【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長　殿
【提出日】	2025年3月7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】	ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス ダイワファンドラップ 日経２２５インデックス ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし） ダイワファンドラップ 日本債券インデックス ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし） ダイワファンドラップ Ｊ－ＲＥＩＴインデックス ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり） ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）
【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120兆円を上限とします。
【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】

ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス
ダイワファンドラップ 日経２２５インデックス
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）
ダイワファンドラップ Ｊ－ＲＥＩＴインデックス
ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）
ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）

（注1）上記の総称を「ダイワファンドラップ インデックス・シリーズ」とします。
（注2）以下「当ファンド」という場合、上記を総称して、またはそれぞれを指していうものとします。
（注3）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。

ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	：FW ＴＯＰＩＸインデックス
ダイワファンドラップ 日経２２５インデックス	：FW 日経２２５インデックス
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	：FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	：FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	：FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	：FW 日本債券インデックス
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）	：FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	：FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	：FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）
ダイワファンドラップ Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	：FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス
ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）	：FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）
ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）	：FW 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120兆円を上限とします。

(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
FW ＴＯＰＩＸインデックス FW 日経２２５インデックス FW 日本債券インデックス FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	取得申込受付日の基準価額
FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし） FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし） FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり） FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）	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わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ　https://www.daiwa-am.co.jp/

(5)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

(6)【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

(7)【申込期間】

2025年3月8日から2025年9月9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。

<FW TOPIXインデックス>

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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	ファミリーファンド	日経225
一般	年2回	日本	ファンド・オブ・ファンズ	TOPIX
大型株	年4回	北米		その他（　　）
中小型株	年6回（隔月）	欧州		
債券	年12回（毎月）	アジア		
一般	日々	オセアニア		
公債	その他（　）	中南米		
社債		アフリカ		
その他債券		中近東（中東）		
クレジット属性（　　）		エマージング		
不動産投信				
その他資産（投資信託証券（株式　一般））				
資産複合（　　）				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 日経225インデックス>

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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	ファミリーファンド	日経225
一般	年2回	日本	ファンド・オブ・ファンズ	TOPIX
大型株	年4回	北米		その他（　　）
中小型株	年6回（隔月）	欧州		
債券	年12回（毎月）	アジア		
一般	日々	オセアニア		
公債	その他（　）	中南米		
社債		アフリカ		
その他債券		中近東（中東）		
クレジット属性（　　）		エマージング		
不動産投信				
その他資産（投資信託証券）（株式　一般）				
資産複合（　　）				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 外国株式インデックス(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	特殊型
	内　外	不動産投信	
		その他資産（　　）	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 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	特殊型
	内　外	不動産投信	
		その他資産（　　）	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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					
社債		欧州			
その他債券	年6回（隔月）				TOPIX
クレジット属性（　　）		アジア			
不動産投信					
その他資産（投資信託証券（株式　一般））	年12回（毎月）	オセアニア			
		中南米			
資産複合（　　）	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)）
資産配分固定型		中近東（中東）			
資産配分変更型	その他（　）				
		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。

<FW 外国株式インデックス EM+（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
追加型投信	海　外	債　券
	内　外	不動産投信
		その他資産（　　）
		資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 日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	特殊型
	内　外	不動産投信	
		その他資産（　　）	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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	ファミリーファンド	日経225
一般	年2回	日本		TOPIX
大型株	年4回	北米		
中小型株	年6回（隔月）	欧州		
債券	年12回（毎月）	アジア	ファンド・オブ・ファンズ	
一般	日々	オセアニア		その他（DBI総合指数）
公債	その他（　）	中南米		
社債		アフリカ		
その他債券		中近東（中東）		
クレジット属性（　　）		エマージング		
不動産投信				
その他資産（投資信託証券）（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。

<FW 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	特殊型
	内　外	不動産投信	
		その他資産（　　）	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式	年1回	グローバル（除く日本）	ファミリーファンド	あり（フルヘッジ）	日経225
一般	年2回	日本			
大型株	年4回	北米			
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、円ヘッジ・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。

