00	2,106,500	貸付株式数	1,600株
全国保証	19,400	5,145.00	99,813,000	貸付株式数	4,300株
めぶきフィナンシャルG	367,800	340.90	125,383,020		
ジャパンインベストメントA	6,000	1,116.00	6,696,000	貸付株式数	2,400株
東京きらぼしFG	9,500	3,130.00	29,735,000		
九州フィナンシャルG	130,200	546.10	71,102,220		
かんぼ生命保険	90,000	2,127.00	191,430,000		
ゆうちょ銀行	207,300	1,088.50	225,646,050	貸付株式数	1,700株
あんしん保証	2,800	307.00	859,600	貸付株式数	1,100株
富山第一銀行	24,500	680.00	16,660,000	貸付株式数	8,800株
コンコルディア・フィナンシャル	397,700	546.50	217,343,050		
ジェイリース	1,900	2,148.00	4,081,200		

西日本フィナンシャルHD	46,000	1,198.00	55,108,000	
イントラスト	2,200	940.00	2,068,000	
日本モーゲージサービス	3,400	568.00	1,931,200	貸付株式数 1,200株
C a s a	2,400	877.00	2,104,800	貸付株式数 700株
アルヒ	9,000	1,003.00	9,027,000	貸付株式数 3,600株
プレミアグループ	12,600	1,624.00	20,462,400	
日産自動車	1,069,800	542.70	580,580,460	
いすゞ自動車	219,000	1,809.00	396,171,000	
トヨタ自動車	4,134,200	2,320.50	9,593,411,100	
日野自動車	96,900	624.30	60,494,670	
三菱自動車工業	293,700	489.80	143,854,260	貸付株式数 110,600株
エフテック	4,100	958.00	3,927,800	
レシップホールディングス	2,300	503.00	1,156,900	貸付株式数 1,100株
G M B	1,100	2,130.00	2,343,000	貸付株式数 400株
ファルテック	900	615.00	553,500	貸付株式数 200株
武蔵精密工業	18,500	1,811.00	33,503,500	貸付株式数 2,400株
日産車体	13,100	871.00	11,410,100	貸付株式数 5,100株
新明和工業	23,300	1,340.00	31,222,000	
極東開発工業	12,400	1,749.00	21,687,600	
トピー工業	6,000	2,168.00	13,008,000	
ティラド	1,900	1,796.00	3,412,400	
タチエス	11,900	1,503.00	17,885,700	
N O K	29,200	2,054.50	59,991,400	貸付株式数 11,500株
フタバ産業	20,300	499.00	10,129,700	
K Y B	7,300	4,780.00	34,894,000	
市光工業	10,800	566.00	6,112,800	
大同メタル工業	14,800	494.00	7,311,200	
プレス工業	33,700	596.00	20,085,200	
ミクニ	6,600	413.00	2,725,800	
太平洋工業	17,500	1,309.00	22,907,500	
河西工業	7,700	152.00	1,170,400	貸付株式数 2,200株
アイシン	58,000	4,404.00	255,432,000	
マ ッ ダ	249,100	1,385.00	345,003,500	
今仙電機製作所	3,700	635.00	2,349,500	
本田技研	612,100	4,511.00	2,761,183,100	
スズキ	138,300	5,100.00	705,330,000	
S U B A R U	238,300	2,692.00	641,503,600	
安永	2,500	923.00	2,307,500	貸付株式数 1,200株
ヤマハ発動機	118,400	3,990.00	472,416,000	貸付株式数 35,400株

小糸製作所	90,600	2,848.00	258,028,800	貸付株式数	11,100株
T B K	6,300	361.00	2,274,300		
エクセディ	12,400	2,290.00	28,396,000		
ミツバ	13,900	803.00	11,161,700		
豊田合成	22,000	2,584.00	56,848,000		
愛三工業	12,300	1,126.00	13,849,800		
盟和産業	800	978.00	782,400	貸付株式数	300株
日本プラスト	4,600	438.00	2,014,800		
ヨロズ	7,300	896.00	6,540,800	貸付株式数	2,700株
エフ・シー・シー	13,400	1,823.00	24,428,200		
新家工業	1,300	2,254.00	2,930,200		
シマノ	30,800	23,235.00	715,638,000		
テイ・エス テック	34,400	1,932.50	66,478,000		
33FG	6,500	1,539.00	10,003,500		
第四北越フィナンシャルG	11,500	3,070.00	35,305,000		
ひろぎんHLDGS	96,600	790.90	76,400,940		
マーキュリアホールディングス	3,300	747.00	2,465,100	貸付株式数	1,300株
おきなわFG	7,100	2,099.00	14,902,900		
ダイレクトマーケティングミクス	9,300	885.00	8,230,500		
ポピンズ	1,100	1,564.00	1,720,400		
LITALICO	6,000	2,507.00	15,042,000		
十六FG	9,600	3,020.00	28,992,000		
北國FHD	8,300	4,215.00	34,984,500	貸付株式数	2,200株
ネットプロHD	24,500	367.00	8,991,500	貸付株式数	9,400株
プロクレアホールディングス	9,000	2,050.00	18,450,000		
あいちフィナンシャルグル	10,300	2,179.00	22,443,700		
ジャムコ	3,100	1,374.00	4,259,400	貸付株式数	1,600株
小野建	7,700	1,600.00	12,320,000		
はるやまHLDGS	2,600	476.00	1,237,600	貸付株式数	1,100株
南陽	1,200	2,182.00	2,618,400	貸付株式数	500株
ノジマ	26,000	1,390.00	36,140,000		
佐島電機	3,800	1,732.00	6,581,600		
カッパ・クリエイト	12,400	1,515.00	18,786,000	貸付株式数	4,900株
エコートレーディング	1,200	789.00	946,800		
伯東	4,500	5,170.00	23,265,000	貸付株式数	1,300株
コンドーテック	6,300	1,126.00	7,093,800	貸付株式数	2,200株
中山福	3,200	342.00	1,094,400		

ライトオン	4,600	568.00	2,612,800	貸付株式数	1,900株
ナガイレーベン	9,900	2,288.00	22,651,200	貸付株式数	200株
三菱食品	7,300	3,600.00	26,280,000		
良品計画	87,100	1,395.00	121,504,500		
パリミキホールディングス	7,800	327.00	2,550,600		
松田産業	6,100	2,210.00	13,481,000		
第一興商	30,800	2,569.00	79,125,200		
メディパルHD	76,200	2,358.50	179,717,700		
アドヴァングループ	7,500	951.00	7,132,500		
S P K	3,500	1,761.00	6,163,500		
萩原電気HLDGS	3,000	3,125.00	9,375,000		
アルビス	2,600	2,384.00	6,198,400		
アズワン	11,300	5,893.00	66,590,900		
スズデン	2,700	2,257.00	6,093,900		
尾家産業	1,400	1,236.00	1,730,400	貸付株式数	300株
シモジマ	5,500	1,125.00	6,187,500	貸付株式数	200株
ドウシシャ	8,300	2,257.00	18,733,100		
小津産業	1,400	1,595.00	2,233,000	貸付株式数	600株
コナカ	7,300	363.00	2,649,900		
高速	4,200	2,084.00	8,752,800		
ハウス ローゼ	800	1,601.00	1,280,800		
G-7ホールディングス	10,000	1,272.00	12,720,000		
たけびし	3,000	1,707.00	5,121,000		
イオン北海道	11,800	857.00	10,112,600	貸付株式数	4,600株
コジマ	13,200	568.00	7,497,600	貸付株式数	5,200株
ヒマラヤ	1,900	940.00	1,786,000	貸付株式数	900株
コーナン商事	10,800	3,505.00	37,854,000		
ネットワンシステムズ	28,100	3,405.00	95,680,500		
エコス	2,900	1,871.00	5,425,900	貸付株式数	1,000株
ワタミ	9,500	896.00	8,512,000	貸付株式数	2,500株
マルシェ	2,000	259.00	518,000	貸付株式数	800株
リックス	1,300	2,944.00	3,827,200		
システムソフト	27,000	76.00	2,052,000	貸付株式数	1,500株
パンパシフィックHD	160,900	2,518.00	405,146,200		
丸文	7,000	1,307.00	9,149,000		
西松屋チェーン	17,500	1,644.00	28,770,000	貸付株式数	5,600株
ゼンショーホールディングス	43,500	6,179.00	268,786,500		
ハピネット	6,700	2,101.00	14,076,700		
幸楽苑ホールディングス	5,100	1,000.00	5,100,000	貸付株式数	900株

ハークスレイ	2,100	615.00	1,291,500	
橋本総業HLDGS	3,100	1,215.00	3,766,500	貸付株式数 1,100株
日本ライフライン	23,500	1,079.00	25,356,500	
サイゼリヤ	11,700	3,610.00	42,237,000	貸付株式数 4,600株
タカショー	6,900	665.00	4,588,500	貸付株式数 2,600株
V Tホールディングス	30,200	521.00	15,734,200	
アルゴグラフィックス	6,900	4,050.00	27,945,000	
魚力	2,500	2,175.00	5,437,500	貸付株式数 800株
IDOM	24,000	885.00	21,240,000	
日本エム・ディ・エム	4,600	980.00	4,508,000	
ポプラ	1,700	187.00	317,900	貸付株式数 700株
フジ・コーポレーション	4,800	1,511.00	7,252,800	
ユナイテッドアローズ	8,500	2,411.00	20,493,500	貸付株式数 1,000株
進和	4,800	2,225.00	10,680,000	貸付株式数 1,500株
エスケイジャパン	1,500	547.00	820,500	
ダイトロン	3,100	3,090.00	9,579,000	
ハイデイ日高	11,800	2,353.00	27,765,400	貸付株式数 3,000株
シークス	11,400	1,578.00	17,989,200	貸付株式数 4,100株
YU-WA CREATI ON H	3,600	195.00	702,000	
コロワイド	36,700	1,991.00	73,069,700	貸付株式数 14,300株
ピーシーデポコーポ	8,700	479.00	4,167,300	
田中商事	1,700	634.00	1,077,800	貸付株式数 300株
オーハシテクニカ	3,800	1,592.00	6,049,600	
壱番屋	6,200	5,360.00	33,232,000	貸付株式数 1,600株
白銅	2,800	2,380.00	6,664,000	貸付株式数 1,100株
トップカルチャー	2,000	188.00	376,000	貸付株式数 800株
PLANT	1,400	694.00	971,600	
スギホールディングス	16,000	6,004.00	96,064,000	
ダイコー通産	600	1,117.00	670,200	貸付株式数 200株
薬王堂ホールディングス	4,500	2,578.00	11,601,000	
島津製作所	91,700	4,565.00	418,610,500	
J M S	7,000	566.00	3,962,000	
クボテック	1,300	224.00	291,200	貸付株式数 700株
長野計器	5,400	1,938.00	10,465,200	
ブイ・テクノロジー	3,600	2,502.00	9,007,200	
スター精密	14,400	1,834.00	26,409,600	
東京計器	5,700	1,299.00	7,404,300	貸付株式数 2,200株
愛知時計	2,900	1,646.00	4,773,400	

インターアクション	3,600	1,438.00	5,176,800	貸付株式数	1,400株
オーバル	5,100	411.00	2,096,100	貸付株式数	2,200株
東京精密	16,500	7,010.00	115,665,000		
マニー	30,200	1,640.50	49,543,100	貸付株式数	10,300株
ニコン	108,900	1,750.50	190,629,450		
トプコン	39,600	2,095.50	82,981,800		
オリンパス	463,500	2,250.00	1,042,875,000		
理研計器	4,700	5,410.00	25,427,000	貸付株式数	2,100株
S C R E E Nホールディングス	12,900	16,245.00	209,560,500		
キヤノン電子	8,200	1,921.00	15,752,200		
タムロン	5,600	3,755.00	21,028,000		
HOYA	160,800	17,945.00	2,885,556,000		
シード	2,900	549.00	1,592,100	貸付株式数	1,500株
ノーリツ鋼機	7,200	2,288.00	16,473,600		
A & Dホロンホールディングス	10,900	1,736.00	18,922,400		
朝日インテック	84,200	2,820.00	237,444,000		
キヤノン	413,100	3,610.00	1,491,291,000		
リコー	188,800	1,261.50	238,171,200		
シチズン時計	82,700	861.00	71,204,700	貸付株式数	32,600株
リズム	1,800	1,609.00	2,896,200		
大研医器	4,300	514.00	2,210,200	貸付株式数	600株
メニコン	25,900	2,517.50	65,203,250		
シンシア	500	556.00	278,000	貸付株式数	200株
KYORITSU	9,000	139.00	1,251,000		
中本パックス	1,800	1,622.00	2,919,600	貸付株式数	100株
スノーピーク	12,900	1,860.00	23,994,000	貸付株式数	5,000株 (100株)
パラマウントベッドHD	17,400	2,452.00	42,664,800		
トランザクション	4,900	1,709.00	8,374,100	貸付株式数	400株
粧美堂	1,600	381.00	609,600	貸付株式数	600株
ニホンフラッシュ	7,000	978.00	6,846,000		
前田工織	6,300	3,120.00	19,656,000	貸付株式数	2,400株
永大産業	6,100	209.00	1,274,900	貸付株式数	1,200株
アートネイチャー	7,700	766.00	5,898,200		
バンダイナムコHLDGS	206,300	3,493.00	720,605,900		
アイフィスジャパン	1,600	620.00	992,000	貸付株式数	400株
SHOEI	17,000	2,605.00	44,285,000		
フランスベッドHLDGS	9,700	1,121.00	10,873,700	貸付株式数	3,400株

マーベラス	12,100	667.00	8,070,700	
パイロットコーポレーション	11,800	4,488.00	52,958,400	
萩原工業	5,100	1,425.00	7,267,500	貸付株式数 1,600株
エイベックス	12,700	1,507.00	19,138,900	貸付株式数 4,500株
フジシールインターナショナル	15,300	1,531.00	23,424,300	
タカラトミー	34,600	1,767.00	61,138,200	
広済堂ホールディングス	3,900	2,126.00	8,291,400	貸付株式数 1,400株
エステールホールディングス	1,300	614.00	798,200	貸付株式数 700株
レック	10,700	815.00	8,720,500	
タカノ	2,100	726.00	1,524,600	貸付株式数 1,000株
三光合成	9,400	572.00	5,376,800	
プロネクサス	6,400	978.00	6,259,200	
ホクシン	5,000	133.00	665,000	貸付株式数 2,000株
ウッドワン	1,900	1,147.00	2,179,300	貸付株式数 100株
大建工業	4,600	2,320.00	10,672,000	
きもと	8,800	192.00	1,689,600	
凸版印刷	98,500	3,095.00	304,857,500	
大日本印刷	82,200	4,048.00	332,745,600	
共同印刷	2,100	3,030.00	6,363,000	
N I S S H A	14,200	1,570.00	22,294,000	
光村印刷	500	1,194.00	597,000	貸付株式数 200株
藤森工業	6,000	3,415.00	20,490,000	
ヴィア・ホールディングス	9,500	83.00	788,500	貸付株式数 3,500株
TAKARA & COMPANY	4,900	2,282.00	11,181,800	
前澤化成工業	5,000	1,631.00	8,155,000	貸付株式数 1,900株
未来工業	2,700	2,643.00	7,136,100	
アシックス	69,500	4,344.00	301,908,000	
ツツミ	1,300	2,158.00	2,805,400	貸付株式数 600株
ウェーブロックHLDGS	1,700	573.00	974,100	貸付株式数 1,200株
ジェイ エス ピー	5,400	1,812.00	9,784,800	貸付株式数 1,400株
ニチハ	9,500	3,150.00	29,925,000	
ローランド	5,500	4,300.00	23,650,000	
エフピコ	14,200	2,940.00	41,748,000	
小松ウォール工業	2,700	2,579.00	6,963,300	
ヤマハ	47,500	5,834.00	277,115,000	
河合楽器	2,000	3,250.00	6,500,000	

クリナップ	8,900	693.00	6,167,700	
ビジョン	48,000	2,055.50	98,664,000	
天馬	6,500	2,724.00	17,706,000	
キングジム	6,600	916.00	6,045,600	貸付株式数 2,600株
象印マホービン	22,600	1,764.00	39,866,400	貸付株式数 6,700株
リンテック	15,100	2,250.50	33,982,550	
信越ポリマー	14,000	1,439.00	20,146,000	
東リ	13,200	314.00	4,144,800	貸付株式数 3,200株
イトーキ	15,400	952.00	14,660,800	
任天堂	475,400	6,225.00	2,959,365,000	
三菱鉛筆	10,600	1,719.00	18,221,400	
松風	3,400	2,251.00	7,653,400	貸付株式数 1,200株
タカラスタンダ-ド	13,800	1,784.00	24,619,200	
コクヨ	36,100	1,920.00	69,312,000	
ナカバヤシ	8,000	485.00	3,880,000	貸付株式数 600株
ニフコ	27,200	4,097.00	111,438,400	
立川ブラインド	3,500	1,283.00	4,490,500	
グローブライド	6,100	2,237.00	13,645,700	
オカムラ	22,500	1,970.00	44,325,000	
バルカー	6,300	3,890.00	24,507,000	
MUTOHホールディングス	800	1,715.00	1,372,000	
伊藤忠	490,900	5,613.00	2,755,421,700	
丸紅	621,600	2,403.00	1,493,704,800	
スクロール	11,800	916.00	10,808,800	貸付株式数 1,600株
高島	1,000	3,535.00	3,535,000	
ヨンドシーホールディングス	6,900	1,787.00	12,330,300	貸付株式数 2,500株
三陽商会	2,300	1,547.00	3,558,100	貸付株式数 500株
長瀬産業	36,400	2,417.50	87,997,000	
ナイガイ	1,900	281.00	533,900	貸付株式数 900株
蝶理	4,200	2,775.00	11,655,000	
豊田通商	69,800	7,238.00	505,212,400	
オンワ-ドホールディングス	49,300	377.00	18,586,100	
三共生興	11,400	563.00	6,418,200	
兼松	30,800	1,984.00	61,107,200	
美津濃	7,500	3,820.00	28,650,000	
ツカモトコーポレーション	900	1,349.00	1,214,100	貸付株式数 400株
ルックホールディングス	1,700	2,364.00	4,018,800	貸付株式数 800株



三井物産	565,400	5,446.00	3,079,168,400	
日本紙パルプ	4,200	5,050.00	21,210,000	
東京エレクトロン	159,400	20,300.00	3,235,820,000	
カメイ	8,500	1,426.00	12,121,000	
東都水産	300	6,470.00	1,941,000	
ＯＵＧホールディングス	900	2,441.00	2,196,900	
スターゼン	6,200	2,356.00	14,607,200	
セイコーグループ	11,700	2,578.00	30,162,600	
山 善	21,300	1,115.00	23,749,500	
椿本興業	1,300	3,970.00	5,161,000	貸付株式数 500株
住友商事	493,300	3,049.00	1,504,071,700	
B I P R O G Y	27,800	3,564.00	99,079,200	
内田洋行	3,200	5,700.00	18,240,000	
三菱商事	492,700	6,792.00	3,346,418,400	
第一実業	2,800	5,800.00	16,240,000	
キャノンマーケティングJ P N	18,400	3,614.00	66,497,600	
西華産業	3,100	2,018.00	6,255,800	
佐藤商事	5,500	1,440.00	7,920,000	
菱洋エレクトロ	6,800	3,535.00	24,038,000	貸付株式数 1,500株
東京産業	7,200	887.00	6,386,400	
ユアサ商事	7,200	4,470.00	32,184,000	
神鋼商事	2,000	5,680.00	11,360,000	
トルク	3,200	267.00	854,400	
阪和興業	14,300	4,635.00	66,280,500	
正栄食品	5,300	4,255.00	22,551,500	貸付株式数 2,000株
カナデン	5,200	1,303.00	6,775,600	貸付株式数 2,200株
R Y O D E N	6,300	2,101.00	13,236,300	貸付株式数 2,400株
ニプロ	62,700	1,027.50	64,424,250	貸付株式数 24,800株
岩谷産業	18,100	7,507.00	135,876,700	
ナイス	2,500	1,485.00	3,712,500	
ニチモウ	800	3,625.00	2,900,000	
極東貿易	4,700	1,680.00	7,896,000	貸付株式数 400株
アステナホールディングス	13,600	453.00	6,160,800	貸付株式数 5,100株
三愛オブリ	21,100	1,507.00	31,797,700	
稲畑産業	16,000	3,235.00	51,760,000	
G S I クレオス	4,600	1,909.00	8,781,400	貸付株式数 1,800株
明和産業	10,500	678.00	7,119,000	
クワザワホールディングス	1,900	453.00	860,700	貸付株式数 1,000株
ゴ - ルドウィン	13,400	13,520.00	181,168,000	

ユニ・チャーム	157,200	5,388.00	846,993,600	
デサント	13,000	4,150.00	53,950,000	
キング	2,500	598.00	1,495,000	貸付株式数 200株
ワキタ	14,500	1,308.00	18,966,000	
ヤマトインタ-ナショナル	4,600	277.00	1,274,200	貸付株式数 2,300株
東邦ホールディングス	19,800	2,572.00	50,925,600	貸付株式数 7,800株
サンゲツ	19,900	2,413.00	48,018,700	
ミツウロコグループ	10,200	1,366.00	13,933,200	
シナネンホールディングス	2,600	3,825.00	9,945,000	
伊藤忠エネクス	19,800	1,229.00	24,334,200	
サンリオ	22,500	5,836.00	131,310,000	
サンワテクノス	4,000	2,410.00	9,640,000	
リョーサン	8,400	4,050.00	34,020,000	
新光商事	10,600	1,230.00	13,038,000	
トーヨー	3,400	2,944.00	10,009,600	貸付株式数 1,300株
三信電気	3,200	2,147.00	6,870,400	
東陽テクニカ	8,100	1,422.00	11,518,200	
モスフードサービス	11,800	3,195.00	37,701,000	貸付株式数 1,300株
加賀電子	6,500	6,100.00	39,650,000	
三益半導体	6,100	3,130.00	19,093,000	
都築電気	3,900	1,864.00	7,269,600	
ソーダニツカ	4,500	796.00	3,582,000	
立花エレテック	5,800	2,917.00	16,918,600	貸付株式数 2,000株
木曽路	12,100	2,382.00	28,822,200	貸付株式数 4,700株
S R Sホールディングス	13,000	946.00	12,298,000	貸付株式数 5,200株
千趣会	14,500	418.00	6,061,000	貸付株式数 5,800株
タカキュー	4,200	74.00	310,800	貸付株式数 2,100株
リテールパートナーズ	11,700	1,680.00	19,656,000	貸付株式数 3,800株
ケーヨー	13,000	823.00	10,699,000	
上新電機	7,200	1,940.00	13,968,000	
日本瓦斯	42,700	1,979.50	84,524,650	
ロイヤルホールディングス	15,300	2,689.00	41,141,700	貸付株式数 6,000株
東天紅	500	770.00	385,000	貸付株式数 100株
いなげや	7,600	1,545.00	11,742,000	貸付株式数 2,900株
チヨダ	7,500	861.00	6,457,500	貸付株式数 1,300株
ライフコーポレーション	7,000	3,020.00	21,140,000	
リンガーハット	10,200	2,443.00	24,918,600	貸付株式数 4,000株 (200株)
MrMaxHD	11,100	621.00	6,893,100	貸付株式数 600株

テナライド	6,900	254.00	1,752,600	貸付株式数	3,100株
AOKIホールディングス	14,800	834.00	12,343,200		
オークワ	13,000	861.00	11,193,000	貸付株式数	500株
コメリ	12,100	2,959.00	35,803,900		
青山商事	17,000	1,261.00	21,437,000	貸付株式数	100株
しまむら	9,400	13,335.00	125,349,000		
はせがわ	2,900	337.00	977,300		
高島屋	60,000	1,885.00	113,100,000	貸付株式数	23,700株
松屋	13,500	1,171.00	15,808,500	貸付株式数	1,700株
エイチ・ツー・オーリテイ リング	38,700	1,468.00	56,811,600	貸付株式数	5,100株
近鉄百貨店	3,400	2,541.00	8,639,400	貸付株式数	900株
丸井グループ	58,700	2,443.50	143,433,450		
クレディセゾン	47,100	2,087.00	98,297,700		
アクシアルリテイリング	5,400	3,555.00	19,197,000	貸付株式数	1,700株
井筒屋	2,900	359.00	1,041,100	貸付株式数	1,300株
イオン	270,000	2,796.00	754,920,000		
イズミ	12,100	3,399.00	41,127,900	貸付株式数	1,300株
フオーバル	3,100	1,061.00	3,289,100	貸付株式数	800株
平和堂	13,300	2,121.00	28,209,300	貸付株式数	5,200株
フジ	12,200	1,824.00	22,252,800	貸付株式数	3,300株
ヤオコー	9,000	7,159.00	64,431,000	貸付株式数	1,200株
ゼビオホールディングス	10,900	1,115.00	12,153,500		
ケーズホールディングス	56,400	1,241.00	69,992,400		
PALTAC	12,500	5,185.00	64,812,500		
三谷産業	13,700	316.00	4,329,200		
OLYMPICグループ	2,300	543.00	1,248,900	貸付株式数	900株
日産東京販売HD	7,800	346.00	2,698,800		
SBI新生銀行	17,100	2,815.00	48,136,500		
あおぞら銀行	46,800	2,630.50	123,107,400	貸付株式数	18,400株
三菱UFJフィナンシャル G	4,644,100	989.90	4,597,194,590		
りそなホールディングス	937,500	663.00	621,562,500		
三井住友トラストHD	134,700	5,045.00	679,561,500		
三井住友フィナンシャルG	541,800	5,865.00	3,177,657,000		
千葉銀行	206,600	863.10	178,316,460		
群馬銀行	143,400	514.00	73,707,600		
武蔵野銀行	9,600	2,106.00	20,217,600		
千葉興業銀行	13,400	552.00	7,396,800		

筑波銀行	33,300	199.00	6,626,700	
七十七銀行	23,600	2,401.00	56,663,600	
秋田銀行	4,900	1,662.00	8,143,800	
山形銀行	8,200	1,070.00	8,774,000	
岩手銀行	5,200	2,016.00	10,483,200	
東邦銀行	57,900	227.00	13,143,300	
東北銀行	2,900	1,000.00	2,900,000	
ふくおかフィナンシャルG	59,200	2,742.50	162,356,000	
スルガ銀行	63,000	507.00	31,941,000	
八十二銀行	159,100	616.30	98,053,330	貸付株式数 35,500株
山梨中央銀行	7,600	1,151.00	8,747,600	
大垣共立銀行	14,200	1,817.00	25,801,400	
福井銀行	6,700	1,421.00	9,520,700	
清水銀行	3,000	1,420.00	4,260,000	
富山銀行	900	1,631.00	1,467,900	
滋賀銀行	12,200	2,704.00	32,988,800	
南都銀行	11,100	2,369.00	26,295,900	
百五銀行	69,100	407.00	28,123,700	
京都銀行	23,500	7,140.00	167,790,000	
紀陽銀行	26,500	1,457.00	38,610,500	貸付株式数 6,000株
ほくほくフィナンシャルG	46,900	1,150.00	53,935,000	
山陰合同銀行	46,400	797.00	36,980,800	
鳥取銀行	1,900	1,133.00	2,152,700	
百十四銀行	6,800	1,754.00	11,927,200	
四国銀行	11,900	840.00	9,996,000	
阿波銀行	10,500	1,959.00	20,569,500	
大分銀行	4,400	2,096.00	9,222,400	
宮崎銀行	4,900	2,274.00	11,142,600	
佐賀銀行	4,300	1,609.00	6,918,700	
琉球銀行	17,300	901.00	15,587,300	
セブン銀行	265,000	287.10	76,081,500	
みずほフィナンシャルG	1,072,300	2,129.50	2,283,462,850	
高知銀行	2,000	670.00	1,340,000	貸付株式数 200株
山口フィナンシャルG	81,300	907.00	73,739,100	
芙蓉総合リース	6,800	10,830.00	73,644,000	
みずほリース	11,000	4,520.00	49,720,000	
東京センチュリー	13,800	5,353.00	73,871,400	
SBIホールディングス	107,500	2,835.00	304,762,500	
日本証券金融	27,200	1,179.00	32,068,800	
アイフル	122,900	343.00	42,154,700	

日本アジア投資	4,500	228.00	1,026,000	
名古屋銀行	4,900	3,270.00	16,023,000	
北洋銀行	111,900	270.00	30,213,000	
大光銀行	1,900	1,052.00	1,998,800	貸付株式数 600株
愛媛銀行	10,000	796.00	7,960,000	
トマト銀行	1,900	1,010.00	1,919,000	貸付株式数 500株
京葉銀行	34,300	532.00	18,247,600	
栃木銀行	34,100	246.00	8,388,600	
北日本銀行	2,600	1,971.00	5,124,600	貸付株式数 300株
東和銀行	14,300	525.00	7,507,500	
福島銀行	6,700	208.00	1,393,600	
大東銀行	2,300	622.00	1,430,600	貸付株式数 500株
リコーリース	7,000	4,045.00	28,315,000	
イオンフィナンシャルサー ビス	42,800	1,279.00	54,741,200	
アコム	131,600	336.70	44,309,720	
ジャックス	7,900	4,805.00	37,959,500	
オリコ	19,300	1,110.00	21,423,000	
オリックス	487,000	2,529.50	1,231,866,500	
三菱HCキャピタル	289,300	801.90	231,989,670	
ジャフコグループ	24,900	1,843.50	45,903,150	
九州リースサービス	2,700	876.00	2,365,200	貸付株式数 1,200株
トモニホールディングス	60,200	359.00	21,611,800	
大和証券G本社	530,500	729.80	387,158,900	
野村ホールディングス	1,365,200	550.20	751,133,040	
岡三証券グループ	64,300	483.00	31,056,900	貸付株式数 20,900株
丸三証券	25,500	451.00	11,500,500	貸付株式数 1,600株
東洋証券	24,300	309.00	7,508,700	
東海東京HD	80,600	388.00	31,272,800	
光世証券	1,300	465.00	604,500	貸付株式数 200株
水戸証券	19,600	317.00	6,213,200	
いちよし証券	14,000	609.00	8,526,000	
松井証券	44,100	815.00	35,941,500	
SOMPOホールディング ス	127,300	6,487.00	825,795,100	
日本取引所グループ	208,500	2,561.50	534,072,750	
マネックスG	80,000	527.00	42,160,000	
極東証券	9,200	655.00	6,026,000	
岩井コスモホールディング	8,300	1,465.00	12,159,500	

アイザワ証券グループ	10,600	828.00	8,776,800	
フィデアホール	7,800	1,308.00	10,202,400	
池田泉州HD	96,300	236.00	22,726,800	
アニコムホールディングス	25,300	599.00	15,154,700	
MS&AD	150,900	5,223.00	788,150,700	
マネーパートナーズGP	5,900	264.00	1,557,600	
スパークス・グループ	8,300	1,589.00	13,188,700	
小林洋行	2,400	231.00	554,400	貸付株式数 100株
第一生命HLDGS	362,400	2,635.00	954,924,000	
東京海上HD	732,900	3,361.00	2,463,276,900	
アドバンテッジリスクマネ	2,900	610.00	1,769,000	貸付株式数 200株
イー・ギャランティ	12,000	1,917.00	23,004,000	
アサックス	2,600	625.00	1,625,000	貸付株式数 1,300株
NECキャピタルソリューション	3,600	2,999.00	10,796,400	
T&Dホールディングス	199,100	2,015.00	401,186,500	
アドバンスクリエイト	4,200	1,185.00	4,977,000	貸付株式数 1,300株
三井不動産	320,500	2,879.00	922,719,500	
三菱地所	447,600	1,754.50	785,314,200	
平和不動産	12,000	3,720.00	44,640,000	
東京建物	70,800	1,914.00	135,511,200	
京阪神ビルディング	12,600	1,176.00	14,817,600	
住友不動産	134,000	3,698.00	495,532,000	
太平洋興発	2,200	729.00	1,603,800	貸付株式数 800株
テオーシー	13,600	619.00	8,418,400	
東京楽天地	1,200	4,185.00	5,022,000	貸付株式数 400株
スターツコーポレーション	10,700	2,878.00	30,794,600	
フジ住宅	10,200	681.00	6,946,200	
空港施設	9,100	546.00	4,968,600	
明和地所	2,700	927.00	2,502,900	
ゴールドクレスト	7,000	1,786.00	12,502,000	
リログループ	43,100	2,089.50	90,057,450	
エスリード	3,400	2,598.00	8,833,200	貸付株式数 1,200株
日神グループHLDGS	11,700	534.00	6,247,800	貸付株式数 4,400株
日本エスコン	16,400	810.00	13,284,000	
MIRARTHホールディング	37,100	435.00	16,138,500	
AVANTIA	3,300	834.00	2,752,200	貸付株式数 1,100株
イオンモール	38,500	1,795.00	69,107,500	

毎日コムネット	2,200	738.00	1,623,600	貸付株式数	900株
ファースト住建	2,300	1,091.00	2,509,300	貸付株式数	1,100株
ランド	442,400	9.00	3,981,600	貸付株式数	162,700株
カチタス	19,900	2,285.00	45,471,500	貸付株式数	5,000株
東祥	5,300	1,150.00	6,095,000	貸付株式数	2,000株
トーセイ	12,300	1,802.00	22,164,600	貸付株式数	3,600株
穴吹興産	1,100	2,290.00	2,519,000	貸付株式数	600株
サンフロンティア不動産	12,400	1,395.00	17,298,000		
インテリックス	1,400	550.00	770,000	貸付株式数	500株
ランドビジネス	2,100	242.00	508,200		
サンネクスタグループ	1,800	1,015.00	1,827,000	貸付株式数	900株
グランディハウス	4,800	571.00	2,740,800		
東武鉄道	82,700	3,749.00	310,042,300		
相鉄ホールディングス	24,800	2,615.00	64,852,000		
東急	211,100	1,786.00	377,024,600		
京浜急行	85,300	1,302.00	111,060,600		
小田急電鉄	114,100	1,999.00	228,085,900		
京王電鉄	39,800	4,661.00	185,507,800		
京成電鉄	48,600	5,793.00	281,539,800		
富士急行	9,200	5,060.00	46,552,000	貸付株式数	1,000株
東日本旅客鉄道	127,700	7,816.00	998,103,200		
西日本旅客鉄道	96,300	5,972.00	575,103,600		
東海旅客鉄道	58,000	17,715.00	1,027,470,000		
西武ホールディングス	91,000	1,510.00	137,410,000		
鴻池運輸	12,700	1,582.00	20,091,400		
西日本鉄道	20,100	2,416.00	48,561,600		
ハマキョウレックス	5,900	3,730.00	22,007,000		
サカイ引越センター	3,500	4,900.00	17,150,000		
近鉄グループHLDGS	75,000	4,902.00	367,650,000		
阪急阪神HLDGS	100,300	4,714.00	472,814,200		
南海電鉄	35,900	3,225.00	115,777,500		
京阪ホールディングス	41,400	3,721.00	154,049,400		
神戸電鉄	2,100	3,065.00	6,436,500	貸付株式数	800株
名古屋鉄道	83,200	2,371.50	197,308,800		
山陽電鉄	5,700	2,205.00	12,568,500	貸付株式数	2,200株
アルプス物流	5,900	1,422.00	8,389,800	貸付株式数	2,200株
トランコム	2,200	6,620.00	14,564,000		
ヤマトホールディングス	96,200	2,553.50	245,646,700		
山 九	19,100	4,890.00	93,399,000		
日 新	5,600	2,516.00	14,089,600		

丸 運	2,800	237.00	663,600	貸付株式数	1,400株
丸全昭和運輸	4,600	3,870.00	17,802,000		
センコーグループHLDGS	39,600	980.00	38,808,000	貸付株式数	3,500株
トナミホールディングス	1,600	4,495.00	7,192,000		
ニッコンホールディングス	24,100	2,847.00	68,612,700		
日石輸送	600	2,679.00	1,607,400		
福山通運	5,700	3,700.00	21,090,000		
セイノーホールディングス	46,600	1,994.00	92,920,400	貸付株式数	6,500株
エスライン	1,600	805.00	1,288,000	貸付株式数	700株
神奈川中央交通	2,200	3,150.00	6,930,000		
AZ-COM丸和ホールディ	18,100	1,988.00	35,982,800	貸付株式数	6,600株
C&Fロジホールディングス	7,400	1,210.00	8,954,000	貸付株式数	800株
日本郵船	201,100	3,069.00	617,175,900	貸付株式数	73,000株
商船三井	132,500	3,316.00	439,370,000	貸付株式数	51,600株
川崎汽船	56,500	3,252.00	183,738,000		
NSユニテッド海運	4,000	3,425.00	13,700,000	貸付株式数	1,600株
明治海運	5,700	556.00	3,169,200	貸付株式数	2,500株
飯野海運	27,500	816.00	22,440,000	貸付株式数	3,700株
共栄タンカー	1,100	843.00	927,300	貸付株式数	300株
九州旅客鉄道	53,200	3,039.00	161,674,800		
SGホールディングス	144,200	2,117.50	305,343,500		
NIPPON EXPRESS	28,100	8,342.00	234,410,200		
日本航空	184,700	2,857.50	527,780,250		
ANAホールディングス	204,600	3,194.00	653,492,400		
ビーウィズ	1,900	2,068.00	3,929,200	貸付株式数	500株
パスコ	1,100	1,771.00	1,948,100		
TREホールディングス	16,300	1,186.00	19,331,800		
人・夢・技術グループ	2,900	1,497.00	4,341,300		
西本WISMETTACHD	2,000	4,520.00	9,040,000	貸付株式数	700株
シルバーライフ	1,500	1,260.00	1,890,000	貸付株式数	700株
ヤマシタヘルスケアHLDGS	500	2,029.00	1,014,500		
GENKY DRUGSTORES	3,500	4,110.00	14,385,000	貸付株式数	1,300株
コア商事HLDGS	4,400	697.00	3,066,800	貸付株式数	1,700株



K P Pグループホールディングン	18,500	621.00	11,488,500	貸付株式数	1,800株
ナルミヤ・インターナショナル	1,000	953.00	953,000	貸付株式数	600株
ブックオフGHD	4,100	1,251.00	5,129,100	貸付株式数	1,700株
ギフトホールディングス	1,700	5,130.00	8,721,000	貸付株式数	600株
三菱倉庫	16,200	3,599.00	58,303,800		
三井倉庫HOLD	7,000	3,535.00	24,745,000	貸付株式数	800株
住友倉庫	20,200	2,373.00	47,934,600	貸付株式数	7,900株
渋沢倉庫	3,000	2,639.00	7,917,000		
ヤマタネ	3,500	1,642.00	5,747,000	貸付株式数	100株
東陽倉庫	8,100	269.00	2,178,900		
乾汽船	9,600	1,299.00	12,470,400	貸付株式数	3,700株
日本トランスシティ	15,400	633.00	9,748,200		
ケイヒン	1,000	1,736.00	1,736,000		
中央倉庫	3,600	1,056.00	3,801,600	貸付株式数	1,400株
川西倉庫	1,000	1,017.00	1,017,000	貸付株式数	200株
安田倉庫	5,100	980.00	4,998,000	貸付株式数	100株
ファイズホールディングス	1,100	1,230.00	1,353,000	貸付株式数	400株
大栄環境	19,600	2,442.00	47,863,200		
日本管財ホールディングク	8,100	2,570.00	20,817,000		
東洋埠頭	1,700	1,335.00	2,269,500		
上組	36,000	3,306.00	119,016,000		
サンリツ	1,400	732.00	1,024,800	貸付株式数	300株
キムラユニティー	2,700	1,200.00	3,240,000	貸付株式数	400株
キューソー流通システム	3,500	958.00	3,353,000	貸付株式数	1,400株
東海運	3,300	282.00	930,600	貸付株式数	1,400株
エーアイティー	4,800	1,835.00	8,808,000	貸付株式数	100株
内外トランスライン	2,700	2,449.00	6,612,300	貸付株式数	900株
ショーエイコーポ	1,700	559.00	950,300	貸付株式数	800株
日本コンセプト	2,400	1,711.00	4,106,400		
TBSホールディングス	38,600	2,418.50	93,354,100		
日本テレビHLD S	67,000	1,319.00	88,373,000		
朝日放送グループHD	7,000	646.00	4,522,000	貸付株式数	2,800株
テレビ朝日HD	18,200	1,567.00	28,519,400		
スカパーJ S A T H D	67,200	574.00	38,572,800		
テレビ東京HD	5,400	2,965.00	16,011,000		
日本BS放送	2,100	911.00	1,913,100	貸付株式数	800株
ビジョン	9,900	1,869.00	18,503,100		

スマートバリュー	1,400	397.00	555,800	貸付株式数	600株
USEN-NEXT HDGS	8,400	3,440.00	28,896,000	貸付株式数	2,500株
ワイヤレスゲート	2,500	225.00	562,500	貸付株式数	100株
日本通信	69,800	265.00	18,497,000		
クロップス	900	1,062.00	955,800		
日本電信電話	967,500	4,081.00	3,948,367,500		
KDDI	583,500	4,523.00	2,639,170,500		
ソフトバンク	1,213,100	1,524.00	1,848,764,400		
光通信	8,900	21,625.00	192,462,500		
エムティーアイ	5,100	663.00	3,381,300	貸付株式数	2,000株
GMOインターネットグ ループ	27,900	2,699.00	75,302,100		
ファイバーゲート	4,100	1,501.00	6,154,100	貸付株式数	1,500株
アйдママーケティングコ ミュ	1,300	273.00	354,900	貸付株式数	600株
KADOKAWA	39,900	3,464.00	138,213,600		
学研ホールディングス	12,600	884.00	11,138,400	貸付株式数	2,600株
ゼンリン	13,300	925.00	12,302,500		
昭文社ホールディングス	2,500	299.00	747,500	貸付株式数	100株
インプレスホールディング ス	5,000	207.00	1,035,000	貸付株式数	2,100株
東京電力HD	678,700	492.90	334,531,230	貸付株式数	255,600株
中部電力	277,300	1,719.50	476,817,350		
関西電力	290,500	1,773.00	515,056,500		
中国電力	119,700	924.20	110,626,740		
北陸電力	70,600	765.80	54,065,480		
東北電力	183,700	880.30	161,711,110		
四国電力	64,100	982.00	62,946,200		
九州電力	173,000	911.20	157,637,600		
北海道電力	72,300	604.00	43,669,200		
沖縄電力	17,500	1,164.00	20,370,000		
電源開発	56,900	2,065.00	117,498,500		
エフオン	4,900	553.00	2,709,700		
イーレックス	13,400	1,131.00	15,155,400	貸付株式数	100株
レノバ	20,100	1,545.00	31,054,500	貸付株式数	7,900株
東京瓦斯	159,300	3,218.00	512,627,400		
大阪瓦斯	152,600	2,242.00	342,129,200		
東邦瓦斯	29,700	2,506.00	74,428,200		
北海道瓦斯	4,600	2,259.00	10,391,400	貸付株式数	1,400株

広島ガス	16,400	369.00	6,051,600	
西部ガスHLDGS	7,200	2,134.00	15,364,800	
静岡ガス	17,300	1,244.00	21,521,200	貸付株式数 6,200株
メタウォーター	9,500	1,866.00	17,727,000	
アイネット	4,500	1,513.00	6,808,500	
松竹	4,300	11,545.00	49,643,500	貸付株式数 1,700株 (1,700株)
東宝	47,300	5,703.00	269,751,900	
エイチ・アイ・エス	20,200	2,063.00	41,672,600	貸付株式数 8,000株
東映	2,100	18,290.00	38,409,000	
ラックランド	3,200	3,350.00	10,720,000	貸付株式数 1,200株
NTTデータ	237,000	2,108.00	499,596,000	
共立メンテナンス	13,300	5,415.00	72,019,500	貸付株式数 5,200株
イチネンホールディングス	8,600	1,347.00	11,584,200	
建設技術研究所	4,000	3,525.00	14,100,000	
スペース	5,500	1,047.00	5,758,500	
アインホールディングス	11,000	5,024.00	55,264,000	貸付株式数 4,200株
燦ホールディングス	3,300	2,202.00	7,266,600	
ピー・シー・エー	4,300	1,387.00	5,964,100	貸付株式数 500株
スバル興業	400	9,590.00	3,836,000	貸付株式数 100株
東京テアトル	2,200	1,130.00	2,486,000	貸付株式数 1,000株
タナベコンサルティング グループ	2,300	911.00	2,095,300	
ビジネスB太田昭和	3,200	2,493.00	7,977,600	
ナガワ	2,100	6,710.00	14,091,000	貸付株式数 600株
東京都競馬	6,500	4,085.00	26,552,500	貸付株式数 100株
常磐興産	2,100	1,224.00	2,570,400	貸付株式数 1,000株
カナモト	14,200	2,184.00	31,012,800	
DTS	16,100	3,545.00	57,074,500	
スクウェア・エニックス・ HD	38,000	6,864.00	260,832,000	
シーイーシー	10,600	1,819.00	19,281,400	
カプコン	75,000	5,532.00	414,900,000	貸付株式数 16,700株
ニシオホールディングス	7,200	3,305.00	23,796,000	貸付株式数 1,500株
アイ・エス・ビー	3,800	1,586.00	6,026,800	貸付株式数 1,200株
アゴーラホスピタリ ティーG	32,600	27.00	880,200	貸付株式数 15,600株
日本空港ビルデング	26,200	6,410.00	167,942,000	
トランス・コスモス	9,600	3,570.00	34,272,000	貸付株式数 3,200株
乃村工藝社	33,600	970.00	32,592,000	

ジャステック	4,600	1,319.00	6,067,400	貸付株式数	1,500株
S C S K	61,700	2,298.00	141,786,600		
藤田観光	3,400	3,580.00	12,172,000	貸付株式数	1,300株
K N T - C Tホールディングス	4,600	1,371.00	6,306,600	貸付株式数	1,800株
トーカイ	6,900	1,867.00	12,882,300		
白 洋 舎	800	2,733.00	2,186,400	貸付株式数	300株
セコム	78,800	9,612.00	757,425,600		
N S W	2,900	2,515.00	7,293,500		
セントラル警備保障	4,200	2,892.00	12,146,400	貸付株式数	1,300株
アイネス	5,400	1,473.00	7,954,200		
丹青社	15,000	783.00	11,745,000		
メイテック	30,300	2,490.00	75,447,000		
T K C	12,100	3,880.00	46,948,000		
富士ソフト	8,500	9,200.00	78,200,000	貸付株式数	400株
応用地質	7,200	1,976.00	14,227,200		
船井総研ホールディング	16,200	2,619.00	42,427,800		
N S D	27,000	2,817.00	76,059,000		
進学会ホールディングス	1,900	291.00	552,900	貸付株式数	900株
丸紅建材リース	500	2,183.00	1,091,500	貸付株式数	100株
オ オ バ	3,700	755.00	2,793,500	貸付株式数	500株
コナミグループ	32,300	7,742.00	250,066,600	貸付株式数	12,700株
いであ	1,300	1,677.00	2,180,100	貸付株式数	600株
学 究 社	3,100	2,153.00	6,674,300		
ベネッセホールディングス	29,000	1,834.50	53,200,500		
イオンディライト	8,500	2,996.00	25,466,000	貸付株式数	3,200株
ナック	3,400	953.00	3,240,200	貸付株式数	1,200株
福井コンピュータH L D S	5,300	2,994.00	15,868,200		
ダイセキ	15,800	3,860.00	60,988,000	貸付株式数	6,200株
ステップ	2,800	1,814.00	5,079,200		
泉州電業	4,000	3,575.00	14,300,000	貸付株式数	1,400株
元気寿司	2,200	3,235.00	7,117,000		
トラスコ中山	16,800	2,299.00	38,623,200		
ヤマダホールディングス	326,500	431.10	140,754,150	貸付株式数	116,100株
オートバックスセブン	28,000	1,530.00	42,840,000		
モリト	5,600	1,048.00	5,868,800		
アークランズ	11,600	1,577.00	18,293,200		
ニトリホールディングス	32,200	17,105.00	550,781,000		
グルメ杵屋	6,400	1,059.00	6,777,600	貸付株式数	2,500株
愛 眼	4,900	192.00	940,800	貸付株式数	1,800株

ケーユーホールディングス	4,600	1,276.00	5,869,600	
吉野家ホールディングス	31,200	2,585.00	80,652,000	貸付株式数 12,300株
加藤産業	9,900	3,990.00	39,501,000	
北恵	1,400	744.00	1,041,600	貸付株式数 500株
イノテック	5,100	1,602.00	8,170,200	
イエローハット	14,200	1,843.00	26,170,600	
松屋フーズHLDGS	3,700	4,135.00	15,299,500	貸付株式数 1,200株
JBCホールディングス	5,500	2,374.00	13,057,000	
JKホールディングス	6,100	967.00	5,898,700	
サガミホールディングス	12,800	1,257.00	16,089,600	貸付株式数 1,500株
日伝	4,700	2,270.00	10,669,000	貸付株式数 1,800株
関西フードマーケット	7,200	1,617.00	11,642,400	貸付株式数 100株
ミロク情報サービス	6,900	1,567.00	10,812,300	貸付株式数 1,800株
北沢産業	3,200	402.00	1,286,400	貸付株式数 1,400株
杉本商事	3,500	2,064.00	7,224,000	貸付株式数 400株
因幡電機産業	20,700	3,340.00	69,138,000	
王将フードサービス	5,200	6,440.00	33,488,000	貸付株式数 1,800株
ミニストップ	5,700	1,455.00	8,293,500	貸付株式数 2,200株
アークス	14,700	2,447.00	35,970,900	貸付株式数 4,100株
パローホールディングス	15,500	1,951.00	30,240,500	
東テック	2,600	4,230.00	10,998,000	
ミスミグループ本社	120,300	3,102.00	373,170,600	
アルテック	3,400	275.00	935,000	
ベルク	4,000	6,210.00	24,840,000	
大庄	3,300	1,115.00	3,679,500	貸付株式数 1,400株
タキヒヨー	1,500	931.00	1,396,500	貸付株式数 700株
ファーストリテイリング	35,800	36,570.00	1,309,206,000	
ソフトバンクグループ	372,500	6,492.00	2,418,270,000	
蔵王産業	1,000	2,234.00	2,234,000	
スズケン	23,400	3,668.00	85,831,200	
サンドラッグ	30,200	4,292.00	129,618,400	
サックスパーホールディング	7,500	955.00	7,162,500	
グ				
ジェコス	4,700	868.00	4,079,600	
ヤマザワ	1,100	1,254.00	1,379,400	貸付株式数 400株
やまや	1,300	2,650.00	3,445,000	貸付株式数 600株
グローセル	7,400	412.00	3,048,800	
ベルーナ	19,100	708.00	13,522,800	
合計			246,890,055,590	

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

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

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## 【ダイワ日経225インデックス（ダイワSMA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7期計算期間(2022年6月16日から2023年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

### 1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 2022年6月15日現在	第7期 2023年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	3,447,530	4,719,213
親投資信託受益証券	1,768,196,798	2,943,044,441
未収入金	18,530,000	1,710,000
流動資産合計	1,790,174,328	2,949,473,654
資産合計	1,790,174,328	2,949,473,654
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	20,252,414	47,690,930
未払解約金	18,514,230	1,669,625
未払受託者報酬	200,603	270,175
未払委託者報酬	2,909,346	3,918,311
その他未払費用	50,069	67,468
流動負債合計	41,926,662	53,616,509
負債合計	41,926,662	53,616,509
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,265,775,901	1,644,514,833
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	482,471,765	1,251,342,312
（分配準備積立金）	64,031,780	255,893,331
元本等合計	1,748,247,666	2,895,857,145
純資産合計	1,748,247,666	2,895,857,145
負債純資産合計	1,790,174,328	2,949,473,654



## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第6期		第7期	
	自	2021年6月16日 至 2022年6月15日	自	2022年6月16日 至 2023年6月15日
<b>営業収益</b>				
受取利息		1		8
有価証券売買等損益		116,802,610		614,597,643
営業収益合計		116,802,609		614,597,651
<b>営業費用</b>				
支払利息		211		1,341
受託者報酬		276,481		480,984
委託者報酬		4,010,310		6,975,574
その他費用		68,955		120,092
営業費用合計		4,355,957		7,577,991
営業利益又は営業損失( )		121,158,566		607,019,660
経常利益又は経常損失( )		121,158,566		607,019,660
当期純利益又は当期純損失( )		121,158,566		607,019,660
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( )		248,247		302,313,385
期首剰余金又は期首欠損金( )		153,844,491		482,471,765
剰余金増加額又は欠損金減少額		501,880,849		3,456,222,149
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		501,880,849		3,456,222,149
剰余金減少額又は欠損金増加額		32,090,842		2,944,366,947
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		32,090,842		2,944,366,947
分配金		1 20,252,414		1 47,690,930
期末剰余金又は期末欠損金( )		482,471,765		1,251,342,312

## (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7期
	自2022年6月16日 至2023年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1. 1 期首元本額	285,541,229円	1,265,775,901円
期中追加設定元本額	1,043,814,417円	6,874,274,786円
期中一部解約元本額	63,579,745円	6,495,535,854円
2. 計算期間末日における受益権の 総数	1,265,775,901口	1,644,514,833口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第6期	第7期
	自2021年6月16日 至2022年6月15日	自2022年6月16日 至2023年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（21,340,798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（418,439,985円）及び分配準備積立金（62,943,396円）より分配対象額は502,724,179円（1万口当たり3,971.67円）であり、うち20,252,414円（1万口当たり160円）を分配金額としております。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（49,139,728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（253,526,033円）、投資信託約款に規定される収益調整金（995,448,981円）及び分配準備積立金（918,500円）より分配対象額は1,299,033,242円（1万口当たり7,899.19円）であり、うち47,690,930円（1万口当たり290円）を分配金額としております。</p>
------------	---	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第7期 自2022年6月16日 至2023年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第7期
	2023年6月15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6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15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	116,545,772	306,137,173
合計	116,545,772	306,137,173

## (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6期	第7期
2022年6月15日現在	2023年6月15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7期
自2022年6月16日
至2023年6月15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6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1口当たり純資産額	1.3812円	1.7609円
(1万口当たり純資産額)	(13,812円)	(17,609円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ストックインデックス225・マザーファンド	649,105,523	2,943,044,441	
親投資信託受益証券 合計			2,943,044,441	
合計			2,943,044,441	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

## 「ストックインデックス225・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2022年6月15日現在 金額 (円)	2023年6月15日現在 金額 (円)
資産の部		

流動資産			
コール・ローン		7,589,051,922	4,299,179,640
株式	2 3	204,507,294,810	251,968,590,600
派生商品評価勘定		-	123,941,050
未収入金		-	19,426,800
未収配当金		1,314,712,940	1,520,242,820
未収利息		163,422	60,059
前払金		117,547,760	-
その他未収収益	4	11,008,846	16,253,348
差入委託証拠金		-	13,230,000
流動資産合計		213,539,779,700	257,960,924,317
資産合計		213,539,779,700	257,960,924,317
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		178,832,260	-
前受金		-	155,290,000
未払解約金		24,550,000	1,378,817,000
受入担保金		3,800,179,110	1,431,695,800
流動負債合計		4,003,561,370	2,965,802,800
負債合計		4,003,561,370	2,965,802,800
純資産の部			
元本等			
元本	1	60,104,604,144	56,240,375,491
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		149,431,614,186	198,754,746,026
元本等合計		209,536,218,330	254,995,121,517
純資産合計		209,536,218,330	254,995,121,517
負債純資産合計		213,539,779,700	257,960,924,317

## 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6月16日 至2023年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1. 1 期首	2021年6月16日	2022年6月16日
期首元本額	50,206,993,331円	60,104,604,144円
期中追加設定元本額	21,670,750,882円	21,913,993,799円
期中一部解約元本額	11,773,140,069円	25,778,222,452円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ストック インデックス ファン ド 2 2 5	25,285,506,759円	21,542,701,854円
適格機関投資家専用・ダイワ・ ストックインデックスファンド 2 2 5 V A	284,528,870円	232,174,028円
大和 スtock インデックス 2 2 5 ファンド	8,019,187,520円	6,944,835,557円
D - I ' s 日経 2 2 5 インデッ クス	101,546,677円	57,189,266円
i F r e e 日経 2 2 5 インデッ クス	9,341,332,565円	10,715,580,491円

	D C ・ ダイワ ・ ストックイン デックス 2 2 5 ( 確定拠出年金 専用ファンド )	5,583,587,288円	5,432,929,086円
	ダイワ ・ ノーロード 日経 2 2 5 ファンド	499,015,657円	366,133,843円
	ダイワファンドラップ 日経 2 2 5 インデックス	4,144,976,466円	4,255,823,451円
	ダイワ日経 2 2 5 インデックス ( ダイワ S M A 専用 )	507,198,898円	649,105,523円
	ダイワ ・ インデックスセレクト 日経 2 2 5	6,337,723,444円	6,043,902,392円
	計	60,104,604,144円	56,240,375,491円
2.	期末日における受益権の総数	60,104,604,144口	56,240,375,491口
3.	2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下 のとおり有価証券の貸付を行 っております。 株式 3,511,184,000円	株券貸借取引契約により、以下 のとおり有価証券の貸付を行 っております。 株式 1,379,502,900円
4.	3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 株式 3,127,850,000円	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 株式 4,542,640,000円
5.	4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相 当額の未入金分が含まれてお ります。	貸付有価証券に係る配当金相 当額の未入金分が含まれてお ります。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2022年6月16日 至2023年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2 条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定 する「運用の基本方針」に従っております。