<FW 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	特殊型
	内　外	不動産投信	
		その他資産（　　）	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式	年1回	グローバル（除く日本）	ファミリーファンド	あり（　　）	日経225
一般	年2回	日本			
大型株	年4回	北米			TOPIX
中小型株	年6回（隔月）	欧州			
債券	年12回（毎月）	アジア			
一般	日々	オセアニア			
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。

<FW 外国債券インデックス EM+（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
追加型投信	海　外	債　券
	内　外	不動産投信
		その他資産（　　）
		資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW J−REITインデックス>

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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	ファミリーファンド	日経225
一般	年2回	日本		TOPIX
大型株	年4回	北米		
中小型株	年6回（隔月）	欧州		
債券	年12回（毎月）	アジア		
一般	日々	オセアニア	ファンド・オブ・ファンズ	その他（東証REIT指数（配当込み））
公債	その他（　）	中南米		
社債		アフリカ		
その他債券		中近東（中東）		
クレジット属性（　　）		エマージング		
不動産投信				
その他資産（投資信託証券（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。

<FW 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	インデックス型
追加型投信	海　外	債　券	特殊型
	内　外	不動産投信	
		その他資産（　　）	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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					
社債		欧州			
その他債券	年6回（隔月）				TOPIX
クレジット属性（　　）		アジア			
不動産投信					
その他資産（投資信託証券）（不動産投信）	年12回（毎月）	オセアニア			
		中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし	その他（S&P先進国REIT指数(除く日本)（円ヘッジ・円ベース））
資産複合（　　）	日々	アフリカ			
資産配分固定型		中近東（中東）			
資産配分変更型	その他（　）	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。

<FW 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）	補足分類
単位型投信	国　内	株　式	インデックス型
追加型投信	海　外	債　券	特殊型
	内　外	不動産投信	
		その他資産（　　）	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式	年1回	グローバル（除く日本）	ファミリーファンド	あり（　　）	日経225
一般	年2回	日本			
大型株	年4回	北米			TOPIX
中小型株	年6回（隔月）	欧州			
債券	年12回（毎月）	アジア			
一般	日々	オセアニア			
公債	その他（　）	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし	その他（S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース））
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（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。

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

（注1）商品分類の定義

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

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

（注2）属性区分の定義

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

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

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

＜信託金の限度額＞

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

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

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

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

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

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

●各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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

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

●各ファンドの基本情報

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

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

※特定の指数の内容については、後掲の「特定の指数について」をご参照下さい。

●各ファンドの運用方針

FW TOPIXインデックス

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

◆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ないます。

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

(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(注)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ないます。

FW 日経225インデックス

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

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ないます。

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

(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ないます。

FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)

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

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

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

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

FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)

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

◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル(注)を用います。
MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)への連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ないます。

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

FW 外国株式インデックスEM+（為替ヘッジなし）

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

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

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

※ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドにおいて、運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、株式の組入総額ならびに株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産の組入総額ならびに外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

FW 日本債券インデックス

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

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

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

FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

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

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

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

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

FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

FW 外国債券インデックスEM+(為替ヘッジなし)

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

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

※ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドにおいて、運用の効率化をはかるため、債券先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、債券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産の組入総額ならびに外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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

FW J-REITインデックス

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

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

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

FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

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

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

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

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

FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

●特定の指数について

◆東証株価指数(TOPIX)
TOPIXは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。

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

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

◆FTSE RAFI エマージング インデックス
FTSE社(FTSE International Limited)による基準をクリアーした新興国の上場株式の中から、4つのファンダメンタル指標(株主資本、キャッシュフロー、売上、配当)に着目し、銘柄の選定およびウェイト付けを行なう指数です。

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

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

◆JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス
ーエマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイド(円換算)
JPモルガン社が算出し公表している債券指数で、新興国の政府が現地通貨建てで発行する債券で構成されています。米ドルベースの指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。外国人投資家に対して著しい不利益を与えうる制度等がある国は除外されています。国別構成比率に、1か国当たりの上限を設けており、分散が図られています。

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

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

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

〈分配方針〉

①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
②原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。
※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

●FW TOPIXインデックス
●FW 日経225インデックス
①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
②株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。
③外貨建資産への投資は、行ないません。

●FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり／為替ヘッジなし)
●FW 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)
①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
②株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。
③外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

●FW 日本債券インデックス
①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
②株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使等により取得したものに限ります。
株式および株式を組入可能な投資信託証券(マザーファンドの受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
③外貨建資産への投資は、行ないません。

●FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)
①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
②株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使等により取得したものに限ります。
株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
③投資信託証券(マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
④外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

●FW 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）
①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
②株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使等により取得したものに限ります。
株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
③投資信託証券（マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
④外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

●FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり／なし）
①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
②株式という資産全体の実質投資割合には、制限を設けません。
③外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

●基準価額の動きに関する留意点

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

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

FW TOPIXインデックス **FW 日経225インデックス** **FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)** **FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)**

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

*「FW TOPIXインデックス」および「FW 日経225インデックス」を除きます。

FW 日本債券インデックス **FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)** **FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)**

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

*「FW 日本債券インデックス」を除きます。

FW J-REITインデックス

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

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

FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり) **FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)**

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

●各マザーファンドが連動対象とする指数の著作権等について

①配当込みTOPIXの指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。

②JPXは、同指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、同指数の指数値の算出もしくは公表の停止または同指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができます。

③JPXは、同指数の指数値および同指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の同指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

④JPXは、同指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

⑤本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。

⑥JPXは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。

⑦JPXは、当社または本件商品の購入者のニーズを同指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。

⑧以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

①「日経平均株価」および「日経平均トータルリターン・インデックス」（以下「日経平均株価」といいます。）は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体および「日経平均株価」を算出する手法に対して著作権その他一切の知的財産権を有しています。

②「日経」および「日経平均株価」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、すべて株式会社日本経済新聞社に帰属しています。

③当ファンドは、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用および受益権の取引に関して、一切の責任を負いません。

④株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。

⑤株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」の構成銘柄、計算方法、その他「日経平均株価」の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

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

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

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

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

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

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

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

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

(2)【ファンドの沿革】

2016年9月26日	信託契約締結、当初自己設定、運用開始
2022年3月9日	＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞ 商品分類の変更

(3)【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者

収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金（※3）

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

↑↓※1　　収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※3）

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

↓運用指図　↑↓※2　　損益↑↓信託金（※3）

受託会社	＜FW 日経２２５インデックス＞ 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	信託契約（※2）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算　　など
	＜上記以外の各ファンド＞ 三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行	信託契約（※2）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算　　など

損益↑↓投資

投資対象	ファミリーファンド方式で運用を行ないます。 ＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞ 東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）　など ＜FW 日経２２５インデックス＞ わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均トータルリターン・インデックスに採用された銘柄　など ＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり/為替ヘッジなし）＞ 外国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）　など ＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞ 外国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）、新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。）、新興国の企業のＤＲ（預託証券）、FTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすＥＴＦ（上場投資信託証券）　など ＜FW 日本債券インデックス＞ わが国の公社債　など ＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり/為替ヘッジなし）＞ 外国の公社債　など ＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞ 外国の公社債、新興国通貨建ての債券　など ＜FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞ わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券　など ＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり/為替ヘッジなし）＞ 海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券　など

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

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

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

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

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

＜委託会社の概況（2024年12月末日現在）＞

・資本金の額　414億2,454万1,896円

・沿革

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

・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

①　主要投資対象

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

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

②　投資態度

＜FW ＴＯＰＩＸ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（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

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

ハ．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。

＜FW 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。

＜FW 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（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に投資し、投資成果をＭＳＣＩコクサイ指数（配当込み、円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

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

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

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。

＜FW 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。

＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

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

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

外国株式インデックスマザーファンドの受益証券……信託財産の純資産総額の80%程度

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの受益証券…信託財産の純資産総額の20%程度

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

＜FW 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、通常の状態で高位に維持することを基本とします。

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

＜FW 外国債券インデックス（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。

＜FW 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。

＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

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

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

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

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券……信託財産の純資産総額の20%程度

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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。

＜FW Ｊ－ＲＥＩＴ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、通常の状態で高位に維持することを基本とします。

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

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

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

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

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

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

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。

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

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

(2)【投資対象】

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

①　当ファンドにおいて投資の対象とする資産（「FW ＴＯＰＩＸインデックス」、「FW 日経２２５インデックス」および「FW 日本債券インデックス」は本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)⑧、⑨、⑩および⑪に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