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

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）

株式	23,892,814,207	44,669,937,802
合計	23,892,814,207	44,669,937,802

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 株式関連

種類	2022年6月15日現在				2023年6月15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	5,171,927,760	-	4,993,200,000	178,727,760	2,849,500,000	-	2,973,490,000	123,990,000
合計	5,171,927,760	-	4,993,200,000	178,727,760	2,849,500,000	-	2,973,490,000	123,990,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1口当たり純資産額	3.4862円	4.5340円
(1万口当たり純資産額)	(34,862円)	(45,340円)

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)	備考
----	-----	--------	----

		単価	金額	
ニッセイ	255,000	646.00	164,730,000	
I N P E X	102,000	1,597.00	162,894,000	
コムシスホールディングス	255,000	2,813.00	717,315,000	
大成建設	51,000	4,739.00	241,689,000	
大 林 組	255,000	1,182.50	301,537,500	
清水建設	255,000	886.70	226,108,500	
長谷工コーポレーション	51,000	1,714.00	87,414,000	
鹿島建設	127,500	2,100.50	267,813,750	
大和ハウス	255,000	3,763.00	959,565,000	
積水ハウス	255,000	2,747.00	700,485,000	
日揮ホールディングス	255,000	1,870.50	476,977,500	
日清製粉G本社	255,000	1,852.50	472,387,500	
明治ホールディングス	102,000	3,220.00	328,440,000	
日本ハム	127,500	4,007.00	510,892,500	
エムスリー	612,000	3,253.00	1,990,836,000	
ディー・エヌ・エー	76,500	1,899.00	145,273,500	
サッポロホールディングス	51,000	3,750.00	191,250,000	
アサヒグループホールディングン	255,000	5,752.00	1,466,760,000	
キリンHD	255,000	2,145.50	547,102,500	
宝ホールディングス	255,000	1,075.00	274,125,000	
双日	25,500	3,158.00	80,529,000	
キッコーマン	255,000	8,416.00	2,146,080,000	
味の素	255,000	5,734.00	1,462,170,000	
ニチレイ	127,500	3,118.00	397,545,000	
日本たばこ産業	255,000	3,214.00	819,570,000	
J . フロント リテイリング	127,500	1,422.00	181,305,000	
三越伊勢丹HD	255,000	1,465.50	373,702,500	
東急不動産HD	255,000	845.40	215,577,000	
セブン&アイ・HLDGS	255,000	6,158.00	1,570,290,000	
帝 人	51,000	1,385.50	70,660,500	
東 レ	255,000	787.50	200,812,500	
ク ラ レ	255,000	1,389.50	354,322,500	
旭 化 成	255,000	972.90	248,089,500	
SUMCO	25,500	2,061.50	52,568,250	
ネクソン	510,000	2,923.50	1,490,985,000	
王子ホールディングス	255,000	549.90	140,224,500	
日本製紙	25,500	1,239.00	31,594,500	

レゾナック・ホールディング	25,500	2,271.00	57,910,500	
住友化学	255,000	431.70	110,083,500	
日産化学	255,000	6,445.00	1,643,475,000	
東ソー	127,500	1,748.50	222,933,750	
トクヤマ	51,000	2,431.50	124,006,500	
デンカ	51,000	2,626.00	133,926,000	
信越化学	1,275,000	4,817.00	6,141,675,000	
協和キリン	255,000	2,702.50	689,137,500	
三井化学	51,000	3,991.00	203,541,000	貸付株式数 1,100株
三菱ケミカルグループ	127,500	826.20	105,340,500	
UBE	25,500	2,453.00	62,551,500	
電通グループ	255,000	4,730.00	1,206,150,000	
花王	255,000	5,118.00	1,305,090,000	
武田薬品	255,000	4,537.00	1,156,935,000	
アステラス製薬	1,275,000	2,258.50	2,879,587,500	
住友ファーマ	255,000	631.90	161,134,500	
塩野義製薬	255,000	6,131.00	1,563,405,000	
中外製薬	765,000	4,146.00	3,171,690,000	
エーザイ	255,000	9,527.00	2,429,385,000	
テルモ	1,020,000	4,586.00	4,677,720,000	
第一三共	765,000	4,800.00	3,672,000,000	
大塚ホールディングス	255,000	5,539.00	1,412,445,000	
DIC	25,500	2,621.00	66,835,500	
オリエンタルランド	255,000	5,447.00	1,388,985,000	
Zホールディングス	102,000	362.00	36,924,000	
トレンドマイクロ	255,000	7,382.00	1,882,410,000	
サイバーエージェント	204,000	1,046.50	213,486,000	
楽天グループ	255,000	518.50	132,217,500	貸付株式数 115,600株
富士フイルムHLDGS	255,000	8,813.00	2,247,315,000	
コニカミノルタ	255,000	468.70	119,518,500	
資生堂	255,000	6,756.00	1,722,780,000	
出光興産	102,000	2,902.50	296,055,000	
ENEOSホールディングス	255,000	483.70	123,343,500	
横浜ゴム	127,500	3,204.00	408,510,000	
ブリヂストン	255,000	6,033.00	1,538,415,000	
AGC	51,000	5,274.00	268,974,000	
日本板硝子	25,500	629.00	16,039,500	
日本電気硝子	76,500	2,619.00	200,353,500	

住友大阪セメント	25,500	3,701.00	94,375,500	
太平洋セメント	25,500	2,843.00	72,496,500	
東海カーボン	255,000	1,248.00	318,240,000	
TOTO	127,500	4,458.00	568,395,000	
日本碍子	255,000	1,787.00	455,685,000	
日本製鉄	25,500	2,989.00	76,219,500	
神戸製鋼所	25,500	1,294.00	32,997,000	貸付株式数 11,300株
JFEホールディングス	25,500	2,029.50	51,752,250	
大平洋金属	25,500	1,599.00	40,774,500	
日本製鋼所	51,000	3,038.00	154,938,000	
三井金属	25,500	3,589.00	91,519,500	
三菱マテリアル	25,500	2,601.50	66,338,250	
住友鉱山	127,500	4,927.00	628,192,500	
DOWAホールディングス	51,000	4,589.00	234,039,000	
古河電工	25,500	2,502.50	63,813,750	
住友電工	255,000	1,767.00	450,585,000	
フジクラ	255,000	1,178.00	300,390,000	
しずおかフィナンシャルク	255,000	1,014.00	258,570,000	
リクルートホールディングス	765,000	4,885.00	3,737,025,000	
オークマ	51,000	7,484.00	381,684,000	
アマダ	255,000	1,410.50	359,677,500	
日本郵政	255,000	1,013.00	258,315,000	
S M C	25,500	81,950.00	2,089,725,000	
小松製作所	255,000	3,865.00	985,575,000	
住友重機械	51,000	3,501.00	178,551,000	
日立建機	255,000	4,027.00	1,026,885,000	
クボタ	255,000	2,204.00	562,020,000	
荏原製作所	51,000	7,254.00	369,954,000	
ダイキン工業	255,000	29,575.00	7,541,625,000	
日本精工	255,000	897.80	228,939,000	貸付株式数 20,000株
N T N	255,000	297.80	75,939,000	
ジェイテクト	255,000	1,304.00	332,520,000	
ミネベアミツミ	255,000	2,805.50	715,402,500	
日立	51,000	8,908.00	454,308,000	
三菱電機	255,000	2,043.50	521,092,500	
富士電機	51,000	6,391.00	325,941,000	
安川電機	255,000	6,732.00	1,716,660,000	
ニデック	204,000	7,753.00	1,581,612,000	
オムロン	255,000	9,218.00	2,350,590,000	

ジーエス・ユアサ コーポ	51,000	2,840.50	144,865,500	
日本電気	25,500	7,029.00	179,239,500	
富士通	25,500	19,085.00	486,667,500	
ルネサスエレクトロニクス	255,000	2,672.50	681,487,500	
セイコーエプソン	510,000	2,207.00	1,125,570,000	
パナソニック ホールディ ンク	255,000	1,678.50	428,017,500	
シャープ	255,000	785.00	200,175,000	貸付株式数 113,200株
ソニーグループ	255,000	13,950.00	3,557,250,000	
T D K	765,000	5,693.00	4,355,145,000	
アルプスアルパイン	255,000	1,273.50	324,742,500	
横河電機	255,000	2,745.50	700,102,500	
アドバンテスト	510,000	19,550.00	9,970,500,000	
キーエンス	25,500	70,970.00	1,809,735,000	
デンソー	255,000	9,660.00	2,463,300,000	
カシオ	255,000	1,208.00	308,040,000	
ファナック	1,275,000	5,207.00	6,638,925,000	
京セラ	510,000	7,972.00	4,065,720,000	
太陽誘電	255,000	4,301.00	1,096,755,000	
村田製作所	204,000	8,520.00	1,738,080,000	
日東電工	255,000	10,840.00	2,764,200,000	
三井E & S	25,500	485.00	12,367,500	貸付株式数 2,600株
日立造船	51,000	918.00	46,818,000	
三菱重工業	25,500	6,861.00	174,955,500	
川崎重工業	25,500	3,553.00	90,601,500	
I H I	25,500	3,926.00	100,113,000	貸付株式数 2,000株
コンコルディア・フィナン シャル	255,000	546.50	139,357,500	
日産自動車	255,000	542.70	138,388,500	
いすゞ自動車	127,500	1,809.00	230,647,500	
トヨタ自動車	1,275,000	2,320.50	2,958,637,500	
日野自動車	255,000	624.30	159,196,500	
三菱自動車工業	25,500	489.80	12,489,900	
マツダ	51,000	1,385.00	70,635,000	
本田技研	510,000	4,511.00	2,300,610,000	
スズキ	255,000	5,100.00	1,300,500,000	
S U B A R U	255,000	2,692.00	686,460,000	
ヤマハ発動機	255,000	3,990.00	1,017,450,000	
ニコン	255,000	1,750.50	446,377,500	
オリンパス	1,020,000	2,250.00	2,295,000,000	

S C R E E Nホールディングス	51,000	16,245.00	828,495,000	
H O Y A	127,500	17,945.00	2,287,987,500	
キヤノン	382,500	3,610.00	1,380,825,000	
リ コ ー	255,000	1,261.50	321,682,500	
シチズン時計	255,000	861.00	219,555,000	貸付株式数 51,400株
バンダイナムコH L D G S	765,000	3,493.00	2,672,145,000	
凸版印刷	127,500	3,095.00	394,612,500	
大日本印刷	127,500	4,048.00	516,120,000	
ヤマハ	255,000	5,834.00	1,487,670,000	
任 天 堂	255,000	6,225.00	1,587,375,000	
伊 藤 忠	255,000	5,613.00	1,431,315,000	貸付株式数 9,800株
丸 紅	255,000	2,403.00	612,765,000	
豊田通商	255,000	7,238.00	1,845,690,000	
三井物産	255,000	5,446.00	1,388,730,000	
東京エレクトロン	765,000	20,300.00	15,529,500,000	
住友商事	255,000	3,049.00	777,495,000	
三菱商事	255,000	6,792.00	1,731,960,000	
高 島 屋	127,500	1,885.00	240,337,500	貸付株式数 10,000株
丸井グループ	255,000	2,443.50	623,092,500	
クレディセゾン	255,000	2,087.00	532,185,000	
イオン	255,000	2,796.00	712,980,000	貸付株式数 25,000株
あおぞら銀行	25,500	2,630.50	67,077,750	貸付株式数 11,500株
三菱U F J フィナンシャル G	255,000	989.90	252,424,500	
りそなホールディングス	25,500	663.00	16,906,500	
三井住友トラストH D	25,500	5,045.00	128,647,500	
三井住友フィナンシャルG	25,500	5,865.00	149,557,500	
千葉銀行	255,000	863.10	220,090,500	
ふくおかフィナンシャルG	51,000	2,742.50	139,867,500	
みずほフィナンシャルG	25,500	2,129.50	54,302,250	
オリックス	255,000	2,529.50	645,022,500	
大和証券G本社	255,000	729.80	186,099,000	
野村ホールディングス	255,000	550.20	140,301,000	
松井証券	255,000	815.00	207,825,000	
S O M P Oホールディング ス	51,000	6,487.00	330,837,000	
日本取引所グループ	255,000	2,561.50	653,182,500	
M S & A D	76,500	5,223.00	399,559,500	貸付株式数 9,400株
第一生命H L D G S	25,500	2,635.00	67,192,500	

東京海上HD	382,500	3,361.00	1,285,582,500	
T & Dホールディングス	51,000	2,015.00	102,765,000	
三井不動産	255,000	2,879.00	734,145,000	貸付株式数 24,700株
三菱地所	255,000	1,754.50	447,397,500	
東京建物	127,500	1,914.00	244,035,000	
住友不動産	255,000	3,698.00	942,990,000	
東武鉄道	51,000	3,749.00	191,199,000	
東急	127,500	1,786.00	227,715,000	
小田急電鉄	127,500	1,999.00	254,872,500	
京王電鉄	51,000	4,661.00	237,711,000	
京成電鉄	127,500	5,793.00	738,607,500	
東日本旅客鉄道	25,500	7,816.00	199,308,000	
西日本旅客鉄道	25,500	5,972.00	152,286,000	
東海旅客鉄道	25,500	17,715.00	451,732,500	
ヤマトホールディングス	255,000	2,553.50	651,142,500	貸付株式数 21,700株
日本郵船	76,500	3,069.00	234,778,500	
商船三井	76,500	3,316.00	253,674,000	
川崎汽船	76,500	3,252.00	248,778,000	
NIPPON EXPRESS	25,500	8,342.00	212,721,000	
日本航空	255,000	2,857.50	728,662,500	
ANAホールディングス	25,500	3,194.00	81,447,000	
三菱倉庫	127,500	3,599.00	458,872,500	
日本電信電話	102,000	4,081.00	416,262,000	
KDDI	1,530,000	4,523.00	6,920,190,000	
ソフトバンク	255,000	1,524.00	388,620,000	
東京電力HD	25,500	492.90	12,568,950	
中部電力	25,500	1,719.50	43,847,250	
関西電力	25,500	1,773.00	45,211,500	
東京瓦斯	51,000	3,218.00	164,118,000	
大阪瓦斯	51,000	2,242.00	114,342,000	貸付株式数 2,000株
東宝	25,500	5,703.00	145,426,500	
NTTデータ	1,275,000	2,108.00	2,687,700,000	
セコム	255,000	9,612.00	2,451,060,000	
コナミグループ	255,000	7,742.00	1,974,210,000	
ファーストリテイリング	765,000	36,570.00	27,976,050,000	貸付株式数 21,500株
ソフトバンクグループ	1,530,000	6,492.00	9,932,760,000	
合計			251,968,590,600	



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

武田薬品	50,000株
ダイキン工業	26,000株
KDDI	156,000株
ファーストリテイリング	50,000株
ソフトバンクグループ	156,000株

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA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7期計算期間(2022年6月16日から2023年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

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）

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 2022年6月15日現在	第7期 2023年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	28,029,703	22,064,079
親投資信託受益証券	10,100,037,277	12,971,178,717
未収入金	867,701,000	68,730,000
流動資産合計	10,995,767,980	13,061,972,796
資産合計	10,995,767,980	13,061,972,796
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	117,804,530	153,510,384
未払解約金	867,734,338	69,390,651
未払受託者報酬	1,291,637	997,689
未払委託者報酬	24,864,671	19,206,270
その他未払費用	322,829	249,347
流動負債合計	1,012,018,005	243,354,341
負債合計	1,012,018,005	243,354,341
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 7,362,783,159	1 8,528,354,682
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,620,966,816	4,290,263,773
（分配準備積立金）	1,418,730,312	791,312,633
元本等合計	9,983,749,975	12,818,618,455
純資産合計	9,983,749,975	12,818,618,455
負債純資産合計	10,995,767,980	13,061,972,796

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第6期		第7期	
	自 2021年6月16日 至 2022年6月15日		自 2022年6月16日 至 2023年6月15日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		-		4
有価証券売買等損益		1,433,398,286		1,210,227,440
<b>営業収益合計</b>		<b>1,433,398,286</b>		<b>1,210,227,444</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		3,686		4,506
受託者報酬		2,605,828		1,815,173
委託者報酬		50,163,583		34,943,707
その他費用		651,298		453,640
<b>営業費用合計</b>		<b>53,424,395</b>		<b>37,217,026</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>		<b>1,486,822,681</b>		<b>1,173,010,418</b>
経常利益又は経常損失（ ）		1,486,822,681		1,173,010,418
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>		<b>1,486,822,681</b>		<b>1,173,010,418</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		118,548,370		80,054,165
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>		<b>4,083,726,447</b>		<b>2,620,966,816</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,296,011,394		2,285,085,547
<b>当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>2,296,011,394</b>		<b>2,285,085,547</b>
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,035,595,444		1,555,234,459
<b>当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>2,035,595,444</b>		<b>1,555,234,459</b>
分配金		117,804,530		153,510,384
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>		<b>2,620,966,816</b>		<b>4,290,263,773</b>

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第7期
	自2022年6月16日 至2023年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1. 1 期首元本額	7,124,652,730円	7,362,783,159円
期中追加設定元本額	3,696,975,613円	5,497,831,929円
期中一部解約元本額	3,458,845,184円	4,332,260,406円
2. 計算期間末日における受益権の 総数	7,362,783,159口	8,528,354,682口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第6期	第7期
	自2021年6月16日 至2022年6月15日	自2022年6月16日 至2023年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(137,669,002円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,612,910,682円)及び分配準備積立金(1,398,865,840円)より分配対象額は3,149,445,524円(1万口当たり4,277.52円)であり、うち117,804,530円(1万口当たり160円)を分配金額としております。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(165,612,002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(131,185,109円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,498,951,140円)及び分配準備積立金(648,025,906円)より分配対象額は4,443,774,157円(1万口当たり5,210.59円)であり、うち153,510,384円(1万口当たり180円)を分配金額としております。</p>
------------	--	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第7期 自2022年6月16日 至2023年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第7期
	2023年6月15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6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,562,640,534	1,124,066,204
合計	1,562,640,534	1,124,066,204

## (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6期	第7期
2022年6月15日現在	2023年6月15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7期
自2022年6月16日
至2023年6月15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6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1口当たり純資産額	1.3560円	1.5031円
(1万口当たり純資産額)	(13,560円)	(15,031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	4,764,611,636	12,971,178,717	
親投資信託受益証券 合計			12,971,178,717	
合計			12,971,178,717	

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6月15日現在 金額 (円)	2023年6月15日現在 金額 (円)
資産の部		



流動資産		
預金	404,940,853	366,079,227
コール・ローン	3,433,965,761	2,697,371,556
株式	69,571,750,406	87,395,440,706
投資証券	1,814,081,515	1,911,507,405
派生商品評価勘定	10,680,421	31,666,665
未収入金	529,873	389,936
未収配当金	96,596,727	116,475,981
差入委託証拠金	1,054,162,540	1,661,775,387
流動資産合計	76,386,708,096	94,180,706,863
資産合計	76,386,708,096	94,180,706,863
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,002,632,161	1,321,464,731
未払解約金	875,641,000	78,510,020
流動負債合計	3,878,273,161	1,399,974,751
負債合計	3,878,273,161	1,399,974,751
純資産の部		
元本等		
元本	1 30,012,407,804	34,080,983,566
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	42,496,027,131	58,699,748,546
元本等合計	72,508,434,935	92,780,732,112
純資産合計	72,508,434,935	92,780,732,112
負債純資産合計	76,386,708,096	94,180,706,863

## 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6月16日 至2023年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1. 1 期首	2021年6月16日	2022年6月16日
期首元本額	26,814,400,442円	30,012,407,804円
期中追加設定元本額	7,690,279,088円	10,302,331,561円
期中一部解約元本額	4,492,271,726円	6,233,755,799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	22,230,689,928円	25,083,432,079円
インデックス（為替ヘッジあり）		
ダイワファンドラップオンライン	1,602,819,096円	1,215,650,805円
外国株式インデックス（為替		
ヘッジあり）		
iFree 外国株式インデック	1,997,899,403円	3,016,767,590円
ス（為替ヘッジあり）		
ダイワ先進国株式インデック	347,331円	521,456円
ス（為替ヘッジあり）（投資一任		
専用）		
ダイワ外国株式インデック	4,180,652,046円	4,764,611,636円
ス（為替ヘッジあり）（ダイワS		
MA専用）		
計	30,012,407,804円	34,080,983,566円
2. 期末日における受益権の総数	30,012,407,804口	34,080,983,566口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2022年6月16日 至2023年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産について為替変動リスクを回避すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p>

(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6月15日現在	2023年6月15日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	15,576,344,404	7,722,771,889
投資証券	409,358,772	32,305,188
合計	15,985,703,176	7,690,466,701

(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6月15日現在				2023年6月15日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超				1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買建	4,371,032,936	-	4,355,210,136	15,822,800	4,356,966,188	-	4,388,436,520	31,470,332
合計	4,371,032,936	-	4,355,210,136	15,822,800	4,356,966,188	-	4,388,436,520	31,470,332

(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6月15日現在				2023年6月15日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売建	78,471,595,651	-	81,447,724,591	2,976,128,940	86,624,537,257	-	87,945,805,655	1,321,268,398
アメリカ・ドル	57,084,762,068	-	59,792,034,943	2,707,272,875	63,615,660,828	-	64,302,833,035	687,172,207
イギリス・ ポンド	3,665,929,412	-	3,659,681,027	6,248,385	3,860,722,387	-	3,970,621,518	109,899,131
イスラエル・ シケル	120,784,186	-	121,141,353	357,167	114,508,325	-	120,329,973	5,821,648
オーストラリ ア・ドル	1,954,293,253	-	1,962,013,730	7,720,477	1,957,381,101	-	2,067,209,055	109,827,954
カナダ・ドル	3,123,263,866	-	3,193,486,217	70,222,351	2,918,355,193	-	3,003,278,338	84,923,145
シンガポー ル・ドル	288,140,606	-	296,982,245	8,841,639	352,979,648	-	359,217,693	6,238,045
スイス・フラン	2,334,037,965	-	2,345,227,523	11,189,558	2,644,923,006	-	2,698,143,912	53,220,906
スウェーデン ・クローナ	898,452,039	-	900,982,985	2,530,946	885,401,477	-	904,005,432	18,603,955
デンマーク・ クローネ	651,333,114	-	663,013,785	11,680,671	839,073,099	-	858,412,696	19,339,597
ニュージーラ ンド・ドル	42,825,720	-	42,754,677	71,043	56,023,077	-	58,336,347	2,313,270
ノルウェー・ クローネ	196,892,418	-	193,173,815	3,718,603	182,039,457	-	190,853,115	8,813,658
ユーロ	7,402,471,078	-	7,535,508,267	133,037,189	8,525,188,522	-	8,733,410,832	208,222,310
香港・ドル	708,409,926	-	741,724,024	33,314,098	672,281,137	-	679,153,709	6,872,572
合計	78,471,595,651	-	81,447,724,591	2,976,128,940	86,624,537,257	-	87,945,805,655	1,321,268,398

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1口当たり純資産額	2.4159円	2.7224円
(1万口当たり純資産額)	(24,159円)	(27,224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	1,571	157.430	247,322.530	
	PALO ALTO NETWORKS INC	3,784	238.560	902,711.040	
	FIRST SOLAR INC	1,100	193.030	212,333.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	2,216	164.180	363,822.880	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,594	105.750	168,565.500	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	746	126.550	94,406.300	
	SYNCHRONY FINANCIAL	5,606	33.540	188,025.240	
	ABBOTT LABORATORIES	20,975	103.250	2,165,668.750	
	HOWMET AEROSPACE INC	3,950	45.700	180,515.000	
	VERISK ANALYTICS INC	1,987	220.280	437,696.360	
	LAS VEGAS SANDS CORP	3,968	59.830	237,405.440	
	AMPHENOL CORP-CL A	6,723	80.770	543,016.710	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	585	537.210	314,267.850	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	7,242	54.700	396,137.400		

QORVO INC	1,147	103.600	118,829.200	
AFLAC INC	7,386	68.760	507,861.360	
DARDEN RESTAURANTS INC	1,570	167.640	263,194.800	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	2,480	87.080	215,958.400	
ADOBE INC	5,600	479.530	2,685,368.000	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,724	67.800	184,687.200	
LULULEMON ATHLETICA INC	1,551	377.210	585,052.710	
GARMIN LTD	1,543	106.550	164,406.650	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2,603	288.840	751,850.520	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	8,037	200.520	1,611,579.240	
WR BERKLEY CORP	2,312	56.540	130,720.480	
AUTOZONE INC	232	2,399.420	556,665.440	
DOLLAR TREE INC	2,780	137.790	383,056.200	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	14,565	7.460	108,654.900	
CELANESE CORP	1,211	116.350	140,899.850	
DR HORTON INC	3,776	113.600	428,953.600	
DENTSPLY SIRONA INC	2,450	38.060	93,247.000	
AUTODESK INC	2,492	213.550	532,166.600	
MOODY'S CORP	2,030	340.710	691,641.300	
DEVON ENERGY CORP	7,599	48.950	371,971.050	
ALBEMARLE CORP	1,489	226.800	337,705.200	
ATMOS ENERGY CORP	1,349	117.070	157,927.430	
ALLIANT ENERGY CORP	3,369	53.130	178,994.970	
CITIGROUP INC	22,953	48.240	1,107,252.720	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	4,940	216.090	1,067,484.600	
AMERICAN ELECTRIC POWER	6,288	83.610	525,739.680	
DOMINO'S PIZZA INC	407	305.720	124,428.040	
HESS CORP	3,373	134.030	452,083.190	
DAVITA INC	609	97.480	59,365.320	
DANAHER CORP	8,349	238.450	1,990,819.050	
FORTIVE CORP	3,536	69.500	245,752.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	6,493	110.670	718,580.310	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	6,706	73.150	490,543.900	
BUNGE LTD	1,653	95.320	157,563.960	
TE CONNECTIVITY LTD	3,899	131.730	513,615.270	
APPLE INC	191,386	183.950	35,205,454.700	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	3,515	117.140	411,747.100	
BOEING CO/THE	6,837	216.900	1,482,945.300	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,913	99.970	191,242.610	



BECTON DICKINSON AND CO	3,501	253.330	886,908.330	
LEIDOS HOLDINGS INC	1,400	83.030	116,242.000	
NISOURCE INC	4,111	27.160	111,654.760	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,404	94.610	132,832.440	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	9,521	44.170	420,542.570	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	50,538	35.730	1,805,722.740	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	15,659	335.900	5,259,858.100	
ANSYS INC	974	334.310	325,617.940	
TRUIST FINANCIAL CORP	16,478	31.720	522,682.160	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	9,243	90.290	834,550.470	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	25,556	64.160	1,639,672.960	
JPMORGAN CHASE & CO	35,200	141.490	4,980,448.000	
T ROWE PRICE GROUP INC	2,855	111.140	317,304.700	
LKQ CORP	2,916	54.470	158,834.520	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	4,171	64.960	270,948.160	
CADENCE DESIGN SYS INC	3,212	236.060	758,224.720	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,337	318.930	426,409.410	
DOLLAR GENERAL CORP	2,608	162.120	422,808.960	
SERVICENOW INC	2,420	567.310	1,372,890.200	
CATERPILLAR INC	6,257	243.320	1,522,453.240	
BROWN & BROWN INC	2,669	64.600	172,417.400	
ESSENTIAL UTILITIES INC	2,456	41.210	101,211.760	
CHARLES RIVER LABORATORIES	574	207.420	119,059.080	
CMS ENERGY CORP	3,093	60.420	186,879.060	
MOSAIC CO/THE	3,841	34.990	134,396.590	
DELTA AIR LINES INC	2,019	42.190	85,181.610	
CORNING INC	10,170	33.240	338,050.800	
CISCO SYSTEMS INC	49,461	50.960	2,520,532.560	
MORGAN STANLEY	15,202	87.980	1,337,471.960	
DECKERS OUTDOOR CORP	300	506.730	152,019.000	
MSCI INC	969	486.200	471,127.800	
FAIR ISAAC CORP	299	795.250	237,779.750	
LENNOX INTERNATIONAL INC	470	306.640	144,120.800	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,998	59.100	177,181.800	
BROADCOM INC	5,012	886.180	4,441,534.160	
UNITED THERAPEUTICS CORP	600	226.280	135,768.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	800	135.000	108,000.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,605	198.490	318,576.450	
ARAMARK	2,858	40.160	114,777.280	

DTE ENERGY COMPANY	2,490	112.950	281,245.500	
CENTENE CORP	7,187	64.650	464,639.550	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,182	138.810	164,073.420	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	6,565	27.100	177,911.500	
DARLING INGREDIENTS INC	1,900	64.590	122,721.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,419	209.790	507,482.010	
GARTNER INC	1,020	352.370	359,417.400	
SPLUNK INC	2,266	104.160	236,026.560	
DOMINION ENERGY INC	9,676	52.560	508,570.560	
MONSTER BEVERAGE CORP	9,544	58.480	558,133.120	
SMITH (A.O.) CORP	1,400	69.630	97,482.000	
DEERE & CO	3,464	399.050	1,382,309.200	
QUANTA SERVICES INC	1,577	185.090	291,886.930	
POOL CORP	438	345.400	151,285.200	
GLOBAL PAYMENTS INC	3,008	101.160	304,289.280	
VMWARE INC-CLASS A	2,861	140.830	402,914.630	
BURLINGTON STORES INC	766	148.410	113,682.060	
NASDAQ INC	4,541	51.160	232,317.560	
VAIL RESORTS INC	448	249.620	111,829.760	
TARGA RESOURCES CORP	2,431	70.970	172,528.070	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	874	114.400	99,985.600	
WESTLAKE CORP	424	113.690	48,204.560	
CONSOLIDATED EDISON INC	4,319	92.390	399,032.410	
COGNEX CORP	1,994	55.900	111,464.600	
WEBSTER FINANCIAL CORP	2,200	38.860	85,492.000	
TELEFLEX INC	645	244.530	157,721.850	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,128	174.390	196,711.920	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	845	354.690	299,713.050	
BIO-RAD LABORATORIES-A	241	370.870	89,379.670	
CATALENT INC	1,863	42.090	78,413.670	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,736	194.390	337,461.040	
MOLINA HEALTHCARE INC	783	275.490	215,708.670	
CARLISLE COS INC	600	236.100	141,660.000	
IDEX CORP	960	207.860	199,545.600	
COLGATE-PALMOLIVE CO	9,750	75.420	735,345.000	
ROLLINS INC	2,337	40.890	95,559.930	
AECOM	1,700	86.200	146,540.000	
WATSCO INC	400	361.500	144,600.000	
GRACO INC	2,100	84.140	176,694.000	

AMETEK INC	2,489	153.600	382,310.400	
TORO CO	1,300	96.740	125,762.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,748	95.370	262,076.760	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	1,664	56.000	93,184.000	
HEICO CORP	535	164.840	88,189.400	
GENERAC HOLDINGS INC	684	119.550	81,772.200	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	521	410.990	214,125.790	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3,306	90.330	298,630.980	
TYLER TECHNOLOGIES INC	467	392.100	183,110.700	
COSTCO WHOLESALE CORP	5,307	527.200	2,797,850.400	
EPAM SYSTEMS INC	763	222.530	169,790.390	
RPM INTERNATIONAL INC	1,457	83.820	122,125.740	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	700	254.850	178,395.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	322	2,061.170	663,696.740	
UGI CORP	2,907	27.700	80,523.900	
CUMMINS INC	1,727	234.310	404,653.370	
ACTIVISION BLIZZARD INC	9,731	81.230	790,449.130	
CDW CORP/DE	1,687	176.580	297,890.460	
COSTAR GROUP INC	4,957	82.800	410,439.600	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,140	320.720	365,620.800	
MERCADOLIBRE INC	594	1,211.840	719,832.960	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	990	160.890	159,281.100	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,386	143.550	486,060.300	
DEXCOM INC	4,507	127.060	572,659.420	
NORDSON CORP	488	233.800	114,094.400	
COPART INC	5,270	86.340	455,011.800	
DIAMONDBACK ENERGY INC	2,150	126.780	272,577.000	
SEAGEN INC	1,745	196.210	342,386.450	
ALIGN TECHNOLOGY INC	862	322.460	277,960.520	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	1,038	205.610	213,423.180	
TRANSDIGM GROUP INC	644	810.860	522,193.840	
BIO-TECHNE CORP	2,164	74.870	162,018.680	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	1,079	94.220	101,663.380	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	2,945	100.620	296,325.900	
KINDER MORGAN INC	25,343	16.900	428,296.700	
HCA HEALTHCARE INC	2,565	284.200	728,973.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	420	276.150	115,983.000	
COTERRA ENERGY INC	8,646	24.260	209,751.960	
T-MOBILE US INC	7,394	128.050	946,801.700	

ZILLOW GROUP INC - C	1,786	46.120	82,370.320	
COCA-COLA CO/THE	49,390	60.860	3,005,875.400	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	2,575	65.460	168,559.500	
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,925	117.640	226,457.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	3,373	26.920	90,801.160	
CSX CORP	24,644	33.090	815,469.960	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,001	226.980	227,206.980	
EXPEDIA GROUP INC	1,996	108.930	217,424.280	
AMAZON.COM INC	111,669	126.420	14,117,194.980	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7,267	90.530	657,881.510	
EXXON MOBIL CORP	49,615	105.160	5,217,513.400	
AES CORP	9,021	20.740	187,095.540	
EVEREST RE GROUP LTD	448	341.110	152,817.280	
EOG RESOURCES INC	7,011	110.670	775,907.370	
EQT CORP	3,828	38.450	147,186.600	
AKAMA I TECHNOLOGIES INC	2,268	91.990	208,633.320	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	134	1,280.700	171,613.800	
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,976	179.050	353,802.800	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	3,592	119.400	428,884.800	
FORD MOTOR CO	48,159	14.200	683,857.800	
EXACT SCIENCES CORP	1,924	93.060	179,047.440	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	2,416	17.220	41,603.520	
ENTEGRIS INC	1,893	113.230	214,344.390	
AERCAP HOLDINGS NV	1,700	60.660	103,122.000	
FORTINET INC	8,351	71.480	596,929.480	
MARKEL CORP	170	1,330.700	226,219.000	
NEXTERA ENERGY INC	23,726	73.400	1,741,488.400	
MASIMO CORP	623	161.350	100,521.050	
FREEPORT-MCMORAN INC	17,714	40.060	709,622.840	
INSULET CORP	809	283.590	229,424.310	
US BANCORP	17,549	32.100	563,322.900	
UNITED RENTALS INC	849	405.980	344,677.020	
F5 NETWORKS INC	659	149.720	98,665.480	
FASTENAL CO	7,158	55.440	396,839.520	
FISERV INC	7,076	120.000	849,120.000	
GENERAL ELECTRIC CO	13,089	104.700	1,370,418.300	
AXON ENTERPRISE INC	900	197.810	178,029.000	
PAYLOCITY HOLDING CORP	500	187.120	93,560.000	
GENERAL MOTORS CO	17,533	37.360	655,032.880	

GENERAL DYNAMICS CORP	2,934	212.140	622,418.760	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	4,054	338.420	1,371,954.680	
FIRST HORIZON CORP	6,400	11.450	73,280.000	
ALPHABET INC-CL A	72,142	123.670	8,921,801.140	
ALPHABET INC-CL C	64,823	124.380	8,062,684.740	
OWENS CORNING	1,083	121.360	131,432.880	
GENERAL MILLS INC	6,978	80.650	562,775.700	
FIRSTENERGY CORP	7,224	38.820	280,435.680	
GENUINE PARTS CO	1,847	158.720	293,155.840	
FIFTH THIRD BANCORP	8,620	25.950	223,689.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,330	190.930	444,866.900	
HALLIBURTON CO	11,426	32.050	366,203.300	
REPLIGEN CORP	600	161.430	96,858.000	
HOME DEPOT INC	12,266	299.710	3,676,242.860	
ASSURANT INC	532	129.110	68,686.520	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	18,748	10.830	203,040.840	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	431	215.320	92,802.920	
HERSHEY CO/THE	1,815	260.590	472,970.850	
HUMANA INC	1,569	455.000	713,895.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	3,276	195.690	641,080.440	
HENRY SCHEIN INC	1,491	74.810	111,541.710	
HP INC	12,871	30.950	398,357.450	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	17,322	16.810	291,182.820	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	681	30.460	20,743.260	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	2,262	78.260	177,024.120	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	4,663	70.080	326,783.040	
KRAFT HEINZ CO/THE	9,063	36.670	332,340.210	
ENPHASE ENERGY INC	1,738	179.200	311,449.600	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	10,861	137.200	1,490,129.200	
HUBBELL INC	739	315.450	233,117.550	
INTERNATIONAL PAPER CO	4,724	31.800	150,223.200	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	1,500	66.030	99,045.000	
ZOETIS INC	5,604	165.650	928,302.600	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	2,849	181.380	516,751.620	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	1,700	92.070	156,519.000	
CHENIERE ENERGY INC	2,818	147.000	414,246.000	
HYATT HOTELS CORP - CL A	600	116.890	70,134.000	
ALLEGION PLC	942	116.770	109,997.340	

BUILDERS FIRSTSOURCE INC	1,800	121.000	217,800.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	2,912	18.230	53,085.760	
WASTE CONNECTIONS INC	3,046	136.830	416,784.180	
JUNIPER NETWORKS INC	3,530	31.680	111,830.400	
JM SMUCKER CO/THE	1,225	152.460	186,763.500	
JOHNSON & JOHNSON	31,444	161.560	5,080,092.640	
ABBVIE INC	21,319	136.230	2,904,287.370	
HOLOGIC INC	3,236	78.220	253,119.920	
KIMBERLY-CLARK CORP	4,210	135.120	568,855.200	
KROGER CO	8,532	47.210	402,795.720	
KLA CORP	1,664	480.540	799,618.560	
LOCKHEED MARTIN CORP	2,855	452.550	1,292,030.250	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	840	239.790	201,423.600	
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	2,872	39.700	114,018.400	
LOWE'S COS INC	7,299	214.860	1,568,263.140	
ELI LILLY & CO	9,756	447.720	4,367,956.320	
LAM RESEARCH CORP	1,701	630.030	1,071,681.030	
LOEWS CORP	2,228	58.120	129,491.360	
MCDONALD'S CORP	8,823	288.440	2,544,906.120	
3M CO	6,415	101.950	654,009.250	
META PLATFORMS INC CLASS A	26,696	273.350	7,297,351.600	
S&P GLOBAL INC	3,988	393.090	1,567,642.920	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	755	425.810	321,486.550	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	736	271.440	199,779.840	
ALCOA CORP	2,093	36.130	75,620.090	
PHILLIPS 66	5,350	95.700	511,995.000	
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	1,900	181.230	344,337.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	3,867	43.840	169,529.280	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,785	90.980	253,379.300	
METLIFE INC	8,330	53.940	449,320.200	
MARVELL TECHNOLOGY INC	11,318	62.960	712,581.280	
ARISTA NETWORKS INC	3,030	169.080	512,312.400	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,969	278.310	547,992.390	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	282	1,315.570	370,990.740	
BAKER HUGHES CO	12,517	29.940	374,758.980	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,297	313.120	406,116.640	
MERCK & CO. INC.	30,545	108.660	3,319,019.700	
DUPONT DE NEMOURS INC	6,267	69.940	438,313.980	

MASCO CORP	2,541	55.290	140,491.890	
M & T BANK CORP	1,806	121.900	220,151.400	
MARSH & MCLENNAN COS	5,896	178.100	1,050,077.600	
BLACK KNIGHT INC	2,498	57.000	142,386.000	
HEICO CORP-CLASS A	1,147	131.290	150,589.630	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	3,313	181.460	601,176.980	
WORKDAY INC-CLASS A	2,724	217.310	591,952.440	
BLOCK INC CLASS A	7,249	63.690	461,688.810	
TRANSUNION	2,557	75.510	193,079.070	
VISTRA CORP	4,057	24.810	100,654.170	
NOVOCURE LTD	1,054	45.000	47,430.000	
NETAPP INC	2,370	73.300	173,721.000	
NIKE INC -CL B	15,156	112.860	1,710,506.160	
NORFOLK SOUTHERN CORP	2,913	221.400	644,938.200	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6,888	86.640	596,776.320	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,496	98.260	245,256.960	
ALLY FINANCIAL INC	3,709	28.370	105,224.330	
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,709	447.900	765,461.100	
APTIV PLC	3,476	101.010	351,110.760	
NEWMONT CORP	9,604	42.100	404,328.400	
MCKESSON CORP	1,707	391.250	667,863.750	
XYLEM INC	2,343	111.780	261,900.540	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	18,638	93.060	1,734,452.280	
NUCOR CORP	3,183	150.640	479,487.120	
GODADDY INC - CLASS A	1,930	74.430	143,649.900	
EVERGY INC	2,923	58.920	172,223.160	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	8,824	58.470	515,939.280	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	269	217.130	58,407.970	
OKTA INC	1,995	74.420	148,467.900	
LIBERTY BROADBAND-C	1,445	75.200	108,664.000	
WIX.COM LTD	785	85.280	66,944.800	
EQUITABLE HOLDINGS INC	4,293	26.770	114,923.610	
KKR & CO INC	6,886	57.030	392,708.580	
PAYCHEX INC	3,974	111.540	443,259.960	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	746	909.640	678,591.440	
ALTRIA GROUP INC	21,458	43.950	943,079.100	
P G & E CORP	18,479	17.240	318,577.960	
PFIZER INC	67,530	39.360	2,657,980.800	
CIGNA CORP	3,589	263.770	946,670.530	

DELL TECHNOLOGIES -C	3,276	49.380	161,768.880	
XCEL ENERGY INC	6,256	62.490	390,937.440	
STERIS PLC	1,293	213.120	275,564.160	
SEA LTD-ADR	4,100	63.640	260,924.000	
FOX CORP - CLASS B	1,530	31.190	47,720.700	
FOX CORP - CLASS A	3,495	33.290	116,348.550	
STRYKER CORP	4,035	293.570	1,184,554.950	
DOW INC	8,760	52.810	462,615.600	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	1,130	71.600	80,908.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	2,751	68.400	188,168.400	
PARKER HANNIFIN CORP	1,555	367.550	571,540.250	
UBER TECHNOLOGIES INC	22,015	41.270	908,559.050	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	2,611	201.280	525,542.080	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	28,436	146.420	4,163,599.120	
EXELON CORP	12,353	40.120	495,602.360	
INGERSOLL-RAND INC	4,291	64.120	275,138.920	
NVR INC	39	5,886.570	229,576.230	
CONOCOPHILLIPS	15,114	102.670	1,551,754.380	
TWILIO INC - A	2,053	66.290	136,093.370	
DOCUSIGN INC	2,333	54.100	126,215.300	
PAYCOM SOFTWARE INC	700	319.910	223,937.000	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	1,470	66.060	97,108.200	
PEPSICO INC	16,523	183.170	3,026,517.910	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	409	151.900	62,127.100	
DROPBOX INC-CLASS A	2,950	25.100	74,045.000	
MONGODB INC	821	374.590	307,538.390	
SNAP INC - A	12,910	10.250	132,327.500	
CORTEVA INC	8,992	57.030	512,813.760	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,596	85.540	393,141.840	
AMCOR PLC	19,545	10.160	198,577.200	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	2,641	153.960	406,608.360	
ROKU INC	1,417	73.370	103,965.290	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,290	146.110	334,591.900	
ACCENTURE PLC-CL A	7,560	315.050	2,381,778.000	
PENTAIR PLC	2,222	60.590	134,630.980	
QUALCOMM INC	13,440	123.400	1,658,496.000	
INVESCO LTD	3,700	16.560	61,272.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	664	70.200	46,612.800	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	2,895	72.350	209,453.250	



DATADOG INC - CLASS A	3,487	96.280	335,728.360	
PINTEREST INC- CLASS A	7,896	24.420	192,820.320	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,267	771.110	976,996.370	
REPUBLIC SERVICES INC	2,789	143.560	400,388.840	
BOOKING HOLDINGS INC	460	2,609.790	1,200,503.400	
ROSS STORES INC	4,254	106.240	451,944.960	
PACKAGING CORP OF AMERICA	998	131.360	131,097.280	
RESMED INC	1,797	216.640	389,302.080	
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,327	136.250	180,803.750	
ROBERT HALF INTL INC	1,209	71.370	86,286.330	
MODERNA INC	4,117	126.050	518,947.850	
HUBSPOT INC	651	503.940	328,064.940	
REVVITY INC	1,345	115.400	155,213.000	
CARRIER GLOBAL CORP	10,330	46.160	476,832.800	
OTIS WORLDWIDE CORP	5,262	87.510	460,477.620	
BILL HOLDINGS INC	1,159	114.240	132,404.160	
AVANTOR INC	9,780	19.560	191,296.800	
CARLYLE GROUP INC/THE	2,773	30.630	84,936.990	
DYNATRACE INC	2,339	51.820	121,206.980	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	6,114	76.810	469,616.340	
REGIONS FINANCIAL CORP	12,113	18.010	218,155.130	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	2,996	27.650	82,839.400	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	4,176	32.150	134,258.400	
MATCH GROUP INC	3,049	44.110	134,491.390	
CHEVRON CORP	22,166	157.090	3,482,056.940	
ZSCALER INC	985	157.550	155,186.750	
EDISON INTERNATIONAL	4,460	68.170	304,038.200	
ETSY INC	1,409	95.060	133,939.540	
TESLA INC	34,601	256.790	8,885,190.790	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	2,965	181.070	536,872.550	
GEN DIGITAL INC	8,505	18.350	156,066.750	
UNITY SOFTWARE INC	3,542	41.040	145,363.680	
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,745	89.090	155,462.050	
SYNOPSYS INC	1,794	446.050	800,213.700	
CHEWY INC - CLASS A	856	39.710	33,991.760	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	3,552	68.870	244,626.240	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,266	335.250	424,426.500	
VIATRIS INC	11,272	9.760	110,014.720	
DOORDASH INC - A	3,438	71.500	245,817.000	

ROBLOX CORP -CLASS A	5,270	39.910	210,325.700	
AIRBNB INC-CLASS A	5,023	125.140	628,578.220	
CBRE GROUP INC - A	3,973	78.390	311,443.470	
SOUTHERN CO/THE	13,211	70.480	931,111.280	
SYSCO CORP	6,345	72.830	462,106.350	
TRAVELERS COS INC/THE	2,826	173.550	490,452.300	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	600	41.920	25,152.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,600	58.700	93,920.000	
STEEL DYNAMICS INC	2,156	104.690	225,711.640	
SCHLUMBERGER LTD	16,649	47.270	786,998.230	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,749	44.550	77,917.950	
AT&T INC	85,991	15.840	1,362,097.440	
APA CORP	3,632	33.650	122,216.800	
SOUTHWEST AIRLINES CO	1,008	33.570	33,838.560	
ON SEMICONDUCTOR CORP	4,947	92.740	458,784.780	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	2,388	49.190	117,465.720	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,066	245.850	753,776.100	
SEMPRA ENERGY	3,708	147.290	546,151.320	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	2,264	53.420	120,942.880	
CLARIVATE PLC	3,377	8.900	30,055.300	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	24,448	15.910	388,967.680	
UIPATH INC - CLASS A	4,500	17.990	80,955.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	2,240	65.290	146,249.600	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	1,335	53.900	71,956.500	
TEXAS INSTRUMENTS INC	10,849	177.120	1,921,574.880	
SALESFORCE.COM INC	12,023	209.400	2,517,616.200	
WESTROCK CO	3,840	29.230	112,243.200	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	5,086	76.150	387,298.900	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	8,284	64.500	534,318.000	
TERADYNE INC	2,046	110.360	225,796.560	
UNION PACIFIC CORP	7,417	202.740	1,503,722.580	
MARATHON OIL CORP	7,622	22.810	173,857.820	
MARATHON PETROLEUM CORP	5,823	111.640	650,079.720	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	17,565	96.860	1,701,345.900	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	8,782	174.880	1,535,796.160	
IQVIA HOLDINGS INC	2,288	212.720	486,703.360	
AMEREN CORPORATION	2,727	82.840	225,904.680	
UNITEDHEALTH GROUP INC	11,236	459.860	5,166,986.960	

TOAST INC CLASS A	2,900	23.280	67,512.000	
VERISIGN INC	1,080	220.790	238,453.200	
LUCID GROUP INC	5,100	6.400	32,640.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	4,541	14.740	66,934.340	
VALERO ENERGY CORP	4,723	111.830	528,173.090	
ULTA BEAUTY INC	668	443.580	296,311.440	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	3,008	34.650	104,227.200	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	767	146.190	112,127.730	
ELEVANCE HEALTH INC	2,852	436.330	1,244,413.160	
WALT DISNEY CO/THE	21,867	92.450	2,021,604.150	
WELLS FARGO & CO	45,552	42.080	1,916,828.160	
WASTE MANAGEMENT INC	4,899	162.420	795,695.580	
WILLIAMS COS INC	14,697	30.200	443,849.400	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,418	218.040	309,180.720	
WHIRLPOOL CORP	636	145.960	92,830.560	
WALMART INC	17,967	156.870	2,818,483.290	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,639	142.010	374,764.390	
WYNN RESORTS LTD	1,145	103.500	118,507.500	
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	13,900	3.400	47,260.000	
WABTEC CORP	1,729	101.660	175,770.140	
TJX COMPANIES INC	13,864	79.900	1,107,733.600	
WATERS CORP	759	262.080	198,918.720	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	697	280.380	195,424.860	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	9,298	31.510	292,979.980	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,391	228.400	317,704.400	
WESTERN DIGITAL CORP	4,444	40.460	179,804.240	
WEC ENERGY GROUP INC	3,920	90.530	354,877.600	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	6,197	61.930	383,780.210	
VISA INC-CLASS A SHARES	19,555	223.440	4,369,369.200	
PPL CORP	9,677	26.860	259,924.220	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	4,120	93.200	383,984.000	
PULTEGROUP INC	2,592	73.250	189,864.000	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	28,848	13.670	394,352.160	
PPG INDUSTRIES INC	2,929	140.700	412,110.300	
NORTHERN TRUST CORP	2,667	74.250	198,024.750	
FERGUSON PLC	2,854	150.030	428,185.620	

NVIDIA CORP	29,900	429.970	12,856,103.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	4,858	126.520	614,634.160	
ASPEN TECHNOLOGY CORP	300	164.550	49,365.000	
TYSON FOODS INC-CL A	3,833	49.760	190,730.080	
NETFLIX INC	5,358	440.860	2,362,127.880	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	4,716	520.120	2,452,885.920	
NRG ENERGY INC	2,411	34.340	82,793.740	
GLOBE LIFE INC	1,011	107.000	108,177.000	
TEXTRON INC	2,388	65.290	155,912.520	
NEWS CORP - CLASS A	3,749	19.260	72,205.740	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	70	1,330.370	93,125.900	
OMNICOM GROUP	2,311	94.620	218,666.820	
JACOBS SOLUTIONS INC	1,337	115.290	154,142.730	
ORACLE CORP	19,574	122.270	2,393,312.980	
MASTERCARD INC - A	10,328	374.760	3,870,521.280	
ONEOK INC	5,566	60.430	336,353.380	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,225	456.440	559,139.000	
U HAUL NON VOTING SERIES N	882	48.730	42,979.860	
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	1,800	94.170	169,506.000	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	1,200	79.760	95,712.000	
HF SINCLAIR CORP	1,900	44.600	84,740.000	
OVINTIV INC	3,000	36.880	110,640.000	
YUM! BRANDS INC	3,486	136.350	475,316.100	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2,174	136.630	297,033.620	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	1,961	67.450	132,269.450	
BANK OF AMERICA CORP	86,551	29.120	2,520,365.120	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	510	398.720	203,347.200	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,586	94.410	244,144.260	
AMERICAN EXPRESS CO	7,600	174.470	1,325,972.000	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	4,632	78.530	363,750.960	
LINDE PLC	5,927	374.310	2,218,535.370	
ANALOG DEVICES INC	5,980	191.890	1,147,502.200	
ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	3,600	20.940	75,384.000	
MONDAYCOM LTD	200	182.910	36,582.000	
ADVANCED MICRO DEVICES	19,372	127.330	2,466,636.760	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	8,268	55.840	461,685.120	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,029	109.890	222,966.810	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	2,609	94.720	247,124.480	

AVERY DENNISON CORP	1,070	167.090	178,786.300	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	6,537	63.710	416,472.270	
EMERSON ELECTRIC CO	7,382	85.840	633,670.880	
AON PLC-CLASS A	2,432	322.970	785,463.040	
AMGEN INC	6,436	222.280	1,430,594.080	
EATON CORP PLC	4,609	193.070	889,859.630	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2,100	247.010	518,721.000	
APPLIED MATERIALS INC	10,197	141.170	1,439,510.490	
CME GROUP INC	4,188	181.510	760,163.880	
ECOLAB INC	3,135	179.810	563,704.350	
EQUIFAX INC	1,576	229.710	362,022.960	
GILEAD SCIENCES INC	14,752	77.950	1,149,918.400	
KEURIG DR PEPPER INC	10,021	31.760	318,266.960	
HORMEL FOODS CORP	3,880	41.250	160,050.000	
STATE STREET CORP	4,667	73.200	341,624.400	
SCHWAB (CHARLES) CORP	17,123	54.350	930,635.050	
BAXTER INTERNATIONAL INC	6,528	43.450	283,641.600	
CAMPBELL SOUP CO	2,716	45.910	124,691.560	
CROWN HOLDINGS INC	1,392	85.320	118,765.440	
CARDINAL HEALTH INC	2,973	86.970	258,561.810	
FEDEX CORP	2,877	229.670	660,760.590	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	4,693	112.330	527,164.690	
FMC CORP	1,360	104.540	142,174.400	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,772	78.300	217,047.600	
INTEL CORP	49,592	35.580	1,764,483.360	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	4,318	40.140	173,324.520	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	4,037	70.640	285,173.680	
WOLFSPEED INC	1,500	56.490	84,735.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	3,598	244.460	879,567.080	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	10,227	3.770	38,555.790	
ILLUMINA INC	1,993	204.840	408,246.120	
SEALED AIR CORP	1,450	39.130	56,738.500	
INTUITIVE SURGICAL INC	4,242	323.070	1,370,462.940	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,239	128.870	159,669.930	
SNAP-ON INC	623	271.780	169,318.940	
CARMAX INC	1,749	79.700	139,395.300	
DUKE ENERGY CORP	8,939	90.850	812,108.150	
TARGET CORP	5,473	133.230	729,167.790	
DOVER CORP	1,784	145.180	259,001.120	

WW GRAINGER INC	541	727.070	393,344.870	
CINTAS CORP	1,059	486.090	514,769.310	
CONAGRA BRANDS INC	5,109	34.950	178,559.550	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	1,700	115.000	195,500.000	
CLOROX COMPANY	1,387	153.940	213,514.780	
ENTERGY CORP	2,623	101.300	265,709.900	
MICROSOFT CORP	85,466	337.340	28,831,100.440	
INCYTE CORP	1,856	61.440	114,032.640	
CVS HEALTH CORP	15,735	66.650	1,048,737.750	
MEDTRONIC PLC	15,957	87.910	1,402,779.870	
MICRON TECHNOLOGY INC	12,891	69.120	891,025.920	
BLACKROCK INC	1,771	692.450	1,226,328.950	
CENTERPOINT ENERGY INC	6,679	29.030	193,891.370	
HASBRO INC	1,326	61.910	82,092.660	
KELLOGG CO	3,095	66.140	204,703.300	
KEYCORP	12,565	9.910	124,519.150	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	16,201	73.130	1,184,779.130	
COOPER COS INC/THE	551	362.740	199,869.740	
CHUBB LTD	4,863	188.840	918,328.920	
ARROW ELECTRONICS INC	737	137.930	101,654.410	
ALLSTATE CORP	3,364	111.400	374,749.600	
EBAY INC	6,077	45.070	273,890.390	
PAYPAL HOLDINGS INC	12,916	63.600	821,457.600	
EASTMAN CHEMICAL CO	1,392	81.970	114,102.240	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,849	192.160	547,463.840	
TRIMBLE INC	3,489	51.920	181,148.880	
LENNAR CORP-A	3,247	114.750	372,593.250	
LEAR CORP	828	144.660	119,778.480	
PROGRESSIVE CORP	6,854	126.930	869,978.220	
PACCAR INC	6,396	78.060	499,271.760	
BIOGEN INC	1,787	299.990	536,082.130	
IDEXX LABORATORIES INC	1,036	466.970	483,780.920	
STARBUCKS CORP	13,829	100.660	1,392,027.140	
PTC INC	1,200	141.380	169,656.000	
EVERSOURCE ENERGY	4,318	69.900	301,828.200	
INTUIT INC	3,394	446.220	1,514,470.680	
BORGWARNER INC	2,741	47.800	131,019.800	
BEST BUY CO INC	2,316	76.640	177,498.240	
BALL CORP	4,223	54.460	229,984.580	