②　委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、「FW 日経２２５インデックス」は、みずほ信託銀行株式会社、「FW 日経２２５インデックス」以外の各ファ

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

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FW 日経２２５インデックス＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

1．株券または新株引受権証書

＜FW 日本債券インデックス＞

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

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

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FW 日経２２５インデックス＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 日本債券インデックス＞

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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。

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

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

＜FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

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

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

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

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

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

2．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券の性質を有するもの

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

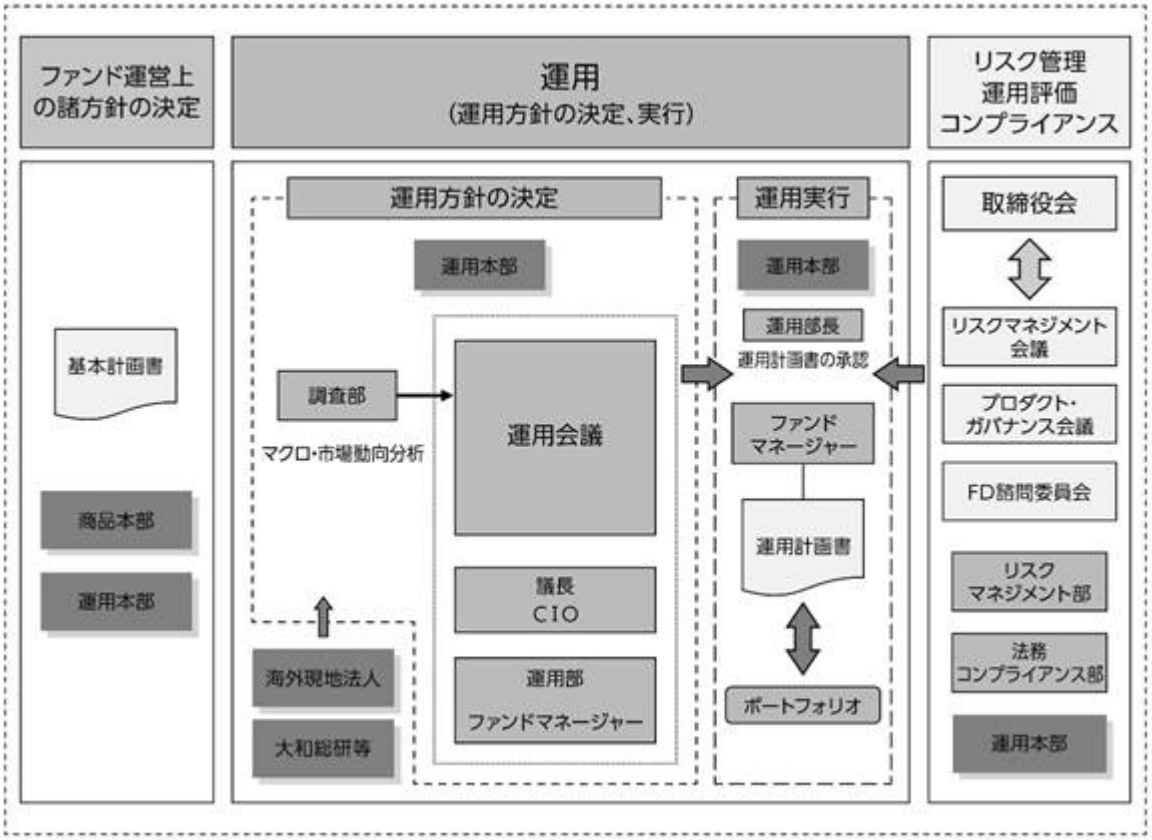
4．手形割引市場において売買される手形

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

(3)【運用体制】

①　運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

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

③ 職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

・基本的な運用方針の決定

・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④　リスクマネジメント会議、プロダクト・ガバナンス会議およびFD諮問委員会

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

イ．リスクマネジメント会議

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

ロ．プロダクト・ガバナンス会議

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

ハ．FD諮問委員会

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

⑤　受託会社に対する管理体制

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

※　上記の運用体制は2024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)【分配方針】

＜各ファンド共通＞

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

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

③　留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

①　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。

②　株式（信託約款）

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FW 日経２２５インデックス＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

＜FW 日本債券インデックス＞

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

イ．株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）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。

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

イ．株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）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。

＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

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

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

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

＜FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

株式への直接投資は、行ないません。

③　新株引受権証券等（信託約款）

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FW 日経２２５インデックス＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

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

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

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

＜上記以外の各ファンド＞
（規定なし）

④　投資信託証券（信託約款）
＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞
＜FW 日経２２５インデックス＞
＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞
＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞
＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞
＜FW 日本債券インデックス＞
＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞
＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞
＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞
＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞
＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

＜FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞
マザーファンドを通じて行なう投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。

⑤　投資する株式等の範囲（信託約款）
＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

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

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

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

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

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

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

＜FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

（規定なし）

⑥　同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

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

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

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

＜上記以外の各ファンド＞

（規定なし）

⑦　信用取引（信託約款）

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FW 日経２２５インデックス＞

＜FW 日本債券インデックス＞

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

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

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権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）

⑧　先物取引等（信託約款）

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FW 日経２２５インデックス＞

＜FW 日本債券インデックス＞

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

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

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

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

＜FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

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

⑨　スワップ取引（信託約款）

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FW 日経２２５インデックス＞

＜FW 日本債券インデックス＞

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

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

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ．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．前ハ．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。

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ．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．前ハ．においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

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

＜FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

（規定なし）

⑩　金利先渡取引（信託約款）

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FW 日経２２５インデックス＞

＜FW 日本債券インデックス＞

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

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

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ．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)③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（以下本ハ．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．前ハ．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）

⑪　金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ．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（以下本ハ．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．前ハ．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）

⑫　直物為替先渡取引（信託約款）

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

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

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

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

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）

⑬　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。

⑭　有価証券の貸付け（信託約款）

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FW 日経２２５インデックス＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 日本債券インデックス＞

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

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

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

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

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

＜FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

（規定なし）

⑮　外貨建資産（信託約款）

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FW 日経２２５インデックス＞

＜FW 日本債券インデックス＞

外貨建資産への投資は、行ないません。

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

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

⑯　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）
＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞
＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞
＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞
＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞
＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞
＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞
＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞
＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞
外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
＜上記以外の各ファンド＞
（規定なし）

⑰　外国為替予約取引（信託約款）
＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞
＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞
＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞
＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞
＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞
＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞
＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞
＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

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

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

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）

⑱　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。

⑲　資金の借入れ（信託約款）

＜各ファンド共通＞

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜参　考＞ マザーファンドの概要

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。
主な投資制限	①　株式 株式への投資には、制限を設けません。 ②　先物取引等 イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。 ロ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。 ③　スワップ取引 イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。 ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。 ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。 ニ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。 ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

ストックインデックス２２５・マザーファンド

運用の基本方針	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。
主要投資対象	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。
投資態度	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。 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。 2．株式の組入比率は、高位を保ちます。 ロ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、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。

主な投資制限	① 株式への投資割合には、制限を設けません。 ② 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、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。 ③ スワップ取引 イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。 ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。 ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。 ニ. スワップ取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。 ホ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

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	① 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。 ② 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。 ③ 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。 ④ 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

主な投資制限	① 株式 株式への投資割合には、制限を設けません。 ② 新株引受権証券等 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③ 投資信託証券 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④ 同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑤ 同一銘柄の転換社債等 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものへの投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑥ 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。 ⑦ 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。 ⑧ スワップ取引 イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。 ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。 ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。 ニ. スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。 ホ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。 ⑨ 金利先渡取引および為替先渡取引 イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。 ロ. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。 ハ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。 ニ. 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信

	託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。 ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。 ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

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（預託証書を含みます。）を主要投資対象とします。
投資態度	イ．主として外国の株式（預託証書を含みます。）に投資し、投資成果をＭＳＣＩコクサイ指数（配当込み、円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 ロ．保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、配当金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。 ハ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。
主な投資制限	①　株式への投資割合には、制限を設けません。 ②　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	投資成果をFTSE RAFI エマージング インデックス（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	イ．新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。） ロ．新興国の企業のＤＲ（預託証券） ハ．FTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすＥＴＦ（上場投資信託証券）
投資態度	イ．主として、新興国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。以下同じ。）（※）に投資し、投資成果をFTSE RAFI エマージング インデックス（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。 ※　効率性の観点からFTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資する場合があります。 ロ．株式およびＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率の合計は、通常の状態で信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。 ハ．運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、株式の組入総額ならびに株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産の組入総額ならびに外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ニ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。 ホ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