	BOSTON SCIENTIFIC CORP	17,522	53.310	934,097.820	
	ELECTRONIC ARTS INC	3,380	127.900	432,302.000	
	VULCAN MATERIALS CO	1,488	207.390	308,596.320	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3,003	340.960	1,023,902.880	
	VF CORP	5,442	19.270	104,867.340	
	PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	8,261	16.600	137,132.600	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	564	98.940	55,802.160	
	CARNIVAL CORP	14,358	15.600	223,984.800	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	7,674	16.720	128,309.280	
	COMCAST CORP-CLASS A	52,031	40.840	2,124,946.040	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	1,900	49.770	94,563.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	13,100	4.100	53,710.000	
アメリカ・ドル 小計				458,317,735.050	
				(64,343,226,824)	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	85,307	23.045	1,965,899.810	
	HALEON PLC	67,998	3.189	216,845.620	
	WISE PLC CLASS A	7,805	6.200	48,391.000	
	BP PLC	220,257	4.611	1,015,715.150	
	UNILEVER PLC	30,507	39.675	1,210,365.220	
	BARCLAYS PLC	177,480	1.574	279,424.510	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	110,496	1.507	166,572.720	
	PRUDENTIAL PLC	33,907	11.360	385,183.520	
	NATWEST GROUP PLC	69,835	2.654	185,342.090	
	JOHNSON MATTHEY PLC	3,080	17.605	54,223.400	
	BAE SYSTEMS PLC	39,854	9.504	378,772.410	
	AVIVA PLC	31,964	4.008	128,111.710	
	GSK	50,745	13.634	691,857.330	
	INFORMA PLC	16,200	7.044	114,112.800	
	AUTO TRADER GROUP PLC	10,587	6.408	67,841.490	
	DCC PLC	1,637	46.650	76,366.050	
	OCADO GROUP PLC	5,149	4.091	21,064.550	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	740	113.700	84,138.000	
	HALMA PLC	3,978	24.290	96,625.620	
	ENTAIN PLC	5,823	12.065	70,254.490	
	JD SPORTS FASHION PLC	45,396	1.482	67,299.570	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	6,857	5.532	37,932.920	
M&G PLC	25,964	2.021	52,473.240		
ENDEAVOUR MINING PLC	2,357	20.520	48,365.640		

RELX PLC	23,973	25.800	618,503.400	
DIAGEO PLC	27,459	33.755	926,878.540	
RIO TINTO PLC	13,268	53.380	708,245.840	
STANDARD CHARTERED PLC	27,461	6.700	183,988.700	
TESCO PLC	87,212	2.640	230,239.680	
SMITH & NEPHEW PLC	9,237	12.490	115,370.130	
GLENCORE PLC	118,288	4.703	556,367.600	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,200	8.444	27,020.800	
SMITHS GROUP PLC	4,080	17.020	69,441.600	
PEARSON PLC	8,271	8.226	68,037.240	
SAINSBURY (J) PLC	17,631	2.725	48,044.470	
NEXT PLC	1,456	64.520	93,941.120	
TAYLOR WIMPEY PLC	57,808	1.103	63,791.120	
WHITBREAD PLC	2,465	34.000	83,810.000	
BUNZL PLC	3,703	31.060	115,015.180	
VODAFONE GROUP PLC	338,629	0.728	246,657.360	
CRODA INTERNATIONAL PLC	1,408	55.260	77,806.080	
KINGFISHER PLC	24,703	2.382	58,842.540	
WPP PLC	13,021	8.748	113,907.700	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	8,244	10.390	85,655.160	
SEVERN TRENT PLC	2,681	27.040	72,494.240	
RENTOKIL INITIAL PLC	30,337	6.420	194,763.540	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	8,936	59.060	527,760.160	
ST JAMES'S PLACE PLC	8,844	11.485	101,573.340	
SCHRODERS PLC	7,217	4.578	33,039.420	
SSE PLC	13,672	18.365	251,086.280	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	12,368	4.517	55,866.250	
ASTRAZENECA PLC	18,889	115.100	2,174,123.900	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	80,741	2.380	192,163.580	
3I GROUP PLC	10,364	20.310	210,492.840	
ASHTREAD GROUP PLC	5,656	54.780	309,835.680	
SAGE GROUP PLC/THE	11,548	8.746	100,998.800	
NATIONAL GRID PLC	45,851	10.315	472,953.060	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	851,544	0.452	385,621.700	
IMPERIAL BRANDS PLC	11,926	17.425	207,810.550	
CENTRICA PLC	72,184	1.171	84,563.550	
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	1,155	39.420	45,530.100	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	26,430	25.700	679,251.000	



	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	3,483	18.795	65,462.980	
	HSBC HOLDINGS PLC	241,675	6.108	1,476,150.900	
	ANGLO AMERICAN PLC	14,524	25.825	375,082.300	
	MONDI PLC	5,248	12.620	66,229.760	
	COMPASS GROUP PLC	20,669	21.800	450,584.200	
	PERSIMMON PLC	3,969	11.685	46,377.760	
	BT GROUP PLC	75,578	1.368	103,390.700	
	COCA-COLA HBC AG-DI	2,574	23.380	60,180.120	
	BURBERRY GROUP PLC	4,508	22.610	101,925.880	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	2,078	55.400	115,121.200	
	INTERTEK GROUP PLC	1,713	43.940	75,269.220	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	4,564	86.580	395,151.120	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2,039	19.000	38,741.000	
	ADMIRAL GROUP PLC	1,570	22.510	35,340.700	
	ANTOFAGASTA PLC	6,056	15.600	94,473.600	
	ABRDN PLC	27,775	2.167	60,188.420	
	EXPERIAN PLC	11,460	29.740	340,820.400	
イギリス・ポンド 小計				21,955,161.370	(3,901,871,279)
イスラエル・ シュケル	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	14,335	18.840	270,071.400	
	AZRIELI GROUP LTD	530	215.600	114,268.000	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	1,279	147.000	188,013.000	
	ICL GROUP LTD	8,294	20.610	170,939.340	
	ELBIT SYSTEMS LTD	300	739.000	221,700.000	
	BANK HAPOALIM BM	15,160	31.050	470,718.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	24,049	27.110	651,968.390	
	NICE LTD	742	818.200	607,104.400	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,883	129.000	242,907.000	
イスラエル・シュケル 小計				2,937,689.530	(115,094,268)
オーストラリ ア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	23,727	5.060	120,058.620	
	TELSTRA GROUP LTD	42,351	4.350	184,226.850	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	38,283	22.920	877,446.360	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	30,136	3.610	108,790.960	
	BHP GROUP LTD	62,531	45.900	2,870,172.900	
	SOUTH32 LTD	64,500	3.900	251,550.000	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	24,185	34.650	838,010.250	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	21,722	21.700	471,367.400	

NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	39,707	25.510	1,012,925.570	
WESTPAC BANKING CORP	44,052	20.560	905,709.120	
SANTOS LTD	34,414	7.290	250,878.060	
RIO TINTO LTD	4,751	116.150	551,828.650	
ORIGIN ENERGY LTD	18,280	8.490	155,197.200	
AURIZON HOLDINGS LTD	19,619	3.570	70,039.830	
PILBARA MINERALS LTD	30,083	4.880	146,805.040	
XERO LTD	1,426	111.340	158,770.840	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	2,748	31.790	87,358.920	
COLES GROUP LTD	16,386	17.890	293,145.540	
WISETECH GLOBAL LTD	1,645	78.300	128,803.500	
IDP EDUCATION LTD	2,088	23.680	49,443.840	
IGO LTD	8,081	15.140	122,346.340	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	16,320	13.040	212,812.800	
REECE LTD	2,322	18.790	43,630.380	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	13,906	5.930	82,462.580	
SEEK LTD	4,813	21.600	103,960.800	
TREASURY WINE ESTATES LTD	8,616	11.420	98,394.720	
NEWCREST MINING LTD	10,878	26.080	283,698.240	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	21,692	97.370	2,112,150.040	
AMPOL LTD	4,605	30.530	140,590.650	
ORICA LTD	4,783	15.160	72,510.280	
QBE INSURANCE GROUP LTD	20,961	15.120	316,930.320	
WOOLWORTHS GROUP LTD	16,085	38.370	617,181.450	
QANTAS AIRWAYS LTD	6,373	6.390	40,723.470	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	4,796	39.090	187,475.640	
MACQUARIE GROUP LTD	4,572	178.050	814,044.600	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	7,793	38.080	296,757.440	
CSL LTD	6,113	287.250	1,755,959.250	
WESFARMERS LTD	14,007	48.200	675,137.400	
COCHLEAR LTD	1,039	237.470	246,731.330	
BLUESCOPE STEEL LTD	5,024	20.530	103,142.720	
SUNCORP GROUP LTD	14,504	13.140	190,582.560	
ASX LTD	2,260	60.820	137,453.200	
COMPUTERSHARE LTD	6,054	22.820	138,152.280	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	27,097	5.230	141,717.310	
SONIC HEALTHCARE LTD	5,223	35.010	182,857.230	
BRAMBLES LTD	21,201	13.770	291,937.770	
MINERAL RESOURCES LTD	1,881	71.320	134,152.920	

	RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,064	57.500	118,680.000	
	REA GROUP LTD	608	132.500	80,560.000	
オーストラリア・ドル 小計				19,275,263.170 (1,838,281,848)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	10,376	65.040	674,855.040	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	4,176	44.700	186,667.200	
	IMPERIAL OIL LTD	3,068	66.190	203,070.920	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	253	2,758.400	697,875.200	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	3,305	101.680	336,052.400	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	5,069	59.430	301,250.670	
	INTACT FINANCIAL CORP	1,951	197.870	386,044.370	
	BCE INC	668	60.370	40,327.160	
	FRANCO-NEVADA CORP	2,414	192.950	465,781.300	
	SUNCOR ENERGY INC	15,297	39.730	607,749.810	
	METRO INC/CN	2,377	71.100	169,004.700	
	NATIONAL BANK OF CANADA	3,895	98.800	384,826.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	14,637	66.310	970,579.470	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	11,245	57.640	648,161.800	
	TORONTO-DOMINION BANK	21,650	79.920	1,730,268.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	3,335	38.470	128,297.450	
	ROYAL BANK OF CANADA	16,209	125.180	2,029,042.620	
	TOURMALINE OIL CORP	3,656	59.570	217,787.920	
	TC ENERGY CORP	11,792	54.440	641,956.480	
	PEMBINA PIPELINE CORP	6,494	41.140	267,163.160	
	BARRICK GOLD CORP	20,761	22.370	464,423.570	
	CAE INC	3,752	27.720	104,005.440	
	THOMSON REUTERS CORP	1,968	169.020	332,631.360	
	EMPIRE CO LTD 'A'	1,800	34.690	62,442.000	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	631	106.190	67,005.890	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,560	62.760	97,905.600	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	4,700	20.340	95,598.000	
	HYDRO ONE LTD	4,866	37.290	181,453.140	
	LOBLAW COMPANIES LTD	1,861	117.020	217,774.220	
	NORTHLAND POWER INC	2,632	27.660	72,801.120	
WSP GLOBAL INC	1,457	175.780	256,111.460		
TOROMONT INDUSTRIES LTD	974	107.760	104,958.240		
PARKLAND CORP	1,621	33.810	54,806.010		

QUEBECOR INC -CL B	1,949	33.250	64,804.250	
EMERA INC	3,524	54.800	193,115.200	
TFI INTERNATIONAL INC	924	141.370	130,625.880	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	2,193	34.770	76,250.610	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	5,043	58.410	294,561.630	
BRP INC/CA- SUB VOTING	403	107.500	43,322.500	
IVANHOE MINES LTD-CL A	7,402	11.860	87,787.720	
AGNICO EAGLE MINES LTD	5,983	66.870	400,083.210	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	6,997	11.130	77,876.610	
AIR CANADA	1,700	23.540	40,018.000	
KINROSS GOLD CORP	14,757	6.480	95,625.360	
BANK OF MONTREAL	8,204	118.270	970,287.080	
POWER CORP OF CANADA	6,972	35.080	244,577.760	
SHOPIFY INC - CLASS A	14,231	87.850	1,250,193.350	
NUTRIEN LTD	6,174	78.040	481,818.960	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	1,532	44.100	67,561.200	
CAMECO CORP	4,390	41.630	182,755.700	
FIRSTSERVICE CORP	422	196.400	82,880.800	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	1,865	50.010	93,268.650	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	772	39.650	30,609.800	
TELUS CORP	600	25.480	15,288.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	5,374	57.780	310,509.720	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	623	171.240	106,682.520	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	13,870	73.930	1,025,409.100	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	274	980.810	268,741.940	
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,947	74.970	295,906.590	
WESTON (GEORGE) LTD	800	153.250	122,600.000	
PAN AMERICAN SILVER CORP	2,615	20.090	52,535.350	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	1,000	103.030	103,030.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	7,751	67.360	522,107.360	
ENBRIDGE INC	24,358	49.160	1,197,439.280	
BROOKFIELD CORP	16,387	44.100	722,666.700	
MANULIFE FINANCIAL CORP	21,041	25.670	540,122.470	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	10,962	103.610	1,135,772.820	
IA FINANCIAL CORP INC	1,609	91.120	146,612.080	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	2,364	40.230	95,103.720	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	6,838	155.490	1,063,240.620	
CGI INC - CLASS A	2,956	139.850	413,396.600	
ONEX CORPORATION	1,104	70.150	77,445.600	

	IGM FINANCIAL INC	1,318	41.010	54,051.180	
	TMX GROUP LTD	3,490	29.850	104,176.500	
	OPEN TEXT CORP	3,210	56.000	179,760.000	
	SAPUTO INC	2,900	31.270	90,683.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	7,781	30.960	240,899.760	
	FORTIS INC	5,938	56.490	335,437.620	
	RB GLOBAL INC	2,046	75.880	155,250.480	
	LUNDIN MINING CORP	6,600	10.730	70,818.000	
	CENOVUS ENERGY INC	18,231	22.160	403,998.960	
	DOLLARAMA INC	3,074	85.870	263,964.380	
	ALTAGAS LTD	3,201	24.540	78,552.540	
	KEYERA CORP	2,200	30.520	67,144.000	
	ARC RESOURCES LTD	7,734	16.940	131,013.960	
カナダ・ドル 小計				28,497,062.840 (3,000,740,718)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	30,400	3.360	102,144.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	14,900	28.070	418,243.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	24,300	31.160	757,188.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	13,750	7.600	104,500.000	
	KEPPEL CORP LTD	17,300	6.690	115,737.000	
	UOL GROUP LTD	3,000	6.700	20,100.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	5,200	6.950	36,140.000	
	SEATRUM	330,171	0.128	42,261.880	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	1,200	33.490	40,188.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	44,700	12.430	555,621.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	130,000	0.950	123,500.000	
	VENTURE CORP LTD	3,200	15.190	48,608.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	112,400	2.490	279,876.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	14,100	3.710	52,311.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	11,800	9.700	114,460.000	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	27,800	4.020	111,756.000		
シンガポール・ドル 小計				2,922,633.880 (305,649,051)	
スイス・フラン	DUFRY AG-REG	1,251	40.360	50,490.360	
	UBS GROUP AG-REG	39,677	18.485	733,429.340	
	ROCHE HOLDING AG-BR	324	295.800	95,839.200	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	89	709.000	63,101.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	1,754	28.470	49,936.380	

ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	8,441	274.550	2,317,476.550	
SIKA AG-REG	1,670	259.700	433,699.000	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	113,400.000	226,800.000	
ABB LTD-REG	19,516	35.410	691,061.560	
SWISS RE AG	3,723	88.460	329,336.580	
NESTLE SA-REG	33,621	106.520	3,581,308.920	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	256	887.200	227,123.200	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	494	199.200	98,404.800	
JULIUS BAER GROUP LTD	2,684	58.140	156,047.760	
SGS SA-REG	2,300	85.100	195,730.000	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	467	192.100	89,710.700	
TEMENOS AG - REG	793	75.980	60,252.140	
HELVETIA HOLDING AG-REG	471	125.600	59,157.600	
VAT GROUP AG	339	392.600	133,091.400	
BKW AG	250	148.300	37,075.000	
ALCON INC	6,230	71.800	447,314.000	
SIG GROUP N AG	3,400	25.620	87,108.000	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	377	265.000	99,905.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,779	426.400	758,565.600	
BALOISE HOLDING AG - REG	550	141.400	77,770.000	
CLARIANT AG-REG	2,552	13.140	33,533.280	
NOVARTIS AG-REG	24,992	89.660	2,240,782.720	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	41	1,739.000	71,299.000	
BACHEM HOLDING AG-REG B	390	87.000	33,930.000	
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	6,182	147.050	909,063.100	
SWISSCOM AG-REG	324	552.200	178,912.800	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	357	95.550	34,111.350	
GEBERIT AG-REG	469	491.200	230,372.800	
GIVAUDAN-REG	107	2,884.000	308,588.000	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,625	137.000	222,625.000	
SONOVA HOLDING AG-REG	613	237.600	145,648.800	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	1,797	50.740	91,179.780	
LONZA GROUP AG-REG	860	569.000	489,340.000	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	450	50.200	22,590.000	
HOLCIM LTD	6,754	59.860	404,294.440	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	329	540.600	177,857.400	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	640	260.000	166,400.000	
SWISS PRIME SITE-REG	946	78.150	73,929.900	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	8	11,240.000	89,920.000	

スイス・フラン 小計				17,024,112.460 (2,652,697,204)	
スウェーデン・ クローナ	SAGAX CLASS B	2,020	230.800	466,216.000	
	INVESTOR CLASS A	6,256	214.200	1,340,035.200	
	VOLVO CAR CLASS B	7,177	44.660	320,524.820	
	ERICSSON LM-B SHS	37,689	56.940	2,146,011.660	
	VOLVO AB-B SHS	18,333	219.050	4,015,843.650	
	SKF AB-B SHARES	4,000	199.150	796,600.000	
	TELE2 AB-B SHS	7,026	92.420	649,342.920	
	GETINGE AB-B SHS	2,869	247.500	710,077.500	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	21,549	118.550	2,554,633.950	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	19,635	89.760	1,762,437.600	
	SWEDBANK AB - A SHARES	10,821	175.350	1,897,462.350	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	8,485	145.600	1,235,416.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	7,320	148.050	1,083,726.000	
	SKANSKA AB-B SHS	3,709	150.100	556,720.900	
	SANDVIK AB	15,440	213.700	3,299,528.000	
	INVESTOR AB-B SHS	23,764	214.450	5,096,189.800	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	36,115	162.850	5,881,327.750	
	VOLVO AB-A SHS	4,359	226.000	985,134.000	
	HOLMEN AB-B SHARES	1,114	412.400	459,413.600	
	SECURITAS AB-B SHS	4,905	84.580	414,864.900	
	TELIA CO AB	29,088	23.980	697,530.240	
	ALFA LAVAL AB	3,803	391.200	1,487,733.600	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	20,329	140.750	2,861,306.750	
	ASSA ABLOY AB-B	13,477	260.100	3,505,367.700	
	SAAB AB-B	800	576.200	460,960.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	2,638	291.400	768,713.200	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	6,420	42.440	272,464.800	
	INDUTRADE AB	3,600	264.100	950,760.000	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	1,911	224.400	428,828.400	
	LUNDBERGS AB-B SHS	948	458.100	434,278.800	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	2,048	224.100	458,956.800		
LIFCO AB-B SHS	2,924	233.900	683,923.600		
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	21,251	110.100	2,339,735.100		
BEIJER REF AB	3,500	161.300	564,550.000		
ESSITY AKTIEBOLAG-B	8,503	279.700	2,378,289.100		
EMBRACER GROUP AB	7,090	26.490	187,814.100		

	BOLIDEN AB	3,171	324.200	1,028,038.200	
	EPIROC AB-A	9,930	203.100	2,016,783.000	
	EPIROC AB-B	4,015	173.600	697,004.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	5,400	89.580	483,732.000	
	NORDEA BANK ABP	36,060	112.440	4,054,586.400	
	EQT AB	3,365	222.300	748,039.500	
	EVOLUTION AB	2,481	1,408.400	3,494,240.400	
	KINNEVIK AB - B	3,003	153.000	459,459.000	
	HEXAGON AB-B SHS	27,767	131.350	3,647,195.450	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	1,216	290.500	353,248.000	
スウェーデン・クローナ 小計				71,135,044.740 (931,157,736)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	21,372	1,091.200	23,321,126.400	
	DANSKE BANK A/S	8,002	162.000	1,296,324.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	39	12,460.000	485,940.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	13,340	195.460	2,607,436.400	
	CARLSBERG AS-B	1,206	1,066.000	1,285,596.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	2,464	338.100	833,078.400	
	COLOPLAST-B	1,400	846.800	1,185,520.000	
	DSV PANALPINA A/S	2,612	1,355.000	3,539,260.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	98	1,784.000	174,832.000	
	DEMANT A/S	614	290.800	178,551.200	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	58	12,620.000	731,960.000	
	TRYG A/S	4,074	154.600	629,840.400	
	PANDORA A/S	1,128	585.000	659,880.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,262	509.000	642,358.000	
	GENMAB A/S	877	2,665.000	2,337,205.000	
ORSTED A/S	2,746	657.400	1,805,220.400		
デンマーク・クローネ 小計				41,714,128.200 (851,802,498)	
ニュージーランド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	15,000	5.420	81,300.000	
	MERCURY NZ LTD	12,380	6.365	78,798.700	
	EBOS GROUP LTD	2,056	35.640	73,275.840	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	23,635	5.120	121,011.200	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	13,289	8.290	110,165.810	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	7,238	23.790	172,192.020	
ニュージーランド・ドル 小計				636,743.570 (55,352,118)	



ノルウェー・ク ローネ	DNB BANK	11,049	192.900	2,131,352.100	
	NORSK HYDRO ASA	20,813	73.420	1,528,090.460	
	ORKLA ASA	11,618	76.940	893,888.920	
	TELENOR ASA	8,746	109.350	956,375.100	
	EQUINOR ASA	13,175	319.250	4,206,118.750	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,112	366.800	774,681.600	
	MOWI ASA	4,677	186.500	872,260.500	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,000	177.100	354,200.000	
	AKER BP ASA	3,655	260.300	951,396.500	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	1,203	468.400	563,485.200	
	SALMAR ASA	728	467.800	340,558.400	
	ADEVINTA ASA	3,382	77.600	262,443.200	
ノルウェー・クローネ 小計				13,834,850.730 (182,066,636)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	10,023	20.070	201,161.610	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	6,557	32.460	212,840.220	
	EXOR NV	1,300	81.460	105,898.000	
	DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	1,320	117.250	154,770.000	
	CORPORACION ACCIONA ENERGIAS RENOV	781	31.520	24,617.120	
	DSM FIRMENICH AG	2,300	99.000	227,700.000	
	BAYER AG-REG	10,947	51.800	567,054.600	
	EVONIK INDUSTRIES AG	2,431	18.290	44,462.990	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	27,677	9.930	274,832.610	
	COMMERZBANK AG	14,830	10.185	151,043.550	
	VOLKSWAGEN AG	341	160.700	54,798.700	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	1,918	131.740	252,677.320	
	SIEMENS AG-REG	8,545	164.340	1,404,285.300	
	E.ON SE	28,880	11.275	325,622.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	3,913	112.900	441,777.700	
	GEA GROUP AG	1,908	39.700	75,747.600	
	CONTINENTAL AG	1,272	71.900	91,456.800	
	BASF SE	10,278	46.835	481,370.130	
	ALLIANZ SE-REG	4,483	209.750	940,309.250	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	2,437	74.200	180,825.400	
RHEINMETALL AG	502	245.300	123,140.600		
RWE AG	8,649	39.950	345,527.550		

DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	6,613	9.476	62,664.780
BRENNTAG SE	2,259	74.140	167,482.260
FRESENIUS SE & CO KGAA	4,835	25.570	123,630.950
SAP SE	11,636	125.480	1,460,085.280
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,535	327.400	502,559.000
ZALANDO SE	2,514	26.420	66,419.880
HEIDELBERG MATERIALS AG	1,641	73.540	120,679.140
COVESTRO AG	3,046	40.820	124,337.720
RATIONAL AG	74	641.500	47,471.000
SARTORIUS AG-VORZUG	279	340.200	94,915.800
TALANX AG	804	53.800	43,255.200
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	1,740	57.940	100,815.600
DELIVERY HERO SE	2,666	36.485	97,269.010
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	560	111.400	62,384.000
BECHTLE AG	819	38.610	31,621.590
NEMETSCHEK SE	789	72.500	57,202.500
SCOUT24 AG	1,083	58.300	63,138.900
SIEMENS HEALTHINEERS AG	3,230	52.740	170,350.200
KNORR-BREMSE AG	926	66.680	61,745.680
HELLOFRESH SE	1,814	18.015	32,679.210
SIEMENS ENERGY AG	4,732	23.700	112,148.400
BEIERSDORF AG	1,147	119.450	137,009.150
MERCK KGAA	1,752	168.150	294,598.800
ADIDAS AG	1,921	174.700	335,598.700
PUMA SE	1,295	51.700	66,951.500
HENKEL AG & CO KGAA	1,311	65.700	86,132.700
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	35,905	19.142	687,293.510
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	2,341	43.250	101,248.250
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	9,952	75.350	749,883.200
QIAGEN N.V.	2,521	42.340	106,739.140
INFINEON TECHNOLOGIES AG	14,156	38.860	550,102.160
HANNOVER RUECK SE	939	191.250	179,583.750
DEUTSCHE POST AG-REG	10,907	43.650	476,090.550
DEUTSCHE BOERSE AG	2,014	167.000	336,338.000
MTU AERO ENGINES AG	763	226.300	172,666.900
WACKER CHEMIE AG	232	121.550	28,199.600
SYMRISE AG	1,509	92.720	139,914.480
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	14,105	2.565	36,179.320
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	733	103.300	75,718.900

VONOVIA SE	7,144	18.905	135,057.320
LEG IMMOBILIEN SE	869	55.140	47,916.660
KONINKLIJKE PHILIPS NV	13,499	18.642	251,648.350
NN GROUP NV	3,860	33.220	128,229.200
ARCELORMITTAL	6,975	26.185	182,640.370
HEINEKEN NV	3,544	93.940	332,923.360
AEGON NV	26,133	4.550	118,905.150
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	12,407	29.680	368,239.760
AKZO NOBEL N.V.	2,168	72.820	157,873.760
WOLTERS KLUWER	3,582	113.950	408,168.900
ING GROEP NV	40,674	12.312	500,778.280
KONINKLIJKE KPN NV	37,607	3.084	115,979.980
ASML HOLDING NV	4,465	681.700	3,043,790.500
ABN AMRO BANK NV-CVA	4,030	14.045	56,601.350
IMCD NV	715	135.350	96,775.250
ADYEN NV	226	1,625.000	367,250.000
JUST EAT TAKEAWAY	2,381	13.134	31,272.050
PROSUS NV	9,055	67.710	613,114.050
JDE PEET'S NV	1,476	27.440	40,501.440
ASM INTERNATIONAL NV	555	411.150	228,188.250
RANDSTAD NV	1,490	48.290	71,952.100
HEINEKEN HOLDING NV	1,557	79.500	123,781.500
OCI NV	1,197	21.170	25,340.490
TOTALENERGIES SE	26,638	53.910	1,436,054.580
MICHELIN (CGDE)	8,584	27.970	240,094.480
AIR LIQUIDE SA	5,807	159.580	926,681.060
KERING	827	523.000	432,521.000
SCHNEIDER ELECTRIC SE	5,969	166.260	992,405.940
BOUYGUES SA	2,721	30.120	81,956.520
BNP PARIBAS	12,231	57.520	703,527.120
THALES SA	1,235	131.850	162,834.750
DANONE	6,944	53.940	374,559.360
CARREFOUR SA	8,563	16.495	141,246.680
VIVENDI	8,930	8.242	73,601.060
L'OREAL	2,676	412.200	1,103,047.200
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	5,911	56.740	335,390.140
LEGRAND SA	3,629	92.560	335,900.240
PERNOD RICARD SA	2,262	203.700	460,769.400
EURAZEO SE	400	66.400	26,560.000

SOCIETE GENERALE SA	11,436	23.515	268,917.540
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	3,103	850.000	2,637,550.000
ACCOR SA	1,850	33.510	61,993.500
CAPGEMINI SE	2,223	177.250	394,026.750
VALEO SA	2,245	21.140	47,459.300
PUBLICIS GROUPE	2,918	74.540	217,507.720
BUREAU VERITAS SA	3,227	25.010	80,707.270
EIFFAGE	945	100.250	94,736.250
SODEXO SA	1,085	101.600	110,236.000
IPSEN	640	110.700	70,848.000
AMUNDI SA	1,005	54.700	54,973.500
TELEPERFORMANCE	745	160.200	119,349.000
EURONEXT NV	929	65.800	61,128.200
EUROFINS SCIENTIFIC	1,480	60.220	89,125.600
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	314	273.300	85,816.200
SEB SA	216	88.400	19,094.400
ESSILORLUXOTTICA	3,241	167.400	542,543.400
DASSAULT AVIATION SA	220	169.600	37,312.000
WORLDLINE SA	2,521	35.700	89,999.700
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	1,700	36.960	62,832.000
AXA SA	20,577	26.655	548,479.930
EDENRED	3,007	61.640	185,351.480
RENAULT SA	2,861	35.575	101,780.070
HERMES INTERNATIONAL	349	1,973.000	688,577.000
STMICROELECTRONICS NV	8,570	46.160	395,591.200
REMY COINTREAU	253	145.500	36,811.500
DASSAULT SYSTEMES SE	9,270	40.875	378,911.250
WENDEL	331	99.700	33,000.700
ORANGE	26,943	10.308	277,728.440
ALSTOM	3,668	27.190	99,732.920
SANOFI	12,678	93.980	1,191,478.440
VINCI SA	5,934	108.760	645,381.840
AIRBUS SE	6,636	129.520	859,494.720
VEOLIA ENVIRONNEMENT	7,989	29.150	232,879.350
CREDIT AGRICOLE SA	14,609	10.960	160,114.640
BIOMERIEUX	457	91.820	41,961.740
ENGIE	24,686	14.296	352,911.050
SAFRAN SA	3,777	138.440	522,887.880
ARKEMA	650	85.000	55,250.000

ADP	350	138.200	48,370.000
GETLINK SE	4,973	15.685	78,001.500
BOLLORE	14,302	5.615	80,305.730
UCB SA	1,550	83.940	130,107.000
KBC GROUP NV	3,011	63.640	191,620.040
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,579	73.380	115,867.020
SOLVAY SA	1,154	108.150	124,805.100
UMICORE	2,270	27.930	63,401.100
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	9,478	52.320	495,888.960
AGEAS	1,887	38.160	72,007.920
D'ETEREN GROUP	296	173.000	51,208.000
ELIA GROUP SA/NV	502	114.800	57,629.600
SOFINA	146	205.200	29,959.200
ARGENX SE	768	364.200	279,705.600
PRYSMIAN SPA	2,949	37.450	110,440.050
ASSICURAZIONI GENERALI	15,678	18.930	296,784.540
MEDIOBANCA SPA	7,465	11.310	84,429.150
TENARIS SA	3,992	12.930	51,616.560
UNICREDIT SPA	21,313	19.122	407,547.180
TELECOM ITALIA SPA	108,503	0.257	27,961.220
INTESA SANPAOLO	175,841	2.350	413,226.350
POSTE ITALIANE SPA	6,465	10.095	65,264.170
MONCLER SPA	2,435	65.680	159,930.800
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	1,285	44.980	57,799.300
ENI SPA	28,895	12.986	375,230.470
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	5,546	12.850	71,266.100
DIASORIN SPA	277	97.860	27,107.220
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	3,308	11.815	39,084.020
NEXI SPA	6,511	7.396	48,155.350
AMPLIFON SPA	1,440	35.230	50,731.200
ENEL SPA	95,439	6.108	582,941.410
SNAM SPA	24,300	5.008	121,694.400
TERNA SPA	15,815	8.010	126,678.150
CNH INDUSTRIAL NV	14,178	13.405	190,056.090
FINECOBANK SPA	8,077	12.465	100,679.800
STELLANTIS NV	24,430	15.766	385,163.380
FERRARI NV	1,599	281.300	449,798.700
TELEFONICA SA	67,494	3.633	245,205.700
ENDESA SA	3,760	20.920	78,659.200

BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	65,905	6.776	446,572.280	
IBERDROLA SA	68,049	11.570	787,326.930	
REPSOL SA	19,220	13.545	260,334.900	
GRIFOLS SA	2,795	11.815	33,022.920	
BANCO SANTANDER SA	185,035	3.250	601,363.750	
AMADEUS IT GROUP SA	5,529	69.640	385,039.560	
NATURGY ENERGY GROUP SA	1,668	26.620	44,402.160	
CAIXABANK SA	62,469	3.661	228,699.000	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,953	31.230	92,222.190	
AENA SME SA	866	148.300	128,427.800	
CELLNEX TELECOM SA	6,812	36.440	248,229.280	
ACCIONA SA	291	162.100	47,171.100	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	11,547	34.210	395,022.870	
ENAGAS SA	3,218	18.180	58,503.240	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	6,658	16.340	108,791.720	
FERROVIAL SA	7,127	28.840	205,542.680	
UPM-KYMMENE OYJ	7,536	29.870	225,100.320	
NOKIA OYJ	54,681	3.890	212,709.090	
WARTSILA OYJ ABP	8,227	10.970	90,250.190	
STORA ENSO OYJ-R SHS	5,911	12.385	73,207.730	
ELISA OYJ	2,212	50.600	111,927.200	
SAMPO OYJ-A SHS	5,826	42.660	248,537.160	
FORTUM OYJ	4,400	13.190	58,036.000	
KESKO OYJ-B SHS	3,470	19.190	66,589.300	
KONE OYJ-B	4,541	49.520	224,870.320	
NESTE OYJ	4,941	40.980	202,482.180	
ORION OYJ-CLASS B	1,315	39.480	51,916.200	
METSO CORPORATION	8,414	11.110	93,479.540	
VERBUND AG	876	75.150	65,831.400	
OMV AG	2,056	39.240	80,677.440	
ERSTE GROUP BANK AG	5,326	32.150	171,230.900	
VOESTALPINE AG	1,323	33.640	44,505.720	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	2,693	34.300	92,369.900	
AIB GROUP PLC	12,680	3.878	49,173.040	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	12,691	9.410	119,422.310	
KINGSPAN GROUP PLC	2,272	63.760	144,862.720	
JERONIMO MARTINS	2,900	24.740	71,746.000	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	42,061	4.613	194,027.390	
GALP ENERGIA SGPS SA	6,135	10.740	65,889.900	

	EDP RENOVAVEIS SA	3,029	19.430	58,853.470	
	KERRY GROUP PLC-A	2,368	90.120	213,404.160	
	CRH PLC	7,919	47.270	374,331.130	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	1,753	181.250	317,731.250	
ユーロ 小計				56,253,743.460 (8,559,007,067)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	17,500	41.150	720,125.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	27,000	51.350	1,386,450.000	
	MTR CORP	23,500	36.800	864,800.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	18,000	101.200	1,821,600.000	
	SINO LAND CO	54,000	9.700	523,800.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	33,552	48.850	1,639,015.200	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	5,000	53.550	267,750.000	
	CLP HOLDINGS LTD	23,000	56.550	1,300,650.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	18,565	23.550	437,205.750	
	HONG KONG & CHINA GAS	138,027	6.850	945,484.950	
	HANG SENG BANK LTD	9,000	112.800	1,015,200.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	15,500	19.960	309,380.000	
	WH GROUP LTD	89,500	4.150	371,425.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	15,900	311.200	4,948,080.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	27,000	13.040	352,080.000	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	22,000	12.400	272,800.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	32,000	19.760	632,320.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	23,552	44.550	1,049,241.600	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	5,500	41.750	229,625.000	
	AIA GROUP LTD	154,400	82.150	12,683,960.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	12,000	14.020	168,240.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	20,000	41.050	821,000.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	19,200	21.250	408,000.000	
ESR CAYMAN LTD	22,000	13.980	307,560.000		
SANDS CHINA LTD	29,000	28.500	826,500.000		
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	17,000	81.600	1,387,200.000		
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	43,000	24.100	1,036,300.000		
香港・ドル 小計				36,725,792.500 (658,493,459)	
合計				87,395,440,706 [87,395,440,706]	

## (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	1,805	343,238.800	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	4,043	448,368.700	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,658	89,913.340	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	1,365	313,704.300	
		EQUITY RESIDENTIAL	4,626	307,027.620	
		EQUINIX INC	1,097	851,030.660	
		AMERICAN TOWER CORP	5,614	1,083,614.280	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	7,895	137,846.700	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	4,367	152,102.610	
		KIMCO REALTY CORP	7,054	136,142.200	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	5,382	105,271.920	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	3,000	150,390.000	
		INVITATION HOMES INC	7,588	258,295.520	
		VICI PROPERTIES INC	10,288	333,125.440	
		VENTAS INC	5,394	249,850.080	
		WEYERHAEUSER CO	9,311	284,171.720	
		CROWN CASTLE INTL CORP	5,407	618,614.870	
		IRON MOUNTAIN INC	3,160	179,235.200	
		SUN COMMUNITIES INC	1,355	181,271.900	
		PROLOGIS INC	11,058	1,352,061.660	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,599	194,950.080	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,049	117,236.240	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	704	164,306.560	
		WELLTOWER INC	5,911	481,982.940	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	7,752	160,466.400	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,236	189,602.400	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,666	180,328.240	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	5,245	108,309.250	
		REALTY INCOME CORP	7,086	433,521.480	
		PUBLIC STORAGE	1,886	535,850.320	
		REGENCY CENTERS CORP	1,761	107,139.240	
		UDR INC	4,545	195,934.950	
WP CAREY INC	2,562	179,135.040			
DIGITAL REALTY TRUST INC	3,672	387,359.280			
EXTRA SPACE STORAGE INC	1,486	212,973.520			



アメリカ・ドル 小計			11,224,373.460 (1,575,789,790)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	7,946	47,183.340	
	SEGR0 PLC	17,001	128,425.550	
	BRITISH LAND CO PLC	9,799	32,797.250	
イギリス・ポンド 小計			208,406.140 (37,037,939)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	12,537	98,666.190	
	LENLEASE GROUP	6,942	49,079.940	
	TRANSURBAN GROUP	40,110	572,369.700	
	APA GROUP	13,286	133,391.440	
	SCENTRE GROUP	64,017	165,804.030	
	GPT GROUP	21,774	87,531.480	
	MIRVAC GROUP	43,513	94,858.340	
	STOCKLAND	40,622	165,331.540	
	GOODMAN GROUP	19,586	385,648.340	
VICINITY CENTRES	50,371	93,690.060		
オーストラリア・ドル 小計			1,846,371.060 (176,088,408)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	831	41,500.140	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	925	18,398.250	
カナダ・ドル 小計			59,898.390 (6,307,300)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	47,500	126,825.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	82,826	163,167.220	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	30,000	49,800.000	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	37,600	62,416.000	
シンガポール・ドル 小計			402,208.220 (42,062,935)	
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,507	70,633.090	
	GECINA SA	578	56,644.000	
	KLEPIERRE	2,394	53,410.140	
	COVIVIO	353	16,322.720	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	1,846	48,697.480	

ユーロ 小計			245,707.430 (37,384,386)	
香港・ドル	LINK REIT	37,000	1,729,750.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	36,000	324,720.000	
香港・ドル 小計			2,054,470.000 (36,836,647)	
投資証券 合計			1,911,507,405 [1,911,507,405]	
合計			1,911,507,405 [1,911,507,405]	

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	97.6%	2.4%	73.7%
	投資証券 35銘柄			
イギリス・ポンド	株式 79銘柄	99.1%	0.9%	4.4%
	投資証券 3銘柄			
イスラエル・シケル	株式 9銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 49銘柄	91.3%	8.7%	2.3%
	投資証券 10銘柄			
カナダ・ドル	株式 85銘柄	99.8%	0.2%	3.4%
	投資証券 2銘柄			
シンガポール・ドル	株式 16銘柄	87.9%	12.1%	0.4%
	投資証券 4銘柄			
スイス・フラン	株式 44銘柄	100%	-%	3.0%
スウェーデン・クローナ	株式 46銘柄	100%	-%	1.0%
デンマーク・クローネ	株式 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 221銘柄	99.6%	0.4%	9.6%
	投資証券 5銘柄			

香港・ドル	株式	27銘柄	94.7%	5.3%	0.8%
	投資証券	2銘柄			

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA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7期計算期間(2022年6月16日から2023年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第6期 2022年6月15日現在	第7期 2023年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	15,947,114	14,369,720
親投資信託受益証券	6,122,858,909	7,555,467,003
未収入金	57,172,300	52,750,000
流動資産合計	6,195,978,323	7,622,586,723
資産合計	6,195,978,323	7,622,586,723
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	66,748,182	78,664,376
未払解約金	57,063,031	52,653,693
未払受託者報酬	756,913	668,972
未払委託者報酬	14,571,191	12,878,377
その他未払費用	189,134	167,166
流動負債合計	139,328,451	145,032,584
負債合計	139,328,451	145,032,584
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 3,513,062,218	1 3,575,653,475
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,543,587,654	3,901,900,664
(分配準備積立金)	484,590,080	906,552,736
元本等合計	6,056,649,872	7,477,554,139
純資産合計	6,056,649,872	7,477,554,139
負債純資産合計	6,195,978,323	7,622,586,723

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第6期		第7期	
	自 2021年6月16日	至 2022年6月15日	自 2022年6月16日	至 2023年6月15日
<b>営業収益</b>				
受取利息		-		3
有価証券売買等損益		793,429,035		886,952,866
営業収益合計		793,429,035		886,952,869
<b>営業費用</b>				
支払利息		3,112		1,684
受託者報酬		1,908,863		884,925
委託者報酬		36,747,068		17,036,428
その他費用		477,044		221,083
営業費用合計		39,136,087		18,144,120
<b>営業利益</b>		754,292,948		868,808,749
経常利益		754,292,948		868,808,749
<b>当期純利益</b>		754,292,948		868,808,749
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（ ）		669,501,924		56,127,041
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		4,348,264,600		2,543,587,654
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,883,431,590		3,404,420,833
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,883,431,590		3,404,420,833
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,706,151,378		2,892,379,237
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,706,151,378		2,892,379,237
分配金		1 66,748,182		1 78,664,376
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		2,543,587,654		3,901,900,664

## (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7期
	自2022年6月16日 至2023年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1. 1 期首元本額	6,496,771,590円	3,513,062,218円
期中追加設定元本額	2,411,536,407円	3,888,370,778円
期中一部解約元本額	5,395,245,779円	3,825,779,521円
2. 計算期間末日における受益権の 総数	3,513,062,218口	3,575,653,475口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第6期	第7期
	自2021年6月16日 至2022年6月15日	自2022年6月16日 至2023年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（67,199,486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（17,591,538円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,058,997,574円）及び分配準備積立金（466,547,238円）より分配対象額は2,610,335,836円（1万口当たり7,430.37円）であり、うち66,748,182円（1万口当たり190円）を分配金額としております。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（82,509,985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（842,425,805円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,995,347,928円）及び分配準備積立金（60,281,322円）より分配対象額は3,980,565,040円（1万口当たり11,132.41円）であり、うち78,664,376円（1万口当たり220円）を分配金額としております。</p>
------------	---	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第7期 自2022年6月16日 至2023年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。



## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第7期
	2023年6月15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6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15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	124,043,416	940,194,216
合計	124,043,416	940,194,216

## (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6期	第7期
2022年6月15日現在	2023年6月15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7期
自2022年6月16日
至2023年6月15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6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1口当たり純資産額	1.7240円	2.0912円
(1万口当たり純資産額)	(17,240円)	(20,912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	1,555,615,105	7,555,467,003	
親投資信託受益証券 合計			7,555,467,003	
合計			7,555,467,003	

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6月15日現在 金額 (円)	2023年6月15日現在 金額 (円)
資産の部		

流動資産		
預金	1,734,391,500	896,504,391
コール・ローン	3,211,057,221	6,759,745,232
株式	242,279,225,320	334,734,999,666
投資証券	6,260,515,772	7,355,904,073
派生商品評価勘定	66,752,670	216,082,079
未収入金	1,691,414	1,293,865
未収配当金	335,111,808	434,111,359
差入委託証拠金	3,743,259,264	6,818,551,422
流動資産合計	257,632,004,969	357,217,192,087
資産合計	257,632,004,969	357,217,192,087
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	30,826,108	1,770,268
未払解約金	110,728,500	245,222,600
流動負債合計	141,554,608	246,992,868
負債合計	141,554,608	246,992,868
純資産の部		
元本等		
元本	1 65,283,819,354	73,496,843,463
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	192,206,631,007	283,473,355,756
元本等合計	257,490,450,361	356,970,199,219
純資産合計	257,490,450,361	356,970,199,219
負債純資産合計	257,632,004,969	357,217,192,087

## 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6月16日 至2023年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価 方法	(1)株式

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

#### (2)投資証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

## 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法

### (1)先物取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

### (2)為替予約取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。

## 3. 収益及び費用の計上基準

### 受取配当金

原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1. 1 期首	2021年6月16日	2022年6月16日
期首元本額	58,443,353,703円	65,283,819,354円
期中追加設定元本額	13,080,204,385円	13,427,703,911円
期中一部解約元本額	6,239,738,734円	5,214,679,802円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国株式インデックスV	351,632,044円	294,550,637円
A		
ダイワ国内重視バランスファン	3,751,596円	2,653,445円
ド30VA(一般投資家私募)		
ダイワ国内重視バランスファン	45,554,421円	32,907,938円
ド50VA(一般投資家私募)		
ダイワ国際分散バランスファン	7,085,384円	4,853,233円
ド30VA(一般投資家私募)		
ダイワ国際分散バランスファン	200,924,115円	150,057,928円
ド50VA(一般投資家私募)		
外国株式インデックスファンド	52,414,761円	88,037,539円
(FOFs用)(適格機関投資家専		
用)		
ダイワバランスファンド2023-01	-円	105,196,680円
(適格機関投資家専用)		
ダイワファンドラップ 外国株式	519,977,583円	643,535,054円
インデックス エマージングプラ		
ス(為替ヘッジなし)		

ダイワファンドラップ 外国株式 インデックス(為替ヘッジな し)	2,749,365,946円	3,687,390,929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)	642,893,627円	596,634,111円
D - I ' s 外国株式インデック ス	17,708,759円	18,265,308円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2050	41,779,373円	50,201,604円
i F r e e 外国株式インデック ス(為替ヘッジなし)	5,050,402,867円	6,840,332,577円
i F r e e 8資産バランス	1,256,126,097円	1,467,364,616円
i F r e e 年金バランス	219,932,241円	284,439,971円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2060	-円	160,733円
D Cダイワ外国株式インデック ス	41,235,492,591円	45,291,687,841円
ダイワ・ライフ・バランス30	525,142,755円	528,148,677円
ダイワ・ライフ・バランス50	988,220,803円	1,053,632,399円
ダイワ・ライフ・バランス70	794,945,647円	923,487,719円
大和D C 海外株式インデックス ファンド	1,826,628,555円	1,964,340,492円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2030	12,452,171円	12,421,942円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2040	11,217,011円	12,657,977円
ダイワつみたてインデックス外 国株式	1,026,950,890円	1,755,886,236円
ダイワつみたてインデックスバ ランス30	1,923,475円	2,074,276円
ダイワつみたてインデックスバ ランス50	2,153,578円	2,262,603円
ダイワつみたてインデックスバ ランス70	4,269,698円	5,620,426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)	275,123円	5,906,694円
ダイワ世界バランスファンド4 0 V A	81,664,400円	66,467,884円

ダイワ世界バランスファンド6 0VA	153,538,731円	40,358,122円
ダイワ・バランスファンド35 VA	1,324,219,005円	1,076,709,877円
ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	68,591,146円	58,861,714円
ダイワバランスファンド2021-02 (適格機関投資家専用)	186,589,341円	160,197,575円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,064,643,760円	1,271,206,780円
ダイワ・ノーロード 外国株式 ファンド	387,018,353円	416,663,223円
ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワS MA専用)	1,552,370,293円	1,555,615,105円
ダイワ投信倶楽部外国株式イン デックス	2,786,345,980円	2,938,768,447円
ダイワライフスタイル25	11,032,136円	9,735,152円
ダイワライフスタイル50	44,105,366円	43,069,169円
ダイワライフスタイル75	34,479,732円	34,480,830円
計	65,283,819,354円	73,496,843,463円
2. 期末日における受益権の総数	65,283,819,354口	73,496,843,463口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2022年6月16日 至2023年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券



種類	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
株式	53,274,213,984	27,602,300,147
投資証券	1,311,383,962	203,753,147
合計	54,585,597,946	27,398,547,000

(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6月15日現在				2023年6月15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								
株値指数								
先物取引								
買建	8,699,946,162	-	8,674,276,604	25,669,558	15,125,719,800	-	15,224,191,321	98,471,521
合計	8,699,946,162	-	8,674,276,604	25,669,558	15,125,719,800	-	15,224,191,321	98,471,521

(注)

### 1. 時価の算定方法

株値指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

### 2. 株値指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## 2. 通貨関連

種類	2022年6月15日現在				2023年6月15日現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)	(円)	(円)		(円)	(円)

市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	2,832,228,390	-	2,893,824,510	61,596,120	6,874,421,770	-	6,990,262,060	115,840,290
アメリカ・ドル	983,803,400	-	1,024,850,120	41,046,720	3,871,800,380	-	3,903,675,930	31,875,550
イギリス・ポンド	211,045,900	-	210,682,290	363,610	397,116,650	-	407,514,000	10,397,350
オーストラリア・ドル	353,182,340	-	353,445,600	263,260	469,082,730	-	494,468,000	25,385,270
カナダ・ドル	254,487,500	-	260,206,750	5,719,250	695,610,640	-	713,864,000	18,253,360
スイス・フラン	268,806,800	-	270,078,600	1,271,800	534,308,160	-	544,740,000	10,431,840
ユーロ	760,902,450	-	774,561,150	13,658,700	906,503,210	-	926,000,130	19,496,920
合計	2,832,228,390	-	2,893,824,510	61,596,120	6,874,421,770	-	6,990,262,060	115,840,290

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1口当たり純資産額	3.9442円	4.8569円
(1万口当たり純資産額)	(39,442円)	(48,569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	5,500	157.430	865,865.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	14,100	238.560	3,363,696.000	
	FIRST SOLAR INC	4,700	193.030	907,241.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	8,300	164.180	1,362,694.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	6,200	105.750	655,650.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,000	126.550	379,650.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	21,100	33.540	707,694.000	
	ABBOTT LABORATORIES	80,866	103.250	8,349,414.500	
	HOWMET AEROSPACE INC	18,283	45.700	835,533.100	
	VERISK ANALYTICS INC	7,100	220.280	1,563,988.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	16,000	59.830	957,280.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	27,700	80.770	2,237,329.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,100	537.210	1,128,141.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	27,600	54.700	1,509,720.000	
	QORVO INC	4,620	103.600	478,632.000	
	AFLAC INC	26,800	68.760	1,842,768.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	5,600	167.640	938,784.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	7,900	87.080	687,932.000	
	ADOBE INC	21,320	479.530	10,223,579.600	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,900	67.800	603,420.000	
	LULULEMON ATHLETICA INC	5,400	377.210	2,036,934.000	
	GARMIN LTD	7,100	106.550	756,505.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	10,300	288.840	2,975,052.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	31,000	200.520	6,216,120.000	
	WR BERKLEY CORP	9,842	56.540	556,466.680	
	AUTOZONE INC	920	2,399.420	2,207,466.400	
	DOLLAR TREE INC	10,271	137.790	1,415,241.090	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	53,100	7.460	396,126.000	
	CELANESE CORP	4,950	116.350	575,932.500	
	DR HORTON INC	14,916	113.600	1,694,457.600	
DENTSPLY SIRONA INC	9,600	38.060	365,376.000		
AUTODESK INC	10,000	213.550	2,135,500.000		
MOODY'S CORP	7,700	340.710	2,623,467.000		

DEVON ENERGY CORP	30,600	48.950	1,497,870.000	
ALBEMARLE CORP	5,500	226.800	1,247,400.000	
ATMOS ENERGY CORP	6,700	117.070	784,369.000	
ALLIANT ENERGY CORP	11,700	53.130	621,621.000	
CITIGROUP INC	90,673	48.240	4,374,065.520	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	19,300	216.090	4,170,537.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	24,000	83.610	2,006,640.000	
DOMINO'S PIZZA INC	1,630	305.720	498,323.600	
HESS CORP	12,900	134.030	1,728,987.000	
DAVITA INC	2,750	97.480	268,070.000	
DANAHER CORP	32,350	238.450	7,713,857.500	
FORTIVE CORP	16,500	69.500	1,146,750.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	26,100	110.670	2,888,487.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	25,400	73.150	1,858,010.000	
BUNGE LTD	7,000	95.320	667,240.000	
TE CONNECTIVITY LTD	14,695	131.730	1,935,772.350	
APPLE INC	737,400	183.950	135,644,730.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	12,400	117.140	1,452,536.000	
BOEING CO/THE	26,500	216.900	5,747,850.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,315	99.970	731,280.550	
BECTON DICKINSON AND CO	13,199	253.330	3,343,702.670	
LEIDOS HOLDINGS INC	6,100	83.030	506,483.000	
NISOURCE INC	19,300	27.160	524,188.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	5,500	94.610	520,355.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	37,571	44.170	1,659,511.070	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	195,604	35.730	6,988,930.920	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	60,550	335.900	20,338,745.000	
ANSYS INC	4,000	334.310	1,337,240.000	
TRUIST FINANCIAL CORP	61,917	31.720	1,964,007.240	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	32,900	90.290	2,970,541.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	97,900	64.160	6,281,264.000	
JPMORGAN CHASE & CO	136,470	141.490	19,309,140.300	
T ROWE PRICE GROUP INC	10,500	111.140	1,166,970.000	
LKQ CORP	12,500	54.470	680,875.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	14,412	64.960	936,203.520	
CADENCE DESIGN SYS INC	12,700	236.060	2,997,962.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,900	318.930	1,562,757.000	
DOLLAR GENERAL CORP	10,200	162.120	1,653,624.000	
SERVICENOW INC	9,500	567.310	5,389,445.000	

CATERPILLAR INC	24,000	243.320	5,839,680.000	
BROWN & BROWN INC	11,300	64.600	729,980.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,700	41.210	482,157.000	
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,400	207.420	497,808.000	
CMS ENERGY CORP	13,600	60.420	821,712.000	
MOSAIC CO/THE	15,400	34.990	538,846.000	
DELTA AIR LINES INC	7,300	42.190	307,987.000	
CORNING INC	37,500	33.240	1,246,500.000	
CISCO SYSTEMS INC	190,750	50.960	9,720,620.000	
MORGAN STANLEY	58,352	87.980	5,133,808.960	
DECKERS OUTDOOR CORP	1,300	506.730	658,749.000	
MSCI INC	3,700	486.200	1,798,940.000	
FAIR ISAAC CORP	1,200	795.250	954,300.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,500	306.640	459,960.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	10,500	59.100	620,550.000	
BROADCOM INC	19,412	886.180	17,202,526.160	
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,200	226.280	497,816.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	3,100	135.000	418,500.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5,800	198.490	1,151,242.000	
ARAMARK	10,600	40.160	425,696.000	
DTE ENERGY COMPANY	9,600	112.950	1,084,320.000	
CENTENE CORP	25,507	64.650	1,649,027.550	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,800	138.810	666,288.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	22,100	27.100	598,910.000	
DARLING INGREDIENTS INC	7,500	64.590	484,425.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	10,000	209.790	2,097,900.000	
GARTNER INC	3,750	352.370	1,321,387.500	
SPLUNK INC	7,400	104.160	770,784.000	
DOMINION ENERGY INC	38,941	52.560	2,046,738.960	
MONSTER BEVERAGE CORP	36,600	58.480	2,140,368.000	
SMITH (A.O.) CORP	5,700	69.630	396,891.000	
DEERE & CO	13,100	399.050	5,227,555.000	
QUANTA SERVICES INC	6,800	185.090	1,258,612.000	
POOL CORP	1,800	345.400	621,720.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	12,384	101.160	1,252,765.440	
VMWARE INC-CLASS A	11,000	140.830	1,549,130.000	
BURLINGTON STORES INC	3,000	148.410	445,230.000	
NASDAQ INC	16,000	51.160	818,560.000	
VAIL RESORTS INC	1,900	249.620	474,278.000	

TARGA RESOURCES CORP	9,800	70.970	695,506.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,400	114.400	388,960.000	
WESTLAKE CORP	1,800	113.690	204,642.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	16,100	92.390	1,487,479.000	
COGNEX CORP	7,900	55.900	441,610.000	
WEBSTER FINANCIAL CORP	7,900	38.860	306,994.000	
TELEFLEX INC	2,200	244.530	537,966.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,900	174.390	680,121.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,500	354.690	1,241,415.000	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,000	370.870	370,870.000	
CATALENT INC	8,400	42.090	353,556.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	6,800	194.390	1,321,852.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,700	275.490	743,823.000	
CARLISLE COS INC	2,400	236.100	566,640.000	
IDEX CORP	3,500	207.860	727,510.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	36,800	75.420	2,775,456.000	
ROLLINS INC	11,607	40.890	474,610.230	
AECOM	6,200	86.200	534,440.000	
WATSCO INC	1,600	361.500	578,400.000	
GRACO INC	8,000	84.140	673,120.000	
AMETEK INC	10,700	153.600	1,643,520.000	
TORO CO	4,900	96.740	474,026.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,400	95.370	1,087,218.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,550	56.000	422,800.000	
HEICO CORP	2,000	164.840	329,680.000	
GENERAC HOLDINGS INC	2,800	119.550	334,740.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,800	410.990	739,782.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	12,100	90.330	1,092,993.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,000	392.100	784,200.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	20,660	527.200	10,891,952.000	
EPAM SYSTEMS INC	2,700	222.530	600,831.000	
RPM INTERNATIONAL INC	5,900	83.820	494,538.000	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	2,800	254.850	713,580.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,300	2,061.170	2,679,521.000	
UGI CORP	9,500	27.700	263,150.000	
CUMMINS INC	6,600	234.310	1,546,446.000	
ACTIVISION BLIZZARD INC	35,600	81.230	2,891,788.000	
CDW CORP/DE	6,300	176.580	1,112,454.000	
COSTAR GROUP INC	18,900	82.800	1,564,920.000	

OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,600	320.720	1,475,312.000	
MERCADOLIBRE INC	2,090	1,211.840	2,532,745.600	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,400	160.890	547,026.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	12,416	143.550	1,782,316.800	
DEXCOM INC	18,100	127.060	2,299,786.000	
NORDSON CORP	2,390	233.800	558,782.000	
COPART INC	20,000	86.340	1,726,800.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	8,000	126.780	1,014,240.000	
SEAGEN INC	6,500	196.210	1,275,365.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,400	322.460	1,096,364.000	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,700	205.610	760,757.000	
TRANSDIGM GROUP INC	2,590	810.860	2,100,127.400	
BIO-TECHNE CORP	7,320	74.870	548,048.400	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,600	94.220	433,412.000	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	9,400	100.620	945,828.000	
KINDER MORGAN INC	94,181	16.900	1,591,658.900	
HCA HEALTHCARE INC	10,200	284.200	2,898,840.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,800	276.150	497,070.000	
COTERRA ENERGY INC	35,500	24.260	861,230.000	
T-MOBILE US INC	28,327	128.050	3,627,272.350	
ZILLOW GROUP INC - C	7,150	46.120	329,758.000	
COCA-COLA CO/THE	191,450	60.860	11,651,647.000	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	10,100	65.460	661,146.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,350	117.640	864,654.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	14,000	26.920	376,880.000	
CSX CORP	95,400	33.090	3,156,786.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	4,100	226.980	930,618.000	
EXPEDIA GROUP INC	6,825	108.930	743,447.250	
AMAZON.COM INC	430,200	126.420	54,385,884.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	28,100	90.530	2,543,893.000	
EXXON MOBIL CORP	188,905	105.160	19,865,249.800	
AES CORP	31,200	20.740	647,088.000	
EVEREST RE GROUP LTD	2,000	341.110	682,220.000	
EOG RESOURCES INC	27,400	110.670	3,032,358.000	
EQT CORP	16,900	38.450	649,805.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	7,300	91.990	671,527.000	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	500	1,280.700	640,350.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	8,100	179.050	1,450,305.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	13,800	119.400	1,647,720.000	

FORD MOTOR CO	183,023	14.200	2,598,926.600	
EXACT SCIENCES CORP	8,300	93.060	772,398.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	7,137	17.220	122,899.140	
ENTEGRIS INC	7,000	113.230	792,610.000	
AERCAP HOLDINGS NV	8,200	60.660	497,412.000	
FORTINET INC	31,000	71.480	2,215,880.000	
MARKEL CORP	600	1,330.700	798,420.000	
NEXTERA ENERGY INC	94,280	73.400	6,920,152.000	
MASIMO CORP	2,300	161.350	371,105.000	
FREEPORT-MCMORAN INC	66,608	40.060	2,668,316.480	
INSULET CORP	3,200	283.590	907,488.000	
US BANCORP	71,700	32.100	2,301,570.000	
UNITED RENTALS INC	3,200	405.980	1,299,136.000	
F5 NETWORKS INC	2,800	149.720	419,216.000	
FASTENAL CO	26,600	55.440	1,474,704.000	
FISERV INC	29,133	120.000	3,495,960.000	
GENERAL ELECTRIC CO	50,806	104.700	5,319,388.200	
AXON ENTERPRISE INC	3,200	197.810	632,992.000	
PAYLOCITY HOLDING CORP	1,900	187.120	355,528.000	
GENERAL MOTORS CO	64,600	37.360	2,413,456.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	10,900	212.140	2,312,326.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	15,550	338.420	5,262,431.000	
FIRST HORIZON CORP	23,900	11.450	273,655.000	
ALPHABET INC-CL A	277,400	123.670	34,306,058.000	
ALPHABET INC-CL C	249,940	124.380	31,087,537.200	
OWENS CORNING	4,300	121.360	521,848.000	
GENERAL MILLS INC	27,300	80.650	2,201,745.000	
FIRSTENERGY CORP	25,318	38.820	982,844.760	
GENUINE PARTS CO	6,650	158.720	1,055,488.000	
FIFTH THIRD BANCORP	31,200	25.950	809,640.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	8,850	190.930	1,689,730.500	
HALLIBURTON CO	42,000	32.050	1,346,100.000	
REPLIGEN CORP	2,500	161.430	403,575.000	
HOME DEPOT INC	47,150	299.710	14,131,326.500	
ASSURANT INC	2,450	129.110	316,319.500	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	67,200	10.830	727,776.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,910	215.320	411,261.200	
HERSHEY CO/THE	6,900	260.590	1,798,071.000	
HUMANA INC	5,800	455.000	2,639,000.000	



NXP SEMICONDUCTORS NV	12,100	195.690	2,367,849.000	
HENRY SCHEIN INC	6,100	74.810	456,341.000	
HP INC	47,300	30.950	1,463,935.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	60,400	16.810	1,015,324.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	7,328	30.460	223,210.880	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	9,200	78.260	719,992.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	17,400	70.080	1,219,392.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	37,303	36.670	1,367,901.010	
ENPHASE ENERGY INC	6,400	179.200	1,146,880.000	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	42,300	137.200	5,803,560.000	
HUBBELL INC	2,500	315.450	788,625.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	15,300	31.800	486,540.000	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	5,900	66.030	389,577.000	
ZOETIS INC	21,500	165.650	3,561,475.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	10,699	181.380	1,940,584.620	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	6,800	92.070	626,076.000	
CHENIERE ENERGY INC	11,400	147.000	1,675,800.000	
HYATT HOTELS CORP - CL A	2,300	116.890	268,847.000	
ALLEGION PLC	4,050	116.770	472,918.500	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	6,800	121.000	822,800.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	12,973	18.230	236,497.790	
WASTE CONNECTIONS INC	12,037	136.830	1,647,022.710	
JUNIPER NETWORKS INC	15,000	31.680	475,200.000	
JM SMUCKER CO/THE	5,000	152.460	762,300.000	
JOHNSON & JOHNSON	121,000	161.560	19,548,760.000	
ABBVIE INC	82,172	136.230	11,194,291.560	
HOLOGIC INC	11,500	78.220	899,530.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	15,700	135.120	2,121,384.000	
KROGER CO	31,800	47.210	1,501,278.000	
KLA CORP	6,400	480.540	3,075,456.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	10,700	452.550	4,842,285.000	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,300	239.790	791,307.000	
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	10,500	39.700	416,850.000	
LOWE'S COS INC	27,700	214.860	5,951,622.000	
ELI LILLY & CO	37,585	447.720	16,827,556.200	
LAM RESEARCH CORP	6,280	630.030	3,956,588.400	
LOEWS CORP	9,100	58.120	528,892.000	

MCDONALD'S CORP	34,050	288.440	9,821,382.000	
3M CO	25,690	101.950	2,619,095.500	
META PLATFORMS INC CLASS A	103,100	273.350	28,182,385.000	
S&P GLOBAL INC	15,339	393.090	6,029,607.510	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,900	425.810	1,234,849.000	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	2,620	271.440	711,172.800	
ALCOA CORP	8,000	36.130	289,040.000	
PHILLIPS 66	21,400	95.700	2,047,980.000	
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	7,100	181.230	1,286,733.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	16,050	43.840	703,632.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	11,700	90.980	1,064,466.000	
METLIFE INC	30,600	53.940	1,650,564.000	
MARVELL TECHNOLOGY INC	39,900	62.960	2,512,104.000	
ARISTA NETWORKS INC	12,200	169.080	2,062,776.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,798	278.310	2,170,261.380	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,000	1,315.570	1,315,570.000	
BAKER HUGHES CO	47,223	29.940	1,413,856.620	
ROCKWELL AUTOMATION INC	5,300	313.120	1,659,536.000	
MERCK & CO. INC.	118,221	108.660	12,845,893.860	
DUPONT DE NEMOURS INC	22,551	69.940	1,577,216.940	
MASCO CORP	10,300	55.290	569,487.000	
M & T BANK CORP	7,799	121.900	950,698.100	
MARSH & MCLENNAN COS	23,070	178.100	4,108,767.000	
BLACK KNIGHT INC	7,350	57.000	418,950.000	
HEICO CORP-CLASS A	3,420	131.290	449,011.800	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	12,302	181.460	2,232,320.920	
WORKDAY INC-CLASS A	9,500	217.310	2,064,445.000	
BLOCK INC CLASS A	25,212	63.690	1,605,752.280	
TRANSUNION	9,000	75.510	679,590.000	
VISTRA CORP	17,600	24.810	436,656.000	
NOVOCURE LTD	4,350	45.000	195,750.000	
NETAPP INC	9,800	73.300	718,340.000	
NIKE INC -CL B	57,200	112.860	6,455,592.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	10,600	221.400	2,346,840.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	25,500	86.640	2,209,320.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,605	98.260	943,787.300	
ALLY FINANCIAL INC	14,200	28.370	402,854.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	6,700	447.900	3,000,930.000	
APTIV PLC	12,600	101.010	1,272,726.000	

NEWMONT CORP	37,011	42.100	1,558,163.100	
MCKESSON CORP	6,400	391.250	2,504,000.000	
XYLEM INC	11,300	111.780	1,263,114.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	72,300	93.060	6,728,238.000	
NUCOR CORP	11,700	150.640	1,762,488.000	
GODADDY INC - CLASS A	7,000	74.430	521,010.000	
EVERGY INC	10,750	58.920	633,390.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	33,524	58.470	1,960,148.280	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,250	217.130	271,412.500	
OKTA INC	7,200	74.420	535,824.000	
LIBERTY BROADBAND-C	5,600	75.200	421,120.000	
WIX.COM LTD	2,610	85.280	222,580.800	
EQUITABLE HOLDINGS INC	16,800	26.770	449,736.000	
KKR & CO INC	28,200	57.030	1,608,246.000	
PAYCHEX INC	15,100	111.540	1,684,254.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,900	909.640	2,637,956.000	
ALTRIA GROUP INC	83,200	43.950	3,656,640.000	
P G & E CORP	84,500	17.240	1,456,780.000	
PFIZER INC	263,013	39.360	10,352,191.680	
CIGNA CORP	13,900	263.770	3,666,403.000	
DELL TECHNOLOGIES -C	11,801	49.380	582,733.380	
XCEL ENERGY INC	25,600	62.490	1,599,744.000	
STERIS PLC	4,600	213.120	980,352.000	
SEA LTD-ADR	18,000	63.640	1,145,520.000	
FOX CORP - CLASS B	6,533	31.190	203,764.270	
FOX CORP - CLASS A	13,699	33.290	456,039.710	
STRYKER CORP	15,880	293.570	4,661,891.600	
DOW INC	33,018	52.810	1,743,680.580	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	5,100	71.600	365,160.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	11,000	68.400	752,400.000	
PARKER HANNIFIN CORP	6,000	367.550	2,205,300.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	85,300	41.270	3,520,331.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	10,900	201.280	2,193,952.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	109,867	146.420	16,086,726.140	
EXELON CORP	46,322	40.120	1,858,438.640	
INGERSOLL-RAND INC	18,908	64.120	1,212,380.960	
NVR INC	150	5,886.570	882,985.500	
CONOCOPHILLIPS	56,702	102.670	5,821,594.340	
TWILIO INC - A	8,300	66.290	550,207.000	

DOCUSIGN INC	9,400	54.100	508,540.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	2,500	319.910	799,775.000	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,800	66.060	449,208.000	
PEPSICO INC	64,200	183.170	11,759,514.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,020	151.900	306,838.000	
DROPBOX INC-CLASS A	12,100	25.100	303,710.000	
MONGODB INC	3,300	374.590	1,236,147.000	
SNAP INC - A	49,700	10.250	509,425.000	
CORTEVA INC	33,168	57.030	1,891,571.040	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	17,100	85.540	1,462,734.000	
AMCOR PLC	69,300	10.160	704,088.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	10,400	153.960	1,601,184.000	
ROKU INC	5,500	73.370	403,535.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	9,100	146.110	1,329,601.000	
ACCENTURE PLC-CL A	29,400	315.050	9,262,470.000	
PENTAIR PLC	7,475	60.590	452,910.250	
QUALCOMM INC	51,900	123.400	6,404,460.000	
INVESCO LTD	15,200	16.560	251,712.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,750	70.200	193,050.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	11,100	72.350	803,085.000	
DATADOG INC - CLASS A	11,600	96.280	1,116,848.000	
PINTEREST INC- CLASS A	27,700	24.420	676,434.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,000	771.110	3,855,550.000	
REPUBLIC SERVICES INC	10,300	143.560	1,478,668.000	
BOOKING HOLDINGS INC	1,800	2,609.790	4,697,622.000	
ROSS STORES INC	15,800	106.240	1,678,592.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,230	131.360	555,652.800	
RESMED INC	6,800	216.640	1,473,152.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	5,230	136.250	712,587.500	
ROBERT HALF INTL INC	4,900	71.370	349,713.000	
MODERNA INC	15,300	126.050	1,928,565.000	
HUBSPOT INC	2,180	503.940	1,098,589.200	
REVVITY INC	5,900	115.400	680,860.000	
CARRIER GLOBAL CORP	38,887	46.160	1,795,023.920	
OTIS WORLDWIDE CORP	19,238	87.510	1,683,517.380	
BILL HOLDINGS INC	4,500	114.240	514,080.000	
AVANTOR INC	31,500	19.560	616,140.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	10,200	30.630	312,426.000	
DYNATRACE INC	10,100	51.820	523,382.000	

TRADE DESK INC/THE -CLASS A	20,700	76.810	1,589,967.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	43,485	18.010	783,164.850	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	13,200	27.650	364,980.000	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	17,600	32.150	565,840.000	
MATCH GROUP INC	12,600	44.110	555,786.000	
CHEVRON CORP	83,718	157.090	13,151,260.620	
ZSCALER INC	4,100	157.550	645,955.000	
EDISON INTERNATIONAL	17,800	68.170	1,213,426.000	
ETSY INC	5,700	95.060	541,842.000	
TESLA INC	133,350	256.790	34,242,946.500	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	12,200	181.070	2,209,054.000	
GEN DIGITAL INC	26,700	18.350	489,945.000	
UNITY SOFTWARE INC	11,300	41.040	463,752.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,102	89.090	632,717.180	
SYNOPSYS INC	7,100	446.050	3,166,955.000	
CHEWY INC - CLASS A	4,350	39.710	172,738.500	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	12,700	68.870	874,649.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	5,005	335.250	1,677,926.250	
VIATRIS INC	55,821	9.760	544,812.960	
DOORDASH INC - A	11,950	71.500	854,425.000	
ROBLOX CORP -CLASS A	19,700	39.910	786,227.000	
AIRBNB INC-CLASS A	19,300	125.140	2,415,202.000	
CBRE GROUP INC - A	14,500	78.390	1,136,655.000	
SOUTHERN CO/THE	50,800	70.480	3,580,384.000	
SYSCO CORP	23,600	72.830	1,718,788.000	
TRAVELERS COS INC/THE	10,803	173.550	1,874,860.650	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,900	41.920	121,568.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,300	58.700	311,110.000	
STEEL DYNAMICS INC	8,150	104.690	853,223.500	
SCHLUMBERGER LTD	66,152	47.270	3,127,005.040	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,000	44.550	311,850.000	
AT&T INC	332,091	15.840	5,260,321.440	
APA CORP	14,400	33.650	484,560.000	
SOUTHWEST AIRLINES CO	6,950	33.570	233,311.500	
ON SEMICONDUCTOR CORP	20,100	92.740	1,864,074.000	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	10,000	49.190	491,900.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	11,400	245.850	2,802,690.000	
SEMPRA ENERGY	14,700	147.290	2,165,163.000	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	10,500	53.420	560,910.000	

CLARIVATE PLC	17,500	8.900	155,750.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	84,100	15.910	1,338,031.000	
UIPATH INC - CLASS A	17,500	17.990	314,825.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	8,850	65.290	577,816.500	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	7,800	53.900	420,420.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	42,300	177.120	7,492,176.000	
SALESFORCE.COM INC	46,566	209.400	9,750,920.400	
WESTROCK CO	11,900	29.230	347,837.000	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	18,609	76.150	1,417,075.350	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	32,034	64.500	2,066,193.000	
TERADYNE INC	7,300	110.360	805,628.000	
UNION PACIFIC CORP	28,380	202.740	5,753,761.200	
MARATHON OIL CORP	29,900	22.810	682,019.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	22,188	111.640	2,477,068.320	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	68,079	96.860	6,594,131.940	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	33,700	174.880	5,893,456.000	
IQVIA HOLDINGS INC	8,704	212.720	1,851,514.880	
AMEREN CORPORATION	12,200	82.840	1,010,648.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	43,466	459.860	19,988,274.760	
TOAST INC CLASS A	14,400	23.280	335,232.000	
VERISIGN INC	4,400	220.790	971,476.000	
LUCID GROUP INC	30,500	6.400	195,200.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	30,900	14.740	455,466.000	
VALERO ENERGY CORP	17,642	111.830	1,972,904.860	
ULTA BEAUTY INC	2,300	443.580	1,020,234.000	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	11,688	34.650	404,989.200	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,830	146.190	413,717.700	
ELEVANCE HEALTH INC	11,100	436.330	4,843,263.000	
WALT DISNEY CO/THE	85,062	92.450	7,863,981.900	
WELLS FARGO & CO	175,222	42.080	7,373,341.760	
WASTE MANAGEMENT INC	18,900	162.420	3,069,738.000	
WILLIAMS COS INC	56,800	30.200	1,715,360.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,100	218.040	1,112,004.000	
WHIRLPOOL CORP	2,400	145.960	350,304.000	
WALMART INC	69,000	156.870	10,824,030.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	9,800	142.010	1,391,698.000	
WYNN RESORTS LTD	4,800	103.500	496,800.000	

GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	92,000	3.400	312,800.000	
WABTEC CORP	8,411	101.660	855,062.260	
TJX COMPANIES INC	53,700	79.900	4,290,630.000	
WATERS CORP	2,700	262.080	707,616.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,400	280.380	672,912.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	34,200	31.510	1,077,642.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,963	228.400	1,133,549.200	
WESTERN DIGITAL CORP	14,900	40.460	602,854.000	
WEC ENERGY GROUP INC	14,700	90.530	1,330,791.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	23,200	61.930	1,436,776.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	75,750	223.440	16,925,580.000	
PPL CORP	34,300	26.860	921,298.000	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	15,324	93.200	1,428,196.800	
PULTEGROUP INC	10,350	73.250	758,137.500	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	107,753	13.670	1,472,983.510	
PPG INDUSTRIES INC	11,000	140.700	1,547,700.000	
NORTHERN TRUST CORP	9,700	74.250	720,225.000	
FERGUSON PLC	9,600	150.030	1,440,288.000	
NVIDIA CORP	115,080	429.970	49,480,947.600	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	18,613	126.520	2,354,916.760	
ASPEN TECHNOLOGY CORP	1,400	164.550	230,370.000	
TYSON FOODS INC-CL A	13,200	49.760	656,832.000	
NETFLIX INC	20,690	440.860	9,121,393.400	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	17,900	520.120	9,310,148.000	
NRG ENERGY INC	10,550	34.340	362,287.000	
GLOBE LIFE INC	4,255	107.000	455,285.000	
TEXTRON INC	9,400	65.290	613,726.000	
NEWS CORP - CLASS A	17,887	19.260	344,503.620	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	350	1,330.370	465,629.500	
OMNICOM GROUP	9,300	94.620	879,966.000	
JACOBS SOLUTIONS INC	5,920	115.290	682,516.800	
ORACLE CORP	75,533	122.270	9,235,419.910	
MASTERCARD INC - A	39,600	374.760	14,840,496.000	
ONEOK INC	20,800	60.430	1,256,944.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	5,000	456.440	2,282,200.000	
U HAUL NON VOTING SERIES N	4,600	48.730	224,158.000	
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	7,400	94.170	696,858.000	

CHESAPEAKE ENERGY CORP	5,200	79.760	414,752.000	
HF SINCLAIR CORP	7,300	44.600	325,580.000	
OVINTIV INC	11,300	36.880	416,744.000	
YUM! BRANDS INC	13,000	136.350	1,772,550.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	7,900	136.630	1,079,377.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	8,800	67.450	593,560.000	
BANK OF AMERICA CORP	335,301	29.120	9,763,965.120	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,200	398.720	877,184.000	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,800	94.410	830,808.000	
AMERICAN EXPRESS CO	29,500	174.470	5,146,865.000	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	16,935	78.530	1,329,905.550	
LINDE PLC	22,846	374.310	8,551,486.260	
ANALOG DEVICES INC	23,591	191.890	4,526,876.990	
ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	14,100	20.940	295,254.000	
MONDAYCOM LTD	900	182.910	164,619.000	
ADVANCED MICRO DEVICES	75,027	127.330	9,553,187.910	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	33,872	55.840	1,891,412.480	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,300	109.890	802,197.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	10,700	94.720	1,013,504.000	
AVERY DENNISON CORP	3,830	167.090	639,954.700	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	23,700	63.710	1,509,927.000	
EMERSON ELECTRIC CO	26,900	85.840	2,309,096.000	
AON PLC-CLASS A	9,600	322.970	3,100,512.000	
AMGEN INC	24,900	222.280	5,534,772.000	
EATON CORP PLC	18,536	193.070	3,578,745.520	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,700	247.010	1,901,977.000	
APPLIED MATERIALS INC	39,300	141.170	5,547,981.000	
CME GROUP INC	16,800	181.510	3,049,368.000	
ECOLAB INC	11,900	179.810	2,139,739.000	
EQUIFAX INC	5,700	229.710	1,309,347.000	
GILEAD SCIENCES INC	58,200	77.950	4,536,690.000	
KEURIG DR PEPPER INC	42,900	31.760	1,362,504.000	
HORMEL FOODS CORP	14,000	41.250	577,500.000	
STATE STREET CORP	16,713	73.200	1,223,391.600	
SCHWAB (CHARLES) CORP	70,140	54.350	3,812,109.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	23,600	43.450	1,025,420.000	
CAMPBELL SOUP CO	9,400	45.910	431,554.000	
CROWN HOLDINGS INC	5,580	85.320	476,085.600	



CARDINAL HEALTH INC	12,100	86.970	1,052,337.000	
FEDEX CORP	11,200	229.670	2,572,304.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	17,754	112.330	1,994,306.820	
FMC CORP	5,850	104.540	611,559.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11,913	78.300	932,787.900	
INTEL CORP	194,400	35.580	6,916,752.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	18,000	40.140	722,520.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	14,450	70.640	1,020,748.000	
WOLFSPEED INC	5,800	56.490	327,642.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	14,200	244.460	3,471,332.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	38,600	3.770	145,522.000	
ILLUMINA INC	7,400	204.840	1,515,816.000	
SEALED AIR CORP	6,700	39.130	262,171.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	16,300	323.070	5,266,041.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,850	128.870	625,019.500	
SNAP-ON INC	2,500	271.780	679,450.000	
CARMAX INC	7,400	79.700	589,780.000	
DUKE ENERGY CORP	35,928	90.850	3,264,058.800	
TARGET CORP	21,400	133.230	2,851,122.000	
DOVER CORP	6,400	145.180	929,152.000	
WW GRAINGER INC	2,100	727.070	1,526,847.000	
CINTAS CORP	4,300	486.090	2,090,187.000	
CONAGRA BRANDS INC	22,200	34.950	775,890.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	6,800	115.000	782,000.000	
CLOROX COMPANY	5,800	153.940	892,852.000	
ENTERGY CORP	9,900	101.300	1,002,870.000	
MICROSOFT CORP	329,400	337.340	111,119,796.000	
INCYTE CORP	8,600	61.440	528,384.000	
CVS HEALTH CORP	59,669	66.650	3,976,938.850	
MEDTRONIC PLC	61,998	87.910	5,450,244.180	
MICRON TECHNOLOGY INC	51,000	69.120	3,525,120.000	
BLACKROCK INC	7,000	692.450	4,847,150.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	29,300	29.030	850,579.000	
HASBRO INC	6,000	61.910	371,460.000	
KELLOGG CO	12,800	66.140	846,592.000	
KEYCORP	43,100	9.910	427,121.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	63,511	73.130	4,644,559.430	
COOPER COS INC/THE	2,300	362.740	834,302.000	
CHUBB LTD	19,299	188.840	3,644,423.160	

	ARROW ELECTRONICS INC	2,900	137.930	399,997.000	
	ALLSTATE CORP	12,300	111.400	1,370,220.000	
	EBAY INC	24,900	45.070	1,122,243.000	
	PAYPAL HOLDINGS INC	49,650	63.600	3,157,740.000	
	EASTMAN CHEMICAL CO	5,500	81.970	450,835.000	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	10,800	192.160	2,075,328.000	
	TRIMBLE INC	11,500	51.920	597,080.000	
	LENNAR CORP-A	11,800	114.750	1,354,050.000	
	LEAR CORP	2,800	144.660	405,048.000	
	PROGRESSIVE CORP	27,300	126.930	3,465,189.000	
	PACCAR INC	24,255	78.060	1,893,345.300	
	BIOGEN INC	6,700	299.990	2,009,933.000	
	IDEXX LABORATORIES INC	3,900	466.970	1,821,183.000	
	STARBUCKS CORP	53,500	100.660	5,385,310.000	
	PTC INC	5,200	141.380	735,176.000	
	EVERSOURCE ENERGY	16,200	69.900	1,132,380.000	
	INTUIT INC	13,080	446.220	5,836,557.600	
	BORGWARNER INC	10,600	47.800	506,680.000	
	BEST BUY CO INC	9,250	76.640	708,920.000	
	BALL CORP	14,604	54.460	795,333.840	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	66,997	53.310	3,571,610.070	
	ELECTRONIC ARTS INC	12,800	127.900	1,637,120.000	
	VULCAN MATERIALS CO	6,200	207.390	1,285,818.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,000	340.960	4,091,520.000	
	VF CORP	14,700	19.270	283,269.000	
	PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	27,125	16.600	450,275.000	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	2,500	98.940	247,350.000	
	CARNIVAL CORP	46,800	15.600	730,080.000	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	23,100	16.720	386,232.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	196,190	40.840	8,012,399.600	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,700	49.770	432,999.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	53,500	4.100	219,350.000	
	アメリカ・ドル 小計			1,766,559,907.740 (248,007,345,449)	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	315,129	23.045	7,262,147.800	
	HALEON PLC	231,333	3.189	737,720.930	
	WISE PLC CLASS A	30,273	6.200	187,692.600	
	BP PLC	816,509	4.611	3,765,331.250	

UNILEVER PLC	115,022	39.675	4,563,497.850	
BARCLAYS PLC	707,553	1.574	1,113,971.440	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	381,060	1.507	574,447.950	
PRUDENTIAL PLC	125,414	11.360	1,424,703.040	
NATWEST GROUP PLC	262,737	2.654	697,303.990	
JOHNSON MATTHEY PLC	8,388	17.605	147,670.740	
BAE SYSTEMS PLC	139,042	9.504	1,321,455.160	
AVIVA PLC	127,014	4.008	509,072.110	
GSK	186,614	13.634	2,544,295.270	
INFORMA PLC	62,995	7.044	443,736.780	
AUTO TRADER GROUP PLC	41,019	6.408	262,849.750	
DCC PLC	4,301	46.650	200,641.650	
OCADO GROUP PLC	23,827	4.091	97,476.250	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	3,270	113.700	371,799.000	
HALMA PLC	16,864	24.290	409,626.560	
ENTAIN PLC	26,861	12.065	324,077.960	
JD SPORTS FASHION PLC	112,804	1.482	167,231.930	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	32,680	5.532	180,785.760	
M&G PLC	104,504	2.021	211,202.580	
ENDEAVOUR MINING PLC	9,141	20.520	187,573.320	
RELX PLC	86,625	25.800	2,234,925.000	
DIAGEO PLC	102,628	33.755	3,464,208.140	
RIO TINTO PLC	51,279	53.380	2,737,273.020	
STANDARD CHARTERED PLC	108,504	6.700	726,976.800	
TESCO PLC	333,384	2.640	880,133.760	
SMITH & NEPHEW PLC	39,859	12.490	497,838.910	
GLENORE PLC	487,397	4.703	2,292,471.780	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	15,095	8.444	127,462.180	
SMITHS GROUP PLC	15,383	17.020	261,818.660	
PEARSON PLC	28,363	8.226	233,314.030	
SAINSBURY (J) PLC	78,274	2.725	213,296.650	
NEXT PLC	5,620	64.520	362,602.400	
TAYLOR WIMPEY PLC	157,039	1.103	173,292.530	
WHITBREAD PLC	9,218	34.000	313,412.000	
BUNZL PLC	15,410	31.060	478,634.600	
VODAFONE GROUP PLC	1,145,592	0.728	834,449.210	
CRODA INTERNATIONAL PLC	6,203	55.260	342,777.780	
KINGFISHER PLC	85,779	2.382	204,325.570	
WPP PLC	48,968	8.748	428,372.060	

UNITED UTILITIES GROUP PLC	31,105	10.390	323,180.950	
SEVERN TRENT PLC	11,475	27.040	310,284.000	
RENTOKIL INITIAL PLC	114,775	6.420	736,855.500	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	32,621	59.060	1,926,596.260	
ST JAMES'S PLACE PLC	24,174	11.485	277,638.390	
SCHRODERS PLC	39,815	4.578	182,273.070	
SSE PLC	49,692	18.365	912,593.580	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	43,245	4.517	195,337.660	
ASTRAZENECA PLC	70,592	115.100	8,125,139.200	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	272,067	2.380	647,519.460	
3I GROUP PLC	44,331	20.310	900,362.610	
ASHTREAD GROUP PLC	19,973	54.780	1,094,120.940	
SAGE GROUP PLC/THE	46,665	8.746	408,132.090	
NATIONAL GRID PLC	167,557	10.315	1,728,350.450	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,016,079	0.452	1,365,831.370	
IMPERIAL BRANDS PLC	39,967	17.425	696,424.970	
CENTRICA PLC	279,988	1.171	328,005.940	
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	4,918	39.420	193,867.560	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	96,741	25.700	2,486,243.700	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	15,800	18.795	296,961.000	
HSBC HOLDINGS PLC	910,010	6.108	5,558,341.080	
ANGLO AMERICAN PLC	57,876	25.825	1,494,647.700	
MONDI PLC	22,149	12.620	279,520.380	
COMPASS GROUP PLC	79,435	21.800	1,731,683.000	
PERSIMMON PLC	13,915	11.685	162,596.770	
BT GROUP PLC	345,300	1.368	472,370.400	
COCA-COLA HBC AG-DI	10,136	23.380	236,979.680	
BURBERRY GROUP PLC	17,053	22.610	385,568.330	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	8,005	55.400	443,477.000	
INTERTEK GROUP PLC	7,169	43.940	315,005.860	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	18,564	86.580	1,607,271.120	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,361	19.000	139,859.000	
ADMIRAL GROUP PLC	9,779	22.510	220,125.290	
ANTOFAGASTA PLC	17,513	15.600	273,202.800	
ABRDN PLC	90,862	2.167	196,897.950	
EXPERIAN PLC	41,857	29.740	1,244,827.180	
イギリス・ポンド 小計			82,411,988.990 (14,646,258,684)	

イスラエル・ シュケル	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	60,911	18.840	1,147,563.240	
	AZRIELI GROUP LTD	1,826	215.600	393,685.600	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	5,051	147.000	742,497.000	
	ICL GROUP LTD	38,090	20.610	785,034.900	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,310	739.000	968,090.000	
	BANK HAPOALIM BM	62,536	31.050	1,941,742.800	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	76,017	27.110	2,060,820.870	
	NICE LTD	3,128	818.200	2,559,329.600	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	7,598	129.000	980,142.000	
イスラエル・シュケル 小計				11,578,906.010 (453,644,169)	
オーストラリ ア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	95,515	5.060	483,305.900	
	TELSTRA GROUP LTD	176,757	4.350	768,892.950	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	131,029	22.920	3,003,184.680	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	116,553	3.610	420,756.330	
	BHP GROUP LTD	220,895	45.900	10,139,080.500	
	SOUTH32 LTD	194,263	3.900	757,625.700	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	82,795	34.650	2,868,846.750	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	73,842	21.700	1,602,371.400	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	136,792	25.510	3,489,563.920	
	WESTPAC BANKING CORP	153,058	20.560	3,146,872.480	
	SANTOS LTD	144,925	7.290	1,056,503.250	
	RIO TINTO LTD	16,187	116.150	1,880,120.050	
	ORIGIN ENERGY LTD	75,281	8.490	639,135.690	
	AURIZON HOLDINGS LTD	75,100	3.570	268,107.000	
	PILBARA MINERALS LTD	113,184	4.880	552,337.920	
	XERO LTD	6,302	111.340	701,664.680	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	10,388	31.790	330,234.520	
	COLES GROUP LTD	58,509	17.890	1,046,726.010	
	WISETECH GLOBAL LTD	7,381	78.300	577,932.300	
	IDP EDUCATION LTD	11,169	23.680	264,481.920	
	IGO LTD	30,405	15.140	460,331.700	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	49,726	13.040	648,427.040	
	REECE LTD	10,500	18.790	197,295.000	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	60,660	5.930	359,713.800	
SEEK LTD	14,264	21.600	308,102.400		
TREASURY WINE ESTATES LTD	30,976	11.420	353,745.920		

	NEWCREST MINING LTD	39,092	26.080	1,019,519.360	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	73,593	97.370	7,165,750.410	
	AMPOL LTD	10,454	30.530	319,160.620	
	ORICA LTD	19,499	15.160	295,604.840	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	65,087	15.120	984,115.440	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	53,152	38.370	2,039,442.240	
	QANTAS AIRWAYS LTD	39,082	6.390	249,733.980	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	18,801	39.090	734,931.090	
	MACQUARIE GROUP LTD	16,010	178.050	2,850,580.500	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	25,750	38.080	980,560.000	
	CSL LTD	21,034	287.250	6,042,016.500	
	WESFARMERS LTD	49,470	48.200	2,384,454.000	
	COCHLEAR LTD	2,823	237.470	670,377.810	
	BLUESCOPE STEEL LTD	19,124	20.530	392,615.720	
	SUNCORP GROUP LTD	54,249	13.140	712,831.860	
	ASX LTD	8,307	60.820	505,231.740	
	COMPUTERSHARE LTD	25,169	22.820	574,356.580	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	103,987	5.230	543,852.010	
	SONIC HEALTHCARE LTD	19,599	35.010	686,160.990	
	BRAMBLES LTD	60,760	13.770	836,665.200	
	MINERAL RESOURCES LTD	7,602	71.320	542,174.640	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,857	57.500	451,777.500	
	REA GROUP LTD	2,236	132.500	296,270.000	
	オーストラリア・ドル 小計			67,603,542.840 (6,447,349,881)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	35,500	65.040	2,308,920.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	15,181	44.700	678,590.700	
	IMPERIAL OIL LTD	9,500	66.190	628,805.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	900	2,758.400	2,482,560.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	13,187	101.680	1,340,854.160	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,800	59.430	1,176,714.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	7,850	197.870	1,553,279.500	
	BCE INC	4,930	60.370	297,624.100	
	FRANCO-NEVADA CORP	8,500	192.950	1,640,075.000	
	SUNCOR ENERGY INC	59,230	39.730	2,353,207.900	
	METRO INC/CN	10,300	71.100	732,330.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	15,000	98.800	1,482,000.000	

BANK OF NOVA SCOTIA	53,000	66.310	3,514,430.000	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	40,300	57.640	2,322,892.000	
TORONTO-DOMINION BANK	81,000	79.920	6,473,520.000	
GREAT-WEST LIFECO INC	12,500	38.470	480,875.000	
ROYAL BANK OF CANADA	61,650	125.180	7,717,347.000	
TOURMALINE OIL CORP	14,400	59.570	857,808.000	
TC ENERGY CORP	45,350	54.440	2,468,854.000	
PEMBINA PIPELINE CORP	24,529	41.140	1,009,123.060	
BARRICK GOLD CORP	78,300	22.370	1,751,571.000	
CAE INC	14,200	27.720	393,624.000	
THOMSON REUTERS CORP	7,512	169.020	1,269,678.240	
EMPIRE CO LTD 'A'	7,100	34.690	246,299.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,500	106.190	371,665.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	6,550	62.760	411,078.000	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	17,600	20.340	357,984.000	
HYDRO ONE LTD	14,400	37.290	536,976.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	6,960	117.020	814,459.200	
NORTHLAND POWER INC	11,200	27.660	309,792.000	
WSP GLOBAL INC	5,500	175.780	966,790.000	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,700	107.760	398,712.000	
PARKLAND CORP	6,600	33.810	223,146.000	
QUEBECOR INC -CL B	6,800	33.250	226,100.000	
EMERA INC	11,800	54.800	646,640.000	
TFI INTERNATIONAL INC	3,500	141.370	494,795.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	5,400	34.770	187,758.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	15,800	58.410	922,878.000	
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,600	107.500	172,000.000	
IVANHOE MINES LTD-CL A	26,700	11.860	316,662.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	22,117	66.870	1,478,963.790	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	29,300	11.130	326,109.000	
AIR CANADA	7,600	23.540	178,904.000	
KINROSS GOLD CORP	56,100	6.480	363,528.000	
BANK OF MONTREAL	31,700	118.270	3,749,159.000	
POWER CORP OF CANADA	26,000	35.080	912,080.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	53,300	87.850	4,682,405.000	
NUTRIEN LTD	23,119	78.040	1,804,206.760	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,800	44.100	255,780.000	
CAMECO CORP	18,900	41.630	786,807.000	
FIRSTSERVICE CORP	1,800	196.400	353,520.000	

	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	9,700	50.010	485,097.000	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2,600	39.650	103,090.000	
	TELUS CORP	10,800	25.480	275,184.000	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	20,500	57.780	1,184,490.000	
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,400	171.240	410,976.000	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	49,300	73.930	3,644,749.000	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,000	980.810	980,810.000	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	12,100	74.970	907,137.000	
	WESTON (GEORGE) LTD	3,137	153.250	480,745.250	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	17,000	20.090	341,530.000	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	3,800	103.030	391,514.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	26,100	67.360	1,758,096.000	
	ENBRIDGE INC	90,000	49.160	4,424,400.000	
	BROOKFIELD CORP	62,625	44.100	2,761,762.500	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	81,800	25.670	2,099,806.000	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	41,420	103.610	4,291,526.200	
	IA FINANCIAL CORP INC	4,400	91.120	400,928.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,500	40.230	301,725.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	25,250	155.490	3,926,122.500	
	CGI INC - CLASS A	9,400	139.850	1,314,590.000	
	ONEX CORPORATION	2,900	70.150	203,435.000	
	IGM FINANCIAL INC	3,600	41.010	147,636.000	
	TMX GROUP LTD	12,500	29.850	373,125.000	
	OPEN TEXT CORP	12,100	56.000	677,600.000	
	SAPUTO INC	10,800	31.270	337,716.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	25,800	30.960	798,768.000	
	FORTIS INC	21,600	56.490	1,220,184.000	
	RB GLOBAL INC	8,400	75.880	637,392.000	
	LUNDIN MINING CORP	27,800	10.730	298,294.000	
	CENOVUS ENERGY INC	63,200	22.160	1,400,512.000	
	DOLLARAMA INC	12,800	85.870	1,099,136.000	
	ALTAGAS LTD	12,100	24.540	296,934.000	
	KEYERA CORP	10,200	30.520	311,304.000	
	ARC RESOURCES LTD	28,600	16.940	484,484.000	
	カナダ・ドル 小計			106,200,677.860 (11,182,931,378)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	128,100	3.360	430,416.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	62,300	28.070	1,748,761.000	



	DBS GROUP HOLDINGS LTD	89,200	31.160	2,779,472.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	65,975	7.600	501,410.000	
	KEPPEL CORP LTD	71,700	6.690	479,673.000	
	UOL GROUP LTD	22,900	6.700	153,430.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	24,600	6.950	170,970.000	
	SEATRIUM	2,016,022	0.128	258,050.810	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,400	33.490	147,356.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	166,700	12.430	2,072,081.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	279,500	0.950	265,525.000	
	VENTURE CORP LTD	12,800	15.190	194,432.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	406,650	2.490	1,012,558.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	72,200	3.710	267,862.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,200	9.700	409,340.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	94,600	4.020	380,292.000	
	シンガポール・ドル 小計			11,271,629.310 (1,178,786,993)	
スイス・フラン	DUFREY AG-REG	4,854	40.360	195,907.440	
	UBS GROUP AG-REG	145,555	18.485	2,690,584.170	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,447	295.800	428,022.600	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	307	709.000	217,663.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	6,823	28.470	194,250.810	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	31,265	274.550	8,583,805.750	
	SIKA AG-REG	6,499	259.700	1,687,790.300	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	5	113,400.000	567,000.000	
	ABB LTD-REG	69,946	35.410	2,476,787.860	
	SWISS RE AG	13,423	88.460	1,187,398.580	
	NESTLE SA-REG	122,379	106.520	13,035,811.080	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,010	887.200	896,072.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,774	199.200	353,380.800	
	JULIUS BAER GROUP LTD	9,536	58.140	554,423.040	
	SGS SA-REG	6,925	85.100	589,317.500	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,026	192.100	197,094.600	
	TEMENOS AG - REG	2,716	75.980	206,361.680	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	1,828	125.600	229,596.800	
	VAT GROUP AG	1,176	392.600	461,697.600	
	BKW AG	942	148.300	139,698.600	
	ALCON INC	22,237	71.800	1,596,616.600	
	SIG GROUP N AG	13,641	25.620	349,482.420	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,290	265.000	341,850.000	

	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,696	426.400	2,855,174.400	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,956	141.400	276,578.400	
	CLARIANT AG-REG	9,678	13.140	127,168.920	
	NOVARTIS AG-REG	94,023	89.660	8,430,102.180	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	159	1,739.000	276,501.000	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,424	87.000	123,888.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	23,230	147.050	3,415,971.500	
	SWISSCOM AG-REG	1,153	552.200	636,686.600	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,344	95.550	128,419.200	
	GEBERIT AG-REG	1,559	491.200	765,780.800	
	GIVAUDAN-REG	411	2,884.000	1,185,324.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	4,967	137.000	680,479.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	2,279	237.600	541,490.400	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	7,375	50.740	374,207.500	
	LONZA GROUP AG-REG	3,314	569.000	1,885,666.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,269	50.200	113,903.800	
	HOLCIM LTD	24,669	59.860	1,476,686.340	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,372	540.600	741,703.200	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,424	260.000	630,240.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,275	78.150	255,941.250	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	44	11,240.000	494,560.000	
スイス・フラン 小計				62,597,085.720 (9,753,877,897)	
スウェーデン・ クローナ	SAGAX CLASS B	8,813	230.800	2,034,040.400	
	INVESTOR CLASS A	23,863	214.200	5,111,454.600	
	VOLVO CAR CLASS B	28,514	44.660	1,273,435.240	
	ERICSSON LM-B SHS	143,721	56.940	8,183,473.740	
	VOLVO AB-B SHS	74,305	219.050	16,276,510.250	
	SKF AB-B SHARES	17,719	199.150	3,528,738.850	
	TELE2 AB-B SHS	26,333	92.420	2,433,695.860	
	GETINGE AB-B SHS	10,572	247.500	2,616,570.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	79,569	118.550	9,432,904.950	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	69,793	89.760	6,264,619.680	
	SWEDBANK AB - A SHARES	43,333	175.350	7,598,441.550	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	34,946	145.600	5,088,137.600	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	29,833	148.050	4,416,775.650	
	SKANSKA AB-B SHS	15,724	150.100	2,360,172.400	
	SANDVIK AB	52,501	213.700	11,219,463.700	

	INVESTOR AB-B SHS	87,179	214.450	18,695,536.550	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	131,528	162.850	21,419,334.800	
	VOLVO AB-A SHS	9,255	226.000	2,091,630.000	
	HOLMEN AB-B SHARES	4,336	412.400	1,788,166.400	
	SECURITAS AB-B SHS	22,743	84.580	1,923,602.940	
	TELIA CO AB	122,866	23.980	2,946,326.680	
	ALFA LAVAL AB	13,863	391.200	5,423,205.600	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	76,858	140.750	10,817,763.500	
	ASSA ABLOY AB-B	49,353	260.100	12,836,715.300	
	SAAB AB-B	3,943	576.200	2,271,956.600	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	6,027	291.400	1,756,267.800	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	30,192	42.440	1,281,348.480	
	INDUTRADE AB	13,454	264.100	3,553,201.400	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	7,807	224.400	1,751,890.800	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,513	458.100	1,609,305.300	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,843	224.100	1,533,516.300	
	LIFCO AB-B SHS	10,774	233.900	2,520,038.600	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	74,623	110.100	8,215,992.300	
	BEIJER REF AB	16,584	161.300	2,674,999.200	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	29,993	279.700	8,389,042.100	
	EMBRACER GROUP AB	30,041	26.490	795,786.090	
	BOLIDEN AB	13,087	324.200	4,242,805.400	
	EPIROC AB-A	31,534	203.100	6,404,555.400	
	EPIROC AB-B	19,202	173.600	3,333,467.200	
	HUSQVARNA AB-B SHS	19,395	89.580	1,737,404.100	
	NORDEA BANK ABP	160,871	112.440	18,088,335.240	
	EQT AB	17,511	222.300	3,892,695.300	
	EVOLUTION AB	9,024	1,408.400	12,709,401.600	
	KINNEVIK AB - B	11,612	153.000	1,776,636.000	
	HEXAGON AB-B SHS	102,232	131.350	13,428,173.200	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	7,118	290.500	2,067,779.000	
	スウェーデン・クローナ 小計			269,815,313.650 (3,531,882,456)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	79,858	1,091.200	87,141,049.600	
	DANSKE BANK A/S	33,963	162.000	5,502,006.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	153	12,460.000	1,906,380.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	49,726	195.460	9,719,443.960	
	CARLSBERG AS-B	4,849	1,066.000	5,169,034.000	

	NOVOZYMES A/S-B SHARES	10,071	338.100	3,405,005.100	
	COLOPLAST-B	5,850	846.800	4,953,780.000	
	DSV PANALPINA A/S	9,166	1,355.000	12,419,930.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	426	1,784.000	759,984.000	
	DEMANT A/S	4,275	290.800	1,243,170.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	240	12,620.000	3,028,800.000	
	TRYG A/S	17,729	154.600	2,740,903.400	
	PANDORA A/S	4,341	585.000	2,539,485.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,194	509.000	2,643,746.000	
	GENMAB A/S	3,249	2,665.000	8,658,585.000	
	ORSTED A/S	9,315	657.400	6,123,681.000	
デンマーク・クローネ 小計				157,954,983.060 (3,225,440,754)	
ニュージーランド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	59,568	5.420	322,858.560	
	MERCURY NZ LTD	34,143	6.365	217,320.190	
	EBOS GROUP LTD	7,660	35.640	273,002.400	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	92,147	5.120	471,792.640	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	61,644	8.290	511,028.760	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	27,626	23.790	657,222.540	
ニュージーランド・ドル 小計				2,453,225.090 (213,258,857)	
ノルウェー・クローネ	DNB BANK	45,804	192.900	8,835,591.600	
	NORSK HYDRO ASA	64,351	73.420	4,724,650.420	
	ORKLA ASA	36,983	76.940	2,845,472.020	
	TELENOR ASA	34,455	109.350	3,767,654.250	
	EQUINOR ASA	46,908	319.250	14,975,379.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	8,153	366.800	2,990,520.400	
	MOWI ASA	21,643	186.500	4,036,419.500	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	9,244	177.100	1,637,112.400	
	AKER BP ASA	15,560	260.300	4,050,268.000	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	4,098	468.400	1,919,503.200	
	SALMAR ASA	3,573	467.800	1,671,449.400	
	ADEVINTA ASA	13,944	77.600	1,082,054.400	
ノルウェー・クローネ 小計				52,536,074.590 (691,374,742)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	37,346	20.070	749,534.220	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	22,443	32.460	728,499.780	
	EXOR NV	4,786	81.460	389,867.560	

DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	5,136	117.250	602,196.000	
CORPORACION ACCIONA ENERGIAS RENOV	2,938	31.520	92,605.760	
DSM FIRMENICH AG	7,889	99.000	781,011.000	
BAYER AG-REG	44,238	51.800	2,291,528.400	
EVONIK INDUSTRIES AG	9,486	18.290	173,498.940	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	90,946	9.930	903,093.780	
COMMERZBANK AG	48,018	10.185	489,063.330	
VOLKSWAGEN AG	1,304	160.700	209,552.800	
VOLKSWAGEN AG-PREF	9,372	131.740	1,234,667.280	
SIEMENS AG-REG	34,201	164.340	5,620,592.340	
E.ON SE	101,096	11.275	1,139,857.400	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	14,909	112.900	1,683,226.100	
GEA GROUP AG	6,681	39.700	265,235.700	
CONTINENTAL AG	4,853	71.900	348,930.700	
BASF SE	40,416	46.835	1,892,883.360	
ALLIANZ SE-REG	18,163	209.750	3,809,689.250	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	7,695	74.200	570,969.000	
RHEINMETALL AG	1,965	245.300	482,014.500	
RWE AG	28,268	39.950	1,129,306.600	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27,029	9.476	256,126.800	
BRENNTAG SE	6,969	74.140	516,681.660	
FRESENIUS SE & CO KGAA	19,055	25.570	487,236.350	
SAP SE	47,021	125.480	5,900,195.080	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,309	327.400	2,065,566.600	
ZALANDO SE	9,669	26.420	255,454.980	
HEIDELBERG MATERIALS AG	6,389	73.540	469,847.060	
COVESTRO AG	8,520	40.820	347,786.400	
RATIONAL AG	215	641.500	137,922.500	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,210	340.200	411,642.000	
TALANX AG	3,119	53.800	167,802.200	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	6,755	57.940	391,384.700	
DELIVERY HERO SE	7,584	36.485	276,702.240	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,748	111.400	194,727.200	
BECHTLE AG	3,626	38.610	139,999.860	
NEMETSCHEK SE	2,557	72.500	185,382.500	
SCOUT24 AG	3,600	58.300	209,880.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	12,721	52.740	670,905.540	

KNORR-BREMSE AG	3,158	66.680	210,575.440	
HELLOFRESH SE	7,177	18.015	129,293.650	
SIEMENS ENERGY AG	23,742	23.700	562,685.400	
BEIERSDORF AG	4,547	119.450	543,139.150	
MERCK KGAA	5,820	168.150	978,633.000	
ADIDAS AG	7,467	174.700	1,304,484.900	
PUMA SE	4,586	51.700	237,096.200	
HENKEL AG & CO KGAA	4,584	65.700	301,168.800	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	145,949	19.142	2,793,755.750	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	9,061	43.250	391,888.250	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	38,764	75.350	2,920,867.400	
QIAGEN N.V.	10,272	42.340	434,916.480	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	58,805	38.860	2,285,162.300	
HANNOVER RUECK SE	2,720	191.250	520,200.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	45,384	43.650	1,981,011.600	
DEUTSCHE BOERSE AG	8,556	167.000	1,428,852.000	
MTU AERO ENGINES AG	2,417	226.300	546,967.100	
WACKER CHEMIE AG	899	121.550	109,273.450	
SYMRISE AG	5,990	92.720	555,392.800	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	41,312	2.565	105,965.280	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	2,686	103.300	277,463.800	
VONOVIA SE	31,518	18.905	595,847.790	
LEG IMMOBILIEN SE	3,105	55.140	171,209.700	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	41,997	18.642	782,908.070	
NN GROUP NV	12,086	33.220	401,496.920	
ARCELORMITTAL	25,700	26.185	672,954.500	
HEINEKEN NV	11,672	93.940	1,096,467.680	
AEGON NV	77,429	4.550	352,301.950	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	46,015	29.680	1,365,725.200	
AKZO NOBEL N.V.	7,841	72.820	570,981.620	
WOLTERS KLUWER	11,595	113.950	1,321,250.250	
ING GROEP NV	163,846	12.312	2,017,271.950	
KONINKLIJKE KPN NV	143,197	3.084	441,619.540	
ASML HOLDING NV	18,154	681.700	12,375,581.800	
ABN AMRO BANK NV-CVA	17,828	14.045	250,394.260	
IMCD NV	2,514	135.350	340,269.900	
ADYEN NV	977	1,625.000	1,587,625.000	
JUST EAT TAKEAWAY	9,530	13.134	125,167.020	
PROSUS NV	36,049	67.710	2,440,877.790	

JDE PEET'S NV	5,785	27.440	158,740.400	
ASM INTERNATIONAL NV	2,115	411.150	869,582.250	
RANDSTAD NV	5,275	48.290	254,729.750	
HEINEKEN HOLDING NV	5,248	79.500	417,216.000	
OCI NV	4,386	21.170	92,851.620	
TOTALENERGIES SE	109,487	53.910	5,902,444.170	
MICHELIN (CGDE)	30,548	27.970	854,427.560	
AIR LIQUIDE SA	23,578	159.580	3,762,577.240	
KERING	3,350	523.000	1,752,050.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	24,430	166.260	4,061,731.800	
BOUYGUES SA	9,572	30.120	288,308.640	
BNP PARIBAS	50,023	57.520	2,877,322.960	
THALES SA	4,734	131.850	624,177.900	
DANONE	28,911	53.940	1,559,459.340	
CARREFOUR SA	26,778	16.495	441,703.110	
VIVENDI	31,166	8.242	256,870.170	
L'OREAL	10,842	412.200	4,469,072.400	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	22,086	56.740	1,253,159.640	
LEGRAND SA	12,015	92.560	1,112,108.400	
PERNOD RICARD SA	9,292	203.700	1,892,780.400	
EURAZEO SE	1,981	66.400	131,538.400	
SOCIETE GENERALE SA	35,528	23.515	835,440.920	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	12,431	850.000	10,566,350.000	
ACCOR SA	8,355	33.510	279,976.050	
CAPGEMINI SE	7,430	177.250	1,316,967.500	
VALEO SA	9,148	21.140	193,388.720	
PUBLICIS GROUPE	10,308	74.540	768,358.320	
BUREAU VERITAS SA	12,970	25.010	324,379.700	
EIFFAGE	3,675	100.250	368,418.750	
SODEXO SA	3,903	101.600	396,544.800	
IPSEN	1,706	110.700	188,854.200	
AMUNDI SA	2,569	54.700	140,524.300	
TELEPERFORMANCE	2,667	160.200	427,253.400	
EURONEXT NV	3,876	65.800	255,040.800	
EUROFINS SCIENTIFIC	5,946	60.220	358,068.120	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,194	273.300	326,320.200	
SEB SA	997	88.400	88,134.800	
ESSILORLUXOTTICA	13,103	167.400	2,193,442.200	
DASSAULT AVIATION SA	1,108	169.600	187,916.800	

WORLDLINE SA	10,790	35.700	385,203.000	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	4,561	36.960	168,574.560	
AXA SA	82,807	26.655	2,207,220.580	
EDENRED	11,258	61.640	693,943.120	
RENAULT SA	8,329	35.575	296,304.170	
HERMES INTERNATIONAL	1,426	1,973.000	2,813,498.000	
STMICROELECTRONICS NV	30,776	46.160	1,420,620.160	
REMY COINTREAU	1,009	145.500	146,809.500	
DASSAULT SYSTEMES SE	30,068	40.875	1,229,029.500	
WENDEL	1,124	99.700	112,062.800	
ORANGE	87,788	10.308	904,918.700	
ALSTOM	14,107	27.190	383,569.330	
SANOFI	51,072	93.980	4,799,746.560	
VINCI SA	23,903	108.760	2,599,690.280	
AIRBUS SE	26,700	129.520	3,458,184.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	30,624	29.150	892,689.600	
CREDIT AGRICOLE SA	54,582	10.960	598,218.720	
BIOMERIEUX	1,852	91.820	170,050.640	
ENGIE	82,244	14.296	1,175,760.220	
SAFRAN SA	15,391	138.440	2,130,730.040	
ARKEMA	2,576	85.000	218,960.000	
ADP	1,343	138.200	185,602.600	
GETLINK SE	19,411	15.685	304,461.530	
BOLLORE	39,141	5.615	219,776.710	
UCB SA	5,577	83.940	468,133.380	
KBC GROUP NV	11,272	63.640	717,350.080	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,383	73.380	321,624.540	
SOLVAY SA	3,212	108.150	347,377.800	
UMICORE	9,239	27.930	258,045.270	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	39,112	52.320	2,046,339.840	
AGEAS	7,114	38.160	271,470.240	
D' IETEREN GROUP	1,036	173.000	179,228.000	
ELIA GROUP SA/NV	1,462	114.800	167,837.600	
SOFINA	670	205.200	137,484.000	
ARGENX SE	2,509	364.200	913,777.800	
PRYSMIAN SPA	11,238	37.450	420,863.100	
ASSICURAZIONI GENERALI	48,878	18.930	925,260.540	
MEDIOBANCA SPA	26,230	11.310	296,661.300	
TENARIS SA	20,832	12.930	269,357.760	