主な投資制限	① 株式 株式への投資割合には、制限を設けません。 ② 投資信託証券 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③ 外貨建資産 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ④ 先物取引等 イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。 ロ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。 ハ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。 ⑤ スワップ取引 イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。 ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。 ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。 ニ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。 ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。 ⑥ 金利先渡取引および為替先渡取引 イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。 ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。 ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。 ニ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。 ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。 ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

日本債券インデックスマザーファンド

運用の基本方針	投資成果をダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	イ．主としてわが国の公社債に投資し、投資成果をダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 ロ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。
主な投資制限	①　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。 ②　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。 ③　同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④　外貨建資産への投資は、行ないません。

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

主な投資制限	① 株式 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ② 投資信託証券 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③ 外貨建資産 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ④ 先物取引等 イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。 ロ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。 ハ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。 ⑤ スワップ取引 イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。 ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。 ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。 ニ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。 ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。 ⑥ 金利先渡取引および為替先渡取引

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

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	イ．主として外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 ロ．保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。 ハ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。
主な投資制限	①　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。 ②　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。 ③　同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	**投資成果をJPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイド（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。**
主要投資対象	**新興国通貨建ての債券を主要投資対象とします。**
投資態度	**イ．主として、新興国通貨建ての債券に投資し、投資成果をJPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイド（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。** **ロ．運用の効率化をはかるため、債券先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、債券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産の組入総額ならびに外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。** **ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。** **ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。**

主な投資制限	① 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。 ② 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。 ③ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ④ 先物取引等 イ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。 ロ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。 ハ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。 ⑤ スワップ取引 イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。 ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。 ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。 ニ. スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。 ホ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。 ⑥ 金利先渡取引および為替先渡取引 イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。 ロ. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。 ハ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。 ニ. 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。 ホ. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。 ヘ. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

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	わが国の金融商品取引所（※）上場（上場予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。 ※金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下当マザーファンドについて同じ。
投資態度	イ．「東証REIT指数」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ロ．投資成果を「東証REIT指数」の動きにできるだけ連動させるため、組入銘柄は「東証REIT指数」の構成銘柄（採用予定を含みます。）とし、組入比率を高位に保ちます。 ハ．運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、「東証REIT指数」が改廃されたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。
主な投資制限	①　株式 株式への直接投資は、行ないません。 ②　投資信託証券 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 ③　同一銘柄の投資信託証券 同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、当該同一銘柄の「東証REIT指数」における時価の構成割合が30%を超える場合には、当該指数における構成割合の範囲で組入れることができるものとします。 ④　外貨建資産 外貨建資産への直接投資は、行ないません。 ⑤　先物取引 委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。）および外国の金融商品取引所におけるこの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

運用の基本方針	S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	イ．先進国（日本を除きます。以下同じ。）の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）または店頭登録（登録予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「リート」といいます。） ロ．先進国のリート指数との連動をめざすETF（上場投資信託証券） ハ．先進国のリートを対象としたリート指数先物取引
投資態度	イ．主として、先進国の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、投資成果をベンチマーク（S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース））の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。 ※　効率性の観点から先進国のリート指数との連動をめざすETF（上場投資信託証券）に投資する場合があります。 ロ．運用の効率化を図るため、先進国のリートを対象としたリート指数先物取引を利用することがあります。このため、リートの組入総額とリート指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ハ．保有外貨建資産については、S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして為替ヘッジを行ないます。 ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

主な投資制限	① 株式への投資割合には、制限を設けません。 ② 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ④ 先物取引 わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