UNICREDIT SPA	84,516	19.122	1,616,114.950	
TELECOM ITALIA SPA	434,374	0.257	111,938.170	
INTESA SANPAOLO	721,438	2.350	1,695,379.300	
POSTE ITALIANE SPA	22,639	10.095	228,540.700	
MONCLER SPA	9,291	65.680	610,232.880	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	4,624	44.980	207,987.520	
ENI SPA	110,008	12.986	1,428,563.880	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	22,654	12.850	291,103.900	
DIASORIN SPA	1,144	97.860	111,951.840	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	14,648	11.815	173,066.120	
NEXI SPA	25,005	7.396	184,936.980	
AMPLIFON SPA	5,632	35.230	198,415.360	
ENEL SPA	366,238	6.108	2,236,981.700	
SNAM SPA	88,957	5.008	445,496.650	
TERNA SPA	63,467	8.010	508,370.670	
CNH INDUSTRIAL NV	46,159	13.405	618,761.390	
FINECOBANK SPA	26,908	12.465	335,408.220	
STELLANTIS NV	101,275	15.766	1,596,701.650	
FERRARI NV	5,676	281.300	1,596,658.800	
TELEFONICA SA	234,049	3.633	850,300.010	
ENDESA SA	14,367	20.920	300,557.640	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	271,306	6.776	1,838,369.450	
IBERDROLA SA	270,354	11.570	3,127,995.780	
REPSOL SA	60,600	13.545	820,827.000	
GRIFOLS SA	12,949	11.815	152,992.430	
BANCO SANTANDER SA	738,996	3.250	2,401,737.000	
AMADEUS IT GROUP SA	20,286	69.640	1,412,717.040	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,300	26.620	274,186.000	
CAIXABANK SA	195,084	3.661	714,202.520	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	9,544	31.230	298,059.120	
AENA SME SA	3,383	148.300	501,698.900	
CELLNEX TELECOM SA	25,443	36.440	927,142.920	
ACCIONA SA	1,117	162.100	181,065.700	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	49,119	34.210	1,680,360.990	
ENAGAS SA	10,803	18.180	196,398.540	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	17,900	16.340	292,486.000	
FERROVIAL SA	23,057	28.840	664,963.880	
UPM-KYMMENE OYJ	24,034	29.870	717,895.580	
NOKIA OYJ	238,120	3.890	926,286.800	

	WARTSILA OYJ ABP	20,930	10.970	229,602.100	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	26,320	12.385	325,973.200	
	ELISA OYJ	6,414	50.600	324,548.400	
	SAMPO OYJ-A SHS	21,110	42.660	900,552.600	
	FORTUM OYJ	19,800	13.190	261,162.000	
	KESKO OYJ-B SHS	12,355	19.190	237,092.450	
	KONE OYJ-B	15,332	49.520	759,240.640	
	NESTE OYJ	19,050	40.980	780,669.000	
	ORION OYJ-CLASS B	4,846	39.480	191,320.080	
	METSO CORPORATION	31,351	11.110	348,309.610	
	VERBUND AG	2,951	75.150	221,767.650	
	OMV AG	6,496	39.240	254,903.040	
	ERSTE GROUP BANK AG	15,510	32.150	498,646.500	
	VOESTALPINE AG	4,878	33.640	164,095.920	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	11,784	34.300	404,191.200	
	AIB GROUP PLC	61,254	3.878	237,543.010	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	47,750	9.410	449,327.500	
	KINGSPAN GROUP PLC	6,975	63.760	444,726.000	
	JERONIMO MARTINS	12,272	24.740	303,609.280	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	132,745	4.613	612,352.680	
	GALP ENERGIA SGPS SA	21,724	10.740	233,315.760	
	EDP RENOVAVEIS SA	12,491	19.430	242,700.130	
	KERRY GROUP PLC-A	7,189	90.120	647,872.680	
	CRH PLC	33,337	47.270	1,575,839.990	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	7,983	181.250	1,446,918.750	
	ユーロ 小計			216,279,612.610 (32,906,943,059)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	68,000	41.150	2,798,200.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	108,000	51.350	5,545,800.000	
	MTR CORP	76,500	36.800	2,815,200.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	71,500	101.200	7,235,800.000	
	SINO LAND CO	182,000	9.700	1,765,400.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	132,169	48.850	6,456,455.650	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	24,000	53.550	1,285,200.000	
	CLP HOLDINGS LTD	80,500	56.550	4,552,275.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	66,507	23.550	1,566,239.850	
	HONG KONG & CHINA GAS	536,475	6.850	3,674,853.750	
	HANG SENG BANK LTD	36,600	112.800	4,128,480.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	72,500	19.960	1,447,100.000	

WH GROUP LTD	399,000	4.150	1,655,850.000	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	59,100	311.200	18,391,920.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	97,000	13.040	1,264,880.000	
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	87,000	12.400	1,078,800.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	54,000	19.760	1,067,040.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	95,669	44.550	4,262,053.950	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	30,000	41.750	1,252,500.000	
AIA GROUP LTD	565,600	82.150	46,464,040.000	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	64,000	14.020	897,280.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	80,000	41.050	3,284,000.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	82,400	21.250	1,751,000.000	
ESR CAYMAN LTD	95,800	13.980	1,339,284.000	
SANDS CHINA LTD	119,600	28.500	3,408,600.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	68,000	81.600	5,548,800.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	177,000	24.100	4,265,700.000	
香港・ドル 小計			139,202,752.200 (2,495,905,347)	
合計			334,734,999,666 [334,734,999,666]	

## (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	6,537	1,243,075.920	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	15,207	1,686,456.300	
		BOSTON PROPERTIES INC	6,700	363,341.000	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	5,000	1,149,100.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	16,800	1,115,016.000	
		EQUINIX INC	4,408	3,419,638.240	
		AMERICAN TOWER CORP	21,700	4,188,534.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	33,343	582,168.780	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	15,200	529,416.000	
		KIMCO REALTY CORP	28,900	557,770.000	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	17,300	338,388.000	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	12,200	611,586.000	
		INVITATION HOMES INC	28,500	970,140.000	
		VICI PROPERTIES INC	46,900	1,518,622.000	
		VENTAS INC	18,600	861,552.000	
		WEYERHAEUSER CO	34,214	1,044,211.280	

	CROWN CASTLE INTL CORP	20,200	2,311,082.000	
	IRON MOUNTAIN INC	13,600	771,392.000	
	SUN COMMUNITIES INC	5,800	775,924.000	
	PROLOGIS INC	42,954	5,251,985.580	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,700	938,784.000	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	5,000	558,800.000	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,000	700,170.000	
	WELLTOWER INC	23,200	1,891,728.000	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	25,500	527,850.000	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,400	828,360.000	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,200	554,648.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	23,100	477,015.000	
	REALTY INCOME CORP	30,895	1,890,156.100	
	PUBLIC STORAGE	7,400	2,102,488.000	
	REGENCY CENTERS CORP	7,200	438,048.000	
	UDR INC	14,500	625,095.000	
	WP CAREY INC	10,000	699,200.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	13,600	1,434,664.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	6,300	902,916.000	
アメリカ・ドル 小計			43,859,321.200 (6,157,410,103)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	30,834	183,092.290	
	SEGR0 PLC	55,182	416,844.820	
	BRITISH LAND CO PLC	38,375	128,441.120	
イギリス・ポンド 小計			728,378.230 (129,447,379)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	45,529	358,313.230	
	LENDLEASE GROUP	28,107	198,716.490	
	TRANSURBAN GROUP	134,358	1,917,288.660	
	APA GROUP	50,633	508,355.320	
	SCENTRE GROUP	218,948	567,075.320	
	GPT GROUP	81,080	325,941.600	
	MIRVAC GROUP	173,080	377,314.400	
	STOCKLAND	104,777	426,442.390	
	GOODMAN GROUP	73,798	1,453,082.620	
	VICINITY CENTRES	163,150	303,459.000	

オーストラリア・ドル 小計			6,435,989.030 (613,800,274)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,400	169,796.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5,800	115,362.000	
カナダ・ドル 小計			285,158.000 (30,027,138)	
シンガポール・ ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	165,600	442,152.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	261,870	515,883.900	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	170,200	282,532.000	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	112,700	187,082.000	
シンガポール・ドル 小計			1,427,649.900 (149,303,627)	
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	5,203	243,864.610	
	GECINA SA	1,995	195,510.000	
	KLEPIERRE	9,340	208,375.400	
	COVIVIO	2,000	92,480.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,389	194,921.820	
ユーロ 小計			935,151.830 (142,283,351)	
香港・ドル	LINK REIT	124,500	5,820,375.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	181,000	1,632,620.000	
香港・ドル 小計			7,452,995.000 (133,632,201)	
投資証券 合計			7,355,904,073 [7,355,904,073]	
合計			7,355,904,073 [7,355,904,073]	

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	97.6%	74.2%
	投資証券	35銘柄		
イギリス・ポンド	株式	79銘柄	99.1%	4.3%
	投資証券	3銘柄		
イスラエル・シェケル	株式	9銘柄	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式	49銘柄	91.3%	2.1%
	投資証券	10銘柄		
カナダ・ドル	株式	85銘柄	99.7%	3.3%
	投資証券	2銘柄		
シンガポール・ドル	株式	16銘柄	88.8%	0.4%
	投資証券	4銘柄		
スイス・フラン	株式	44銘柄	100%	2.9%
スウェーデン・クローナ	株式	46銘柄	100%	1.0%
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄	100%	0.9%
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	221銘柄	99.6%	9.7%
	投資証券	5銘柄		
香港・ドル	株式	27銘柄	94.9%	0.8%
	投資証券	2銘柄		

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 【ダイワ日本債券インデックス(ダイワSMA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7期計算期間(2022年6月16日から2023年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

### 1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 2022年6月15日現在	第7期 2023年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	30,100,887	58,761,369
親投資信託受益証券	18,645,471,380	24,836,040,680
未収入金	-	146,983,918
流動資産合計	18,675,572,267	25,041,785,967
<b>資産合計</b>		
	18,675,572,267	25,041,785,967
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	-	12,610,514
未払解約金	-	146,976,035
未払受託者報酬	841,539	1,529,261
未払委託者報酬	10,519,860	19,116,278
その他未払費用	420,702	764,545
流動負債合計	11,782,101	180,996,633
<b>負債合計</b>		
	11,782,101	180,996,633
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 18,951,985,094	<sup>1</sup> 25,221,028,431
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	<sup>2</sup> 288,194,928	<sup>2</sup> 360,239,097
（分配準備積立金）	96,112,250	166,355,581
元本等合計	18,663,790,166	24,860,789,334
<b>純資産合計</b>		
	18,663,790,166	24,860,789,334
<b>負債純資産合計</b>		
	18,675,572,267	25,041,785,967



## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第6期		第7期	
	自 2021年6月16日 至 2022年6月15日		自 2022年6月16日 至 2023年6月15日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		2		17
有価証券売買等損益		529,522,933		46,085,302
営業収益合計		529,522,931		46,085,319
<b>営業費用</b>				
支払利息		2,974		16,150
受託者報酬		1,230,842		3,326,400
委託者報酬		15,386,672		41,581,122
その他費用		615,274		1,663,060
営業費用合計		17,235,762		46,586,732
営業損失( )		546,758,693		501,413
経常損失( )		546,758,693		501,413
当期純損失( )		546,758,693		501,413
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( )		8,919,012		50,423,226
期首剰余金又は期首欠損金( )		111,522,719		288,194,928
剰余金増加額又は欠損金減少額		154,905,892		216,963,655
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		216,963,655
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		154,905,892		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		16,783,858		326,319,123
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		16,783,858		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		326,319,123
分配金		1 -		1 12,610,514
期末剰余金又は期末欠損金( )		288,194,928		360,239,097

## (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7期
	自2022年6月16日 至2023年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1. 1 期首元本額	5,663,399,869円	18,951,985,094円
期中追加設定元本額	14,231,839,472円	20,573,676,151円
期中一部解約元本額	943,254,247円	14,304,632,814円
2. 計算期間末日における受益権の総数	18,951,985,094口	25,221,028,431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288,194,928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360,239,097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6期	第7期
	自2021年6月16日 至2022年6月15日	自2022年6月16日 至2023年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(64,156,295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(713,199,327円)及び分配準備積立金(31,955,955円)より分配対象額は809,311,577円(1万口当たり427.03円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(119,373,419円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,024,316,271円)及び分配準備積立金(59,592,676円)より分配対象額は1,203,282,366円(1万口当たり477.09円)であり、うち12,610,514円(1万口当たり5円)を分配金額としております。</p>
------------	---	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第7期 自2022年6月16日 至2023年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。</p> <p>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第7期
	2023年6月15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6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15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	522,370,343	82,928,985
合計	522,370,343	82,928,985

## (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6期	第7期
2022年6月15日現在	2023年6月15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7期
自2022年6月16日
至2023年6月15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6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1口当たり純資産額	0.9848円	0.9857円
(1万口当たり純資産額)	(9,848円)	(9,857円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	18,044,202,761	24,836,040,680	
親投資信託受益証券 合計			24,836,040,680	
合計			24,836,040,680	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2022年6月15日現在 金額 (円)	2023年6月15日現在 金額 (円)
資産の部		

流動資産		
コール・ローン	302,073,691	518,536,777
国債証券	92,613,356,150	98,258,745,880
地方債証券	3,235,573,500	5,181,131,600
特殊債券	2,139,540,000	2,638,329,900
社債券	3,011,147,700	5,469,294,700
未収利息	224,306,352	234,276,260
前払費用	7,247,473	11,768,485
流動資産合計	101,533,244,866	112,312,083,602
資産合計	101,533,244,866	112,312,083,602
負債の部		
流動負債		
未払解約金	38,930,233	161,642,018
流動負債合計	38,930,233	161,642,018
負債合計	38,930,233	161,642,018
純資産の部		
元本等		
元本	1 73,960,042,577	81,482,693,217
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	27,534,272,056	30,667,748,367
元本等合計	101,494,314,633	112,150,441,584
純資産合計	101,494,314,633	112,150,441,584
負債純資産合計	101,533,244,866	112,312,083,602

## 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6月16日 至2023年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1. 1 期首	2021年6月16日	2022年6月16日
期首元本額	64,064,308,423円	73,960,042,577円
期中追加設定元本額	17,973,852,132円	24,175,910,309円
期中一部解約元本額	8,078,117,978円	16,653,259,669円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	54,565,427円	45,707,970円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	315,564,639円	257,319,978円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	48,652,428円	38,998,448円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	613,503,159円	508,218,693円
DCダイワ日本債券インデック ス	10,111,102,726円	10,677,575,748円
ダイワ国内債券インデックス (ラップ専用)	174,707,253円	4,443,088,033円
ダイワ・バランスファンド35 VA	9,361,547,593円	8,403,957,372円
ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	1,608,085,232円	1,491,821,438円
ダイワ国内バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専用)	206,246,835円	189,175,173円
ダイワ国内バランスファンド3 0VA(適格機関投資家専用)	265,114,893円	230,352,173円

ダイワ・ノーロード 日本債券 ファンド	64,583,321円	64,009,901円
ダイワファンドラップ 日本債券 インデックス	26,819,810,382円	26,632,158,744円
ダイワ日本債券インデックス （ダイワSMA専用）	13,587,022,794円	18,044,202,761円
ダイワファンドラップオンライ ン 日本債券インデックス	2,204,813,322円	2,103,335,471円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	914,338,515円	836,254,996円
ダイワ投信倶楽部日本債券イン デックス	6,497,025,332円	6,361,008,900円
ダイワライフスタイル25	437,731,133円	436,278,657円
ダイワライフスタイル50	536,978,217円	565,099,699円
ダイワライフスタイル75	138,649,376円	154,129,062円
計	73,960,042,577円	81,482,693,217円
2. 期末日における受益権の総数	73,960,042,577口	81,482,693,217口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2022年6月16日 至2023年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項



区分	2023年6月15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	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	3,528,371,060	908,525,830
地方債証券	77,752,400	7,139,300
特殊債券	58,493,700	4,607,500
社債券	64,962,000	8,003,500
合計	3,729,579,160	912,269,130

(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

2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1口当たり純資産額	1.3723円	1.3764円
(1万口当たり純資産額)	(13,723円)	(13,764円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
国債証券	4 3 9 2年国債	650,000,000	651,020,500	
	4 4 0 2年国債	180,000,000	180,293,400	
	4 4 1 2年国債	80,000,000	80,128,800	
	4 4 2 2年国債	500,000,000	500,790,000	
	4 4 3 2年国債	220,000,000	220,352,000	
	4 4 5 2年国債	100,000,000	100,163,000	
	4 4 8 2年国債	240,000,000	240,381,600	
	1 4 1 5年国債	1,240,000,000	1,243,447,200	
	1 4 2 5年国債	1,040,000,000	1,043,140,800	
	1 4 3 5年国債	2,500,000,000	2,508,125,000	
	1 4 4 5年国債	1,180,000,000	1,184,153,600	
	1 4 5 5年国債	1,650,000,000	1,656,352,500	
	1 4 6 5年国債	1,080,000,000	1,084,482,000	
	1 4 7 5年国債	1,630,000,000	1,632,917,700	
	1 4 8 5年国債	1,380,000,000	1,382,277,000	
	1 4 9 5年国債	680,000,000	680,999,600	
	1 5 0 5年国債	1,250,000,000	1,251,537,500	
	1 5 1 5年国債	1,240,000,000	1,240,930,000	
	1 5 3 5年国債	750,000,000	750,000,000	
	1 5 4 5年国債	690,000,000	692,201,100	
	1 5 5 5年国債	730,000,000	738,380,400	
	1 4 0年国債	70,000,000	88,831,400	
	2 4 0年国債	110,000,000	134,285,800	
	3 4 0年国債	150,000,000	183,163,500	
	4 4 0年国債	180,000,000	219,999,600	
	5 4 0年国債	185,000,000	218,275,950	
	6 4 0年国債	285,000,000	330,557,250	
	7 4 0年国債	121,000,000	134,289,430	
	8 4 0年国債	230,000,000	237,571,600	
	9 4 0年国債	220,000,000	168,509,000	
	1 0 4 0年国債	230,000,000	206,236,400	
	1 1 4 0年国債	320,000,000	276,723,200	
	1 2 4 0年国債	380,000,000	294,294,800	
	1 3 4 0年国債	360,000,000	276,336,000	
	1 4 4 0年国債	430,000,000	351,735,700	
1 5 4 0年国債	630,000,000	565,973,100		

1 6	4 0 年国債	340,000,000	332,588,000	
3 3 5	1 0 年国債	690,000,000	695,409,600	
3 3 6	1 0 年国債	275,000,000	277,497,000	
3 3 7	1 0 年国債	400,000,000	402,420,000	
3 3 8	1 0 年国債	580,000,000	584,953,200	
3 3 9	1 0 年国債	590,000,000	595,640,400	
3 4 0	1 0 年国債	760,000,000	768,094,000	
3 4 1	1 0 年国債	500,000,000	504,590,000	
3 4 2	1 0 年国債	710,000,000	713,138,200	
3 4 3	1 0 年国債	780,000,000	783,525,600	
3 4 4	1 0 年国債	780,000,000	783,564,600	
3 4 5	1 0 年国債	950,000,000	954,341,500	
3 4 6	1 0 年国債	780,000,000	783,369,600	
3 4 7	1 0 年国債	1,100,000,000	1,104,180,000	
3 4 8	1 0 年国債	1,050,000,000	1,053,349,500	
3 4 9	1 0 年国債	1,250,000,000	1,253,087,500	
3 5 0	1 0 年国債	900,000,000	900,846,000	
3 5 2	1 0 年国債	700,000,000	699,811,000	
3 5 3	1 0 年国債	930,000,000	928,977,000	
3 5 4	1 0 年国債	680,000,000	678,633,200	
3 5 5	1 0 年国債	1,380,000,000	1,376,287,800	
3 5 6	1 0 年国債	500,000,000	498,135,000	
3 5 7	1 0 年国債	750,000,000	746,137,500	
3 5 8	1 0 年国債	980,000,000	973,786,800	
3 5 9	1 0 年国債	800,000,000	793,640,000	
3 6 0	1 0 年国債	940,000,000	930,271,000	
3 6 1	1 0 年国債	970,000,000	957,855,600	
3 6 2	1 0 年国債	790,000,000	778,608,200	
3 6 3	1 0 年国債	1,200,000,000	1,180,296,000	
3 6 4	1 0 年国債	1,000,000,000	981,890,000	
3 6 5	1 0 年国債	700,000,000	686,098,000	
3 6 6	1 0 年国債	950,000,000	937,488,500	
3 6 7	1 0 年国債	900,000,000	886,653,000	
3 6 8	1 0 年国債	420,000,000	413,049,000	
3 6 9	1 0 年国債	1,450,000,000	1,463,949,000	
3 7 0	1 0 年国債	130,000,000	130,912,600	
1	3 0 年国債	16,000,000	18,630,720	
2	3 0 年国債	24,000,000	27,527,040	
3	3 0 年国債	30,000,000	34,315,500	

4	30年国債	36,000,000	43,005,960	
5	30年国債	28,000,000	32,168,360	
6	30年国債	24,000,000	28,120,800	
7	30年国債	55,000,000	64,366,500	
8	30年国債	27,000,000	30,506,220	
9	30年国債	43,000,000	47,004,590	
10	30年国債	45,000,000	47,890,800	
11	30年国債	40,000,000	44,897,200	
12	30年国債	60,000,000	69,780,000	
13	30年国債	75,000,000	86,581,500	
14	30年国債	82,000,000	98,207,300	
15	30年国債	50,000,000	60,562,500	
16	30年国債	250,000,000	303,635,000	
17	30年国債	130,000,000	156,716,300	
18	30年国債	80,000,000	95,726,400	
19	30年国債	57,000,000	68,353,830	
21	30年国債	60,000,000	72,165,000	
22	30年国債	170,000,000	209,023,500	
24	30年国債	92,000,000	113,474,640	
25	30年国債	150,000,000	181,531,500	
26	30年国債	180,000,000	220,478,400	
27	30年国債	150,000,000	186,220,500	
28	30年国債	170,000,000	211,498,700	
29	30年国債	200,000,000	246,544,000	
30	30年国債	220,000,000	268,246,000	
31	30年国債	300,000,000	361,479,000	
32	30年国債	285,000,000	347,916,600	
33	30年国債	280,000,000	328,720,000	
34	30年国債	270,000,000	325,989,900	
35	30年国債	250,000,000	294,055,000	
36	30年国債	350,000,000	412,118,000	
37	30年国債	450,000,000	522,157,500	
38	30年国債	600,000,000	684,270,000	
39	30年国債	270,000,000	312,865,200	
40	30年国債	180,000,000	205,299,000	
41	30年国債	210,000,000	235,622,100	
42	30年国債	205,000,000	230,063,300	
43	30年国債	260,000,000	291,852,600	
44	30年国債	300,000,000	336,822,000	

4 5	3 0 年国債	250,000,000	271,167,500	
4 6	3 0 年国債	210,000,000	227,745,000	
4 7	3 0 年国債	370,000,000	408,206,200	
4 8	3 0 年国債	280,000,000	297,682,000	
4 9	3 0 年国債	220,000,000	233,807,200	
5 0	3 0 年国債	310,000,000	291,744,100	
5 1	3 0 年国債	340,000,000	284,821,400	
5 2	3 0 年国債	385,000,000	337,213,800	
5 3	3 0 年国債	250,000,000	223,515,000	
5 4	3 0 年国債	310,000,000	289,481,100	
5 5	3 0 年国債	260,000,000	242,192,600	
5 6	3 0 年国債	340,000,000	315,924,600	
5 7	3 0 年国債	330,000,000	305,863,800	
5 8	3 0 年国債	430,000,000	397,547,900	
5 9	3 0 年国債	300,000,000	269,844,000	
6 0	3 0 年国債	220,000,000	206,802,200	
6 1	3 0 年国債	200,000,000	178,376,000	
6 2	3 0 年国債	430,000,000	363,264,000	
6 3	3 0 年国債	300,000,000	245,844,000	
6 4	3 0 年国債	220,000,000	179,649,800	
6 5	3 0 年国債	270,000,000	220,349,700	
6 6	3 0 年国債	220,000,000	178,389,200	
6 7	3 0 年国債	300,000,000	256,224,000	
6 8	3 0 年国債	340,000,000	289,469,200	
6 9	3 0 年国債	350,000,000	305,585,000	
7 0	3 0 年国債	300,000,000	261,417,000	
7 1	3 0 年国債	310,000,000	269,867,400	
7 2	3 0 年国債	320,000,000	278,016,000	
7 3	3 0 年国債	240,000,000	208,310,400	
7 4	3 0 年国債	320,000,000	300,531,200	
7 5	3 0 年国債	330,000,000	333,511,200	
7 6	3 0 年国債	480,000,000	497,020,800	
7 7	3 0 年国債	20,000,000	21,696,200	
7 2	2 0 年国債	105,000,000	107,948,400	
7 3	2 0 年国債	120,000,000	123,816,000	
7 4	2 0 年国債	73,000,000	75,432,360	
7 5	2 0 年国債	80,000,000	83,078,400	
7 6	2 0 年国債	51,000,000	52,782,960	
7 7	2 0 年国債	130,000,000	134,773,600	

78	20年国債	61,000,000	63,425,970	
79	20年国債	50,000,000	52,089,500	
80	20年国債	53,000,000	55,321,400	
82	20年国債	87,000,000	91,278,660	
83	20年国債	93,000,000	98,066,640	
85	20年国債	58,000,000	61,462,020	
86	20年国債	80,000,000	85,216,800	
87	20年国債	55,000,000	58,434,750	
88	20年国債	100,000,000	107,086,000	
89	20年国債	78,000,000	83,291,520	
90	20年国債	20,000,000	21,463,600	
92	20年国債	310,000,000	333,215,900	
93	20年国債	100,000,000	107,578,000	
94	20年国債	130,000,000	140,340,200	
95	20年国債	50,000,000	54,601,500	
96	20年国債	55,000,000	59,620,550	
97	20年国債	40,000,000	43,704,800	
98	20年国債	320,000,000	348,275,200	
99	20年国債	100,000,000	109,254,000	
100	20年国債	155,000,000	170,617,800	
101	20年国債	350,000,000	388,587,500	
105	20年国債	126,000,000	139,192,200	
106	20年国債	150,000,000	166,491,000	
107	20年国債	90,000,000	99,785,700	
108	20年国債	300,000,000	329,331,000	
109	20年国債	55,000,000	60,564,350	
110	20年国債	260,000,000	289,276,000	
111	20年国債	200,000,000	224,624,000	
112	20年国債	150,000,000	167,574,000	
113	20年国債	310,000,000	347,506,900	
114	20年国債	70,000,000	78,701,700	
115	20年国債	180,000,000	203,535,000	
116	20年国債	200,000,000	226,902,000	
117	20年国債	200,000,000	225,566,000	
118	20年国債	95,000,000	106,785,700	
119	20年国債	93,000,000	103,252,320	
120	20年国債	317,000,000	347,561,970	
121	20年国債	200,000,000	223,858,000	
122	20年国債	200,000,000	222,430,000	

1 2 3	2 0 年国債	200,000,000	227,282,000	
1 2 4	2 0 年国債	300,000,000	338,712,000	
1 2 5	2 0 年国債	130,000,000	149,067,100	
1 2 6	2 0 年国債	110,000,000	124,414,400	
1 2 7	2 0 年国債	250,000,000	280,860,000	
1 2 8	2 0 年国債	250,000,000	281,510,000	
1 2 9	2 0 年国債	200,000,000	223,642,000	
1 3 0	2 0 年国債	140,000,000	156,868,600	
1 3 1	2 0 年国債	150,000,000	166,864,500	
1 3 2	2 0 年国債	100,000,000	111,435,000	
1 3 4	2 0 年国債	30,000,000	33,739,800	
1 3 5	2 0 年国債	92,000,000	102,685,800	
1 3 6	2 0 年国債	550,000,000	609,202,000	
1 3 8	2 0 年国債	300,000,000	330,135,000	
1 3 9	2 0 年国債	370,000,000	410,400,300	
1 4 0	2 0 年国債	570,000,000	638,177,700	
1 4 1	2 0 年国債	400,000,000	448,472,000	
1 4 2	2 0 年国債	190,000,000	214,768,400	
1 4 3	2 0 年国債	210,000,000	233,448,600	
1 4 4	2 0 年国債	390,000,000	429,885,300	
1 4 5	2 0 年国債	340,000,000	381,626,200	
1 4 6	2 0 年国債	420,000,000	471,731,400	
1 4 7	2 0 年国債	400,000,000	445,500,000	
1 4 8	2 0 年国債	270,000,000	298,020,600	
1 4 9	2 0 年国債	532,000,000	587,519,520	
1 5 0	2 0 年国債	530,000,000	579,931,300	
1 5 1	2 0 年国債	480,000,000	514,612,800	
1 5 2	2 0 年国債	500,000,000	535,890,000	
1 5 3	2 0 年国債	680,000,000	736,623,600	
1 5 4	2 0 年国債	630,000,000	674,717,400	
1 5 5	2 0 年国債	440,000,000	460,482,000	
1 5 6	2 0 年国債	500,000,000	486,130,000	
1 5 7	2 0 年国債	560,000,000	529,132,800	
1 5 8	2 0 年国債	350,000,000	342,958,000	
1 5 9	2 0 年国債	350,000,000	346,748,500	
1 6 0	2 0 年国債	460,000,000	460,864,800	
1 6 1	2 0 年国債	420,000,000	414,376,200	
1 6 2	2 0 年国債	580,000,000	570,627,200	
1 6 3	2 0 年国債	480,000,000	471,192,000	

164	20年国債	300,000,000	289,647,000		
165	20年国債	370,000,000	356,076,900		
166	20年国債	600,000,000	593,046,000		
167	20年国債	400,000,000	382,648,000		
168	20年国債	420,000,000	394,279,200		
169	20年国債	320,000,000	294,572,800		
170	20年国債	420,000,000	385,068,600		
171	20年国債	500,000,000	456,540,000		
172	20年国債	200,000,000	185,032,000		
173	20年国債	510,000,000	470,296,500		
174	20年国債	600,000,000	551,466,000		
175	20年国債	400,000,000	372,972,000		
176	20年国債	580,000,000	539,110,000		
177	20年国債	530,000,000	482,570,300		
178	20年国債	450,000,000	416,214,000		
179	20年国債	380,000,000	350,591,800		
180	20年国債	490,000,000	476,397,600		
181	20年国債	500,000,000	493,585,000		
182	20年国債	340,000,000	346,891,800		
183	20年国債	240,000,000	257,140,800		
184	20年国債	240,000,000	243,758,400		
27	メキシコ国債	100,000,000	97,877,000		
11	フィリピン共和国	100,000,000	99,588,700		
国債証券 合計			98,258,745,880		
地方債証券	751	東京都公債	100,000,000	100,800,400	
	796	東京都公債	100,000,000	98,352,500	
	808	東京都公債	100,000,000	97,828,100	
	827	東京都公債	100,000,000	97,910,600	
	4	東京都5年	200,000,000	199,859,800	
	16	東京都20年	100,000,000	109,628,100	
	3-5	北海道公債	100,000,000	97,093,200	
	37-2	宮城県公債	100,000,000	96,920,500	
	222	神奈川県公債	100,000,000	99,936,900	
	31	神奈川県20年	100,000,000	101,984,700	
	420	大阪府公債	200,000,000	200,057,200	
	7	大阪府20年	200,000,000	221,232,600	
	26-17	兵庫県公債	100,000,000	100,698,300	
	3	兵庫県公債12年	200,000,000	201,848,600	



	1 9 兵庫県公債 2 0 年	100,000,000	108,222,200	
	2 6 - 1 0 静岡県公債	100,000,000	100,702,700	
	8 静岡県 2 0 年	200,000,000	223,754,000	
	2 1 - 5 愛知県公債	100,000,000	111,848,000	
	2 7 - 1 2 愛知県 1 5 年	100,000,000	102,435,500	
	2 9 - 5 広島県公債	100,000,000	100,187,300	
	2 - 7 埼玉県公債	100,000,000	97,864,700	
	4 埼玉県 3 0 年	100,000,000	101,913,800	
	9 埼玉県 2 0 年	100,000,000	112,240,900	
	1 2 埼玉県 2 0 年	100,000,000	110,332,700	
	2 9 - 1 福岡県公債	100,000,000	100,191,800	
	5 - 1 福岡県公債	100,000,000	99,979,400	
	2 2 - 1 福岡県 1 5 年	100,000,000	103,911,800	
	1 3 千葉県 2 0 年	100,000,000	110,065,600	
	1 6 千葉県 2 0 年	100,000,000	108,417,300	
	2 8 - 2 新潟県公債	100,000,000	100,250,100	
	1 6 8 共同発行地方	100,000,000	100,341,200	
	4 - 3 長崎県公債	100,000,000	98,385,800	
	2 7 - 1 滋賀県公債	100,000,000	101,018,000	
	1 1 名古屋市 2 0 年	100,000,000	111,575,400	
	1 0 京都市 2 0 年	100,000,000	110,631,800	
	2 0 - 1 神戸市 2 0 年	100,000,000	110,581,200	
	1 9 横浜市 2 0 年	100,000,000	111,666,600	
	2 - 4 札幌市公債	100,000,000	97,891,700	
	4 川崎市公債 3 0 年	100,000,000	116,628,800	
	1 北九州市 1 5 年	100,000,000	103,908,800	
	2 3 - 4 福岡市 2 0 年	100,000,000	111,120,000	
	1 - 5 千葉市公債	100,000,000	98,276,500	
	3 - 2 徳島県公債	100,000,000	96,825,400	
	1 - 1 山梨県公債	100,000,000	98,318,600	
	2 - 2 岡山県公債	100,000,000	97,492,500	
地方債証券	合計		5,181,131,600	
特殊債券	4 7 日本政策投資 C O	100,000,000	104,131,700	
	2 4 7 道路機構	200,000,000	178,750,400	
	8 6 政保道路機構	100,000,000	110,719,100	
	2 2 3 政保道路機構	100,000,000	108,129,200	
	2 3 6 政保道路機構	100,000,000	100,553,400	
	2 6 1 政保道路機構	200,000,000	201,854,600	
	2 8 4 政保道路機構	200,000,000	185,076,800	

	2 9 8 政保道路機構	100,000,000	97,171,900	
	F 1 4 3 地方公共団体	100,000,000	104,787,700	
	1 地方公共団 1 5 年	100,000,000	105,005,700	
	3 1 地方公共団 2 0	100,000,000	110,220,800	
	F 1 9 2 地方公共団体	100,000,000	104,605,200	
	F 2 2 1 地方公共団体	200,000,000	210,717,000	
	F 2 2 6 地方公共団体	100,000,000	104,394,700	
	6 5 地方公共団体	100,000,000	100,652,900	
	7 1 地方公共団体	100,000,000	100,702,800	
	1 2 9 地方公共団体	200,000,000	196,052,800	
	1 2 7 都市再生	100,000,000	99,766,300	
	8 0 住宅支援機構	100,000,000	104,709,400	
	1 2 3 住宅支援機構	100,000,000	110,612,700	
	1 9 利付商工債	100,000,000	99,714,800	
	特殊債券 合計		2,638,329,900	
社債券	2 0 成田国際空港	100,000,000	99,756,200	
	6 3 中日本高速道	100,000,000	101,104,700	
	2 2 積水ハウス	100,000,000	99,996,500	
	1 2 アサヒグループHD	100,000,000	100,124,100	
	1 1 サントリーホールディング	100,000,000	99,993,200	
	1 1 日本たばこ産業	100,000,000	100,941,200	
	1 1 ヒューリック	100,000,000	100,028,000	
	5 野村不動産HD	100,000,000	101,344,100	
	2 3 森ビル	100,000,000	94,100,400	
	1 4 セブンアンドアイ	100,000,000	99,840,200	
	1 レゾナックHD	100,000,000	100,003,800	
	7 花王 FR	100,000,000	100,000,000	
	2 0 ZHD	100,000,000	97,385,100	
	1 8 楽天グループ	100,000,000	73,535,800	
	2 AGC	100,000,000	99,980,500	
	7 日本製鉄	100,000,000	100,689,800	
	1 6 クボタ	100,000,000	100,455,300	
	1 7 パナソニック	100,000,000	100,286,600	
	1 5 デンソー	100,000,000	99,542,400	
	3 1 トヨタ自動車	100,000,000	99,979,500	
	6 楽天カード	100,000,000	92,062,500	
	1 日生 2 0 2 1 基金	100,000,000	99,767,500	
	7 凸版印刷	100,000,000	103,489,300	
	3 1 豊田通商	200,000,000	200,007,800	

6 3	住友商事	100,000,000	99,990,700	
2 6	りそなホールディング	100,000,000	99,996,500	
3 6	芙蓉総合リース	100,000,000	99,985,200	
1 6	NTTファイナンス	100,000,000	99,830,200	
8 1	ホンダファイナンス	100,000,000	100,000,000	
7 8	トヨタファイナンス	100,000,000	99,623,800	
4 2	リコーリース	100,000,000	99,984,700	
3 6	三井住友F&L	200,000,000	199,976,000	
1	SOMPOHD	100,000,000	99,986,200	
7	三井住友海上	100,000,000	99,635,000	
8 2	三井不動産	100,000,000	99,996,500	
1 4 3	三菱地所	100,000,000	100,652,900	
1 1 1	住友不動産	100,000,000	100,516,400	
1 3	NTTファイナンス	100,000,000	103,471,300	
1 0 7	東日本旅客鉄	100,000,000	99,892,900	
4 1	東海旅客鉄道	100,000,000	109,408,800	
1 5	ソフトバンク	100,000,000	97,057,200	
5 0 9	関西電力	100,000,000	100,527,200	
5 3 8	関西電力	100,000,000	97,458,500	
4 4 8	中国電力	100,000,000	100,098,400	
4 8 2	九州電力	100,000,000	100,093,800	
3 3 2	北海道電力	100,000,000	95,510,900	
3 4	沖縄電力	100,000,000	99,999,500	
8 5	電源開発	100,000,000	101,901,200	
1 1	東京電力パワー	100,000,000	100,348,400	
1 6	J E R A	100,000,000	100,798,200	
6 5	東京瓦斯	100,000,000	96,915,200	
5 0	大阪瓦斯	100,000,000	99,995,600	
4	ファーストリテイリング	100,000,000	101,229,000	
社債券 合計			5,469,294,700	
合計			111,547,502,080	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。



【ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA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7期計算期間(2022年6月16日から2023年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 2022年6月15日現在	第7期 2023年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	300,690,562	78,882,762
親投資信託受益証券	16,243,405,990	15,347,133,496
未収入金	-	79,985,053
流動資産合計	16,544,096,552	15,506,001,311
資産合計	16,544,096,552	15,506,001,311
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	214,320,791	-
未払解約金	-	79,177,396
未払受託者報酬	1,911,862	1,733,869
未払委託者報酬	34,414,472	31,210,567
その他未払費用	716,884	650,123
流動負債合計	251,364,009	112,771,955
負債合計	251,364,009	112,771,955
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 17,860,065,982	<sup>1</sup> 17,697,664,507
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	<sup>2</sup> 1,567,333,439	<sup>2</sup> 2,304,435,151
（分配準備積立金）	197,858,674	431,232,773
元本等合計	16,292,732,543	15,393,229,356
純資産合計	16,292,732,543	15,393,229,356
負債純資産合計	16,544,096,552	15,506,001,311

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第6期		第7期	
	自 2021年6月16日 至 2022年6月15日		自 2022年6月16日 至 2023年6月15日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		8		28
有価証券売買等損益		2,559,494,047		912,340,824
<b>営業収益合計</b>		<b>2,559,494,039</b>		<b>912,340,796</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		11,546		28,291
受託者報酬		3,019,676		4,056,722
委託者報酬		54,355,802		73,022,517
その他費用		1,132,232		1,521,113
<b>営業費用合計</b>		<b>58,519,256</b>		<b>78,628,643</b>
<b>営業損失（ ）</b>		<b>2,618,013,295</b>		<b>990,969,439</b>
経常損失（ ）		2,618,013,295		990,969,439
<b>当期純損失（ ）</b>		<b>2,618,013,295</b>		<b>990,969,439</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		35,302,322		267,260,415
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>		<b>552,166,225</b>		<b>1,567,333,439</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額		761,740,268		996,695,296
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		996,695,296
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		761,740,268		-
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>84,208,168</b>		<b>1,010,087,984</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		84,208,168		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		1,010,087,984
<b>分配金</b>		<b>1,214,320,791</b>		<b>1-</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>		<b>1,567,333,439</b>		<b>2,304,435,151</b>

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第7期
	自2022年6月16日 至2023年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1. 1 期首元本額	7,628,232,231円	17,860,065,982円
期中追加設定元本額	11,384,539,682円	11,600,215,353円
期中一部解約元本額	1,152,705,931円	11,762,616,828円
2. 計算期間末日における受益権の総数	17,860,065,982口	17,697,664,507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1,567,333,439円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,304,435,151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6期	第7期
	自2021年6月16日 至2022年6月15日	自2022年6月16日 至2023年6月15日



1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（247,543,625円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,518,860,275円）及び分配準備積立金（164,635,840円）より分配対象額は1,931,039,740円（1万口当たり1,081.21円）であり、うち214,320,791円（1万口当たり120円）を分配金額としております。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（322,333,437円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,607,849,233円）及び分配準備積立金（108,899,336円）より分配対象額は2,039,082,006円（1万口当たり1,152.18円）であり、分配を行っておりません。</p>
------------	--	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第7期 自2022年6月16日 至2023年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第7期
	2023年6月15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6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	2,502,413,391	667,089,247
合計	2,502,413,391	667,089,247

## (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6期	第7期
2022年6月15日現在	2023年6月15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7期
自2022年6月16日
至2023年6月15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6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1口当たり純資産額	0.9122円	0.8698円
(1万口当たり純資産額)	(9,122円)	(8,698円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	17,824,777,580	15,347,133,496	
親投資信託受益証券 合計			15,347,133,496	
合計			15,347,133,496	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

「外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2022年6月15日現在 金額 (円)	2023年6月15日現在 金額 (円)
資産の部		

流動資産		
預金	508,189,860	1,177,169,181
コール・ローン	516,355,179	2,042,811,022
国債証券	122,375,149,528	120,077,109,021
派生商品評価勘定	4,087,089	17,286,979
未収利息	810,738,948	820,688,338
前払費用	30,000,154	43,682,720
差入委託証拠金	251,030,114	278,481,888
流動資産合計	124,495,550,872	124,457,229,149
資産合計	124,495,550,872	124,457,229,149
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,353,912,676	1,820,330,153
未払金	1,785,041	350,335,223
未払解約金	19,061,932	79,985,053
流動負債合計	4,374,759,649	2,250,650,429
負債合計	4,374,759,649	2,250,650,429
純資産の部		
元本等		
元本	1 133,574,429,591	141,933,741,025
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 13,453,638,368	19,727,162,305
元本等合計	120,120,791,223	122,206,578,720
純資産合計	120,120,791,223	122,206,578,720
負債純資産合計	124,495,550,872	124,457,229,149

## 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6月16日 至2023年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価 方法	国債証券

	<p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
	<p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1. 1 期首	2021年6月16日	2022年6月16日
期首元本額	113,403,229,819円	133,574,429,591円
期中追加設定元本額	33,395,160,755円	30,925,430,263円
期中一部解約元本額	13,223,960,983円	22,566,118,829円

期末元本額の内訳			
ファンド名			
	ダイワバランスファンド2023-01 (適格機関投資家専用)	-円	2,183,533,217円
	ダイワファンドラップ 外国債券 インデックス(為替ヘッジあ り)	108,109,338,430円	114,005,277,420円
	ダイワファンドラップオンライ ン 外国債券インデックス(為替 ヘッジあり)	4,161,900,030円	4,497,197,642円
	ダイワ先進国債券インデックス (為替ヘッジあり)(ラップ専 用)	1,564,129円	6,955,905円
	ダイワバランスファンド2021-02 (適格機関投資家専用)	3,239,349,686円	3,415,999,261円
	ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジあり)(ダイワS MA専用)	18,062,277,316円	17,824,777,580円
	計	133,574,429,591円	141,933,741,025円
2.	期末日における受益権の総数	133,574,429,591口	141,933,741,025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13,453,638,368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19,727,162,305円であ ります。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2022年6月16日 至2023年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2 条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定 する「運用の基本方針」に従っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	21,108,565,524	3,796,459,728
合計	21,108,565,524	3,796,459,728

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 債券関連

種類	2022年6月15日現在				2023年6月15日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超				1年超		
市場取引								
債券先物取引								
買建	285,387,931	-	280,388,348	4,999,583	1,922,889,910	-	1,917,135,276	5,754,634
合計	285,387,931	-	280,388,348	4,999,583	1,922,889,910	-	1,917,135,276	5,754,634

（注）

### 1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

### 2. 債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## 2. 通貨関連

種類	2022年6月15日現在				2023年6月15日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超				1年超		
市場取引以外の取引								



為替予約取引								
売建	125,705,971,494	-	130,050,797,498	4,344,826,004	122,068,233,013	-	123,865,521,553	1,797,288,540
アメリカ・ドル	62,486,482,287	-	65,593,509,200	3,107,026,913	59,616,908,070	-	60,027,890,271	410,982,201
イギリス・ポンド	6,668,473,595	-	6,674,090,820	5,617,225	5,747,494,252	-	5,908,884,052	161,389,800
イスラエル・シケル	499,134,353	-	503,544,291	4,409,938	451,814,760	-	473,742,205	21,927,445
オーストラリア・ドル	1,991,754,084	-	2,009,245,224	17,491,140	1,879,774,962	-	1,985,268,862	105,493,900
オフショア・人民元	2,511,215,504	-	2,611,465,402	100,249,898	6,737,724,061	-	6,725,046,496	12,677,565
カナダ・ドル	2,587,204,274	-	2,651,819,030	64,614,756	2,536,526,294	-	2,602,603,666	66,077,372
シンガポール・ドル	591,989,018	-	611,881,241	19,892,223	568,666,761	-	577,824,951	9,158,190
スウェーデン・クローナ	345,879,122	-	348,455,165	2,576,043	266,511,192	-	272,080,655	5,569,463
デンマーク・クローネ	529,967,949	-	541,416,930	11,448,981	509,054,462	-	520,227,266	11,172,804
ニュージーランド・ドル	-	-	-	-	256,425,893	-	266,736,541	10,310,648
ノルウェー・クローネ	288,564,147	-	284,477,058	4,087,089	188,584,175	-	198,291,546	9,707,371
ポーランド・ズロチ	587,238,162	-	588,348,105	1,109,943	500,400,450	-	521,809,794	21,409,344
マレーシア・リンギット	671,860,800	-	710,242,536	38,381,736	709,250,808	-	705,800,712	3,450,096
メキシコ・ペソ	1,048,434,526	-	1,057,297,731	8,863,205	1,190,138,877	-	1,244,954,256	54,815,379
ユーロ	44,897,773,673	-	45,865,004,765	967,231,092	40,908,957,996	-	41,834,360,280	925,402,284
合計	125,705,971,494	-	130,050,797,498	4,344,826,004	122,068,233,013	-	123,865,521,553	1,797,288,540

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1口当たり純資産額	0.8993円	0.8610円
(1万口当たり純資産額)	(8,993円)	(8,610円)

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	8,950,000.000	9,675,039.500	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,910,863.000	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	1,400,000.000	1,595,552.000	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	630,000.000	692,653.500	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	2,000,000.000	2,156,280.000	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	300,000.000	339,273.000	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	430,000.000	411,178.900	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	2,000,000.000	2,146,940.000	

4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,410,000.000	1,490,073.900	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,390,000.000	1,511,666.700	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	2,270,000.000	2,498,816.000	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	600,000.000	578,388.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	670,000.000	586,497.900	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	1,500,000.000	1,231,695.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,000,000.000	819,530.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,000,000.000	1,738,700.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,500,000.000	2,083,625.000	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	1,100,000.000	1,031,415.000	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	1,532,000.000	1,461,880.360	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	1,000,000.000	935,110.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	2,200,000.000	1,977,404.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	2,940,000.000	2,534,309.400	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	12,810,000.000	12,320,017.500	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,500,000.000	2,107,125.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	1,100,000.000	847,275.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	15,300,000.000	14,572,026.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	370,000.000	311,210.700	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	14,820,000.000	14,027,426.400	

2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	12,800,000.000	12,136,960.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	1,400,000.000	1,175,832.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	12,000,000.000	11,160,000.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	300,000.000	229,938.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	6,865,000.000	6,351,978.550	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	1,070,000.000	819,149.200	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	11,750,000.000	10,781,447.500	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	500,000.000	363,765.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	14,850,000.000	13,788,967.500	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	820,740.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	5,000,000.000	4,668,750.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	900,000.000	754,938.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	5,550,000.000	5,191,414.500	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	950,000.000	797,069.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	14,000,000.000	13,000,820.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	12,700,000.000	12,270,105.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	1,000,000.000	801,030.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	7,000,000.000	6,727,490.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	700,000.000	560,875.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	4,000,000.000	3,774,440.000	

2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	15,800,000.000	15,202,128.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	1,000,000.000	839,230.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,500,000.000	2,406,425.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	1,000,000.000	858,710.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	3,300,000.000	3,126,981.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	8,000,000.000	7,564,000.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	800,000.000	671,624.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	7,300,000.000	6,979,311.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	1,850,000.000	1,663,612.500	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	15,500,000.000	14,408,335.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	1,500,000.000	1,261,845.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	2,000,000.000	1,644,280.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	2,300,000.000	2,104,362.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	7,000,000.000	6,520,360.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	5,000,000.000	4,372,450.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	2,100,000.000	1,515,507.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,400,000.000	4,750,272.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	1,300,000.000	964,379.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	4,500,000.000	3,868,560.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,000,000.000	5,456,460.000	

2% United States Treasury Note/Bond 20500215	2,500,000.000	1,700,525.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	3,000,000.000	2,408,310.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	3,400,000.000	1,894,752.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	4,000,000.000	2,583,400.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	2,000,000.000	1,834,400.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	6,300,000.000	5,027,400.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	3,700,000.000	2,129,054.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	500,000.000	320,065.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	4,000,000.000	3,243,880.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	3,800,000.000	2,337,570.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	4,500,000.000	3,866,895.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	4,000,000.000	3,616,480.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	6,300,000.000	5,423,040.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	4,100,000.000	2,688,534.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	4,900,000.000	4,039,021.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,000,000.000	1,800,880.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	1,000,000.000	874,370.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	2,400,000.000	1,736,856.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	1,000,000.000	900,990.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	5,500,000.000	4,829,330.000	

1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	4,600,000.000	3,912,576.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	3,000,000.000	2,629,860.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	4,400,000.000	3,244,824.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,600,000.000	1,228,560.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	1,000,000.000	874,860.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240615	2,000,000.000	1,903,120.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	1,500,000.000	1,309,800.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240715	8,000,000.000	7,592,320.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	4,700,000.000	3,856,444.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	3,900,000.000	2,633,085.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	5,750,000.000	4,023,735.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	2,400,000.000	2,147,280.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	4,500,000.000	3,709,575.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	1,500,000.000	979,920.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	2,000,000.000	1,457,500.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	5,400,000.000	4,626,018.000	
2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	1,500,000.000	1,073,925.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	1,000,000.000	775,480.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	2,500,000.000	2,229,675.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250415	2,000,000.000	1,924,020.000	

	2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	5,300,000.000	4,915,432.000	
	2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	2,300,000.000	1,889,979.000	
	3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,000,000.000	889,860.000	
	3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240630	4,000,000.000	3,908,000.000	
	2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	2,000,000.000	1,833,780.000	
	3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	2,000,000.000	1,686,740.000	
	3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	1,200,000.000	1,192,872.000	
	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	3,000,000.000	2,998,050.000	
	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	4,000,000.000	4,092,160.000	
	4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	3,000,000.000	3,060,000.000	
	3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	4,000,000.000	3,898,120.000	
	3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	1,000,000.000	971,560.000	
	3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	800,000.000	762,248.000	
	3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	1,000,000.000	964,760.000	
	3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	800,000.000	763,184.000	
	アメリカ・ドル 小計		417,161,586.510 (58,565,315,130)	
イギリス・ポンド	2% United Kingdom Gilt 20250907	1,350,000.000	1,267,164.000	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	810,000.000	520,830.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,775,000.000	1,612,090.500	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	650,000.000	359,151.000	



1.75% United Kingdom Gilt 20370907	820,000.000	580,371.400	
1.75% United Kingdom Gilt 20570722	900,000.000	478,890.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20270722	650,000.000	569,237.500	
1.625% United Kingdom Gilt 20281022	800,000.000	692,616.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20711022	517,000.000	240,358.470	
1.75% United Kingdom Gilt 20490122	800,000.000	461,928.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	441,218.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20291022	800,000.000	645,192.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,000,000.000	589,900.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20301022	400,000.000	300,440.000	
0.5% United Kingdom Gilt 20611022	850,000.000	248,710.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20280131	500,000.000	408,450.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	370,000.000	145,213.900	
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,450,000.000	930,914.500	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	1,700,000.000	1,225,275.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20460131	500,000.000	240,775.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,200,000.000	577,044.000	
0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	2,000,000.000	1,601,500.000	
0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	500,000.000	356,870.000	
1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	200,000.000	100,988.000	

1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	1,500,000.000	1,139,775.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	400,000.000	145,096.000	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	1,100,000.000	1,070,300.000	
3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	400,000.000	364,140.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	963,000.000	1,030,554.450	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	400,000.000	398,200.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,275,000.000	1,274,031.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	915,000.000	893,552.400	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	550,000.000	560,835.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	850,000.000	812,676.500	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	770,000.000	730,422.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	300,000.000	295,500.000	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	911,000.000	900,022.450	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	907,500.000	930,241.950	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	543,000.000	514,628.250	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,130,000.000	1,086,698.400	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	600,000.000	603,270.000	
4% United Kingdom Gilt 20600122	527,000.000	486,125.880	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,000,000.000	959,940.000	
3.75% United Kingdom Gilt 20520722	700,000.000	609,245.000	

	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	875,000.000	718,165.000	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	838,900.000	696,555.440	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,000,000.000	972,910.000	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	740,000.000	628,119.400	
イギリス・ポンド 小計			32,416,131.390 (5,760,994,871)	
イスラエル・ シュケル	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,200,000.000	1,432,860.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	500,000.000	474,305.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	4,000,000.000	3,736,480.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	1,200,000.000	1,136,892.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,000,000.000	925,880.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	1,700,000.000	1,421,727.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,000,000.000	742,620.000	
イスラエル・シュケル 小計			9,870,764.000 (386,721,727)	
オーストラリ ア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	889,000.000	916,158.950	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	320,000.000	309,468.800	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,800,000.000	1,773,486.000	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	359,000.000	374,271.860	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,398,000.000	2,419,078.420	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	725,000.000	695,782.500	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	800,000.000	701,832.000	

	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	684,000.000	607,508.280	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,300,000.000	1,241,214.000	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	658,000.000	610,485.820	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	775,000.000	625,556.750	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,250,000.000	1,181,787.500	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,100,000.000	1,921,143.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	510,000.000	413,548.800	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	1,800,000.000	1,499,346.000	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	2,350,000.000	1,873,232.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	900,000.000	529,128.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,800,000.000	1,487,700.000	
	3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,000,000.000	916,110.000	
	オーストラリア・ドル 小計		20,096,838.680 (1,916,635,505)	
オフショア・人民元	3.22% China Government Bond 20251206	3,000,000.000	3,076,920.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	6,500,000.000	6,784,505.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	11,000,000.000	11,487,520.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	15,000,000.000	15,456,900.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	3,000,000.000	3,081,660.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	5,300,000.000	5,484,334.000	
	2.94% China Government Bond 20241017	14,000,000.000	14,174,020.000	

2.85% China Government Bond 20270604	8,000,000.000	8,140,480.000	
2.68% China Government Bond 20300521	6,000,000.000	6,028,440.000	
1.99% China Government Bond 20250409	12,000,000.000	11,969,520.000	
3.02% China Government Bond 20251022	13,000,000.000	13,254,540.000	
3.28% China Government Bond 20271203	14,000,000.000	14,546,980.000	
3.27% China Government Bond 20301119	6,000,000.000	6,303,000.000	
3.81% China Government Bond 20500914	7,000,000.000	7,937,020.000	
3.01% China Government Bond 20280513	8,000,000.000	8,216,080.000	
3.72% China Government Bond 20510412	1,600,000.000	1,785,840.000	
3.02% China Government Bond 20310527	8,800,000.000	9,027,392.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	5,000,000.000	5,058,000.000	
2.9% CHINA GOVERNMENT BOND 20260505	7,000,000.000	7,136,850.000	
2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	13,000,000.000	13,169,910.000	
3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	6,500,000.000	6,853,535.000	
3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	6,000,000.000	6,398,040.000	
4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	4,400,000.000	5,162,916.000	
3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	6,000,000.000	6,819,180.000	
3.77% CHINA GOVERNMENT BOND 20250308	15,000,000.000	15,497,700.000	
3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	4,800,000.000	5,050,992.000	
2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	3,500,000.000	3,572,205.000	

3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	3,300,000.000	3,571,821.000	
2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	5,300,000.000	5,385,807.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	1,800,000.000	1,809,234.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	4,000,000.000	4,058,280.000	
3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,000,000.000	5,223,900.000	
2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	9,000,000.000	9,047,520.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	3,000,000.000	3,028,770.000	
2.5% CHINA GOVERNMENT BOND 20270725	12,000,000.000	12,038,640.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	7,000,000.000	7,000,490.000	
2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20250825	15,000,000.000	14,994,600.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	2,000,000.000	1,984,900.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	3,000,000.000	3,004,830.000	
2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	4,000,000.000	4,003,200.000	
3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	2,000,000.000	2,033,320.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	6,000,000.000	6,061,380.000	
2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	3,000,000.000	3,032,370.000	
2.29% CHINA GOVERNMENT BOND 20241225	10,000,000.000	10,033,600.000	
2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	4,000,000.000	4,077,640.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	8,000,000.000	8,106,640.000	
3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	3,000,000.000	3,101,280.000	

	2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	5,000,000.000	5,014,950.000	
オフショア・人民元 小計			338,087,651.000 (6,610,627,840)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	460,000.000	404,749.400	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	907,000.000	1,014,434.150	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,050,000.000	1,253,910.000	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	300,000.000	352,857.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	620,000.000	669,556.600	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	140,000.000	143,033.800	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	400,000.000	390,900.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	900,000.000	813,348.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,492,000.000	1,431,335.280	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,920,000.000	1,786,867.200	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	930,000.000	838,088.100	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	600,000.000	557,532.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	1,520,000.000	1,158,346.400	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	300,000.000	280,107.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	2,200,000.000	2,113,716.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	1,700,000.000	1,468,851.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	900,000.000	826,974.000		
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	1,500,000.000	1,210,755.000		

	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	2,000,000.000	1,730,280.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	1,250,000.000	885,250.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	1,500,000.000	1,365,885.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,000,000.000	858,280.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	500,000.000	445,055.000	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250201	2,000,000.000	1,970,240.000	
	カナダ・ドル 小計		23,970,350.930 (2,524,077,953)	
シンガポール・ ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	203,000.000	205,233.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	150,000.000	148,770.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	600,000.000	594,300.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	239,000.000	243,851.700	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	420,000.000	435,204.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	500,000.000	495,500.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	400,000.000	392,036.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	300,000.000	312,450.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	200,000.000	193,500.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	660,000.000	617,100.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	350,000.000	310,800.000	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	400,000.000	360,400.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	170,000.000	153,542.300	



	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	1,000,000.000	937,000.000	
シンガポール・ドル 小計			5,399,687.000 (564,699,266)	
スウェーデン・ クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	2,520,000.000	2,817,964.800	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	3,820,000.000	3,775,115.000	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	4,780,000.000	4,506,440.600	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	2,550,000.000	2,338,987.500	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	500,000.000	492,805.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	3,000,000.000	2,697,990.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	4,000,000.000	3,339,720.000	
スウェーデン・クローナ 小計			19,969,022.900 (261,394,510)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	5,740,000.000	6,996,945.200	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	2,830,000.000	2,749,345.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	3,200,000.000	2,911,200.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	4,700,000.000	4,106,907.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	2,400,000.000	1,218,648.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	2,000,000.000	1,602,500.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20241115	3,000,000.000	2,867,880.000	
デンマーク・クローネ 小計			22,453,425.200 (458,498,943)	
ニュージーラン ド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	1,000,000.000	997,510.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	300,000.000	275,361.000	

	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	300,000.000	241,920.000	
	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	500,000.000	461,910.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	500,000.000	401,055.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	200,000.000	141,248.000	
ニュージーランド・ドル 小計			2,519,004.000 (218,977,018)	
ノルウェー・ク ローネ	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	150,000.000	144,895.500	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	1,430,000.000	1,351,578.800	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,000,000.000	2,812,020.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	2,000,000.000	1,861,040.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	2,000,000.000	1,802,520.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	2,500,000.000	2,158,200.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	2,000,000.000	1,671,500.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	2,000,000.000	1,779,320.000	
ノルウェー・クローネ 小計			13,581,074.300 (178,726,938)	
ポーランド・ズ ロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	2,640,000.000	2,394,612.000	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	1,815,000.000	1,599,468.750	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	2,300,000.000	1,936,048.000	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	2,000,000.000	1,903,280.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	1,800,000.000	1,315,800.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	900,000.000	749,763.000	

	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,000,000.000	716,100.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	600,000.000	597,420.000	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	1,800,000.000	1,571,670.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	2,230,000.000	2,115,489.500	
ポーランド・ズロチ 小計			14,899,651.250 (508,979,537)	
マレーシア・リ ンギット	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,760,000.000	1,849,460.800	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,000,000.000	1,029,970.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	1,950,000.000	1,969,656.000	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,400,000.000	1,403,038.000	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,500,000.000	1,506,390.000	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,150,000.000	1,162,293.500	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	500,000.000	513,450.000	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	1,420,000.000	1,532,790.600	
	4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	2,700,000.000	2,723,787.000	
	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	500,000.000	506,155.000	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,000,000.000	1,074,610.000	
	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	1,600,000.000	1,756,976.000	
	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	1,500,000.000	1,519,800.000	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,200,000.000	1,213,392.000	
3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,286,597.000		

	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,400,000.000	1,335,964.000	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	1,400,000.000	1,373,190.000	
マレーシア・リングット 小計			23,757,519.900 (721,259,298)	
メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	24,200,000.000	22,028,534.000	
	8% Mexican Bonos 20471107	11,450,000.000	10,301,450.500	
	8% Mexican Bonos 20240905	27,900,000.000	26,984,043.000	
	10% Mexican Bonos 20241205	6,340,000.000	6,285,285.800	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	20,800,000.000	19,669,104.000	
	10% Mexican Bonos 20361120	2,750,000.000	2,999,067.500	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	6,500,000.000	6,392,035.000	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	5,000,000.000	4,786,300.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	22,700,000.000	21,293,962.000	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	14,050,000.000	12,373,273.000	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	10,300,000.000	9,493,716.000	
メキシコ・ペソ 小計			142,606,770.800 (1,167,279,201)	
ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	190,000.000	161,184.600	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	800,000.000	763,736.000	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	180,000.000	168,370.200	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	270,000.000	191,440.800	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	200,000.000	181,300.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	150,000.000	123,090.000	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	443,215.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	300,000.000	259,539.000	

0.125% Finland Government Bond 20360415	350,000.000	237,345.500	
0.25% Finland Government Bond 20400915	150,000.000	91,348.500	
0.125% Finland Government Bond 20520415	200,000.000	89,222.000	
0.125% Finland Government Bond 20310915	200,000.000	158,948.000	
FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	400,000.000	364,444.000	
1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	300,000.000	263,973.000	
1.2% Austria Government Bond 20251020	540,000.000	518,562.000	
0.75% Austria Government Bond 20261020	490,000.000	456,724.100	
1.5% Austria Government Bond 20470220	270,000.000	193,425.300	
1.5% Austria Government Bond 20861102	280,000.000	160,498.800	
0.5% Austria Government Bond 20270420	1,000,000.000	914,390.000	
2.1% Austria Government Bond 21170920	200,000.000	140,348.000	
0.75% Austria Government Bond 20280220	600,000.000	544,140.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	700,000.000	611,814.000	
Austria Government Bond 20300220	450,000.000	370,129.500	
0.75% Austria Government Bond 20510320	600,000.000	334,014.000	
0.85% Austria Government Bond 21200630	100,000.000	39,298.000	
Austria Government Bond 20310220	1,000,000.000	796,710.000	
Austria Government Bond 20250420	400,000.000	378,280.000	
0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	200,000.000	135,944.000	

0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	150,000.000	64,381.500	
1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	200,000.000	151,912.000	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,300,000.000	1,121,133.000	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	460,000.000	380,700.600	
1% Belgium Government Bond 20260622	595,000.000	562,554.650	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,000,000.000	693,880.000	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	470,000.000	335,063.000	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	730,000.000	673,768.100	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	500,000.000	482,305.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	310,000.000	234,781.600	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	400,000.000	316,856.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	880,000.000	798,635.200	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	500,000.000	426,540.000	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	100,000.000	89,546.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	350,000.000	240,744.000	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	900,000.000	743,400.000	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	600,000.000	366,876.000	
Belgium Government Bond 20271022	300,000.000	265,584.000	
Belgium Government Bond 20311022	400,000.000	312,880.000	
0.65% Belgium Government Bond 20710622	270,000.000	104,346.900	

0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	700,000.000	553,182.000	
1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	400,000.000	245,408.000	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	455,000.000	522,981.550	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	800,000.000	907,232.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	800,000.000	886,232.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	2,096,000.000	2,577,472.160	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	2,000,000.000	2,419,800.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	3,270,000.000	3,977,464.500	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	1,390,000.000	1,612,177.600	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,020,000.000	1,232,282.400	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,810,000.000	2,328,709.800	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	656,000.000	715,190.880	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,098,000.000	1,079,344.980	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	1,475,000.000	1,458,730.750	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	2,000,000.000	1,950,940.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	1,190,000.000	1,141,519.400	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	3,400,000.000	3,265,530.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	1,883,000.000	1,774,445.050	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	3,850,000.000	3,543,078.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,550,000.000	1,424,899.500	

0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,100,000.000	2,854,728.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	660,000.000	504,827.400	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,050,000.000	959,364.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	1,000,000.000	893,980.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	1,800,000.000	1,594,080.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	500,000.000	431,480.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,600,000.000	818,064.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	700,000.000	597,401.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	300,000.000	222,699.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	700,000.000	583,891.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	200,000.000	143,906.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	400,000.000	205,272.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,600,000.000	1,319,488.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	3,500,000.000	2,850,890.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	800,000.000	669,056.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	1,000,000.000	979,320.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	900,000.000	436,023.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	1,800,000.000	1,705,770.000	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	1,000,000.000	985,780.000	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	1,715,000.000	1,829,767.800	



5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,600,000.000	3,192,176.000	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	1,210,000.000	1,402,317.400	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,232,000.000	1,369,158.560	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	1,265,000.000	1,376,661.550	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	2,143,000.000	2,478,915.250	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,000,000.000	1,122,650.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	2,500,000.000	2,536,950.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	2,410,000.000	2,401,444.500	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	1,340,000.000	1,313,883.400	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	1,186,000.000	1,163,466.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	2,000,000.000	1,960,300.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	5,400,000.000	5,138,424.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	800,000.000	726,080.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,400,000.000	3,169,684.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	2,150,000.000	1,711,959.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	800,000.000	522,144.000	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	2,070,000.000	1,892,911.500	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	500,000.000	407,215.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	1,400,000.000	1,304,282.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	800,000.000	615,208.000	

0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	3,000,000.000	2,716,140.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	1,800,000.000	1,499,868.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	2,750,000.000	2,466,887.500	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,150,000.000	1,445,187.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	4,400,000.000	3,852,376.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	3,000,000.000	2,839,920.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	2,400,000.000	2,008,008.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	1,100,000.000	575,773.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	1,000,000.000	637,450.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	3,000,000.000	2,435,760.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	200,000.000	73,542.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	1,100,000.000	633,193.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	2,600,000.000	2,048,072.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	500,000.000	450,315.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	1,000,000.000	509,920.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	600,000.000	464,610.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	1,000,000.000	761,760.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	1,500,000.000	1,363,950.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	1,500,000.000	1,385,520.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	580,000.000	647,512.000	

4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,400,000.000	1,570,198.000	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,180,000.000	1,324,066.200	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	390,000.000	381,872.400	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	910,000.000	898,270.100	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	980,000.000	967,514.800	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,670,000.000	1,556,406.600	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	970,000.000	896,202.400	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	900,000.000	817,488.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	700,000.000	605,395.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	250,000.000	171,912.500	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	750,000.000	621,870.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	400,000.000	185,216.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	700,000.000	564,977.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	300,000.000	258,276.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	300,000.000	246,879.000	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	400,000.000	333,728.000	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	2,700,000.000	3,023,028.000	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	1,135,000.000	1,273,685.650	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	2,000,000.000	1,972,620.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	905,000.000	760,064.250	

1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	920,000.000	885,877.200	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,500,000.000	1,257,825.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	900,000.000	869,274.000	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,300,000.000	989,898.000	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	1,250,000.000	1,004,637.500	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	700,000.000	485,807.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	200,000.000	174,090.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,700,000.000	1,620,355.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	950,000.000	818,415.500	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,050,000.000	1,937,270.500	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	700,000.000	596,729.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	1,500,000.000	1,403,040.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	900,000.000	864,873.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,300,000.000	1,271,972.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	700,000.000	647,353.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	500,000.000	456,975.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,100,000.000	1,060,642.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	1,400,000.000	1,344,336.000	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	500,000.000	429,055.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	250,000.000	174,675.000	

1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	500,000.000	366,100.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	500,000.000	412,770.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	600,000.000	516,918.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,000,000.000	925,450.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	700,000.000	484,351.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,000,000.000	805,780.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	400,000.000	233,908.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	200,000.000	133,300.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,600,000.000	1,242,544.000	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	200,000.000	121,134.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	450,000.000	257,143.500	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	300,000.000	237,588.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,000,000.000	780,050.000	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	500,000.000	418,835.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	200,000.000	127,734.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	500,000.000	476,475.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	700,000.000	621,537.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	400,000.000	353,976.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	1,200,000.000	1,181,364.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	1,500,000.000	1,508,595.000	

5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	1,840,000.000	2,007,458.400	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	1,488,000.000	1,711,110.720	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,300,000.000	1,481,597.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	1,650,000.000	1,776,175.500	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	1,270,000.000	1,240,269.300	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,140,000.000	1,225,773.600	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,900,000.000	2,972,964.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	1,714,000.000	1,846,115.120	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	3,250,000.000	3,334,760.000	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,080,000.000	2,194,670.400	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,025,000.000	1,069,567.000	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,110,000.000	2,116,646.500	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,370,000.000	1,354,025.800	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,000,000.000	1,119,330.000	
5% Belgium Government Bond 20350328	750,000.000	878,430.000	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	965,000.000	1,066,730.300	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	700,000.000	728,686.000	

4% Belgium Government Bond 20320328	300,000.000	322,284.000	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	390,000.000	406,001.700	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	800,000.000	793,912.000	
3% Belgium Government Bond 20340622	300,000.000	295,353.000	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	688,000.000	716,400.640	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	680,000.000	666,338.800	
2% IRISH TREASURY 20450218	510,000.000	405,450.000	
1% IRISH TREASURY 20260515	520,000.000	493,537.200	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	731,944.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	150,000.000	129,510.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	1,100,000.000	996,952.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	300,000.000	273,078.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	400,000.000	272,312.000	
IRISH TREASURY 20311018	200,000.000	159,414.000	
0.55% IRISH TREASURY 20410422	200,000.000	127,638.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	380,000.000	428,100.400	
4.15% Austria Government Bond 20370315	800,000.000	877,712.000	
4.85% Austria Government Bond 20260315	700,000.000	734,258.000	
3.8% Austria Government Bond 20620126	170,000.000	191,270.400	
3.15% Austria Government Bond 20440620	500,000.000	490,750.000	
2.4% Austria Government Bond 20340523	630,000.000	588,079.800	

1.65% Austria Government Bond 20241021	880,000.000	862,954.400	
4% Finland Government Bond 20250704	200,000.000	203,730.000	
2.75% Finland Government Bond 20280704	120,000.000	119,566.800	
2.625% Finland Government Bond 20420704	460,000.000	422,188.000	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,420,000.000	1,627,817.000	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	3,100,000.000	3,011,185.000	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	910,000.000	838,519.500	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,400,000.000	1,354,668.000	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	300,000.000	254,559.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,480,000.000	1,304,842.000	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	4,500,000.000	4,244,220.000	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	2,100,000.000	1,979,103.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	820,000.000	745,822.800	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	1,170,000.000	1,091,212.200	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	1,650,000.000	1,524,270.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,050,000.000	845,785.500	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	800,000.000	728,712.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	1,400,000.000	1,166,438.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	900,000.000	769,419.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,000,000.000	837,090.000	



1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	100,000.000	51,851.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	1,800,000.000	1,570,320.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	950,000.000	635,911.000	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	800,000.000	627,760.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	200,000.000	93,042.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	2,000,000.000	1,734,580.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,400,000.000	1,119,258.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	500,000.000	309,055.000	
0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	1,000,000.000	802,010.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	400,000.000	347,708.000	
2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	600,000.000	561,240.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	600,000.000	560,046.000	
3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	1,500,000.000	1,467,015.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	680,000.000	809,784.800	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	900,000.000	951,030.000	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	800,000.000	909,264.000	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	500,000.000	555,645.000	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,000,000.000	1,080,440.000	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,700,000.000	1,866,209.000	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	790,000.000	932,176.300	

	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	1,084,000.000	1,078,623.360	
	ユーロ 小計		264,429,321.620 (40,232,921,284)	
国債証券 合計			120,077,109,021 [120,077,109,021]	
合計			120,077,109,021 [120,077,109,021]	

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 123銘柄	100%	48.8%
イギリス・ポンド	国債証券 48銘柄	100%	4.8%
イスラエル・シケル	国債証券 7銘柄	100%	0.3%
オーストラリア・ドル	国債証券 19銘柄	100%	1.6%
オフショア・人民元	国債証券 48銘柄	100%	5.5%
カナダ・ドル	国債証券 24銘柄	100%	2.1%
シンガポール・ドル	国債証券 14銘柄	100%	0.5%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	100%	0.2%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.4%
ニュージーランド・ドル	国債証券 6銘柄	100%	0.2%
ノルウェー・クローネ	国債証券 8銘柄	100%	0.1%
ポーランド・ズロチ	国債証券 10銘柄	100%	0.4%
マレーシア・リングgit	国債証券 17銘柄	100%	0.6%
メキシコ・ペソ	国債証券 11銘柄	100%	1.0%
ユーロ	国債証券 267銘柄	100%	33.5%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。



【ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA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7期計算期間(2022年6月16日から2023年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 2022年6月15日現在	第7期 2023年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	162,571,454	258,834,601
親投資信託受益証券	7,883,899,723	7,887,500,133
未収入金	-	55,095,954
流動資産合計	8,046,471,177	8,201,430,688
資産合計	8,046,471,177	8,201,430,688
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	122,266,931	220,193,595
未払解約金	-	55,247,602
未払受託者報酬	855,222	715,242
未払委託者報酬	15,394,638	12,874,985
その他未払費用	320,636	268,140
流動負債合計	138,837,427	289,299,564
負債合計	138,837,427	289,299,564
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 7,192,172,427	1 7,103,019,200
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	715,461,323	809,111,924
（分配準備積立金）	110,121,472	55,597,935
元本等合計	7,907,633,750	7,912,131,124
純資産合計	7,907,633,750	7,912,131,124
負債純資産合計	8,046,471,177	8,201,430,688

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第6期		第7期	
	自 2021年6月16日 至 2022年6月15日		自 2022年6月16日 至 2023年6月15日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		3		8
有価証券売買等損益		79,253,038		342,912,087
<b>営業収益合計</b>		<b>79,253,035</b>		<b>342,912,095</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		6,285		7,410
受託者報酬		1,548,670		1,161,992
委託者報酬		27,877,580		20,917,125
その他費用		580,606		435,601
<b>営業費用合計</b>		<b>30,013,141</b>		<b>22,522,128</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>		<b>109,266,176</b>		<b>320,389,967</b>
経常利益又は経常損失（ ）		109,266,176		320,389,967
<b>当期純利益又は当期純損失（ ）</b>		<b>109,266,176</b>		<b>320,389,967</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		1,383,142		3,850,831
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>		<b>644,954,409</b>		<b>715,461,323</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額		428,769,608		423,021,509
<b>当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>428,769,608</b>		<b>423,021,509</b>
剰余金減少額又は欠損金増加額		128,112,729		425,716,449
<b>当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>128,112,729</b>		<b>425,716,449</b>
<b>分配金</b>		<b>1 122,266,931</b>		<b>1 220,193,595</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金（ ）</b>		<b>715,461,323</b>		<b>809,111,924</b>

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第7期
	自2022年6月16日 至2023年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1. 1 期首元本額	4,925,705,481円	7,192,172,427円
期中追加設定元本額	3,239,365,115円	4,176,709,431円
期中一部解約元本額	972,898,169円	4,265,862,658円
2. 計算期間末日における受益権の 総数	7,192,172,427口	7,103,019,200口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第6期	第7期
	自2021年6月16日 至2022年6月15日	自2022年6月16日 至2023年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（97,618,596円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,193,389,991円）及び分配準備積立金（134,769,807円）より分配対象額は2,425,778,394円（1万口当たり3,372.80円）であり、うち122,266,931円（1万口当たり170円）を分配金額としております。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（110,483,784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（118,262,460円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,233,843,146円）及び分配準備積立金（47,045,286円）より分配対象額は2,509,634,676円（1万口当たり3,533.19円）であり、うち220,193,595円（1万口当たり310円）を分配金額としております。</p>
------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第7期 自2022年6月16日 至2023年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。



## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第7期
	2023年6月15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6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15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	82,615,509	330,133,318
合計	82,615,509	330,133,318

## (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6期	第7期
2022年6月15日現在	2023年6月15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7期
自2022年6月16日
至2023年6月15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6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1口当たり純資産額	1.0995円	1.1139円
(1万口当たり純資産額)	(10,995円)	(11,139円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	2,432,461,646	7,887,500,133	
親投資信託受益証券 合計			7,887,500,133	
合計			7,887,500,133	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

## 「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2022年6月15日現在 金額 (円)	2023年6月15日現在 金額 (円)
資産の部		

流動資産		
預金	864,834,913	2,713,982,921
コール・ローン	1,002,891,357	1,211,121,119
国債証券	230,597,354,794	251,640,652,633
派生商品評価勘定	35,378,522	9,786,277
未収入金	17,496,576	798,837
未収利息	1,328,578,121	1,628,987,291
前払費用	51,803,807	85,322,411
流動資産合計	233,898,338,090	257,290,651,489
資産合計	233,898,338,090	257,290,651,489
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,072	1,376,687
未払金	-	116,907
未払解約金	167,384,604	236,595,318
流動負債合計	167,387,676	238,088,912
負債合計	167,387,676	238,088,912
純資産の部		
元本等		
元本	1 75,409,227,916	79,274,139,359
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	158,321,722,498	177,778,423,218
元本等合計	233,730,950,414	257,052,562,577
純資産合計	233,730,950,414	257,052,562,577
負債純資産合計	233,898,338,090	257,290,651,489

## 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6月16日 至2023年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価 方法	国債証券

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1. 1 期首	2021年6月16日	2022年6月16日
期首元本額	72,148,022,911円	75,409,227,916円
期中追加設定元本額	9,369,636,335円	10,151,638,189円
期中一部解約元本額	6,108,431,330円	6,286,726,746円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックスV	467,936,815円	419,615,070円
A		

ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	9,719,452円	7,806,699円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	60,072,843円	47,693,634円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	21,864,771円	16,653,868円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	266,252,598円	217,000,520円
外国債券インデックスファンド (F0Fs用)(適格機関投資家専 用)	262,983,175円	460,215,414円
ダイワファンドラップ 外国債券 インデックス エマージングプラ ス(為替ヘッジなし)	590,145,683円	754,198,135円
ダイワファンドラップ 外国債券 インデックス(為替ヘッジな し)	2,451,240,358円	3,156,989,769円
ダイワファンドラップオンライ ン 外国債券インデックス エ マージングプラス(為替ヘッジ なし)	642,323,368円	856,969,643円
D-I's 外国債券インデック ス	955,173円	1,576,951円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	11,074,320円	17,803,370円
iFree 外国債券インデック ス	1,955,184,846円	2,200,419,902円
iFree 8資産バランス	1,638,369,400円	2,096,998,681円
iFree 年金バランス	286,017,356円	414,955,962円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2060	-円	15,487円
DCダイワ外国債券インデック ス	49,808,996,532円	50,637,770,780円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,014,640,444円	1,136,510,420円
ダイワ・ライフ・バランス50	638,800,912円	748,096,200円
ダイワ・ライフ・バランス70	416,763,408円	536,355,138円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	613,972,044円	678,972,136円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	476,490,455円	528,662,958円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	180,112,794円	207,883,088円

D Cダイワ・ターゲットイヤー 2030	31,665,502円	35,036,632円
D Cダイワ・ターゲットイヤー 2040	12,404,666円	17,108,723円
ダイワつみたてインデックス外 国債券	1,097,389,560円	1,616,647,733円
ダイワつみたてインデックスバ ランス30	3,775,192円	4,455,883円
ダイワつみたてインデックスバ ランス50	1,373,889円	1,664,065円
ダイワつみたてインデックスバ ランス70	2,283,447円	3,266,544円
ダイワ先進国債券インデックス (為替ヘッジなし)(ラップ専 用)	13,190,068円	500,189,943円
ダイワ世界バランスファンド4 0VA	126,843,591円	112,079,398円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	102,203,653円	29,164,889円
ダイワ・バランスファンド35 VA	3,551,269,117円	3,120,655,285円
ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	216,527,536円	196,547,666円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	147,565,497円	157,087,189円
ダイワ・ノーロード 外国債券 ファンド	45,857,095円	59,842,527円
ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワS MA専用)	2,543,603,718円	2,432,461,646円
ダイワ投信倶楽部外国債券イン デックス	5,594,994,510円	5,738,328,232円
ダイワライフスタイル25	29,519,607円	28,659,043円
ダイワライフスタイル50	59,493,589円	61,249,567円
ダイワライフスタイル75	15,350,932円	16,530,569円
計	75,409,227,916円	79,274,139,359円
2. 期末日における受益権の総数	75,409,227,916口	79,274,139,359口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自2022年6月16日 至2023年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	38,401,363,090	4,615,955,011
合計	38,401,363,090	4,615,955,011

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

(デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種類	2022年6月15日現在				2023年6月15日現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)		(円)		(円)	
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買建	959,572,179	-	994,947,629	35,375,450	1,210,552,044	-	1,218,961,634	8,409,590
アメリカ・ドル	492,309,221	-	515,256,882	22,947,661	161,165,540	-	161,488,681	323,141
イギリス・ ポンド	-	-	-	-	10,810,273	-	10,809,474	799
オフショア・ 人民元	171,335,360	-	178,175,216	6,839,856	723,623,800	-	722,258,500	1,365,300
シンガポ- ル・ドル	-	-	-	-	27,108,708	-	27,545,284	436,576
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	195,982,580	-	205,009,140	9,026,560
ユーロ	295,927,598	-	301,515,531	5,587,933	91,861,143	-	91,850,555	10,588
合計	959,572,179	-	994,947,629	35,375,450	1,210,552,044	-	1,218,961,634	8,409,590

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のよう  
に評価しております。期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されてい  
る場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。



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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1口当たり純資産額	3,0995円	3,2426円
(1万口当たり純資産額)	(30,995円)	(32,426円)

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	888,490.350	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	766,436.090	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	780,058.620	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	813,731.520	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,628,784.950	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,267,892.640	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	957,880.770	

4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	582,195.200	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	557,707.020	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	1,003,085.270	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,169,819.550	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,137,878.200	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,278,715.900	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,098,405.300	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	1,769,098.620	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,080,144.550	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,523,015.130	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,380,403.200	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,432,635.750	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,462,357.660	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,273,578.500	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,420,725.510	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,159,074.510	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	4,295,331.030	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,335,833.900	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,282,913.100	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,915,268.100	

3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	3,013,607.100	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	1,985,752.630	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	3,092,408.770	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	2,990,374.140	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	5,963,398.740	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,662,817.290	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	5,694,521.750	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,314,466.100	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,478,247.700	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	1,974,150.750	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	5,512,606.960	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	1,835,000.000	1,543,436.850	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,435,864.360	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,539,212.670	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,537,488.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	553,480.920	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,525,380.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	2,412,816.080	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,151,411.830	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	2,161,175.880	

1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	4,954,878.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	2,022,533.400	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	4,921,315.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	820,740.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,398,850.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	1,967,032.900	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	5,986,496.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,678,040.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240531	3,300,000.000	3,199,185.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,320,704.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,478,917.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	2,898,450.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	1,450,000.000	1,161,493.500	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	1,922,140.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,406,375.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,089,425.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	2,003,125.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,368,680.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,069,984.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,686,516.000	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	5,991,923.500	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,501,616.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,606,958.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,517,690.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	2,791,453.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	3,263,098.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,159,205.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	1,835,267.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,428,093.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	2,888,190.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,334,850.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,703,286.600	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,411,500.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,461,040.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,415,025.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,413,375.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,537,459.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,715,735.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	2,886,780.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,500,000.000	1,434,255.000	

2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,135,162.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,388,550.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	3,953,781.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,379,000.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,361,500.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	3,822,951.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,568,266.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,650,480.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,816,130.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,375,330.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,608,144.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	5,500,000.000	5,291,880.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,323,325.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,110,103.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	3,319,682.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,556,456.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	3,815,920.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,298,475.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	2,864,220.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	952,510.000	

1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,753,370.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	2,850,000.000	2,507,088.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	3,338,235.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,833,080.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	2,851,980.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,299,150.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,380,850.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,700,000.000	1,606,194.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,298,400.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	5,911,165.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	3,673,134.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	268,716.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	4,883,216.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,500,000.000	2,316,650.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,401,776.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,458,836.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,489,427.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,087,280.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	3,120,768.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	3,229,250.000	

0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,034,395.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,751,600.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	6,500,000.000	5,949,775.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,026,870.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,102,296.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,384,000.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,289,800.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,700,000.000	3,855,314.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	5,000,000.000	3,200,650.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,012,380.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	4,000,000.000	3,632,880.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,415,360.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,184,160.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	7,947,506.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,619,600.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,425,280.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	4,183,020.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,396,651.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,617,081.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,296,550.000	



0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,287,200.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,000,000.000	904,120.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,025,600.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	3,868,866.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	8,819,903.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,502,200.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,371,850.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,401,343.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,702,970.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,512,240.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,626,680.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	7,399,872.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,064,400.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,259,720.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	4,719,744.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	2,917,830.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	4,000,000.000	3,499,440.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	3,963,608.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240615	2,000,000.000	1,903,120.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,366,000.000	

0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,519,200.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240715	5,500,000.000	5,219,720.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240815	3,000,000.000	2,836,260.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,451,356.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	6,900,000.000	4,658,535.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	3,700,000.000	2,589,186.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,360,220.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,300,000.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,319,100.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,473,500.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240915	7,500,000.000	7,067,700.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,339,600.000	
0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,141,285.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241015	2,000,000.000	1,884,960.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241115	4,500,000.000	4,236,210.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	10,000,000.000	8,243,500.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,600,000.000	4,311,648.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	2,915,000.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,235,180.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	7,000,000.000	6,316,380.000	

1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,617,480.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	4,912,432.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241215	2,200,000.000	2,073,060.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	4,000,000.000	3,479,200.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,613,320.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250115	1,000,000.000	941,810.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	10,400,000.000	8,909,368.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250215	3,700,000.000	3,498,720.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,813,627.000	
2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	3,900,000.000	2,792,205.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	1,938,700.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,459,350.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	5,000,000.000	4,602,200.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250315	5,000,000.000	4,741,300.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,748,390.000	
2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,705,350.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250415	3,000,000.000	2,886,030.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	9,300,000.000	8,625,192.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250515	3,000,000.000	2,890,650.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	4,108,650.000	

3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,334,790.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,822,670.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,846,460.000	
2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240531	4,500,000.000	4,383,090.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	6,000,000.000	5,605,020.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,887,340.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250615	2,000,000.000	1,930,580.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,840,120.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,898,510.000	
3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250715	3,000,000.000	2,901,600.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	3,854,412.100	
3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240630	1,000,000.000	977,000.000	
3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250815	2,500,000.000	2,423,775.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	9,500,000.000	8,710,455.000	
3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	5,200,000.000	4,385,524.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	2,000,000.000	1,810,000.000	
3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240731	3,970,000.000	3,873,449.600	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,114,148.800	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240831	3,890,000.000	3,800,996.800	
3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,402,000.000	

3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,336,340.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250915	2,300,000.000	2,247,123.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240930	3,500,000.000	3,460,870.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,485,150.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	1,500,000.000	1,499,025.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251015	3,400,000.000	3,376,540.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241031	1,000,000.000	990,210.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031	3,000,000.000	2,999,340.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	6,700,000.000	6,854,368.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251115	1,500,000.000	1,498,785.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	3,700,000.000	3,774,000.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	3,003,960.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241130	3,000,000.000	2,976,090.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	2,500,000.000	2,486,750.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	3,000,000.000	2,972,040.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20421115	2,500,000.000	2,476,550.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251215	3,500,000.000	3,460,555.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260115	1,500,000.000	1,478,460.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	5,000,000.000	4,975,000.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271231	1,500,000.000	1,486,140.000	

4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241231	3,000,000.000	2,966,190.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250131	1,000,000.000	987,010.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	5,000,000.000	4,869,500.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260215	3,500,000.000	3,461,500.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	8,000,000.000	7,796,240.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	1,500,000.000	1,457,340.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	4,500,000.000	4,287,645.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131	3,700,000.000	3,610,016.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250228	4,500,000.000	4,479,660.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300228	1,000,000.000	1,003,120.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280229	3,000,000.000	2,992,770.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260315	2,500,000.000	2,514,450.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250331	3,000,000.000	2,950,530.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,800,000.000	1,767,366.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280331	3,700,000.000	3,630,736.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260415	2,000,000.000	1,965,840.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	3,000,000.000	2,923,110.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280430	2,000,000.000	1,951,860.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260515	1,000,000.000	979,800.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	3,300,000.000	3,183,708.000	

	3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	1,300,000.000	1,240,174.000	
	3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	1,500,000.000	1,458,630.000	
	3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250430	4,000,000.000	3,935,600.000	
	4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250531	3,600,000.000	3,569,328.000	
	3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280531	3,700,000.000	3,635,509.000	
アメリカ・ドル 小計			891,230,505.660 (125,119,850,690)	
イギリス・ポンド	2% United Kingdom Gilt 20250907	921,000.000	864,487.440	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,282,000.000	824,326.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,330,542.300	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	972,470.400	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,026,266.500	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	963,101.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,410,000.000	1,234,807.500	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,298,655.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,040,000.000	483,506.400	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	698,666.100	
	1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	441,218.000	
	0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,500,000.000	1,209,735.000	
	0.625% United Kingdom Gilt 20250607	1,900,000.000	1,751,743.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	701,981.000		

0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,300,000.000	976,430.000	
0.5% United Kingdom Gilt 20611022	1,700,000.000	497,420.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,331,475.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,307,040.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	431,717.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,700,000.000	1,091,417.000	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	1,801,875.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20460131	2,000,000.000	963,100.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20261022	3,500,000.000	3,021,725.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,800,000.000	865,566.000	
0.25% UNITED KINGDOM GILT 20250131	1,100,000.000	1,017,665.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	2,100,000.000	1,295,658.000	
0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	700,000.000	560,525.000	
0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	2,300,000.000	1,641,602.000	
1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	1,300,000.000	656,422.000	
1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	3,600,000.000	2,735,460.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	820,000.000	297,446.800	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	2,000,000.000	1,946,000.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	1,000,000.000	910,100.000	
3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	100,000.000	91,035.000	



3.5% UNITED KINGDOM GILT 20251022	400,000.000	384,936.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	600,000.000	516,300.000	
4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	300,000.000	276,960.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,015,572.350	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	2,240,000.000	2,229,920.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,470,881.280	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,362,000.000	1,330,074.720	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	1,383,732.900	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	1,633,001.720	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,295,787.600	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,213,520.000	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	2,090,502.200	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,600,000.000	1,640,096.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,272,828.250	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	1,390,589.280	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,568,502.000	
4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	1,082,944.560	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,513,825.380	
3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,350,783.200	
3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,866,000.000	1,531,538.160	

	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	1,150,823.520	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,062,417.720	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,524,000.000	1,293,586.440	
イギリス・ポンド 小計			66,940,307.720 (11,896,631,489)	
イスラエル・ シュケル	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	1,927,098.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,600,000.000	1,910,480.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,181,803.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,681,416.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,273,784.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,111,056.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,007,144.000	
	0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	1,600,000.000	1,492,848.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,262,454.000	
	0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	181,808.000	
	0.4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20241031	900,000.000	852,633.000	
	1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	300,000.000	245,091.000	
	2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129	600,000.000	461,610.000	
	イスラエル・シュケル 小計			17,589,225.000 (689,119,451)
オーストラリ ア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,049,763.950	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,309,439.860	

3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,798,000.000	1,771,515.460	
4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	2,258,000.000	2,354,055.320	
4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,748,000.000	1,763,364.920	
3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,068,146.100	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,146,618.030	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	703,430.640	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,596,392.160	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,092,936.620	
3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,010,576.840	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,418,145.000	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,776,481.000	
2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,625,562.100	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,127,123.200	
1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,365,634.800	
1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	2,700,000.000	2,152,224.000	
0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,270,160.000	
1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,620,900.000	
1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	823,088.000	
0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,600,000.000	1,463,696.000	
1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	1,973,450.000	

	0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,075,932.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,600,000.000	1,322,400.000	
	3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,300,000.000	1,190,943.000	
	3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	1,200,000.000	1,173,432.000	
	3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221	1,100,000.000	1,047,046.000	
	オーストラリア・ドル 小計		41,292,457.000 (3,938,061,624)	
オフショア・人民元	3.22% China Government Bond 20251206	5,200,000.000	5,333,328.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,218,850.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,221,600.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,152,300.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,326,640.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	8,000,000.000	8,278,240.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,228,280.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	11,500,000.000	11,554,510.000	
	3.02% China Government Bond 20251022	18,000,000.000	18,352,440.000	
	3.28% China Government Bond 20271203	9,000,000.000	9,351,630.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	13,131,250.000	
	3.03% China Government Bond 20260311	7,000,000.000	7,158,830.000	
	3.81% China Government Bond 20500914	7,300,000.000	8,277,178.000	
	3.01% China Government Bond 20280513	7,000,000.000	7,189,070.000	

3.72% China Government Bond 20510412	14,000,000.000	15,626,100.000	
3.02% China Government Bond 20310527	15,800,000.000	16,208,272.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,552,200.000	
2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,065,350.000	
3.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20240622	11,000,000.000	11,195,470.000	
3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,799,145.000	
3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20240921	15,000,000.000	15,362,700.000	
3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,331,700.000	
3.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20250607	17,000,000.000	17,581,570.000	
3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,760,730.000	
4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	4,500,000.000	5,280,255.000	
3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	6,300,000.000	7,160,139.000	
3.77% CHINA GOVERNMENT BOND 20250308	11,000,000.000	11,364,980.000	
3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	12,000,000.000	12,627,480.000	
2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,613,465.000	
3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	11,500,000.000	12,447,255.000	
2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	6,000,000.000	6,097,140.000	
2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	17,000,000.000	16,998,300.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	7,200,000.000	7,236,936.000	
2.26% CHINA GOVERNMENT BOND 20250224	10,000,000.000	10,021,000.000	

2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	15,218,550.000	
3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	5,746,290.000	
2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	5,026,400.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	4,000,000.000	4,038,360.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	4,000,000.000	4,000,280.000	
2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20250825	25,000,000.000	24,991,000.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	32,000,000.000	31,758,400.000	
1.99% CHINA GOVERNMENT BOND 20240915	22,000,000.000	21,984,820.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	9,515,295.000	
2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	17,200,000.000	17,213,760.000	
3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	14,000,000.000	14,233,240.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	5,500,000.000	5,556,265.000	
2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20251125	18,000,000.000	18,031,860.000	
2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	19,000,000.000	19,205,010.000	
2.29% CHINA GOVERNMENT BOND 20241225	5,000,000.000	5,016,800.000	
2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	20,000,000.000	20,199,000.000	
2.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20260215	18,000,000.000	18,105,120.000	
2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	15,000,000.000	15,291,150.000	
2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20250315	23,000,000.000	23,098,210.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	15,000,000.000	15,199,950.000	

	2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	25,000,000.000	25,232,000.000	
	3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	7,000,000.000	7,236,320.000	
	2.3% CHINA GOVERNMENT BOND 20260515	7,000,000.000	7,016,940.000	
	2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	15,000,000.000	15,044,850.000	
	オフショア・人民元 小計		674,064,203.000 (13,179,977,361)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	605,000.000	532,333.450	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,099,436.350	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,333,921.400	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,190,304.280	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	985,976.090	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	981,824.870	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,373,036.250	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,208,273.640	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,108,997.040	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	901,809.540	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,117,450.800	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	603,993.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,827,279.700	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,139,101.800	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,345,092.000	

1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	2,980,903.500	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	700,000.000	662,186.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,655,505.400	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,614,340.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	1,891,764.000	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	273,636.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	2,941,476.000	
0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241001	1,000,000.000	949,400.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	2,650,000.000	1,876,730.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	2,200,000.000	2,003,298.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,100,000.000	1,802,388.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250401	200,000.000	189,458.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,335,165.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	92,906.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	400,000.000	383,904.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240801	200,000.000	195,242.000	
3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20251001	1,000,000.000	970,420.000	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	770,000.000	713,104.700	
3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241101	360,000.000	351,298.800	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	200,000.000	198,142.000	



	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250201	300,000.000	295,536.000	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260401	600,000.000	582,006.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	600,000.000	566,976.000	
	3.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250501	300,000.000	295,734.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201	400,000.000	357,036.000	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280901	1,200,000.000	1,176,684.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250801	500,000.000	490,565.000	
	カナダ・ドル 小計		45,594,634.610 (4,801,115,025)	
シンガポール・ ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	780,492.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	923,000.000	915,431.400	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	801,314.500	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	408,120.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	588,561.600	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	619,375.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	513,567.160	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	716,552.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	435,375.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	701,250.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	539,654.500	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	332,517.500	

	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	479,520.000	
	0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	750,000.000	701,850.000	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	540,600.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	200,000.000	180,638.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	187,400.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	232,855.200	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	220,000.000	260,590.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	100,000.000	99,200.000	
シンガポール・ドル 小計			10,034,863.860 (1,049,446,062)	
スウェーデン・ クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	3,655,000.000	4,087,167.200	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	7,505,758.750	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	6,769,088.600	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,632,112.500	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,252,513.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	5,755,712.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,174,650.000	
	1.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20331111	2,000,000.000	1,882,820.000	
スウェーデン・クローナ 小計			38,059,822.050 (498,203,071)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	16,653,704.760	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	5,841,629.500	

	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,639,725.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	8,590,000.000	7,506,027.900	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	1,777,195.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	400,625.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20241115	1,000,000.000	955,960.000	
デンマーク・クローネ 小計			37,774,867.160 (771,362,788)	
ニュージーランド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	600,000.000	598,506.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	900,000.000	826,083.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	395,136.000	
	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	600,000.000	554,292.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	530,000.000	425,118.300	
	1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	224,609.000	
	0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	400,000.000	325,916.000	
	0.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20260515	500,000.000	443,645.000	
	2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	440,000.000	359,070.800	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	268,371.200	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20250415	640,000.000	613,964.800	
	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20340515	200,000.000	194,476.000	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20300515	500,000.000	500,275.000	
ニュージーランド・ドル 小計			5,729,463.100 (498,062,228)	

ノルウェー・ク ローネ	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,211,408.150	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,101,994.400	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,171,163.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,256,820.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,469,851.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,143,744.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	2,925,125.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	1,700,000.000	1,512,422.000	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20330815	1,500,000.000	1,430,430.000	
ノルウェー・クローネ 小計			30,222,957.550 (397,734,121)	
ポーランド・ズ ロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	3,970,157.850	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	2,793,562.500	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,074,118.400	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	3,400,000.000	3,235,576.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	2,000,000.000	1,823,800.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,193,000.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	1,832,754.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20240725	1,000,000.000	937,620.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,800,000.000	1,288,980.000	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	500,000.000	464,325.000	

	7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	1,000,000.000	1,070,240.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20251025	1,500,000.000	1,319,715.000	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	2,000,000.000	2,017,000.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	823,443.900	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,186,997.500	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	4,355,252.150	
	ポーランド・ズロチ 小計		35,386,542.300 (1,208,821,978)	
マレーシア・リ ンギット	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,365,026.720	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,237,877.740	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,552,273.920	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,338,961.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	738,368.480	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,430,096.590	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,894,034.360	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,436,500.000	
	4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,065,456.000	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,755,568.530	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,252,818.000	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,003,869.900	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,568,724.000		

4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	1,550,000.000	1,563,655.500	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,204,648.900	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,095,489.500	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,211,460.000	
4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,285,080.000	
4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	2,000,000.000	2,196,220.000	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	658,580.000	
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,335,779.600	
4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,340,808.000	
3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	400,808.000	
3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,286,597.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,669,955.000	
4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,599,252.500	
2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,655,964.000	
3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	1,400,000.000	1,384,110.000	
4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	400,000.000	431,032.000	
4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	521,980.000	
4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	700,000.000	736,512.000	
3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	1,000,000.000	999,920.000	
マレーシア・リングgit 小計		44,217,427.240 (1,342,405,717)	

メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	37,290,000.000	33,943,968.300	
	8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	19,163,397.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	23,800,000.000	23,018,646.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	6,195,070.000	
	5% MEXICAN BONOS 20250306	1,000,000.000	919,840.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	14,000,000.000	12,489,680.000	
	7.5% MEXICAN BONOS 20330526	10,000,000.000	9,114,500.000	
	10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	23,712,579.030	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	26,447,379.840	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,677,718.180	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	29,053,274.160	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	18,086,470.440	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	32,515,000.000	30,501,020.900	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	21,654,000.000	19,069,811.640	
7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	7,322,143.680		
メキシコ・ペソ 小計		268,715,499.170 (2,199,516,975)		
ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	308,795.760	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	266,352.930	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	758,601.290	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	255,254.400	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	725,200.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	385,682.000	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	443,215.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	432,565.000	
	Finland Government Bond 20240915	200,000.000	192,274.000	

0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	210,220.300	
0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	243,596.000	
Finland Government Bond 20300915	500,000.000	405,790.000	
0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	178,444.000	
0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	476,844.000	
FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	182,222.000	
0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	271,732.500	
1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	300,000.000	263,973.000	
1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	255,420.000	
2.75% FINLAND GOVERNMENT BOND 20380415	400,000.000	375,584.000	
3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20330915	300,000.000	298,581.000	
1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,318,491.900	
0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,049,533.340	
1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	561,649.760	
1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	137,570.400	
0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,170,419.200	
2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	378,939.600	
0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,088,280.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,118,745.600	
Austria Government Bond 20240715	800,000.000	773,128.000	



Austria Government Bond 20300220	980,000.000	806,059.800	
0.75% Austria Government Bond 20510320	700,000.000	389,683.000	
Austria Government Bond 20401020	400,000.000	228,996.000	
0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	137,543.000	
Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	956,052.000	
Austria Government Bond 20250420	480,000.000	453,936.000	
0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	407,832.000	
0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	128,763.000	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	300,000.000	257,304.000	
0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	1,500,000.000	1,257,405.000	
1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	300,000.000	227,868.000	
2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	300,000.000	291,936.000	
2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	300,000.000	295,221.000	
2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20290523	1,000,000.000	998,830.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,625,858.050	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,529,915.340	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	875,611.380	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,463,000.000	1,383,222.610	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	863,186.720	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	527,546.000	

0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,015,267.000	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,012,840.500	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	439,268.800	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	475,284.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,352,234.600	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	554,502.000	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,343,190.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	481,488.000	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,007,720.000	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	525,855.600	
Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,062,336.000	
Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,251,520.000	
0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	204,829.100	
0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	400,000.000	316,104.000	
1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	490,816.000	
2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	400,000.000	367,832.000	
3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	500,000.000	494,965.000	
3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	600,000.000	567,378.000	
3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20430622	700,000.000	693,875.000	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,341,361.470	

5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,451,794.480	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,052,400.500	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,399,164.210	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,687,775.200	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	2,803,686.750	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,271,000.000	3,793,836.640	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	1,600,759.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,237,362.620	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,974,000.000	2,152,114.020	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	2,760,292.080	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	2,649,450.630	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	4,042,000.000	3,942,849.740	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,104,616.440	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,049,600.300	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	4,168,000.000	3,927,714.800	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,227,077.600	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	4,200,000.000	3,861,018.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,038,904.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	2,770,000.000	2,118,745.300	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,735,992.000	

0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,665,318.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	4,700,000.000	4,162,320.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,588,880.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,850,000.000	1,457,176.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,493,502.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,100,000.000	1,558,893.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,792,700.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,519,650.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,014,768.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	900,000.000	750,717.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	1,400,000.000	1,007,342.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,754,800.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	564,498.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	3,600,000.000	2,968,848.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	577,969.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	3,800,000.000	3,095,252.000	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	1,600,000.000	1,281,216.000	
1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,542,779.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,200,000.000	1,003,584.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	200,000.000	195,864.000	

2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	100,000.000	98,693.000	
2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,700,000.000	1,679,702.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	2,100,000.000	1,017,387.000	
0.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240614	100,000.000	97,091.000	
0.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240913	530,000.000	512,351.000	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20241212	1,500,000.000	1,480,305.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250313	1,500,000.000	1,486,335.000	
2.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250612	1,000,000.000	996,370.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,630,589.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,274,360.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,153,881.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	93,780.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,037,838.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	1,300,000.000	1,191,242.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	100,000.000	90,678.000	
1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,849,430.000	
1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	409,557.800	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	100,000.000	98,578.000	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,227,433.000	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,793,935.560	

5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	3,227,000.000	3,961,981.520	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,081,621.460	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	1,960,386.120	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,583,552.980	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,659,957.000	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,217,000.000	1,366,265.050	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	3,699,887.880	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,899,000.000	5,878,058.550	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	3,088,000.000	3,027,814.880	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	4,990,347.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	4,899,000.000	4,801,754.850	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,322,847.520	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	4,864,925.720	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,646,912.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	4,387,000.000	4,089,824.620	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	3,319,607.940	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	905,267.160	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	3,703,522.500	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	2,093,085.100	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,167,542.000	

2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	1,960,975.500	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	4,889,052.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	3,291,377.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,440,397.500	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,850,000.000	1,915,713.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	4,350,000.000	3,808,599.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	4,330,000.000	4,098,951.200	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,514,014.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,449,901.100	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	2,773,200.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,402,390.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	4,000,000.000	3,247,680.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	1,480,000.000	544,210.800	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	1,500,000.000	863,445.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,623,512.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	3,100,000.000	2,791,953.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,600,000.000	1,325,792.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	3,600,000.000	2,787,660.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250225	2,100,000.000	1,992,081.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	1,200,000.000	914,112.000	

0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	2,300,000.000	2,091,390.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	4,800,000.000	4,433,664.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	871,420.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	1,100,000.000	1,004,696.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260924	200,000.000	197,126.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20330525	700,000.000	701,113.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290225	600,000.000	596,604.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,271,579.600	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	1,968,355.350	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	1,940,093.610	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,437,406.880	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	1,904,135.190	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,494,711.640	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,693,533.780	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,938,000.000	1,806,177.240	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,032,624.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,226,232.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,037,820.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	618,885.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,160,824.000	



NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	724,864.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,250,000.000	578,800.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,049,243.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	591,588.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	774,828.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	100,000.000	92,854.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	600,000.000	493,758.000	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	300,000.000	250,296.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715	900,000.000	880,956.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300115	1,300,000.000	1,281,449.000	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,242,800.400	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,684,278.480	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,789,166.340	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,267,333.650	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,394,757.170	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,731,605.750	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	2,891,000.000	2,792,301.260	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,225,950.600	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,260,925.880	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	1,867,822.040	

1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	991,883.640	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	671,801.680	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,305,675.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,439,256.500	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,650,000.000	1,421,458.500	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,551,527.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,555,952.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,108,211.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	1,964,256.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,252,290.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,450,473.500	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,516,582.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,174,483.300	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,650,000.000	1,508,017.500	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	1,832,018.000	
1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	2,200,000.000	2,160,092.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,016,504.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,067,200.000	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,630,409.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,236,313.000	

0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,144,845.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,082,985.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,098,300.000	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	1,500,000.000	1,452,825.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,651,080.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,809,213.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	1,982,090.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,573,265.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,037,895.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,900,000.000	1,530,982.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	701,724.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	466,550.000	
0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,629,383.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,397,862.000	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	2,200,000.000	1,332,474.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	998,844.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	262,857.800	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	686,816.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,504,724.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,000,000.000	960,780.000	

ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	3,100,000.000	2,783,645.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,700,000.000	1,326,085.000	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	900,000.000	753,903.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241215	300,000.000	284,961.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	510,936.000	
1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	274,791.000	
1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250815	500,000.000	476,325.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	762,360.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,600,000.000	1,420,656.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	300,000.000	265,482.000	
2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	200,000.000	192,840.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	500,000.000	492,235.000	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260115	300,000.000	300,018.000	
4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	2,800,000.000	2,894,080.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	300,000.000	301,719.000	
3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,500,000.000	1,489,455.000	
4.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20430901	100,000.000	100,006.000	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	500,000.000	499,825.000	
3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250328	400,000.000	399,032.000	
3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260415	500,000.000	503,725.000	

4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311030	900,000.000	909,828.000	
3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	1,200,000.000	1,192,680.000	
4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	600,000.000	614,748.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	3,254,000.000	3,550,146.540	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,276,179.060	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,057,140.450	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,473,728.060	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,675,856.600	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	2,197,790.560	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,171,288.880	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,415,890.440	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,123,985.600	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,542,863.300	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	1,891,829.240	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,207,933.150	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,290,972.120	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	1,909,576.980	

5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,230,040.960	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	1,773,093.680	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,042,020.980	
4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	837,938.400	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	669,382.290	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,493,546.950	
3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	735,428.970	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,073,559.680	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	941,693.510	
2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	740,145.000	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,018,395.030	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	461,109.000	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	731,944.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	647,550.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	679,740.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	864,747.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	408,468.000	
0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	261,023.000	
0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	452,565.000	
0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	665,152.000	
IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	637,656.000	

0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	255,276.000	
0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	80,086.000	
3% IRISH TREASURY 20431018	200,000.000	193,072.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	929,428.500	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,506,373.220	
4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	917,822.500	
3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	380,290.560	
3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	709,624.500	
2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	719,697.660	
1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	913,947.160	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	679,439.550	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	387,595.710	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	373,544.600	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,040,120.200	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	1,986,410.750	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	1,890,815.400	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,144,674.720	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	2,644,505.460	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,656,330.560	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	1,366,557.500	

1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,480,510.800	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,790,617.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,591,695.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	1,911,953.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,217,120.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	2,200,000.000	1,772,122.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,668,145.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,457,424.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	2,250,000.000	1,874,632.500	
0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	2,300,000.000	2,222,053.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,393,748.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	2,560,000.000	2,142,950.400	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	2,500,000.000	2,374,975.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	725,914.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,187,912.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,093,760.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	870,194.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	460,875.000	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,726,340.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20240531	300,000.000	290,523.000	



1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	302,386.500	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	2,500,000.000	2,168,225.000	
0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	1,900,000.000	1,306,934.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,518,993.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	370,866.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	900,000.000	804,897.000	
0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,684,221.000	
1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	600,000.000	384,726.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20250531	100,000.000	93,927.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	100,000.000	86,927.000	
2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,700,000.000	1,590,180.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,000,000.000	933,410.000	
3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	1,500,000.000	1,467,015.000	
2.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260531	300,000.000	296,712.000	
3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730	800,000.000	806,208.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,594,883.940	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,853,451.800	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,858,000.000	2,111,765.640	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,192,575.170	
4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,789,000.000	2,871,693.850	

	5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,123,064.600	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	1,943,052.900	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	1,532,781.030	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,086,598.880	
	ユーロ 小計		552,417,640.840 (84,050,344,053)	
国債証券 合計			251,640,652,633 [251,640,652,633]	
合計			251,640,652,633 [251,640,652,633]	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 272銘柄	100%	49.7%
イギリス・ポンド	国債証券 57銘柄	100%	4.7%
イスラエル・シケル	国債証券 13銘柄	100%	0.3%
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	100%	1.6%
オフショア・人民元	国債証券 58銘柄	100%	5.2%
カナダ・ドル	国債証券 42銘柄	100%	1.9%
シンガポール・ドル	国債証券 20銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	100%	0.2%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	100%	0.3%
ニュージーランド・ドル	国債証券 13銘柄	100%	0.2%
ノルウェー・クローネ	国債証券 9銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 16銘柄	100%	0.5%
マレーシア・リングgit	国債証券 32銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	100%	0.9%
ユーロ	国債証券 371銘柄	100%	33.4%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 【ダイワJ - REITインデックス（ダイワSMA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7期計算期間(2022年6月16日から2023年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

### 1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワJ - REITインデックス（ダイワSMA専用）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 2022年6月15日現在	第7期 2023年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,460,034	2,665,863
親投資信託受益証券	1,163,251,126	1,332,178,846
流動資産合計	1,165,711,160	1,334,844,709
資産合計	1,165,711,160	1,334,844,709
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	30,243,392	41,423,538
未払受託者報酬	122,464	135,277
未払委託者報酬	1,776,347	1,962,104
その他未払費用	30,538	33,741
流動負債合計	32,172,741	43,554,660
負債合計	32,172,741	43,554,660
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,008,113,072	1,150,653,836
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	125,425,347	140,636,213
（分配準備積立金）	21,842,011	19,863,733
元本等合計	1,133,538,419	1,291,290,049
純資産合計	1,133,538,419	1,291,290,049
負債純資産合計	1,165,711,160	1,334,844,709

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第6期		第7期	
	自	2021年6月16日 至 2022年6月15日	自	2022年6月16日 至 2023年6月15日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		90,963,000		38,967,720
<b>営業収益合計</b>		<b>90,963,000</b>		<b>38,967,720</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		178		522
受託者報酬		224,385		265,209
委託者報酬		3,254,748		3,846,633
その他費用		55,946		66,140
<b>営業費用合計</b>		<b>3,535,257</b>		<b>4,178,504</b>
営業利益又は営業損失（ ）		94,498,257		34,789,216
経常利益又は経常損失（ ）		94,498,257		34,789,216
当期純利益又は当期純損失（ ）		94,498,257		34,789,216
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（ ）		6,494,222		7,690,002
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		289,596,871		125,425,347
剰余金増加額又は欠損金減少額		248,948,797		46,505,732
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		248,948,797		46,505,732
剰余金減少額又は欠損金増加額		294,872,894		16,970,542
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		294,872,894		16,970,542
分配金		1 30,243,392		1 41,423,538
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		125,425,347		140,636,213

## (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7期
	自2022年6月16日 至2023年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1. 1 期首元本額	1,040,271,027円	1,008,113,072円
期中追加設定元本額	1,050,973,291円	276,978,902円
期中一部解約元本額	1,083,131,246円	134,438,138円
2. 計算期間末日における受益権の 総数	1,008,113,072口	1,150,653,836口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第6期	第7期
	自2021年6月16日 至2022年6月15日	自2022年6月16日 至2023年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(30,477,327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(189,717,821円)及び分配準備積立金(21,608,076円)より分配対象額は241,803,224円(1万口当たり2,398.57円)であり、うち30,243,392円(1万口当たり300円)を分配金額としております。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(42,263,055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(223,968,792円)及び分配準備積立金(19,024,216円)より分配対象額は285,256,063円(1万口当たり2,479.08円)であり、うち41,423,538円(1万口当たり360円)を分配金額としております。</p>
------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第7期 自2022年6月16日 至2023年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。



## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第7期
	2023年6月15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6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15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	85,907,807	31,179,719
合計	85,907,807	31,179,719

## (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6期	第7期
2022年6月15日現在	2023年6月15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7期
自2022年6月16日
至2023年6月15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6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1口当たり純資産額	1.1244円	1.1222円
(1万口当たり純資産額)	(11,244円)	(11,222円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ダイワJ - REITマザーファンド	406,375,098	1,332,178,846	
親投資信託受益証券 合計			1,332,178,846	
合計			1,332,178,846	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

## 「ダイワJ - REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2022年6月15日現在 金額 (円)	2023年6月15日現在 金額 (円)
資産の部		

流動資産			
コール・ローン		8,226,563,058	8,356,129,716
投資証券	2	429,701,345,100	457,635,466,600
未収入金		1,569,533,936	2,906,211,667
未収配当金		2,639,651,445	3,035,932,269
前払金		409,920,000	96,320,000
流動資産合計		442,547,013,539	472,030,060,252
資産合計		442,547,013,539	472,030,060,252
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		729,736,000	10,136,000
未払解約金		18,334,000	2,067,518,000
流動負債合計		748,070,000	2,077,654,000
負債合計		748,070,000	2,077,654,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	139,303,981,506	143,357,852,675
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		302,494,962,033	326,594,553,577
元本等合計		441,798,943,539	469,952,406,252
純資産合計		441,798,943,539	469,952,406,252
負債純資産合計		442,547,013,539	472,030,060,252

## 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6月16日 至2023年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1. 1 期首	2021年6月16日	2022年6月16日
期首元本額	140,780,222,102円	139,303,981,506円
期中追加設定元本額	25,498,473,442円	31,595,153,336円
期中一部解約元本額	26,974,714,038円	27,541,282,167円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ-REITオープン	4,649,706,801円	4,382,210,878円
ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	122,625,951,024円	125,900,106,201円
ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	343,647,782円	390,067,503円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	12,174,835円	17,523,105円
iFree J-REITイン デックス	632,690,424円	650,961,876円
iFree 8資産バランス	1,531,174,342円	2,051,017,920円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2060	-円	2,397円
DC・ダイワJ-REITオー プン	5,400,391,803円	5,515,708,487円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	6,412,105円	7,494,804円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	5,416,927円	7,382,097円
ダイワ国内REITインデッ クス(投資一任専用)	324,864円	1,606,303円
ダイワ・ノーロード J-REI Tファンド	94,767,979円	102,421,379円

	ダイワファンドラップ J - R E I Tインデックス	2,188,150,866円	2,550,149,034円
	ダイワJ - R E I Tインデックス(ダイワSMA専用)	366,782,635円	406,375,098円
	ダイワファンドラップオンライン J - R E I Tインデックス	505,967,594円	459,885,005円
	ダイワ・インデックスセレクト J - R E I T	940,421,525円	914,940,588円
計		139,303,981,506円	143,357,852,675円
2.	期末日における受益権の総数	139,303,981,506口	143,357,852,675口
3.	2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 5,215,950,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 4,699,050,000円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2022年6月16日 至2023年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	2,933,814,643	15,950,869,975
合計	2,933,814,643	15,950,869,975

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 不動産投信関連

種類	2022年6月15日現在				2023年6月15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								

不動産投信 指数先物取引								
買建	11,131,120,000	-	10,402,000,000	729,120,000	10,338,720,000	-	10,329,200,000	9,520,000
合計	11,131,120,000	-	10,402,000,000	729,120,000	10,338,720,000	-	10,329,200,000	9,520,000

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1口当たり純資産額	3.1715円	3.2782円
(1万口当たり純資産額)	(31,715円)	(32,782円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	8,810	1,040,461,000	
	サンケイリアルエステート	13,883	1,223,092,300	
	SOSILA物流リート投	21,557	2,880,015,200	
	東海道リート投資法	7,208	874,330,400	
	日本アコモデーションファンド投資 法人	14,964	9,921,132,000	
	森ヒルズリート	50,962	7,700,358,200	
	産業ファンド	66,125	10,375,012,500	
	アドバンス・レジデンス	43,332	15,577,854,000	

ケネディクス・レジデンシャル・ネットワーク投資法人	31,782	6,858,555,600	
A P I 投資法人	22,880	9,289,280,000	
G L P 投資法人	146,113	21,274,052,800	
コンフォリア・レジデンシャル	20,724	7,263,762,000	
日本プロロジスリート	75,358	22,388,861,800	
星野リゾート・リート	7,580	5,010,380,000	
O n e リート投資法人	7,560	1,818,180,000	
イオンリート投資	49,752	7,761,312,000	
ヒューリックリート投資法	40,548	6,325,488,000	
日本リート投資法人	14,077	4,736,910,500	
積水ハウス・リート投資	130,228	10,392,194,400	
トーセイ・リート投資法人	9,614	1,262,318,200	
ケネディクス商業リート	18,840	5,098,104,000	
ヘルスケア&メディカル投資	10,685	1,758,751,000	
サムティ・レジデンシャル	11,265	1,333,776,000	
野村不動産マスターF	140,147	22,633,740,500	
いちごホテルリート投資	7,180	724,462,000	
ラサールロジポート投資	53,055	8,568,382,500	
スターアジア不動産投	54,111	3,235,837,800	
マリモ地方創生リート	6,620	877,150,000	
三井不動産パーク	17,120	8,799,680,000	
大江戸温泉リート	6,995	456,773,500	
投資法人みらい	52,652	2,429,889,800	
三菱地所物流REIT	14,889	6,305,491,500	
CREロジスティクスファンド	18,568	3,533,490,400	
ザイマックス・リート	7,030	783,142,000	
タカラレーベン不動産投	20,429	1,920,326,000	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	18,891	2,584,288,800	
日本ビルファンド	50,558	28,514,712,000	
ジャパンリアルエステイト	44,441	24,042,581,000	
日本都市ファンド投資法人	218,666	21,298,068,400	
オリックス不動産投資	86,352	15,586,536,000	
日本プライムリアルティ	29,639	10,432,928,000	
NTT都市開発リート投資法人	41,660	5,482,456,000	
東急リアル・エステート	29,057	5,465,621,700	
グローバル・ワン不動産投資法人	31,892	3,485,795,600	
ユナイテッド・アーバン投資法人	96,945	14,279,998,500	
森トラストリート投資法人	80,662	5,710,869,600	



インヴィンシブル投資法人	190,751	10,834,656,800	
フロンティア不動産投資	16,080	7,871,160,000	
平和不動産リート	30,536	4,601,775,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人	29,222	9,351,040,000	
福岡リート投資法人	22,414	3,666,930,400	
ケネディクス・オフィス投資法人	25,217	8,182,916,500	
いちごオフィスリート投資法人	35,511	3,160,479,000	
大和証券オフィス投資法人	8,978	5,485,558,000	
阪急阪神リート投資法人	19,576	2,820,901,600	
スタートアップリート投資法人	7,512	1,754,052,000	
大和ハウスリート投資法人	65,327	18,768,447,100	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	139,758	10,146,430,800	
大和証券リビング投資法人	60,055	6,840,264,500	
ジャパンエクセレント投資法人	39,757	4,834,451,200	
投資証券 合計		457,635,466,600	
合計		457,635,466,600	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA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7期計算期間(2022年6月16日から2023年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 2022年6月15日現在	第7期 2023年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	7,270,244	4,703,001
親投資信託受益証券	2,243,201,058	2,863,391,344
未収入金	-	17,610,000
流動資産合計	2,250,471,302	2,885,704,345
資産合計	2,250,471,302	2,885,704,345
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	48,409,926	72,069,139
未払解約金	-	17,578,215
未払受託者報酬	375,530	245,567
未払委託者報酬	7,042,220	4,605,339
その他未払費用	93,807	61,308
流動負債合計	55,921,483	94,559,568
負債合計	55,921,483	94,559,568
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 2,200,451,221	<sup>1</sup> 3,002,880,833
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	<sup>2</sup> 5,901,402	<sup>2</sup> 211,736,056
（分配準備積立金）	232,062,312	154,539,947
元本等合計	2,194,549,819	2,791,144,777
純資産合計	2,194,549,819	2,791,144,777
負債純資産合計	2,250,471,302	2,885,704,345

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第6期		第7期	
	自	2021年6月16日 至 2022年6月15日	自	2022年6月16日 至 2023年6月15日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		28,259,739		23,916,714
為替差損益		309,389,144		-
営業収益合計		281,129,405		23,916,714
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,397		873
受託者報酬		809,087		493,278
委託者報酬		15,172,359		9,250,837
その他費用		323,551		129,097
営業費用合計		16,306,394		9,874,085
営業損失（ ）		297,435,799		33,790,799
経常損失（ ）		297,435,799		33,790,799
当期純損失（ ）		297,435,799		33,790,799
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（ ）		88,622,446		22,567,927
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		552,571,123		5,901,402
剰余金増加額又は欠損金減少額		441,880,462		6,726,222
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		6,726,222
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		441,880,462		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		565,884,816		129,268,865
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		565,884,816		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		129,268,865
分配金		1 48,409,926		1 72,069,139
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,901,402		211,736,056

## (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7期
	自2022年6月16日 至2023年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1. 1 期首元本額	2,993,845,190円	2,200,451,221円
期中追加設定元本額	2,073,516,186円	1,781,193,842円
期中一部解約元本額	2,866,910,155円	978,764,230円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,200,451,221口	3,002,880,833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5,901,402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211,736,056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6期	第7期
	自2021年6月16日 至2022年6月15日	自2022年6月16日 至2023年6月15日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(52,685,422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(540,104,220円)及び分配準備積立金(227,786,816円)より分配対象額は820,576,458円(1万口当たり3,729.13円)であり、うち48,409,926円(1万口当たり220円)を分配金額としております。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(80,311,065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(916,070,676円)及び分配準備積立金(146,298,021円)より分配対象額は1,142,679,762円(1万口当たり3,805.28円)であり、うち72,069,139円(1万口当たり240円)を分配金額としております。</p>
------------	--	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第7期 自2022年6月16日 至2023年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>外貨建資産について為替変動リスクを回避することを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
----------------------------	---

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	第7期
	2023年6月15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6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15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	464,152,712	2,993,171
合計	464,152,712	2,993,171

## (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6期	第7期
2022年6月15日現在	2023年6月15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7期
自2022年6月16日
至2023年6月15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6期 2022年6月15日現在	第7期 2023年6月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9973円 (9,973円)	0.9295円 (9,295円)

## (4)【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	先進国リート・インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド	3,397,474,305	2,863,391,344	
親投資信託受益証券 合計			2,863,391,344	
合計			2,863,391,344	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

「先進国リート・インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド」の状況  
以下に記載した情報は監査の対象外であります。



## 貸借対照表

	2022年6月15日現在 金額（円）	2023年6月15日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	38,375,995	48,891,025
コール・ローン	224,814,474	296,161,395
投資信託受益証券	748,747,617	519,089,273
投資証券	20,320,475,804	22,162,714,557
派生商品評価勘定	2,785,122	8,958,295
未収入金	15,956,744	75,093,306
未収配当金	48,218,543	60,079,306
差入委託証拠金	89,707,769	360,775,820
流動資産合計	21,489,082,068	23,531,762,977
資産合計	21,489,082,068	23,531,762,977
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	920,055,082	350,559,490
未払金	1,168,640	-
未払解約金	-	17,610,000
流動負債合計	921,223,722	368,169,490
負債合計	921,223,722	368,169,490
純資産の部		
元本等		
元本	1 23,434,151,916	27,483,964,976
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 2,866,293,570	4,320,371,489
元本等合計	20,567,858,346	23,163,593,487
純資産合計	20,567,858,346	23,163,593,487
負債純資産合計	21,489,082,068	23,531,762,977

## 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6月16日 至2023年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、市場価格のない有価証券については投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。また、市場価格のある有価証券については、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

## (2)投資証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

## 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法

### (1)先物取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

### (2)為替予約取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。

## 3. 収益及び費用の計上基準

受取配当金

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1. 1 期首	2021年10月6日	2022年6月16日
期首元本額	1,492,500,000円	23,434,151,916円
期中追加設定元本額	24,408,344,047円	7,967,013,569円
期中一部解約元本額	2,466,692,131円	3,917,200,509円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）	18,535,989,788円	21,657,672,412円
ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）	857,624,811円	1,000,051,316円
ダイワ海外REITインデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用）	952,554円	1,124,792円
ダイワ・マクロ・ナビゲーター・ファンド2021-10（為替ヘッジあり / 適格機関投資家専用）	1,483,812,793円	1,427,642,151円
ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）	2,555,771,970円	3,397,474,305円

計	23,434,151,916円	27,483,964,976円
2. 期末日における受益権の総数	23,434,151,916口	27,483,964,976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2,866,293,570円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は4,320,371,489円であります。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2022年6月16日 至2023年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。</p> <p>投資信託約款の運用の基本方針に規定する投資成果を得ることを目的として、当該規定に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産について為替変動リスクを回避すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	80,203,063	7,639,774
投資証券	4,244,768,780	3,231,043,402
合計	4,324,971,843	3,223,403,628

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 不動産投信関連

種類	2022年6月15日現在				2023年6月15日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買建	479,224,828	-	475,302,358	3,922,470	761,498,997	-	770,457,292	8,958,295
合計	479,224,828	-	475,302,358	3,922,470	761,498,997	-	770,457,292	8,958,295

## (注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

種類	2022年6月15日現在				2023年6月15日現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)	(円)	(円)		(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	23,280,653,896	-	24,194,001,386	913,347,490	21,937,027,320	-	22,287,586,810	350,559,490
アメリカ・ドル	17,843,267,642	-	18,686,685,572	843,417,930	16,926,952,180	-	17,109,014,074	182,061,894
イギリス・ポンド	1,269,424,854	-	1,267,237,768	2,187,086	1,107,378,942	-	1,138,948,476	31,569,534
イスラエル・シェケル	30,785,688	-	30,876,723	91,035	25,772,179	-	27,082,447	1,310,268
オーストラリア・ドル	1,571,574,007	-	1,577,362,604	5,788,597	1,511,405,493	-	1,595,676,763	84,271,270
カナダ・ドル	454,248,302	-	464,177,616	9,929,314	422,483,567	-	434,743,176	12,259,609
シンガポール・ドル	756,994,149	-	780,114,686	23,120,537	812,340,658	-	826,862,126	14,521,468
ニュージーランド・ドル	83,460,168	-	83,321,320	138,848	88,059,712	-	91,718,423	3,658,711
ユーロ	902,532,463	-	918,530,943	15,998,480	710,885,874	-	728,276,331	17,390,457
香港・ドル	368,366,623	-	385,694,154	17,327,531	331,748,715	-	335,264,994	3,516,279
合計	23,280,653,896	-	24,194,001,386	913,347,490	21,937,027,320	-	22,287,586,810	350,559,490

## (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。

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1口当たり純資産額	0.8777円	0.8428円
(1万口当たり純資産額)	(8,777円)	(8,428円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REAL ESTATE ETF	44,260	3,697,480.400	
	アメリカ・ドル 小計			3,697,480.400 (519,089,273)	
投資信託受益証券 合計				519,089,273 [519,089,273]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	16,643	226,677.660	
		URBAN EDGE PROPERTIES	14,866	222,098.040	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	14,412	178,564.680	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	17,309	3,291,479.440	

SIMON PROPERTY GROUP INC	40,452	4,486,126.800	
BOSTON PROPERTIES INC	17,650	957,159.500	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	18,199	152,689.610	
VORNADO REALTY TRUST	19,757	301,886.960	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	11,496	166,462.080	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	10,362	364,120.680	
NEXPOINT RESIDENTIAL	2,878	130,114.380	
EQUITY RESIDENTIAL	42,140	2,796,831.800	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	26,085	395,970.300	
EPR PROPERTIES	9,199	420,486.290	
CITY OFFICE REIT INC	4,603	25,224.440	
GLOBAL NET LEASE INC	13,139	140,324.520	
EQUINIX INC	11,449	8,881,905.220	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	10,286	271,138.960	
CHATHAM LODGING TRUST	5,858	55,065.200	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	6,764	634,260.280	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	15,765	212,039.250	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,824	97,569.200	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	6,929	28,131.740	
HOST HOTELS & RESORTS INC	88,468	1,544,651.280	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	37,977	1,322,738.910	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	15,392	73,881.600	
RLJ LODGING TRUST	20,514	211,909.620	
FARMLAND PARTNERS INC	5,962	74,048.040	
PHYSICIANS REALTY TRUST	27,988	404,986.360	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	8,574	102,630.780	
KIMCO REALTY CORP	76,523	1,476,893.900	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7,392	69,780.480	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	47,087	921,021.720	
WHITESTONE REIT	5,635	54,039.650	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	31,862	1,597,242.060	



PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	14,810	101,744.700	
PARK HOTELS & RESORTS INC	27,569	369,700.290	
INVITATION HOMES INC	71,866	2,446,318.640	
JBG SMITH PROPERTIES	12,531	191,473.680	
ALEXANDER & BALDWIN INC	9,177	171,609.900	
CLIPPER REALTY INC	1,647	9,025.560	
GLADSTONE LAND CORP	3,874	66,632.800	
AMERICOLD REALTY TRUST	33,332	1,060,957.560	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	7,310	18,786.700	
VICI PROPERTIES INC	124,184	4,021,077.920	
BRT APARTMENTS CORP	1,402	27,563.320	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,429	249,151.140	
NECESSITY RETAIL REIT INC CLASS A	16,991	119,956.460	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	17,458	430,339.700	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,936	112,244.640	
BROADSTONE NET LEASE INC	21,227	346,424.640	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	13,532	89,040.560	
LIFE STORAGE INC	10,517	1,345,860.490	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	6,248	121,773.520	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	27,446	508,299.920	
PARAMOUNT GROUP INC	20,870	95,793.300	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	15,789	110,049.330	
NETSTREIT CORP	6,947	127,130.100	
APARTMENT INCOME REIT CO	18,237	672,945.300	
CTO REALTY GROWTH INC	2,544	42,612.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	23,399	1,243,188.870	
STAG INDUSTRIAL INC	21,975	805,383.750	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	1,311	20,871.120	
INDUS REALTY TRUST INC	564	37,754.160	
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2,085	30,962.250	

PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	14,361	482,816.820	
ORION OFFICE REIT INC	6,028	38,820.320	
DIGITAL CORE REIT UNITS	38,700	18,576.000	
VENTAS INC	49,490	2,292,376.800	
CARETRUST REIT INC	12,202	242,453.740	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	8,535	200,487.150	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	36,774	792,847.440	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	6,148	48,200.320	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	28,321	335,887.060	
UMH PROPERTIES INC	6,804	110,224.800	
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	3,103	71,772.390	
BLUEROCK HOMES TRUST INC CLASS A	392	6,279.840	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C	3,471	40,402.440	
STAR HOLDINGS SHARES OF BENEFICIAL	1,592	22,622.320	
IRON MOUNTAIN INC	35,969	2,040,161.680	
TERRENO REALTY CORP	8,946	522,088.560	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	17,124	683,076.360	
SUN COMMUNITIES INC	15,329	2,050,713.620	
ACADIA REALTY TRUST	12,020	171,285.000	
ALEXANDER'S INC	272	50,224.800	
PROLOGIS INC	114,210	13,964,456.700	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	19,488	2,375,976.960	
BRANDYWINE REALTY TRUST	21,718	95,993.560	
SAUL CENTERS INC	1,633	60,029.080	
VERIS RESIDENTIAL INC	10,031	170,326.380	
CAMDEN PROPERTY TRUST	13,627	1,522,953.520	
COUSINS PROPERTIES INC	18,580	404,486.600	
SITE CENTERS CORP	22,493	296,682.670	
EASTGROUP PROPERTIES INC	5,392	937,614.880	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,993	1,865,486.270	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	16,349	855,052.700	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	9,059	854,354.290	
GETTY REALTY CORP	5,383	188,512.660	

WELLTOWER INC	58,464	4,767,154.560	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	67,652	1,400,396.400	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	12,901	290,014.480	
SERVICE PROPERTIES TRUST	20,944	185,563.840	
EQUITY COMMONWEALTH	13,434	286,144.200	
KILROY REALTY CORP	12,921	394,478.130	
LTC PROPERTIES INC	5,127	174,574.350	
LXP INDUSTRIAL TRUST	33,808	347,546.240	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	14,288	2,191,779.200	
MACERICH CO/THE	26,392	296,118.240	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	21,646	1,464,135.440	
NATL HEALTH INVESTORS INC	5,320	286,428.800	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	22,452	956,006.160	
REALTY INCOME CORP	77,596	4,747,323.280	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	13,785	329,875.050	
PUBLIC STORAGE	19,558	5,556,818.960	
REGENCY CENTERS CORP	19,055	1,159,306.200	
RPT REALTY	10,232	105,798.880	
SAFEHOLD INC	4,575	108,793.500	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	12,795	275,476.350	
SL GREEN REALTY CORP	8,150	212,307.500	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	29,173	88,977.650	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	3,667	76,566.960	
UDR INC	38,263	1,649,517.930	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,607	78,373.390	
WP CAREY INC	26,060	1,822,115.200	
ELME	11,078	174,478.500	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4,132	16,941.200	
AGREE REALTY CORP	10,860	714,262.200	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	28,983	904,269.600	
CUBESMART	27,786	1,215,359.640	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	25,798	261,849.700	
DIGITAL REALTY TRUST INC	35,574	3,752,701.260	
EXTRA SPACE STORAGE INC	16,570	2,374,812.400	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4,032	24,312.960	

	CENTERSPACE	1,908	118,715.760	
	KITE REALTY GROUP TRUST	26,865	565,239.600	
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,965	41,147.100	
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4,549	58,909.550	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	26,504	216,007.600	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	73,445	666,880.600	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	11,605	16,363.050	
	DOUGLAS EMMETT INC	21,554	269,425.000	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	203,400	34,374.600	
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	82,300	25,513.000	
	PRIME US REIT	68,400	15,048.000	
アメリカ・ドル 小計			121,816,269.690 (17,101,786,101)	
イギリス・ポンド	WAREHOUSE REIT PLC	55,820	49,903.080	
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT COMPAN	24,551	15,221.620	
	ASSURA PLC	380,806	177,150.950	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	74,712	64,924.720	
	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITE	51,354	26,087.830	
	CLS HOLDINGS PLC	20,382	27,923.340	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	112,677	60,958.250	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	64,471	49,126.900	
	REGIONAL REIT LTD	54,681	27,094.430	
	NEWRIVER REIT PLC	39,166	34,896.900	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	228,947	269,012.720	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	73,284	58,407.340	
	CUSTODIAN REIT PLC	51,902	47,023.210	
	PRS REIT PLC/THE	64,664	52,765.820	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	53,298	49,567.140	
	LXI REIT PLC	220,524	217,987.970	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	46,825	24,489.470	
	AEW UK REIT PLC	20,041	20,441.820	
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	102,818	79,478.310		
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	163,262	129,140.240		

	URBAN LOGISTICS REIT PLC	58,444	75,977.200	
	HOME REIT PLC	84,338	32,090.600	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	95,938	569,679.840	
	SEGRO PLC	154,426	1,166,534.000	
	HAMMERSON PLC	514,732	135,992.190	
	UNITE GROUP PLC/THE	51,114	454,914.600	
	BRITISH LAND CO PLC	119,772	400,876.880	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	32,654	150,665.550	
	DERWENT LONDON PLC	14,136	298,552.320	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	171,906	170,702.650	
	WORKSPACE GROUP PLC	17,748	91,668.420	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	27,984	255,633.840	
	BIG YELLOW GROUP PLC	22,516	252,179.200	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	126,393	224,979.540	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	71,398	32,307.590	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	235,253	323,943.380	
イギリス・ポンド 小計			6,118,299.860 (1,087,344,251)	
イスラエル・ シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	82,303	142,631.090	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	26,700	212,985.900	
	REIT 1 LTD	22,083	357,965.430	
イスラエル・シュケル 小計			713,582.420 (27,957,089)	
オーストラリ ア・ドル	DEXUS/AU	141,069	1,110,213.030	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	52,157	73,280.580	
	HMC CAPITAL LTD	25,139	114,382.450	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY UN	46,291	30,320.600	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	45,483	132,355.530	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	184,360	96,789.000	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	69,800	212,890.000	
	RURAL FUNDS GROUP	50,015	85,275.570	
	WAYPOINT REIT	86,888	235,466.480	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	86,457	351,015.420	

	CENTURIA OFFICE REIT	52,359	73,040.800	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	92,458	148,395.090	
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	200,894	228,014.690	
	REGION GROUP	152,660	361,804.200	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	38,675	111,384.000	
	NATIONAL STORAGE REIT	155,886	383,479.560	
	DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	26,925	72,697.500	
	GDI PROPERTY GROUP	64,299	44,044.810	
	SCENTRE GROUP	680,758	1,763,163.220	
	ARENA REIT	46,460	171,902.000	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	26,404	86,605.120	
	BWP TRUST	62,311	225,565.820	
	GPT GROUP	251,243	1,009,996.860	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	66,904	242,861.520	
	MIRVAC GROUP	517,530	1,128,215.400	
	STOCKLAND	313,096	1,274,300.720	
	ABACUS PROPERTY GROUP	52,859	136,376.220	
	GOODMAN GROUP	224,441	4,419,243.290	
	VICINITY CENTRES	507,506	943,961.160	
	CHARTER HALL GROUP	61,174	665,573.120	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	47,821	190,805.790	
	オーストラリア・ドル 小計		16,123,419.550 (1,537,690,522)	
カナダ・ドル	INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	2,000	6,420.000	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	4,600	14,674.000	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	5,600	15,736.000	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	3,600	30,708.000	
	PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	6,525	83,389.500	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	3,500	18,655.000	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST U	2,026	33,712.640	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	7,100	51,120.000	

SLATE GROCERY REIT	3,600	46,980.000	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	7,300	130,013.000	
SLATE OFFICE REIT	4,900	9,800.000	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,500	38,025.000	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	15,700	120,890.000	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	5,500	13,805.000	
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2,400	27,984.000	
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,200	337,260.000	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	16,300	226,733.000	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	8,900	113,386.000	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	13,500	204,525.000	
CHOICE PROPERTIES REIT	20,800	277,888.000	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	2,400	39,648.000	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	7,000	104,650.000	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	9,200	231,104.000	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	10,900	544,346.000	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	17,700	182,664.000	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	19,000	377,910.000	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,000	44,280.000	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2,900	174,029.000	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6,900	100,188.000	
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	8,100	184,356.000	

カナダ・ドル 小計			3,784,879.140 (398,547,773)	
シンガポール・ドル	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	66,100	38,668.500	
	AIMS APAC REIT	2,390	136.560	
	KEPPEL DC REIT	175,800	356,874.000	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	153,800	39,988.000	
	AIMS APAC REIT	68,300	80,594.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	374,400	464,256.000	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT	66,400	45,484.000	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	244,500	163,815.000	
	EC WORLD REIT	32,900	10,857.000	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	440,800	1,176,936.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	660,400	1,300,988.000	
	SUNTEC REIT	291,200	369,824.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	423,200	702,512.000	
	KEPPEL REIT	256,500	228,285.000	
	CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRUST	280,900	297,754.000	
	ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	761,700	239,935.500	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	108,200	130,922.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	142,600	310,868.000	
	STARHILL GLOBAL REIT	188,200	95,982.000	
	CAPITALAND CHINA TRUST	152,800	154,328.000	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	50,500	186,850.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	258,900	577,347.000	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	298,000	494,680.000	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	143,200	85,920.000	
PARAGON REIT	141,900	133,386.000		
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT	316,200	101,184.000		
シンガポール・ドル 小計			7,788,374.560 (814,508,212)	



ニュージーランド・ドル	STRIDE PROPERTY GROUP	64,452	86,365.680	
	ARGOSY PROPERTY LTD	108,963	120,948.930	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	202,139	180,914.400	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	60,746	140,323.260	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	136,116	294,010.560	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	183,185	227,149.400	
ニュージーランド・ドル 小計			1,049,712.230 (91,251,484)	
ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	4,980	111,651.600	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	914	4,743.660	
	HAMBORNER REIT AG	8,342	57,976.900	
	WERELDHAVE NV	4,699	66,020.950	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	12,422	582,219.140	
	NSI NV	1,842	37,300.500	
	VASTNED RETAIL NV	1,879	37,955.800	
	ICADE	3,736	149,888.320	
	CARMILA	6,707	98,056.340	
	ALTAREA	505	52,015.000	
	GECINA SA	6,325	619,850.000	
	KLEPIERRE	22,678	505,946.180	
	COVIVIO	5,419	250,574.560	
	MERCIALYS	8,982	72,709.290	
	AEDIFICA	4,650	308,062.500	
	COFINIMMO	3,567	269,308.500	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	3,070	48,199.000	
	RETAIL ESTATES	1,315	84,291.500	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	18,023	475,446.740	
	CARE PROPERTY INVEST	4,054	53,999.280	
XIOR STUDENT HOUSING NV	2,745	81,252.000		
MONTEA NV	1,577	121,744.400		
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,703	17,059.130		
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	7,263	38,493.900		

	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	34,627	197,027.630	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	38,915	307,233.920	
	CROMWELL REIT EUR	38,000	60,040.000	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	44,558	45,181.810	
ユーロ 小計			4,754,248.550 (723,358,917)	
韓国・ウォン	SK REITS LTD	7,476	38,426,640.000	
	D&D PLATFORM REIT LTD	6,865	22,963,425.000	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT LTD	3,286	12,059,620.000	
	NH ALL ONE REIT LTD	3,459	12,850,185.000	
	E KOCREF CR	2,796	14,958,600.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	7,432	46,375,680.000	
	LOTTE REIT CO LTD	15,417	60,974,235.000	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	11,781	52,130,925.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	3,918	19,041,480.000	
	JR REIT XXVII	16,902	77,495,670.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	5,393	30,039,010.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	18,659	76,408,605.000	
韓国・ウォン 小計			463,724,075.000 (51,102,393)	
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	291,000	494,700.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	128,000	362,240.000	
	FORTUNE REIT	188,000	1,054,680.000	
	PROSPERITY REIT	156,000	268,320.000	
	LINK REIT	331,700	15,506,975.000	
	CHAMPION REIT	246,000	671,580.000	
	香港・ドル 小計			18,358,495.000 (329,167,815)
投資証券 合計			22,162,714,557 [22,162,714,557]	
合計			22,681,803,830 [22,681,803,830]	

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

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	2.9%	97.1%	77.6%
	投資証券 144銘柄			
イギリス・ポンド	投資証券 36銘柄	-%	100%	4.8%
イスラエル・シケル	投資証券 3銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券 31銘柄	-%	100%	6.8%
カナダ・ドル	投資証券 30銘柄	-%	100%	1.8%
シンガポール・ドル	投資証券 26銘柄	-%	100%	3.6%
ニュージーランド・ドル	投資証券 6銘柄	-%	100%	0.4%
ユーロ	投資証券 28銘柄	-%	100%	3.2%
韓国・ウォン	投資証券 12銘柄	-%	100%	0.2%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	-%	100%	1.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）】

(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7期計算期間(2022年6月16日から2023年6月15日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

## 【財務諸表】

ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）

## (1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 2022年6月15日現在	第7期 2023年6月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	29,027	27,025
親投資信託受益証券	12,106,116	12,530,604
未収入金	600	-
流動資産合計	12,135,743	12,557,629
資産合計	12,135,743	12,557,629
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	115,000	400,000
未払受託者報酬	1,373	1,266
未払委託者報酬	26,822	24,545
その他未払費用	240	182
流動負債合計	143,435	425,993
負債合計	143,435	425,993
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	10,000,000	10,000,000
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,992,308	2,131,636
（分配準備積立金）	2,087,387	2,226,715
元本等合計	11,992,308	12,131,636
純資産合計	11,992,308	12,131,636
負債純資産合計	12,135,743	12,557,629

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第6期		第7期	
	自	2021年6月16日 至 2022年6月15日	自	2022年6月16日 至 2023年6月15日
営業収益				
有価証券売買等損益		9,390,099		592,888
営業収益合計		9,390,099		592,888
営業費用				
支払利息		47		-
受託者報酬		49,007		2,607
委託者報酬		920,984		50,558
その他費用		12,071		395
営業費用合計		982,109		53,560
営業利益		8,407,990		539,328
経常利益		8,407,990		539,328
当期純利益		8,407,990		539,328
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（ ）		8,016,376		-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		188,966,707		1,992,308
剰余金減少額又は欠損金増加額		187,251,013		-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		187,251,013		-
分配金		1 115,000		1 400,000
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,992,308		2,131,636

## (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7期
	自2022年6月16日 至2023年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1. 1 期首元本額	1,101,058,979円	10,000,000円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中一部解約元本額	1,091,058,979円	- 円
2. 計算期間末日における受益権の 総数	10,000,000口	10,000,000口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第6期	第7期
	自2021年6月16日 至2022年6月15日	自2022年6月16日 至2023年6月15日

<p>1 分配金の計算過程</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(115,096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(276,518円)、投資信託約款に規定される収益調整金(134,546円)及び分配準備積立金(1,810,773円)より分配対象額は2,336,933円(1万口当たり2,336.93円)であり、うち115,000円(1万口当たり115円)を分配金額としております。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(436,765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(102,563円)、投資信託約款に規定される収益調整金(134,546円)及び分配準備積立金(2,087,387円)より分配対象額は2,761,261円(1万口当たり2,761.26円)であり、うち400,000円(1万口当たり400円)を分配金額としております。</p>
-------------------	--	--

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	第7期 自2022年6月16日 至2023年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項



区分	第7期
	2023年6月15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6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15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	449,668	591,157
合計	449,668	591,157

## (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6期	第7期
2022年6月15日現在	2023年6月15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7期
自2022年6月16日
至2023年6月15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6期	第7期
	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1口当たり純資産額	1.1992円	1.2132円
(1万口当たり純資産額)	(11,992円)	(12,132円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	3,929,321	12,530,604	
親投資信託受益証券 合計			12,530,604	
合計			12,530,604	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

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

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2022年6月15日現在 金額(円)	2023年6月15日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		

預金	64,421,750	154,307,636
コール・ローン	272,236,281	484,818,531
投資信託受益証券	1,003,957,474	1,754,535,818
投資証券	24,030,593,444	28,791,803,997
派生商品評価勘定	4,606,986	15,800,902
未収入金	5,244,903	1,131,204
未収配当金	57,254,896	77,136,732
差入委託証拠金	110,930,801	167,487,490
流動資産合計	25,549,246,535	31,447,022,310
資産合計	25,549,246,535	31,447,022,310
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,707,677	-
未払金	179,214,434	-
未払解約金	8,675,500	55,171,000
流動負債合計	191,597,611	55,171,000
負債合計	191,597,611	55,171,000
純資産の部		
元本等		
元本	1 8,345,562,785	9,843,782,869
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	17,012,086,139	21,548,068,441
元本等合計	25,357,648,924	31,391,851,310
純資産合計	25,357,648,924	31,391,851,310
負債純資産合計	25,549,246,535	31,447,022,310

## 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6月16日 至2023年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価 方法	(1)投資信託受益証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、市場価格のない有価証券については投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。また、市場価格のある有価証券については、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

## (2)投資証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

## 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法

### (1)先物取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

### (2)為替予約取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。

## 3. 収益及び費用の計上基準

受取配当金

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1. 1 期首	2021年6月16日	2022年6月16日
期首元本額	14,827,050,251円	8,345,562,785円
期中追加設定元本額	4,338,728,665円	2,162,995,640円
期中一部解約元本額	10,820,216,131円	664,775,556円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワバランスファンド2023-01	-円	94,248,022円
（適格機関投資家専用）		
ダイワファンドラップ 外国RE	1,136,729,180円	1,458,299,802円
ITインデックス（為替ヘッジ		
なし）		
ダイワファンドラップオンライ	241,121,883円	274,543,609円
ン 外国REITインデックス		
（為替ヘッジなし）		
D - I ' s グローバルREIT	1,675,380円	1,640,299円
インデックス		
DCダイワ・ターゲットイヤー	10,746,531円	15,709,152円
2050		
i F r e e 外国REITイン	729,914,213円	744,870,116円
デックス		
i F r e e 8資産バランス	1,582,219,772円	2,197,414,066円

グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)	256,304,741円	371,513,203円
グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)	150,433,938円	225,034,809円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	-円	30,065円
DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド	3,742,300,862円	3,973,004,517円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	6,607,695円	7,781,902円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	5,568,438円	7,881,175円
ダイワ海外REITインデックス(為替ヘッジなし)(投資一任専用)	330,548円	1,403,715円
ダイワバランスファンド2021-02(適格機関投資家専用)	161,211,552円	145,182,962円
ダイワ・インデックスセレクトグローバルREIT	248,229,351円	254,276,260円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	68,184,460円	67,019,874円
ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	3,984,241円	3,929,321円
計	8,345,562,785円	9,843,782,869円
2. 期末日における受益権の総数	8,345,562,785口	9,843,782,869口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区分	自2022年6月16日 至2023年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	90,792,240	21,270,363
投資証券	5,575,385,632	429,776,574
合計	5,666,177,872	408,506,211

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 不動産投信関連

種類	2022年6月15日現在				2023年6月15日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超				1年超		
市場取引								
不動産投信								
指数先物取引								
買建	466,809,508	-	464,087,761	2,721,747	840,481,969	-	850,296,032	9,814,063
合計	466,809,508	-	464,087,761	2,721,747	840,481,969	-	850,296,032	9,814,063

（注）

### 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

### 2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## 2. 通貨関連

種類	2022年6月15日現在				2023年6月15日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超				1年超		



市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	409,318,657	-	412,939,713	3,621,056	465,522,474	-	471,509,313	5,986,839
アメリカ・ドル	256,616,125	-	260,458,191	3,842,066	395,878,626	-	400,161,762	4,283,136
イギリス・ポンド	23,252,515	-	22,688,862	563,653	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	23,237,930	-	23,253,000	15,070	-	-	-	-
カナダ・ドル	9,622,440	-	9,367,443	254,997	-	-	-	-
ユーロ	96,589,647	-	97,172,217	582,570	69,643,848	-	71,347,551	1,703,703
合計	409,318,657	-	412,939,713	3,621,056	465,522,474	-	471,509,313	5,986,839

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2022年6月15日現在	2023年6月15日現在
1口当たり純資産額	3.0385円	3.1890円
(1万口当たり純資産額)	(30,385円)	(31,890円)

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REAL ESTATE ETF	149,600	12,497,584.000	
	アメリカ・ドル	小計		12,497,584.000 (1,754,535,818)	
投資信託受益証券 合計				1,754,535,818 [1,754,535,818]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	21,004	286,074.480	
		URBAN EDGE PROPERTIES	18,762	280,304.280	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	18,188	225,349.320	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	22,350	4,250,076.000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	52,233	5,792,639.700	
		BOSTON PROPERTIES INC	22,790	1,235,901.700	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	24,225	203,247.750	
		VORNADO REALTY TRUST	25,742	393,337.760	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	14,508	210,075.840	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13,500	474,390.000	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	3,633	164,247.930	
		EQUITY RESIDENTIAL	54,412	3,611,324.440	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	33,987	515,922.660	
		EPR PROPERTIES	11,985	547,834.350	
		CITY OFFICE REIT INC	6,000	32,880.000	
		GLOBAL NET LEASE INC	16,582	177,095.760	
		EQUINIX INC	14,784	11,469,131.520	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	13,402	353,276.720	
		CHATHAM LODGING TRUST	7,231	67,971.400	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8,813	826,395.010	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	19,897	267,614.650			
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,759	129,873.450			

BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	7,800	31,668.000	
HOST HOTELS & RESORTS INC	114,233	1,994,508.180	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	49,037	1,707,958.710	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	20,508	98,438.400	
RLJ LODGING TRUST	25,890	267,443.700	
FARMLAND PARTNERS INC	7,936	98,565.120	
PHYSICIANS REALTY TRUST	36,467	527,677.490	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	10,821	129,527.370	
KIMCO REALTY CORP	98,809	1,907,013.700	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9,060	85,526.400	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	60,818	1,189,600.080	
WHITESTONE REIT	7,417	71,129.030	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	41,141	2,062,398.330	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU- A	19,721	135,483.270	
PARK HOTELS & RESORTS INC	35,921	481,700.610	
INVITATION HOMES INC	92,795	3,158,741.800	
JBG SMITH PROPERTIES	15,816	241,668.480	
ALEXANDER & BALDWIN INC	11,583	216,602.100	
CLIPPER REALTY INC	1,890	10,357.200	
GLADSTONE LAND CORP	5,156	88,683.200	
AMERICOLD REALTY TRUST	43,039	1,369,931.370	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	9,000	23,130.000	
VICI PROPERTIES INC	160,350	5,192,133.000	
BRT APARTMENTS CORP	1,600	31,456.000	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4,468	324,644.880	
NECESSITY RETAIL REIT INC CLASS A	21,444	151,394.640	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	22,746	560,688.900	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	6,229	141,647.460	
BROADSTONE NET LEASE INC	27,657	451,362.240	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	17,078	112,373.240	

LIFE STORAGE INC	13,579	1,737,704.630	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,342	162,585.580	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	35,761	662,293.720	
PARAMOUNT GROUP INC	26,339	120,896.010	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	21,017	146,488.490	
NETSTREIT CORP	8,767	160,436.100	
APARTMENT INCOME REIT CO	23,761	876,780.900	
CTO REALTY GROWTH INC	3,211	53,784.250	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	30,213	1,605,216.690	
STAG INDUSTRIAL INC	28,632	1,049,362.800	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	2,066	32,890.720	
INDUS REALTY TRUST INC	861	57,635.340	
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2,825	41,951.250	
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	18,712	629,097.440	
ORION OFFICE REIT INC	9,048	58,269.120	
DIGITAL CORE REIT UNITS	49,400	23,712.000	
VENTAS INC	63,903	2,959,986.960	
CARETRUST REIT INC	15,898	315,893.260	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	10,772	253,034.280	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	47,914	1,033,025.840	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,759	60,830.560	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	36,901	437,645.860	
UMH PROPERTIES INC	8,587	139,109.400	
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	3,916	90,577.080	
BLUEROCK HOMES TRUST INC CLASS A	487	7,801.740	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C	4,800	55,872.000	
STAR HOLDINGS SHARES OF BENEFICIAL	2,122	30,153.620	
IRON MOUNTAIN INC	46,445	2,634,360.400	
TERRENO REALTY CORP	11,656	680,244.160	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	22,312	890,025.680	

SUN COMMUNITIES INC	19,793	2,647,907.540	
ACADIA REALTY TRUST	15,170	216,172.500	
ALEXANDER'S INC	343	63,334.950	
PROLOGIS INC	147,471	18,031,279.170	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	25,164	3,067,994.880	
BRANDYWINE REALTY TRUST	27,410	121,152.200	
SAUL CENTERS INC	2,061	75,762.360	
VERIS RESIDENTIAL INC	12,660	214,966.800	
CAMDEN PROPERTY TRUST	17,595	1,966,417.200	
COUSINS PROPERTIES INC	24,209	527,029.930	
SITE CENTERS CORP	29,307	386,559.330	
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,962	1,210,622.180	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,321	2,408,818.190	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	21,110	1,104,053.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,697	1,103,144.070	
GETTY REALTY CORP	6,794	237,925.880	
WELLTOWER INC	75,490	6,155,454.600	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	87,354	1,808,227.800	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	16,809	377,866.320	
SERVICE PROPERTIES TRUST	26,433	234,196.380	
EQUITY COMMONWEALTH	17,503	372,813.900	
KILROY REALTY CORP	16,835	513,972.550	
LTC PROPERTIES INC	6,471	220,337.550	
LXP INDUSTRIAL TRUST	44,050	452,834.000	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	18,449	2,830,076.600	
MACERICH CO/THE	34,387	385,822.140	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	27,950	1,890,538.000	
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,932	373,218.880	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	28,990	1,234,394.200	
REALTY INCOME CORP	100,194	6,129,868.920	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	17,961	429,806.730	
PUBLIC STORAGE	25,254	7,175,166.480	
REGENCY CENTERS CORP	24,605	1,496,968.200	
RPT REALTY	13,619	140,820.460	
SAFEHOLD INC	6,107	145,224.460	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	16,670	358,905.100	
SL GREEN REALTY CORP	10,285	267,924.250	

	DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	38,295	116,799.750	
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	4,628	96,632.640	
	UDR INC	49,406	2,129,892.660	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,029	98,954.330	
	WP CAREY INC	33,649	2,352,738.080	
	ELME	13,982	220,216.500	
	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4,700	19,270.000	
	AGREE REALTY CORP	14,150	930,645.500	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	37,424	1,167,628.800	
	CUBESMART	35,878	1,569,303.720	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	33,614	341,182.100	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	45,935	4,845,683.150	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	21,395	3,066,331.400	
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	4,575	27,587.250	
	CENTERSPACE	2,407	149,763.540	
	KITE REALTY GROUP TRUST	35,003	736,463.120	
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,592	54,276.480	
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6,328	81,947.600	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	33,450	272,617.500	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	95,694	868,901.520	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	13,105	18,478.050	
	DOUGLAS EMMETT INC	28,084	351,050.000	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	265,962	44,947.570	
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	110,200	34,162.000	
	EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	0.000	
	PRIME US REIT	92,200	20,284.000	
	アメリカ・ドル 小計		157,379,418.460 (22,094,496,558)	
イギリス・ポンド	WAREHOUSE REIT PLC	70,605	63,120.870	
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT COMPAN	31,488	19,522.560	
	ASSURA PLC	490,928	228,379.700	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	101,879	88,532.850	

ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITE	67,467	34,273.230	
CLS HOLDINGS PLC	57,322	78,531.140	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	135,056	73,065.290	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	86,237	65,712.590	
REGIONAL REIT LTD	71,837	35,595.230	
NEWRIVER REIT PLC	51,721	46,083.410	
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	307,101	360,843.670	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	98,025	78,125.920	
CUSTODIAN REIT PLC	69,425	62,899.050	
PRS REIT PLC/THE	86,496	70,580.730	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	69,968	65,070.240	
LXI REIT PLC	284,295	281,025.600	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	51,240	26,798.520	
AEW UK REIT PLC	21,930	22,368.600	
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	134,976	104,336.440	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	206,054	162,988.710	
URBAN LOGISTICS REIT PLC	78,434	101,964.200	
HOME REIT PLC	117,587	44,741.850	
LAND SECURITIES GROUP PLC	126,863	753,312.490	
SEGR0 PLC	204,206	1,542,572.120	
HAMMERSON PLC	663,583	175,318.620	
UNITE GROUP PLC/THE	67,590	601,551.000	
BRITISH LAND CO PLC	158,380	530,097.860	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	42,097	194,235.550	
DERWENT LONDON PLC	18,961	400,456.320	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	221,618	220,066.670	
WORKSPACE GROUP PLC	22,880	118,175.200	
SAFESTORE HOLDINGS PLC	36,736	335,583.360	
BIG YELLOW GROUP PLC	29,558	331,049.600	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	162,943	290,038.540	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	93,799	42,444.040	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	315,559	434,524.740	
イギリス・ボンド 小計		8,083,986.510 (1,436,686,083)	
イスラエル・ シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	105,526	182,876.550

	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	37,152	296,361.500	
	REIT 1 LTD	33,128	537,004.880	
イスラエル・シュケル 小計			1,016,242.930 (39,814,874)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	188,008	1,479,622.960	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	38,400	53,952.000	
	HMC CAPITAL LTD	34,174	155,491.700	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY UN	53,900	35,304.500	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	57,979	168,718.890	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	247,199	129,779.470	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	92,172	281,124.600	
	RURAL FUNDS GROUP	67,167	114,519.730	
	WAYPOINT REIT	117,959	319,668.890	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	113,735	461,764.100	
	CENTURIA OFFICE REIT	68,959	96,197.800	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	120,539	193,465.090	
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	269,082	305,408.070	
	REGION GROUP	200,826	475,957.620	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	50,422	145,215.360	
	NATIONAL STORAGE REIT	208,797	513,640.620	
	DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	35,122	94,829.400	
	GDI PROPERTY GROUP	87,347	59,832.690	
	SCENTRE GROUP	907,275	2,349,842.250	
	ARENA REIT	60,571	224,112.700	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	31,154	102,185.120	
	BWP TRUST	84,216	304,861.920	
	GPT GROUP	334,842	1,346,064.840	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	90,423	328,235.490	
MIRVAC GROUP	689,734	1,503,620.120		
STOCKLAND	417,276	1,698,313.320		
ABACUS PROPERTY GROUP	70,207	181,134.060		
GOODMAN GROUP	299,121	5,889,692.490		
VICINITY CENTRES	676,374	1,258,055.640		



	CHARTER HALL GROUP	81,938	891,485.440	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	63,546	253,548.540	
オーストラリア・ドル 小計			21,415,645.420 (2,042,410,103)	
カナダ・ドル	INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	2,300	7,383.000	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	5,100	16,269.000	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	6,200	17,422.000	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	5,600	47,768.000	
	PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	7,841	100,207.980	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	4,400	23,452.000	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST U	2,758	45,893.120	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,800	70,560.000	
	SLATE GROCERY REIT	4,700	61,335.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	9,800	174,538.000	
	SLATE OFFICE REIT	5,100	10,200.000	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,800	42,588.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	20,100	154,770.000	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	6,100	15,311.000	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2,700	31,482.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5,400	433,620.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	21,800	303,238.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,800	150,332.000	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	18,100	274,215.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	27,400	366,064.000	

	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	3,300	54,516.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	9,100	136,045.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,100	303,952.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,500	724,130.000	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	22,266	229,785.120	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	25,700	511,173.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,300	48,708.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,800	228,038.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	8,900	129,228.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	10,700	243,532.000	
	カナダ・ドル 小計		4,955,755.220 (521,841,024)	
シンガポール・ドル	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	84,700	49,549.500	
	AIMS APAC REIT	3,118	178.160	
	KEPPEL DC REIT	231,283	469,504.490	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	210,276	54,671.760	
	AIMS APAC REIT	89,100	105,138.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	506,090	627,551.600	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	87,900	60,211.500	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	327,840	219,652.800	
	EC WORLD REIT	36,500	12,045.000	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	587,477	1,568,563.590	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	880,122	1,733,840.340	
	SUNTEC REIT	393,600	499,872.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	559,000	927,940.000	
KEPPEL REIT	343,600	305,804.000		

	CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	353,056	374,239.360	
	ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T	1,042,402	328,356.630	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	145,700	176,297.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	187,576	408,915.680	
	STARHILL GLOBAL REIT	247,600	126,276.000	
	CAPITALAND CHINA TRUST	196,542	198,507.420	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	66,100	244,570.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	346,769	773,294.870	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	399,084	662,479.440	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	169,000	101,400.000	
	PARAGON REIT	177,000	166,380.000	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	412,463	131,988.160	
	シンガポール・ドル 小計		10,327,227.300 (1,080,021,430)	
ニュージーランド・ドル	STRIDE PROPERTY GROUP	92,477	123,919.180	
	ARGOSY PROPERTY LTD	144,609	160,515.990	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	261,440	233,988.800	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	80,882	186,837.420	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	179,742	388,242.720	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	230,216	285,467.840	
	ニュージーランド・ドル 小計		1,378,971.950 (119,874,032)	
ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	6,463	144,900.460	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1,820	9,445.800	
	HAMBORNER REIT AG	10,717	74,483.150	
	WERELDHAVE NV	6,098	85,676.900	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	16,180	758,356.600	
	NSI NV	2,733	55,343.250	
	VASTNED RETAIL NV	2,739	55,327.800	
	ICADE	4,849	194,541.880	
	CARMILA	8,705	127,267.100	
	ALTAREA	710	73,130.000	

	GECINA SA	8,238	807,324.000	
	KLEPIERRE	29,539	659,015.090	
	COVIVIO	7,033	325,205.920	
	MERCIALYS	11,658	94,371.510	
	AEDIFICA	6,035	399,818.750	
	COFINIMMO	4,630	349,565.000	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	3,984	62,548.800	
	RETAIL ESTATES	1,706	109,354.600	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	23,476	619,296.880	
	CARE PROPERTY INVEST	5,601	74,605.320	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	3,526	104,369.600	
	MONTEA NV	2,047	158,028.400	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,930	17,636.850	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	8,842	46,862.600	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	44,944	255,731.360	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	50,509	398,768.550	
	CROMWELL REIT EUR	54,520	86,141.600	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	64,959	65,868.420	
	ユーロ 小計		6,212,986.190 (945,305,848)	
韓国・ウォン	SK REITS LTD	11,423	58,714,220.000	
	D&D PLATFORM REIT LTD	8,000	26,760,000.000	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT LTD	3,930	14,423,100.000	
	NH ALL ONE REIT LTD	6,454	23,976,610.000	
	E KOCREF CR	3,584	19,174,400.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	12,235	76,346,400.000	
	LOTTE REIT CO LTD	20,132	79,622,060.000	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	15,855	70,158,375.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	5,600	27,216,000.000	
	JR REIT XXVII	25,282	115,917,970.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	5,990	33,364,300.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	27,294	111,768,930.000	
	韓国・ウォン 小計		657,442,365.000 (72,450,148)	

香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	398,000	676,600.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	160,000	452,800.000	
	FORTUNE REIT	254,000	1,424,940.000	
	PROSPERITY REIT	205,000	352,600.000	
	LINK REIT	442,100	20,668,175.000	
	CHAMPION REIT	331,000	903,630.000	
香港・ドル 小計			24,478,745.000 (438,903,897)	
投資証券 合計			28,791,803,997 [28,791,803,997]	
合計			30,546,339,815 [30,546,339,815]	

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

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	7.4%	92.6%	78.2%
	投資証券 145銘柄			
イギリス・ポンド	投資証券 36銘柄	-%	100%	4.7%
イスラエル・シケル	投資証券 3銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券 31銘柄	-%	100%	6.7%
カナダ・ドル	投資証券 30銘柄	-%	100%	1.7%
シンガポール・ドル	投資証券 26銘柄	-%	100%	3.5%
ニュージーランド・ドル	投資証券 6銘柄	-%	100%	0.4%
ユーロ	投資証券 28銘柄	-%	100%	3.1%
韓国・ウォン	投資証券 12銘柄	-%	100%	0.2%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	-%	100%	1.4%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワTOPIXインデックス(ダイワSMA専用)】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年6月16日から2023年12月15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。

## 1【中間財務諸表】

## ダイワTOPIXインデックス(ダイワSMA専用)

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2023年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		15,671,796
親投資信託受益証券		9,844,760,369
流動資産合計		9,860,432,165
資産合計		9,860,432,165
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		951,695
未払委託者報酬		13,800,200
その他未払費用		237,856
流動負債合計		14,989,751
負債合計		14,989,751
純資産の部		
元本等		
元本		1 6,199,368,611
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )		3,646,073,803
(分配準備積立金)		627,521,003
元本等合計		9,845,442,414
純資産合計		9,845,442,414
負債純資産合計		9,860,432,165



## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間
	自 2023年6月16日
	至 2023年12月15日
営業収益	
有価証券売買等損益	208,781,372
営業収益合計	208,781,372
営業費用	
支払利息	985
受託者報酬	951,695
委託者報酬	13,800,200
その他費用	237,856
営業費用合計	14,990,736
営業利益又は営業損失（ ）	193,790,636
経常利益又は経常損失（ ）	193,790,636
中間純利益又は中間純損失（ ）	193,790,636
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	30,582,571
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,993,972,228
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,217,135,706
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,217,135,706
剰余金減少額又は欠損金増加額	728,242,196
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	728,242,196
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,646,073,803

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年6月16日 至2023年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1. 1 期首元本額	3,639,859,036円
期中追加設定元本額	3,865,661,289円
期中一部解約元本額	1,306,151,714円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	6,199,368,611口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年6月16日 至2023年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2023年12月15日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,5881円 (15,881円)

(参考)

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

	2023年12月15日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,965,961,201
株式	273,500,872,940
派生商品評価勘定	1,581,750
未収入金	7,171,000
未収配当金	103,191,037
未収利息	299,537

前払金		73,500,000
その他未収収益	4	3,988,730
差入委託証拠金		51,531,310
流動資産合計		285,708,097,505
資産合計		285,708,097,505
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		42,604,650
未払解約金		55,719,660
受入担保金		6,066,528,811
流動負債合計		6,164,853,121
負債合計		6,164,853,121
純資産の部		
元本等		
元本	1	167,054,913,059
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		112,488,331,325
元本等合計		279,543,244,384
純資産合計		279,543,244,384
負債純資産合計		285,708,097,505

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年6月16日 至2023年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2023年12月15日現在
1. 1 期首	2023年6月16日
期首元本額	155,385,420,480円
期中追加設定元本額	19,243,258,972円
期中一部解約元本額	7,573,766,393円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
トピックス・インデックスファンド	2,803,481,931円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A	4,345,259,538円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドV A 2	911,099円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	15,019,052円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	187,470,864円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	13,126,071円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	405,732,331円
国内株式ファンド(適格機関投資家専用)	332,765,240円
日本株式インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	683,069,361円
D-I's TOPIXインデックス	13,681,611円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	252,338,863円
iFree TOPIXインデックス	7,291,454,564円
iFree 8資産バランス	4,608,275,672円
iFree 年金バランス	1,000,433,045円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	606,201円
DCダイワ日本株式インデックス	70,746,383,888円
ダイワ・ライフ・バランス30	3,116,115,764円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,942,781,215円

ダイワ・ライフ・バランス70	5,662,400,354円
年金ダイワ日本株式インデックス	7,354,950,099円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	55,543,033円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	76,255,158円
ダイワつみたてインデックス日本株式	4,849,709,096円
ダイワつみたてインデックスバランス30	12,445,814円
ダイワつみたてインデックスバランス50	11,685,906円
ダイワつみたてインデックスバランス70	29,772,487円
ダイワ国内株式インデックス(ラップ専用)	11,854,854,881円
ダイワ世界バランスファンド40VA	54,371,807円
ダイワ世界バランスファンド60VA	21,015,894円
ダイワ・バランスファンド35VA	3,760,333,024円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	350,930,093円
ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	51,746,439円
ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)	73,719,521円
ダイワ・ノーロードTOPIXファンド	238,728,010円
ダイワファンドラップTOPIXインデックス	12,328,953,067円
ダイワTOPIXインデックス(ダイワSMA専用)	5,883,088,544円
ダイワファンドラップオンラインTOPIXインデックス	3,344,997,099円
スタイル9(4資産分散・保守型)	86,587円
スタイル9(4資産分散・バランス型)	145,111円
スタイル9(4資産分散・積極型)	202,435円
スタイル9(6資産分散・保守型)	74,055円
スタイル9(6資産分散・バランス型)	128,381円
スタイル9(6資産分散・積極型)	203,035円
スタイル9(8資産分散・保守型)	74,654円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	126,582円
スタイル9(8資産分散・積極型)	213,768円
ダイワ・インデックスセレクトTOPIX	1,153,858,205円
ダイワライフスタイル25	107,289,628円
ダイワライフスタイル50	481,894,635円
ダイワライフスタイル75	403,714,677円
DC・ダイワ・トピックス・インデックス(確定拠出年金専用ファンド)	8,132,494,670円
計	167,054,913,059円
2. 期末日における受益権の総数	167,054,913,059口

3.	2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 5,726,686,640円
4.	3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 626,130,000円
5.	4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

種類	2023年12月15日現在		
	契約額等 (円)	時価	評価損益 (円)
		うち 1年超 (円)	
市場取引			
株価指数			
先物取引			

買建	6,512,710,000	-	6,471,840,000	40,870,000
合計	6,512,710,000	-	6,471,840,000	40,870,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2023年12月15日現在
1口当たり純資産額	1.6734円
(1万口当たり純資産額)	(16,734円)



【ダイワ日経225インデックス(ダイワSMA専用)】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年6月16日から2023年12月15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。

## 1【中間財務諸表】

## ダイワ日経225インデックス(ダイワSMA専用)

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2023年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		5,033,871
親投資信託受益証券		3,249,109,732
流動資産合計		3,254,143,603
資産合計		3,254,143,603
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		286,595
未払委託者報酬		4,156,174
その他未払費用		71,576
流動負債合計		4,514,345
負債合計		4,514,345
純資産の部		
元本等		
元本		1,861,083,951
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )		1,388,545,307
(分配準備積立金)		22,120,833
元本等合計		3,249,629,258
純資産合計		3,249,629,258
負債純資産合計		3,254,143,603

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2023年6月16日 至 2023年12月15日
<b>営業収益</b>	
受取利息	4
有価証券売買等損益	2,855,291
営業収益合計	2,855,295
<b>営業費用</b>	
支払利息	558
受託者報酬	286,595
委託者報酬	4,156,174
その他費用	71,576
営業費用合計	4,514,903
営業利益又は営業損失（ ）	1,659,608
経常利益又は経常損失（ ）	1,659,608
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,659,608
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	71,947,407
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,251,342,312
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,694,209,543
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,694,209,543
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,627,294,347
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,627,294,347
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,388,545,307

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年6月16日 至2023年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1. 1 期首元本額	1,644,514,833円
期中追加設定元本額	3,806,000,158円
期中一部解約元本額	3,589,431,040円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	1,861,083,951口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年6月16日 至2023年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2023年12月15日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7461円 (17,461円)

(参考)

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

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

「ストックインデックス225・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年12月15日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,744,342,805
株式	23 266,332,405,010
派生商品評価勘定	48,212,100
未収配当金	6,655,500
未収利息	88,317
前払金	19,460,000

その他未収収益	4	63,604
流動資産合計		274,151,227,336
資産合計		274,151,227,336
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		73,850
未払解約金		459,717,000
受入担保金		1,275,402,555
流動負債合計		1,735,193,405
負債合計		1,735,193,405
純資産の部		
元本等		
元本	1	60,490,315,709
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		211,925,718,222
元本等合計		272,416,033,931
純資産合計		272,416,033,931
負債純資産合計		274,151,227,336

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年6月16日 至2023年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2023年12月15日現在
1. 1 期首	2023年6月16日
期首元本額	56,240,375,491円
期中追加設定元本額	13,776,182,081円
期中一部解約元本額	9,526,241,863円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ストック インデックス ファンド 2 2 5	23,240,543,955円
適格機関投資家専用・ダイワ・ストックイン	221,605,515円
デックスファンド 2 2 5 V A	
大和 スtock インデックス 2 2 5 ファンド	7,329,359,448円
D - I ' s 日経 2 2 5 インデックス	52,285,782円
i F r e e 日経 2 2 5 インデックス	12,433,129,095円
D C ・ダイワ・ストックインデックス 2 2 5	5,525,174,413円
(確定拠出年金専用ファンド)	
ダイワ・ノーロード 日経 2 2 5 ファンド	418,295,218円
ダイワファンドラップ 日経 2 2 5 インデックス	4,489,472,913円
ダイワ日経 2 2 5 インデックス (ダイワ S M A	721,463,247円
専用)	
ダイワ・インデックスセレクト 日経 2 2 5	6,058,986,123円
計	60,490,315,709円
2. 期末日における受益権の総数	60,490,315,709口
3. 2 貸付有価証券	<p>株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。</p> <p>株式 1,202,459,300円</p>
4. 3 差入委託証拠金代用有価証券	<p>先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。</p> <p>株式 4,203,076,000円</p>

## 5. 4 その他未収収益

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

種類	2023年12月15日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超		
市場取引				
株価指数 先物取引				
買建	6,036,410,000	-	6,084,650,000	48,240,000
合計	6,036,410,000	-	6,084,650,000	48,240,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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



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

## (1口当たり情報)

	2023年12月15日現在
1口当たり純資産額	4,5035円
(1万口当たり純資産額)	(45,035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)】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年6月16日から2023年12月15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。

## 1【中間財務諸表】

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)

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

当中間計算期間末 2023年12月15日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	42,504,027
親投資信託受益証券	22,619,324,754
未収入金	517,130,000
流動資産合計	23,178,958,781
資産合計	23,178,958,781
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	516,047,156
未払受託者報酬	1,983,372
未払委託者報酬	38,180,802
その他未払費用	495,764
流動負債合計	556,707,094
負債合計	556,707,094
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	14,455,453,151
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	8,166,798,536
(分配準備積立金)	686,744,661
元本等合計	22,622,251,687
純資産合計	22,622,251,687
負債純資産合計	23,178,958,781

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2023年6月16日 至 2023年12月15日
営業収益	
有価証券売買等損益	976,662,437
営業収益合計	976,662,437
営業費用	
支払利息	2,968
受託者報酬	1,983,372
委託者報酬	38,180,802
その他費用	495,764
営業費用合計	40,662,906
営業利益又は営業損失( )	935,999,531
経常利益又は経常損失( )	935,999,531
中間純利益又は中間純損失( )	935,999,531
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	13,638,378
期首剰余金又は期首欠損金( )	4,290,263,773
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,910,972,492
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,910,972,492
剰余金減少額又は欠損金増加額	984,075,638
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	984,075,638
中間剰余金又は中間欠損金( )	8,166,798,536

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年6月16日 至2023年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1. 1 期首元本額	8,528,354,682円
期中追加設定元本額	7,889,486,739円
期中一部解約元本額	1,962,388,270円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	14,455,453,151口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年6月16日 至2023年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2023年12月15日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5650円 (15,650円)

(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、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「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

	2023年12月15日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	598,443,345
コール・ローン	1,652,604,514
株式	99,869,822,314
投資証券	2,210,387,097
派生商品評価勘定	3,410,658,569
未収入金	5,478,395

未収配当金		132,458,732
差入委託証拠金		1,905,225,636
流動資産合計		109,785,078,602
資産合計		109,785,078,602
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		1,558,541
未払解約金		535,670,030
流動負債合計		537,228,571
負債合計		537,228,571
純資産の部		
元本等		
元本	1	38,455,011,791
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		70,792,838,240
元本等合計		109,247,850,031
純資産合計		109,247,850,031
負債純資産合計		109,785,078,602

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年6月16日 至2023年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券</p>

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

### (3)投資証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

## 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法

### (1)先物取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

### (2)為替予約取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。

## 3. 収益及び費用の計上基準

### 受取配当金

原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。



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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2023年12月15日現在
1. 1 期首	2023年6月16日
期首元本額	34,080,983,566円
期中追加設定元本額	7,644,782,183円
期中一部解約元本額	3,270,753,958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	25,954,381,636円
(為替ヘッジあり)	
ダイワファンドラップオンライン 外国株式イン	1,243,132,158円
デックス(為替ヘッジあり)	
i F r e e 外国株式インデックス(為替ヘッジ	3,294,860,427円
あり)	
ダイワ先進国株式インデックス(為替ヘッジあ	609,778円
り)(投資一任専用)	
ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジあ	7,962,027,792円
り)(ダイワSMA専用)	
計	38,455,011,791円
2. 期末日における受益権の総数	38,455,011,791口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 1. 株式関連

種類	2023年12月15日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価	評価損益
			(円)	(円)
市場取引				
株価指数 先物取引				
買建	3,693,951,533	-	3,754,466,842	60,515,309
合計	3,693,951,533	-	3,754,466,842	60,515,309

(注)

#### 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

#### 2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

#### 2. 通貨関連

種類	2023年12月15日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価	評価損益
			(円)	(円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	103,988,308,538	-	100,639,723,819	3,348,584,719
アメリカ・ドル	77,690,554,086	-	75,033,885,775	2,656,668,311
イギリス・ ポンド	4,496,336,813	-	4,379,739,598	116,597,215
イスラエル・ シケル	125,713,959	-	123,110,362	2,603,597
オーストラリ ア・ドル	2,184,081,062	-	2,135,305,130	48,775,932
カナダ・ドル	3,445,915,812	-	3,359,868,403	86,047,409
シンガポー ル・ドル	389,413,295	-	377,853,924	11,559,371
スイス・フラン	2,912,102,128	-	2,827,717,530	84,384,598
スウェーデン ・クローナ	996,848,865	-	982,984,697	13,864,168
デンマーク・ クローネ	1,032,666,134	-	1,003,924,317	28,741,817
ニュージーラ ンド・ドル	66,083,436	-	64,126,823	1,956,613
ノルウェー・ クローネ	203,484,937	-	201,768,292	1,716,645
ユーロ	9,792,008,602	-	9,518,361,520	273,647,082
香港・ドル	653,099,409	-	631,077,448	22,021,961
合計	103,988,308,538	-	100,639,723,819	3,348,584,719

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2023年12月15日現在
1口当たり純資産額	2,8409円
(1万口当たり純資産額)	(28,409円)

【ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年6月16日から2023年12月15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。

## 1【中間財務諸表】

ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）

## (1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

当中間計算期間末 2023年12月15日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	24,092,582
親投資信託受益証券	12,221,061,732
未収入金	26,178,000
流動資産合計	12,271,332,314
資産合計	12,271,332,314
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	25,885,138
未払受託者報酬	1,130,197
未払委託者報酬	21,757,090
その他未払費用	282,470
流動負債合計	49,054,895
負債合計	49,054,895
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	5,352,212,768
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	6,870,064,651
（分配準備積立金）	753,323,761
元本等合計	12,222,277,419
純資産合計	12,222,277,419
負債純資産合計	12,271,332,314

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2023年6月16日 至 2023年12月15日
営業収益	
有価証券売買等損益	861,259,329
営業収益合計	861,259,329
営業費用	
支払利息	1,679
受託者報酬	1,130,197
委託者報酬	21,757,090
その他費用	282,470
営業費用合計	23,171,436
営業利益又は営業損失( )	838,087,893
経常利益又は経常損失( )	838,087,893
中間純利益又は中間純損失( )	838,087,893
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	68,258,872
期首剰余金又は期首欠損金( )	3,901,900,664
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,179,583,510
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,179,583,510
剰余金減少額又は欠損金増加額	981,248,544
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	981,248,544
中間剰余金又は中間欠損金( )	6,870,064,651

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年6月16日 至2023年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1. 1 期首元本額	3,575,653,475円
期中追加設定元本額	2,649,355,967円
期中一部解約元本額	872,796,674円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	5,352,212,768口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年6月16日 至2023年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等



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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2023年12月15日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.2836円 (22,836円)

(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、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年12月15日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,796,875,553
コール・ローン	9,892,269,730
株式	390,281,188,689
投資証券	8,695,838,032
派生商品評価勘定	335,471,177
未収入金	16,181,262

未収配当金		499,011,440
差入委託証拠金		8,479,838,210
流動資産合計		419,996,674,093
資産合計		419,996,674,093
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		290,944,710
未払解約金		118,731,400
流動負債合計		409,676,110
負債合計		409,676,110
純資産の部		
元本等		
元本	1	78,934,368,827
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		340,652,629,156
元本等合計		419,586,997,983
純資産合計		419,586,997,983
負債純資産合計		419,996,674,093

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年6月16日 至2023年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p>

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

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	2023年12月15日現在
1. 1 期首	2023年6月16日
期首元本額	73,496,843,463円
期中追加設定元本額	7,512,605,858円
期中一部解約元本額	2,075,080,494円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国株式インデックスV A	252,219,794円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	2,398,033円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	25,753,127円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	4,173,336円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	130,046,867円
外国株式インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	101,926,645円
ダイワバランスファンド2023-01(適格機関投資家専用)	89,930,302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)	730,226,519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)	4,666,386,566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)	560,632,240円
D-I's 外国株式インデックス	20,777,577円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	53,190,442円

i F r e e 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)	7,614,556,547円
i F r e e 8資産バランス	1,483,678,196円
i F r e e 年金バランス	322,769,357円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2060	2,911,681円
D Cダイワ外国株式インデックス	47,591,879,515円
ダイワ・ライフ・バランス30	500,377,466円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,067,785,681円
ダイワ・ライフ・バランス70	1,025,339,397円
大和D C 海外株式インデックスファンド	2,018,027,441円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2030	12,498,122円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2040	13,060,578円
ダイワつみたてインデックス外国株式	2,130,195,134円
ダイワつみたてインデックスバランス30	2,057,594円
ダイワつみたてインデックスバランス50	2,504,278円
ダイワつみたてインデックスバランス70	5,295,411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)	11,579,002円
ダイワ世界バランスファンド40VA	52,676,509円
ダイワ世界バランスファンド60VA	33,932,785円
ダイワ・バランスファンド35VA	900,545,333円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	48,117,622円
ダイワバランスファンド2021-02(適格機関投資家専用)	140,109,625円
スタイル9(4資産分散・保守型)	36,916円
スタイル9(4資産分散・バランス型)	62,672円
スタイル9(4資産分散・積極型)	88,640円
スタイル9(6資産分散・保守型)	31,336円
スタイル9(6資産分散・バランス型)	55,374円
スタイル9(6資産分散・積極型)	88,833円
スタイル9(8資産分散・保守型)	28,073円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	47,882円
スタイル9(8資産分散・積極型)	84,991円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,391,496,312円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	433,076,574円
ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	2,299,093,561円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,023,672,163円
ダイワライフスタイル25	8,562,753円
ダイワライフスタイル50	38,800,537円
ダイワライフスタイル75	32,426,160円

ダイワバランスファンド2023-08(適格機関投資家専用)	89,157,328円
計	78,934,368,827円
2. 期末日における受益権の総数	78,934,368,827口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 株式関連

種類	2023年12月15日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超		
市場取引				
株価指数 先物取引				
買建	20,627,915,631	-	20,954,648,568	326,732,937
合計	20,627,915,631	-	20,954,648,568	326,732,937

## （注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

種類	2023年12月15日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価	評価損益
			(円)	(円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	10,426,841,750	-	10,144,635,280	282,206,470
アメリカ・ドル	6,240,046,530	-	6,057,370,760	182,675,770
イギリス・ ポンド	350,864,330	-	343,787,140	7,077,190
オーストラリ ア・ドル	650,732,040	-	637,140,520	13,591,520
カナダ・ドル	986,367,930	-	962,791,830	23,576,100
スイス・フラン	809,154,100	-	786,720,000	22,434,100
ユーロ	1,389,676,820	-	1,356,825,030	32,851,790
合計	10,426,841,750	-	10,144,635,280	282,206,470

## （注） 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2023年12月15日現在
1口当たり純資産額	5.3156円
(1万口当たり純資産額)	(53,156円)



【ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年6月16日から2023年12月15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。

## 1【中間財務諸表】

## ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

		当中間計算期間末 2023年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		33,331,002
親投資信託受益証券		18,535,049,672
未収入金		4,059,862
流動資産合計		18,572,440,536
資産合計		18,572,440,536
負債の部		
流動負債		
未払解約金		3,896,331
未払受託者報酬		1,077,459
未払委託者報酬		13,468,739
その他未払費用		538,662
流動負債合計		18,981,191
負債合計		18,981,191
純資産の部		
元本等		
元本	1	19,305,897,525
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2	752,438,180
（分配準備積立金）		103,327,744
元本等合計		18,553,459,345
純資産合計		18,553,459,345
負債純資産合計		18,572,440,536

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間
	自 2023年6月16日
	至 2023年12月15日
営業収益	
有価証券売買等損益	496,642,656
営業収益合計	496,642,656
営業費用	
支払利息	4,849
受託者報酬	1,077,459
委託者報酬	13,468,739
その他費用	538,662
営業費用合計	15,089,709
営業利益又は営業損失（ ）	511,732,365
経常利益又は経常損失（ ）	511,732,365
中間純利益又は中間純損失（ ）	511,732,365
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	97,523,427
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	360,239,097
剰余金増加額又は欠損金減少額	145,793,436
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	145,793,436
剰余金減少額又は欠損金増加額	123,783,581
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	123,783,581
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	752,438,180

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年6月16日 至2023年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1. 1 期首元本額	25,221,028,431円
期中追加設定元本額	4,194,320,372円
期中一部解約元本額	10,109,451,278円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	19,305,897,525口
3. 2 元本の欠損	中間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752,438,180円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年6月16日 至2023年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券

重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載していません。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等  
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2023年12月15日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9610円 (9,610円)

(参考)

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

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

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年12月15日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	317,725,101
国債証券	93,999,896,040
地方債証券	6,107,565,800

特殊債券		2,789,074,100
社債券		8,073,775,600
未収利息		245,616,905
前払費用		11,934,845
流動資産合計		111,545,588,391
資産合計		111,545,588,391
負債の部		
流動負債		
未払解約金		37,866,233
流動負債合計		37,866,233
負債合計		37,866,233
純資産の部		
元本等		
元本	1	83,034,790,179
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		28,472,931,979
元本等合計		111,507,722,158
純資産合計		111,507,722,158
負債純資産合計		111,545,588,391

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年6月16日 至2023年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023年12月15日現在
----	---------------

1. 1 期首	2023年6月16日
期首元本額	81,482,693,217円
期中追加設定元本額	12,642,219,297円
期中一部解約元本額	11,090,122,335円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	45,308,502円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	236,468,333円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	37,299,453円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	514,973,405円
DCダイワ日本債券インデックス	10,618,636,126円
ダイワ国内債券インデックス(ラップ専用)	10,053,470,747円
ダイワ・バランスファンド35VA	8,329,208,938円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	1,470,939,630円
ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	195,807,040円
ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)	212,842,015円
ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド	66,723,121円
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	27,093,659,044円
ダイワ日本債券インデックス(ダイワSMA専用)	13,802,256,067円
ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス	2,107,697,044円
スタイル9(4資産分散・保守型)	446,645円
スタイル9(4資産分散・バランス型)	198,651円
スタイル9(4資産分散・積極型)	22,348円
スタイル9(6資産分散・保守型)	455,569円
スタイル9(6資産分散・バランス型)	212,824円
スタイル9(6資産分散・積極型)	23,098円
スタイル9(8資産分散・保守型)	450,319円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	203,150円
スタイル9(8資産分散・積極型)	21,598円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	808,394,946円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	6,231,473,991円
ダイワライフスタイル25	442,027,775円

ダイワライフスタイル50	599,549,879円
ダイワライフスタイル75	166,019,921円
計	83,034,790,179円
2. 期末日における受益権の総数	83,034,790,179口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2023年12月15日現在
該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	2023年12月15日現在
1口当たり純資産額	1.3429円
(1万口当たり純資産額)	(13,429円)



【ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年6月16日から2023年12月15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。

## 1【中間財務諸表】

## ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

## (1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

		当中間計算期間末 2023年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		100,582,803
親投資信託受益証券		20,723,407,863
未収入金		41,236,427
流動資産合計		20,865,227,093
<b>資産合計</b>		
20,865,227,093		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		40,939,493
未払受託者報酬		2,088,542
未払委託者報酬		37,594,523
その他未払費用		783,129
流動負債合計		81,405,687
<b>負債合計</b>		
81,405,687		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		<sup>1</sup> 23,923,993,429
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	<sup>2</sup>	3,140,172,023
（分配準備積立金）		400,046,878
元本等合計		20,783,821,406
<b>純資産合計</b>		
20,783,821,406		
<b>負債純資産合計</b>		
20,865,227,093		

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2023年6月16日 至 2023年12月15日
営業収益	
有価証券売買等損益	77,655,960
営業収益合計	77,655,960
営業費用	
支払利息	12,814
受託者報酬	2,088,542
委託者報酬	37,594,523
その他費用	783,129
営業費用合計	40,479,008
営業利益又は営業損失（ ）	37,176,952
経常利益又は経常損失（ ）	37,176,952
中間純利益又は中間純損失（ ）	37,176,952
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	31,470,040
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,304,435,151
剰余金増加額又は欠損金減少額	231,152,645
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	231,152,645
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,135,536,509
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,135,536,509
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,140,172,023

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年6月16日 至2023年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1. 1 期首元本額	17,697,664,507円
期中追加設定元本額	7,968,385,188円
期中一部解約元本額	1,742,056,266円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	23,923,993,429口
3. 2 元本の欠損	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,140,172,023円です。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年6月16日 至2023年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券

重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載してあります。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等  
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2023年12月15日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8687円 (8,687円)

(参考)

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

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

「外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年12月15日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	2,377,533,908
コール・ローン	430,234,909
国債証券	122,433,616,609

派生商品評価勘定		4,038,026,434
未収利息		836,547,213
前払費用		51,001,180
差入委託証拠金		225,237,304
流動資産合計		130,392,197,557
資産合計		130,392,197,557
負債の部		
流動負債		
未払金		4,149,481
未払解約金		69,182,646
流動負債合計		73,332,127
負債合計		73,332,127
純資産の部		
元本等		
元本	1	151,214,287,599
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	20,895,422,169
元本等合計		130,318,865,430
純資産合計		130,318,865,430
負債純資産合計		130,392,197,557

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年6月16日 至2023年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2023年12月15日現在
1. 1 期首	2023年6月16日
期首元本額	141,933,741,025円
期中追加設定元本額	20,720,402,231円
期中一部解約元本額	11,439,855,657円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワバランスファンド2023-01（適格機関投資家専用）	2,287,280,752円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）	114,202,096,979円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）	4,810,935,125円

ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ラップ専用）	14,217,460円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	3,564,921,584円
ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）	24,046,655,678円
ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	2,288,180,021円
計	151,214,287,599円
2. 期末日における受益権の総数	151,214,287,599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20,895,422,169円であります。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 債券関連

種類	2023年12月15日現在		
	契約額等	時価	評価損益
	(円)		
		うち 1年超	(円)



市場取引				
債券先物取引				
買建	1,906,887,805	-	1,951,874,955	44,987,150
合計	1,906,887,805	-	1,951,874,955	44,987,150

(注) 1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

種類	2023年12月15日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価	評価損益
			(円)	(円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	127,075,997,359	-	123,082,958,075	3,993,039,284
アメリカ・ドル	58,389,082,055	-	56,381,125,967	2,007,956,088
イギリス・ ポンド	6,798,615,226	-	6,611,876,076	186,739,150
イスラエル・ シュケル	482,237,974	-	471,230,020	11,007,954
オーストラリ ア・ドル	1,991,206,498	-	1,941,455,934	49,750,564
オフショア・ 人民元	10,144,186,351	-	9,800,402,296	343,784,055
カナダ・ドル	2,710,641,228	-	2,645,014,230	65,626,998

シンガポ ル・ドル	606,443,467	-	587,812,305	18,631,162
スウェーデン ・クローナ	294,254,210	-	290,075,683	4,178,527
デンマーク・ クローネ	553,594,224	-	537,626,025	15,968,199
ニュージーラ ンド・ドル	277,490,004	-	268,918,481	8,571,523
ノルウェー・ クローネ	206,924,911	-	204,885,353	2,039,558
ポーランド・ ズロチ	666,401,587	-	652,220,092	14,181,495
マレーシア・ リングギット	673,724,800	-	647,769,584	25,955,216
メキシコ・ペソ	1,109,917,474	-	1,084,417,460	25,500,014
ユーロ	42,171,277,350	-	40,958,128,569	1,213,148,781
合計	127,075,997,359	-	123,082,958,075	3,993,039,284

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

## (1口当たり情報)

	2023年12月15日現在
1口当たり純資産額	0.8618円
(1万口当たり純資産額)	(8,618円)



【ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年6月16日から2023年12月15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。

## 1【中間財務諸表】

## ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2023年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		54,477,675
親投資信託受益証券		10,881,157,122
未収入金		20,461,886
流動資産合計		10,956,096,683
資産合計		10,956,096,683
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		20,550,262
未払受託者報酬		1,135,009
未払委託者報酬		20,430,851
その他未払費用		425,549
流動負債合計		42,541,671
負債合計		42,541,671
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		9,352,506,896
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )		1,561,048,116
(分配準備積立金)		46,935,918
元本等合計		10,913,555,012
純資産合計		10,913,555,012
負債純資産合計		10,956,096,683

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2023年6月16日 至 2023年12月15日
営業収益	
有価証券売買等損益	465,599,270
営業収益合計	465,599,270
営業費用	
支払利息	7,444
受託者報酬	1,135,009
委託者報酬	20,430,851
その他費用	425,549
営業費用合計	21,998,853
営業利益又は営業損失（ ）	443,600,417
経常利益又は経常損失（ ）	443,600,417
中間純利益又は中間純損失（ ）	443,600,417
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	35,974,984
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	809,111,924
剰余金増加額又は欠損金減少額	534,819,327
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	534,819,327
剰余金減少額又は欠損金増加額	190,508,568
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	190,508,568
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,561,048,116

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年6月16日 至2023年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1. 1 期首元本額	7,103,019,200円
期中追加設定元本額	3,818,013,994円
期中一部解約元本額	1,568,526,298円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	9,352,506,896口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年6月16日 至2023年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2023年12月15日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1669円 (11,669円)

(参考)

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年12月15日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	3,135,880,916
コール・ローン	1,475,879,868
国債証券	274,670,206,635
派生商品評価勘定	696,577
未収利息	1,874,790,604
前払費用	98,139,946



流動資産合計		281,255,594,546
資産合計		281,255,594,546
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		41,027,131
未払金		220,125
未払解約金		64,170,313
流動負債合計		105,417,569
負債合計		105,417,569
純資産の部		
元本等		
元本	1	82,579,547,070
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		198,570,629,907
元本等合計		281,150,176,977
純資産合計		281,150,176,977
負債純資産合計		281,255,594,546

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年6月16日 至2023年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

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

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2023年12月15日現在
1. 1 期首	2023年6月16日
期首元本額	79,274,139,359円
期中追加設定元本額	6,141,435,683円
期中一部解約元本額	2,836,027,972円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国債券インデックスV A	378,543,472円
ダイワ国内重視バランスファンド30V A(一般投資家私募)	7,319,300円
ダイワ国内重視バランスファンド50V A(一般投資家私募)	39,693,753円
ダイワ国際分散バランスファンド30V A(一般投資家私募)	15,003,665円
ダイワ国際分散バランスファンド50V A(一般投資家私募)	202,530,565円
外国債券インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	572,664,276円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックスエマージングプラス(為替ヘッジなし)	799,088,241円

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス (為替ヘッジなし)	3,785,741,254円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券イン デックス エマージングプラス(為替ヘッジな し)	844,723,777円
D - I ' s 外国債券インデックス	2,560,063円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2050	19,901,451円
i F r e e 外国債券インデックス	2,147,442,933円
i F r e e 8資産バランス	2,281,416,064円
i F r e e 年金バランス	497,542,993円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2060	297,564円
D Cダイワ外国債券インデックス	51,323,404,923円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,156,859,664円
ダイワ・ライフ・バランス50	817,194,869円
ダイワ・ライフ・バランス70	624,799,661円
D Cダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安 定コース)	690,989,129円
D Cダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6 分散コース)	547,649,971円
D Cダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成 長コース)	218,659,108円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2030	37,332,966円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2040	18,942,184円
ダイワつみたてインデックス外国債券	1,957,006,433円
ダイワつみたてインデックスバランス30	4,614,349円
ダイワつみたてインデックスバランス50	1,938,861円
ダイワつみたてインデックスバランス70	3,291,159円
ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジな し)(ラップ専用)	1,150,727,144円
ダイワ世界バランスファンド40VA	94,521,436円
ダイワ世界バランスファンド60VA	26,095,640円
ダイワ・バランスファンド35VA	2,806,821,322円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関 投資家専用)	174,580,938円
スタイル9(4資産分散・保守型)	19,262円
スタイル9(4資産分散・バランス型)	48,912円
スタイル9(4資産分散・積極型)	50,401円
スタイル9(6資産分散・保守型)	9,170円
スタイル9(6資産分散・バランス型)	17,475円
スタイル9(6資産分散・積極型)	8,872円
スタイル9(8資産分散・保守型)	8,872円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	19,559円

スタイル9（8資産分散・積極型）	13,635円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	156,879,102円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	67,018,494円
ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）	3,196,016,308円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,807,038,136円
ダイワライフスタイル25	26,624,614円
ダイワライフスタイル50	59,333,724円
ダイワライフスタイル75	16,541,406円
計	82,579,547,070円
2. 期末日における受益権の総数	82,579,547,070口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種類	2023年12月15日現在		
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)
		1年超	
市場取引以外の取引			
為替予約取引			

買建	1,609,848,740	-	1,569,518,186	40,330,554
アメリカ・ドル	244,503,315	-	242,477,192	2,026,123
イギリス・ ポンド	21,051,745	-	20,992,380	59,365
オフショア・ 人民元	1,046,331,594	-	1,010,871,666	35,459,928
カナダ・ドル	10,070,572	-	10,158,480	87,908
シンガポ ー ル・ドル	19,520,002	-	18,920,308	599,694
ニュージ ーラ ンド・ドル	25,779,248	-	24,982,940	796,308
ポーランド・ ズロチ	27,875,525	-	27,282,315	593,210
メキシコ・ペソ	46,764,863	-	45,690,455	1,074,408
ユーロ	167,951,876	-	168,142,450	190,574
合計	1,609,848,740	-	1,569,518,186	40,330,554

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

## (1口当たり情報)

	2023年12月15日現在
1口当たり純資産額	3.4046円
(1万口当たり純資産額)	(34,046円)



【ダイワJ - REITインデックス(ダイワSMA専用)】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年6月16日から2023年12月15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。

## 1【中間財務諸表】

## ダイワJ-REITインデックス(ダイワSMA専用)

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2023年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		3,689,005
親投資信託受益証券		1,723,708,369
流動資産合計		1,727,397,374
資産合計		1,727,397,374
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		182,355
未払委託者報酬		2,644,864
その他未払費用		45,508
流動負債合計		2,872,727
負債合計		2,872,727
純資産の部		
元本等		
元本		1,556,067,251
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )		168,457,396
(分配準備積立金)		18,909,476
元本等合計		1,724,524,647
純資産合計		1,724,524,647
負債純資産合計		1,727,397,374



## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2023年6月16日 至 2023年12月15日
営業収益	
有価証券売買等損益	22,420,477
営業収益合計	22,420,477
営業費用	
支払利息	202
受託者報酬	182,355
委託者報酬	2,644,864
その他費用	45,508
営業費用合計	2,872,929
営業利益又は営業損失（ ）	25,293,406
経常利益又は経常損失（ ）	25,293,406
中間純利益又は中間純損失（ ）	25,293,406
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	421,686
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	140,636,213
剰余金増加額又は欠損金減少額	62,321,578
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	62,321,578
剰余金減少額又は欠損金増加額	9,628,675
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,628,675
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	168,457,396

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年6月16日 至2023年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1. 1 期首元本額	1,150,653,836円
期中追加設定元本額	482,959,970円
期中一部解約元本額	77,546,555円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	1,556,067,251口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年6月16日 至2023年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2023年12月15日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1083円 (11,083円)

(参考)

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

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

「ダイワ」-REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年12月15日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,746,448,325
投資証券	2 400,421,522,000
未収入金	4,267,436,232
未収配当金	2,685,645,141
前払金	33,880,000
差入委託証拠金	526,115,192

流動資産合計		415,681,046,890
資産合計		415,681,046,890
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		28,896,000
未払解約金		2,059,758,000
流動負債合計		2,088,654,000
負債合計		2,088,654,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	127,531,933,917
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		286,060,458,973
元本等合計		413,592,392,890
純資産合計		413,592,392,890
負債純資産合計		415,681,046,890

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年6月16日 至2023年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金

原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2023年12月15日現在
1. 1 期首	2023年6月16日
期首元本額	143,357,852,675円
期中追加設定元本額	4,563,083,654円
期中一部解約元本額	20,389,002,412円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワJ-REITオープン	4,207,101,875円
ダイワJ-REITオープン(毎月分配型)	109,428,116,257円
ダイワJ-REITオープン(年1回決算型)	436,919,619円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	20,834,771円
iFree J-REITインデックス	672,764,314円
iFree 8資産バランス	2,376,245,772円
ダイワJ-REITオープン(奇数月決算型)	2,299,189円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	50,619円
DC・ダイワJ-REITオープン	5,434,390,333円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	8,475,750円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	8,667,097円
ダイワ国内REITインデックス(投資一任専用)	3,388,466円
ダイワ・ノーロード J-REITファンド	98,876,278円
ダイワファンドラップ J-REITインデックス	2,959,884,280円
ダイワJ-REITインデックス(ダイワSMA専用)	531,516,611円
ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス	482,660,037円
スタイル9(6資産分散・保守型)	12,261円
スタイル9(6資産分散・バランス型)	26,062円
スタイル9(6資産分散・積極型)	19,007円
スタイル9(8資産分散・保守型)	10,721円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	23,012円
スタイル9(8資産分散・積極型)	7,948円
ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	859,643,638円
計	127,531,933,917円
2. 期末日における受益権の総数	127,531,933,917口

3. 2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 1,666,650,000円
--------------------	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年12月15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ぬ。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 不動産投信関連

種類	2023年12月15日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引  不動産投信 指数先物取引  買建	10,018,680,000	-	9,990,400,000	28,280,000
合計	10,018,680,000	-	9,990,400,000	28,280,000

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	2023年12月15日現在
1口当たり純資産額	3,2430円
(1万口当たり純資産額)	(32,430円)

【ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年6月16日から2023年12月15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。



## 1【中間財務諸表】

ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

## (1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

		当中間計算期間末 2023年12月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		5,121,421
親投資信託受益証券		1,285,617,004
流動資産合計		1,290,738,425
資産合計		1,290,738,425
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		274,987
未払委託者報酬		5,156,762
その他未払費用		68,669
流動負債合計		5,500,418
負債合計		5,500,418
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,316,613,122
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2	31,375,115
（分配準備積立金）		50,518,141
元本等合計		1,285,238,007
純資産合計		1,285,238,007
負債純資産合計		1,290,738,425

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2023年6月16日 至 2023年12月15日
営業収益	
有価証券売買等損益	121,551,340
営業収益合計	121,551,340
営業費用	
支払利息	353
受託者報酬	274,987
委託者報酬	5,156,762
その他費用	68,669
営業費用合計	5,500,771
営業利益又は営業損失（ ）	127,052,111
経常利益又は経常損失（ ）	127,052,111
中間純利益又は中間純損失（ ）	127,052,111
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	188,699,180
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	211,736,056
剰余金増加額又は欠損金減少額	183,566,358
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	183,566,358
剰余金減少額又は欠損金増加額	64,852,486
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	64,852,486
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	31,375,115

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年6月16日 至2023年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1. 1 期首元本額	3,002,880,833円
期中追加設定元本額	959,507,512円
期中一部解約元本額	2,645,775,223円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	1,316,613,122口
3. 2 元本の欠損	中間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31,375,115円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年6月16日 至2023年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券

重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載していません。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等  
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2023年12月15日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9762円 (9,762円)

(参考)

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

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

「先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年12月15日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	189,039,830
コール・ローン	97,099,783
投資信託受益証券	348,588,174

投資証券		22,448,115,608
派生商品評価勘定		754,207,815
未収入金		383,817
未収配当金		69,262,690
差入委託証拠金		364,121,568
流動資産合計		24,270,819,285
資産合計		24,270,819,285
負債の部		
流動負債		
未払解約金		780,000
流動負債合計		780,000
負債合計		780,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	27,358,202,367
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	3,088,163,082
元本等合計		24,270,039,285
純資産合計		24,270,039,285
負債純資産合計		24,270,819,285

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年6月16日 至2023年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、市場価格のない有価証券については投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。また、市場価格のある有価証券については、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

## (2)投資証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

## 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法

### (1)先物取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

### (2)為替予約取引

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。

## 3. 収益及び費用の計上基準

受取配当金

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。
	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	2023年12月15日現在
1. 1 期首	2023年6月16日
期首元本額	27,483,964,976円
期中追加設定元本額	4,035,422,475円
期中一部解約元本額	4,161,185,084円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)	23,385,178,549円
ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)	1,094,939,255円
ダイワ海外REITインデックス(為替ヘッジあり)(投資一任専用)	1,206,695円
ダイワ・マクロ・ナビゲーター・ファンド2021-10(為替ヘッジあり/適格機関投資家専用)	1,427,642,151円
ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)	1,449,235,717円
計	27,358,202,367円
2. 期末日における受益権の総数	27,358,202,367口

3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,088,163,082円であります。
------------	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 不動産投信関連

種類	2023年12月15日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超		
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買建	765,112,768	-	813,401,251	48,288,483
合計	765,112,768	-	813,401,251	48,288,483



## (注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

種類	2023年12月15日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価	評価損益
			(円)	(円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	21,752,278,698	-	21,046,359,366	705,919,332
アメリカ・ドル	16,879,387,538	-	16,301,462,840	577,924,698
イギリス・ ポンド	1,139,318,539	-	1,109,527,758	29,790,781
イスラエル・ シケル	33,372,388	-	32,681,229	691,159
オーストラリ ア・ドル	1,486,632,616	-	1,453,089,296	33,543,320
カナダ・ドル	346,047,119	-	337,389,765	8,657,354
シンガポー ル・ドル	769,028,123	-	746,174,126	22,853,997
ニュージーラ ンド・ドル	72,578,410	-	70,424,287	2,154,123
ユーロ	746,678,749	-	725,761,029	20,917,720
香港・ドル	279,235,216	-	269,849,036	9,386,180
合計	21,752,278,698	-	21,046,359,366	705,919,332

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2023年12月15日現在
1口当たり純資産額	0.8871円
(1万口当たり純資産額)	( 8,871円)

【ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2023年6月16日から2023年12月15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。

## 1【中間財務諸表】

ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2023年12月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		59,283
親投資信託受益証券		46,159,698
未収入金		1,000
流動資産合計		46,219,981
<b>資産合計</b>		
46,219,981		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬		2,812
未払委託者報酬		53,712
その他未払費用		598
流動負債合計		57,122
<b>負債合計</b>		
57,122		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		34,423,063
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )		11,739,796
(分配準備積立金)		2,226,715
元本等合計		46,162,859
<b>純資産合計</b>		
46,162,859		
<b>負債純資産合計</b>		
46,219,981		

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2023年6月16日 至 2023年12月15日
営業収益	
有価証券売買等損益	3,535,094
営業収益合計	3,535,094
営業費用	
受託者報酬	2,812
委託者報酬	53,712
その他費用	598
営業費用合計	57,122
営業利益又は営業損失( )	3,477,972
経常利益又は経常損失( )	3,477,972
中間純利益又は中間純損失( )	3,477,972
期首剰余金又は期首欠損金( )	2,131,636
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,130,188
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,130,188
中間剰余金又は中間欠損金( )	11,739,796

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年6月16日 至2023年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1. 1 期首元本額	10,000,000円
期中追加設定元本額	24,423,063円
期中一部解約元本額	- 円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	34,423,063口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2023年6月16日 至2023年12月15日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2023年12月15日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2023年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3410円 (13,410円)

(参考)

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

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

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年12月15日現在 金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	491,487,788
コール・ローン	224,312,142
投資信託受益証券	1,172,593,455
投資証券	34,633,901,332
派生商品評価勘定	65,873,904
未収入金	577,372

未収配当金		104,322,396
差入委託証拠金		288,246,339
流動資産合計		36,981,314,728
資産合計		36,981,314,728
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		5,779,676
未払金		70,918,558
未払解約金		39,620,000
流動負債合計		116,318,234
負債合計		116,318,234
純資産の部		
元本等		
元本	1	10,434,638,685
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		26,430,357,809
元本等合計		36,864,996,494
純資産合計		36,864,996,494
負債純資産合計		36,981,314,728

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2023年6月16日 至2023年12月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のない有価証券については投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。また、市場価格のある有価証券については、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>



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

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	2023年12月15日現在
1. 1 期首	2023年6月16日
期首元本額	9,843,782,869円
期中追加設定元本額	1,082,767,126円
期中一部解約元本額	491,911,310円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワバランスファンド2023-01(適格機関投資家専用)	92,408,770円
ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)	1,721,613,158円
ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)	271,682,634円
D-I's グローバルREITインデックス	1,522,467円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	17,406,934円
iFree 外国REITインデックス	709,275,076円
iFree 8資産バランス	2,396,093,659円
グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)	369,611,138円
グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)	253,736,872円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	556,964円
DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド	4,024,790,496円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	8,311,324円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	8,548,978円
ダイワ海外REITインデックス(為替ヘッジなし)(投資一任専用)	3,261,395円

ダイワバランスファンド2021-02(適格機関投資家専用)	143,999,267円
スタイル9(6資産分散・保守型)	9,610円
スタイル9(6資産分散・バランス型)	20,459円
スタイル9(6資産分散・積極型)	22,574円
スタイル9(8資産分散・保守型)	8,401円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	18,041円
スタイル9(8資産分散・積極型)	9,006円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	240,024,422円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	66,460,846円
ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	13,065,668円
ダイワバランスファンド2023-08(適格機関投資家専用)	92,180,526円
計	10,434,638,685円
2. 期末日における受益権の総数	10,434,638,685口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2023年12月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 不動産投信関連

種類	2023年12月15日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超		
市場取引  不動産投信 指数先物取引  買建	1,033,287,648	-	1,099,161,552	65,873,904
合計	1,033,287,648	-	1,099,161,552	65,873,904

## (注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 2. 通貨関連

種類	2023年12月15日現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超		
市場取引以外の取引  為替予約取引  買建	221,092,119	-	215,312,443	5,779,676
アメリカ・ドル	145,686,541	-	142,012,700	3,673,841
ユーロ	75,405,578	-	73,299,743	2,105,835
合計	221,092,119	-	215,312,443	5,779,676

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	2023年12月15日現在
1口当たり純資産額	3,5329円
(1万口当たり純資産額)	(35,329円)

## 2【ファンドの現況】

ダイワTOPIXインデックス(ダイワSMA専用)

## 【純資産額計算書】

2023年12月29日

資産総額	10,510,847,874円
負債総額	1,334,976円
純資産総額( - )	10,509,512,898円
発行済数量	6,514,072,216口
1単位当たり純資産額( / )	1.6134円

(参考) トピックス・インデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

2023年12月29日

資産総額	294,653,571,073円
負債総額	7,718,688,250円
純資産総額( - )	286,934,882,823円
発行済数量	168,766,987,274口
1単位当たり純資産額( / )	1.7002円

ダイワ日経225インデックス(ダイワSMA専用)

## 純資産額計算書

2023年12月29日

資産総額	3,302,942,962円
負債総額	433,867円
純資産総額( - )	3,302,509,095円
発行済数量	1,861,083,951口
1単位当たり純資産額( / )	1.7745円

(参考) ストックインデックス225・マザーファンド

## 純資産額計算書

2023年12月29日

資産総額	276,035,662,175円
負債総額	2,017,812,930円
純資産総額( - )	274,017,849,245円
発行済数量	59,863,195,836口
1単位当たり純資産額( / )	4.5774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)

純資産額計算書

2023年12月29日

資産総額	22,756,327,068円
負債総額	3,906,270円
純資産総額( - )	22,752,420,798円
発行済数量	14,402,253,645口
1単位当たり純資産額( / )	1.5798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12月29日

資産総額	111,004,254,223円
負債総額	35,101,759円
純資産総額( - )	110,969,152,464円
発行済数量	38,688,437,648口
1単位当たり純資産額( / )	2.8683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)

純資産額計算書

2023年12月29日

資産総額	12,530,374,748円
負債総額	2,145,030円
純資産総額( - )	12,528,229,718円
発行済数量	5,430,339,869口
1単位当たり純資産額( / )	2.3071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12月29日

資産総額	427,502,403,105円
負債総額	418,376,345円
純資産総額（ - ）	427,084,026,760円
発行済数量	79,513,676,221口
1単位当たり純資産額（ / ）	5.3712円

ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）

## 純資産額計算書

2023年12月29日

資産総額	18,638,819,945円
負債総額	51,059,665円
純資産総額（ - ）	18,587,760,280円
発行済数量	19,251,069,802口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9655円

## (参考) 日本債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

2023年12月29日

資産総額	112,787,385,286円
負債総額	329,064,206円
純資産総額（ - ）	112,458,321,080円
発行済数量	83,346,556,494口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3493円

ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

## 純資産額計算書

2023年12月29日

資産総額	20,872,316,745円
負債総額	3,395,849円
純資産総額（ - ）	20,868,920,896円
発行済数量	23,857,490,509口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.8747円



## (参考) 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド

## 純資産額計算書

2023年12月29日

資産総額	131,657,251,103円
負債総額	11,810,612円
純資産総額( - )	131,645,440,491円
発行済数量	151,679,848,936口
1単位当たり純資産額( / )	0.8679円

ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)

## 純資産額計算書

2023年12月29日

資産総額	11,062,634,741円
負債総額	1,797,008円
純資産総額( - )	11,060,837,733円
発行済数量	9,398,246,013口
1単位当たり純資産額( / )	1.1769円

## (参考) 外国債券インデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

2023年12月29日

資産総額	285,357,344,043円
負債総額	581,926,437円
純資産総額( - )	284,775,417,606円
発行済数量	82,919,285,917口
1単位当たり純資産額( / )	3.4344円

ダイワJ-REITインデックス(ダイワSMA専用)

## 純資産額計算書

2023年12月29日

資産総額	1,729,222,100円
負債総額	226,217円

純資産総額（ - ）	1,728,995,883円
発行済数量	1,556,471,346口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.1108円

## (参考) ダイワ J - R E I T マザーファンド

## 純資産額計算書

2023年12月29日

資産総額	404,430,588,623円
負債総額	1,362,956,000円
純資産総額（ - ）	403,067,632,623円
発行済数量	123,981,161,320口
1 単位当たり純資産額（ / ）	3.2510円

ダイワ外国 R E I T インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワ S M A 専用）

## 純資産額計算書

2023年12月29日

資産総額	1,292,771,101円
負債総額	214,327円
純資産総額（ - ）	1,292,556,774円
発行済数量	1,316,613,122口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.9817円

## (参考) 先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

## 純資産額計算書

2023年12月29日

資産総額	24,597,639,359円
負債総額	55,428,168円
純資産総額（ - ）	24,542,211,191円
発行済数量	27,505,861,221口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.8923円

ダイワ外国 R E I T インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワ S M A 専用）

## 純資産額計算書

2023年12月29日

資産総額	46,431,928円
負債総額	7,695円
純資産総額( - )	46,424,233円
発行済数量	34,423,063口
1単位当たり純資産額( / )	1.3486円

(参考) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

## 純資産額計算書

2023年12月29日

資産総額	37,119,039,581円
負債総額	128,296,638円
純資産総額( - )	36,990,742,943円
発行済数量	10,409,695,029口
1単位当たり純資産額( / )	3.5535円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等  
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典  
ありません。

(3) 譲渡制限の内容  
譲渡制限はありません。

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

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

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

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

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

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

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

2023年12月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. 商品会議

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

##### ロ. 商品担当役員

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

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

##### ホ. リスクマネジメント会議

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

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年12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	90	293,196
追加型株式投資信託	790	25,470,735
株式投資信託 合計	880	25,763,932
単位型公社債投資信託	101	170,879
追加型公社債投資信託	14	1,533,421
公社債投資信託 合計	115	1,704,299
総合計	995	27,468,231

### 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)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
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
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	1	196
建物	4	3
器具備品	198	193
無形固定資産	1,770	1,482
ソフトウェア	1,738	1,351
ソフトウェア仮勘定	31	131



投資その他の資産	16,617	13,824
投資有価証券	10,755	8,260
関係会社株式	3,705	3,475
出資金	177	177
長期差入保証金	1,067	1,066
繰延税金資産	885	824
その他	26	20
固定資産計	18,591	15,503
資産合計	61,390	52,959

(単位:百万円)

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

資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,925	11,505
利益剰余金合計	14,299	11,879
株主資本合計	40,969	38,549
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	971	534
評価・換算差額等合計	971	534
純資産合計	41,941	39,084
負債・純資産合計	61,390	52,959

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

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

賞与引当金繰入額	866	692
福利厚生費	867	874
交際費	46	66
旅費交通費	48	95
租税公課	527	476
不動産賃借料	1,300	1,300
退職給付費用	408	488
役員退職慰労引当金繰入額	10	38
固定資産減価償却費	606	625
諸経費	1,864	2,193
一般管理費計	11,628	11,946
営業利益	18,551	15,310

(単位:百万円)

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 9,388	△ 9,388	△ 9,388
当期純利益	-	-	-	12,738	12,738	12,738
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,350	3,350	3,350
当期末残高	15,174	11,495	374	13,925	14,298	40,969

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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

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

## 注記事項

（重要な会計方針）

## 1．有価証券の評価基準及び評価方法

## （1）子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

## （2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2．固定資産の減価償却の方法

## （1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物 15～18年

器具備品 4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 収益及び費用の計上基準

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

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

(重要な会計上の見積り)

該当事項はありません。

(会計方針の変更に関する注記)

(時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用)

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

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

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

前事業年度	当事業年度
(2022年3月31日)	(2023年3月31日)

建物	37百万円	38百万円
器具備品	283百万円	296百万円

## 2 関係会社項目

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

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

## 3 保証債務

前事業年度(2022年3月31日)

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

当事業年度(2023年3月31日)

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自2021年4月1日至2022年3月31日)

### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

## 2. 配当に関する事項

### (1) 配当金支払額

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

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

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

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

効力発生日

2022年6月24日

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

## 1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

## 2．配当に関する事項

## （1）配当金支払額

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

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

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

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

## （金融商品関係）

## 1．金融商品の状況に関する事項

## （1）金融商品に対する取組方針

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

## （2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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



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

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### 市場リスクの管理

##### ( ) 為替変動リスクの管理

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

##### ( ) 価格変動リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

## 2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

### 前事業年度(2022年3月31日)

#### (1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

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

### 当事業年度(2023年3月31日)

#### (1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

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

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

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

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

(単位：百万円)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（2022年3月31日）

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

当事業年度（2023年3月31日）

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

2. その他有価証券

前事業年度（2022年3月31日）

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

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

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

当事業年度(2023年3月31日)

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

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

### 3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

### 4. 減損処理を行った有価証券

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

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

(退職給付関係)

#### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

### (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

### (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(注) その他には、臨時に支払った割増退職金等を含んでおります。

## 3. 確定拠出制度

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

### (税効果会計関係)

#### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位: 百万円)

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

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

前事業年度(2022年3月31日)

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

当事業年度(2023年3月31日)

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

3. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

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

(収益認識関係)

(1) 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

(2) 収益を理解するための基礎となる情報

(重要な会計方針)の4.収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

## (ア) 財務諸表提出会社の親会社

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## (イ) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(ウ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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



当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

## 2. 親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

## (1株当たり情報)

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

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

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

(単位:百万円)

当中間会計期間  
(2023年9月30日)

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

## (2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

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

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

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

（単位：百万円）

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

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

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

## 注記事項

（重要な会計方針）

### 1．有価証券の評価基準及び評価方法

#### （1）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

#### （2）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

### 2．固定資産の減価償却の方法

#### （1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

#### （2）無形固定資産

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

### 3. 引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

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

#### (2) 退職給付引当金

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

#### (3) 役員退職慰労引当金

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

### 4. 収益及び費用の計上基準

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

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

### 5. グループ通算制度の適用

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

#### (中間貸借対照表関係)

#### 1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2023年9月30日現在)
有形固定資産	340百万円

#### 2 消費税等の取扱い

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

#### 3 保証債務

当中間会計期間（2023年9月30日現在）

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

## （中間損益計算書関係）

## 1 減価償却実施額

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

## 2 営業外収益の主要項目

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

## 3 営業外費用の主要項目

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

## 4 特別損失の項目

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

## （中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 2023年 4月 1日 至 2023年 9月30日）

## 1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

## 2．配当に関する事項

## 配当金支払額

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

(金融商品関係)

当中間会計期間(2023年9月30日)

## 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

## (1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

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

## (2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

## (注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

## 有価証券及び投資有価証券

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



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

（単位：百万円）

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

（有価証券関係）

当中間会計期間（2023年9月30日）

1．子会社株式及び関連会社株式

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

2．その他有価証券

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

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

（収益認識関係）

（1）顧客との契約から生じる収益を分解した情報

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

（2）収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の4．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

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

[関連情報]

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

該当事項はありません。

## (1株当たり情報)

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

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

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

	名 称	資本金の額 (2023年03月末日現在)	事業の内容	備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	(注6)	
	みずほ信託銀行株式会社	247,369百万円	(注6)	
再信託受託会社	株式会社日本カスト ディ銀行	51,000百万円	(注6)	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	(注1)	

(注1) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

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

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

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

(注7) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注8) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注9) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

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

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

(注12) 農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

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

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

## 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。
  - 委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
  - 請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
- ・ 使用開始日を記載することがあります。
- ・ 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
  - 届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
  - 届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
- ・ 次の事項を記載することがあります。
  - 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
  - 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
  - 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載
- ・ 委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。
- ・ ファンドの形態等を記載することがあります。
- ・ 図案を採用することがあります。
- ・ ファンドの管理番号等を記載することがあります。
- ・ 委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。
- ・ UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

(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**

2023年8月10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TOPIXインデックス（ダイワSMA専用）の2022年6月16日から2023年6月15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TOPIXインデックス（ダイワSMA専用）の2023年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2023年8月10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日経225インデックス（ダイワSMA専用）の2022年6月16日から2023年6月15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、ダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）の2023年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2023年8月10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日本債券インデックス（ダイワSMA専用）の2022年6月16日から2023年6月15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、ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）の2023年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**その他の記載内容**

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか



か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2023年8月10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」-REITインデックス（ダイワSMA専用）の2022年6月16日から2023年6月15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」-REITインデックス（ダイワSMA専用）の2023年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**その他の記載内容**

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2023年8月10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外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2022年6月16日から2023年6月15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、ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2023年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**その他の記載内容**

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。



**独立監査人の監査報告書**

2023年8月10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外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2022年6月16日から2023年6月15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、ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2023年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**その他の記載内容**

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2023年8月10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外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2022年6月16日から2023年6月15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、ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2023年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**その他の記載内容**

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2023年8月10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外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2022年6月16日から2023年6月15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、ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2023年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**その他の記載内容**

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。



- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2023年8月10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外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2022年6月16日から2023年6月15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、ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2023年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**その他の記載内容**

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2023年8月10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外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2022年6月16日から2023年6月15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、ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2023年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**その他の記載内容**

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2023年11月27日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	間瀬 友未
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	渡部 啓太

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第65期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。



監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

#### 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2024年2月9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**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）の2023年6月16日から2023年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）の2023年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年6月16日から2023年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2024年2月9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

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）の2023年6月16日から2023年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）の2023年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年6月16日から2023年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。



**独立監査人の中間監査報告書**

2024年2月9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
--------------------	-------	-------

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）の2023年6月16日から2023年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）の2023年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年6月16日から2023年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2024年2月9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
--------------------	-------	-------

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワJ-REITインデックス（ダイワSMA専用）の2023年6月16日から2023年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワJ-REITインデックス（ダイワSMA専用）の2023年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年6月16日から2023年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2024年2月9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

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている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）の2023年6月16日から2023年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、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）の2023年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年6月16日から2023年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。



以上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2024年2月9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

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている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）の2023年6月16日から2023年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、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）の2023年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年6月16日から2023年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2024年2月9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

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2023年6月16日から2023年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2023年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年6月16日から2023年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2024年2月9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
--------------------	-------	-------

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2023年6月16日から2023年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2023年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年6月16日から2023年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。



## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2024年2月9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

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2023年6月16日から2023年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2023年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年6月16日から2023年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2024年2月9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

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2023年6月16日から2023年12月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2023年12月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年6月16日から2023年12月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

## 利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。