運用の基本方針	Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース）に連動した投資成果をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	海外の金融商品取引所（※）上場（上場予定を含みます。以下同じ。）および店頭登録（登録予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。 ※金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下当マザーファンドについて同じ。
投資態度	イ．主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券に投資し、ベンチマーク（Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース）をいいます。以下同じ。）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ロ．組入銘柄はベンチマーク構成銘柄とし、不動産投資信託証券の組入比率を高位に保ちます。 ハ．運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ニ．保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。 ホ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。
主な投資制限	① 株式への直接投資は、行ないません。 ② 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 ③ 同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、「投資態度」で定めた指数における時価の構成割合が30%を超える場合には、当該指数における構成割合の範囲で組入れることができるものとします。 ④ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ⑤ 先物取引 委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。）および外国の金融商品取引所におけるこの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

3【投資リスク】

(1)価額変動リスク

当ファンドは、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、よろしくお願い申上げます。

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FW 日経２２５インデックス＞

①　株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

②　その他

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

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

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

①　株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

（FW ＴＯＰＩＸインデックスおよびFW 日経２２５インデックスの①と同内容）

②　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、為替ヘッジを行ないます。ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。為替ヘッジを行なう際、日本円の金利が組入資産の通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

ロ．カントリー・リスク

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

③　その他

（FW ＴＯＰＩＸインデックスおよびFW 日経２２５インデックスの②と同内容）

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

①　株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

（FW ＴＯＰＩＸインデックスおよびFW 日経２２５インデックスの①と同内容）

②　外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

③　その他

（FW ＴＯＰＩＸインデックスおよびFW 日経２２５インデックスの②と同内容）

＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

①　株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

当ファンドの基準価額は、株価変動の影響を大きく受けます。

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

②　外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

新興国の経済状況は、先進国経済に比較して脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化、また、政治不安や社会不安あるいは他国との外交関係

の悪化などが市場に及ぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制など数々の規制が緊急に導入されたり、あるいは政策の変更等により証券市場が著しい悪影響を被る可能性もあります。

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

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

③　その他

（FW ＴＯＰＩＸインデックスおよびFW 日経２２５インデックスの②と同内容）

＜FW 日本債券インデックス＞

①　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。

②　その他

（FW ＴＯＰＩＸインデックスおよびFW 日経２２５インデックスの②と同内容）

＜FW外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

①　公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

（FW 日本債券インデックスの①と同内容）

②　外国証券への投資に伴うリスク

（FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の②と同内容）

③　その他

（FW ＴＯＰＩＸインデックスおよびFW 日経２２５インデックスの②と同内容）

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

①　公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

（FW 日本債券インデックスの①と同内容）

②　外国証券への投資に伴うリスク

（FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の②と同内容）

③　その他

（FW ＴＯＰＩＸインデックスおよびFW 日経２２５インデックスの②と同内容）

＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

①　公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

（FW日本債券インデックスの①と同内容）

②　外国証券への投資に伴うリスク

（FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）の②と同内容）

③　その他

（FW ＴＯＰＩＸインデックスおよびFW 日経２２５インデックスの②と同内容）

＜FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

①　リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

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

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

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

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

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

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

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

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

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

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

②　その他

（FW ＴＯＰＩＸインデックスおよびFW 日経２２５インデックスの②と同内容）

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

①　リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

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

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

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

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

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

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

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

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

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

ニ．当ファンドの基準価額は、海外のリート市場の変動の影響を大きく受けます。

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

②　外国証券への投資に伴うリスク

（FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の②と同内容）

③　その他

（FW ＴＯＰＩＸインデックスおよびFW 日経２２５インデックスの②と同内容）

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

①　リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

（FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）の①と同内容）

②　外国証券への投資に伴うリスク

（FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の②と同内容）

③　その他

（FW ＴＯＰＩＸインデックスおよびFW 日経２２５インデックスの②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。

① 金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止（「FW ＴＯＰＩＸインデックス」、「FW 日経２２５インデックス」、「FW 日本債券インデックス」および「FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス」を除きます。）その他やむを得ない事情が発生した場合には、お買付けの申込みの受付けを中止すること、すでに受付けたお買付けの申込みを取消すことがあります。

② 金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止（「FW ＴＯＰＩＸインデックス」、「FW 日経２２５インデックス」、「FW 日本債券インデックス」および「FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス」を除きます。）その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等*）があるときは、ご換金の申込みの受付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できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

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

(3)その他の留意点

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

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

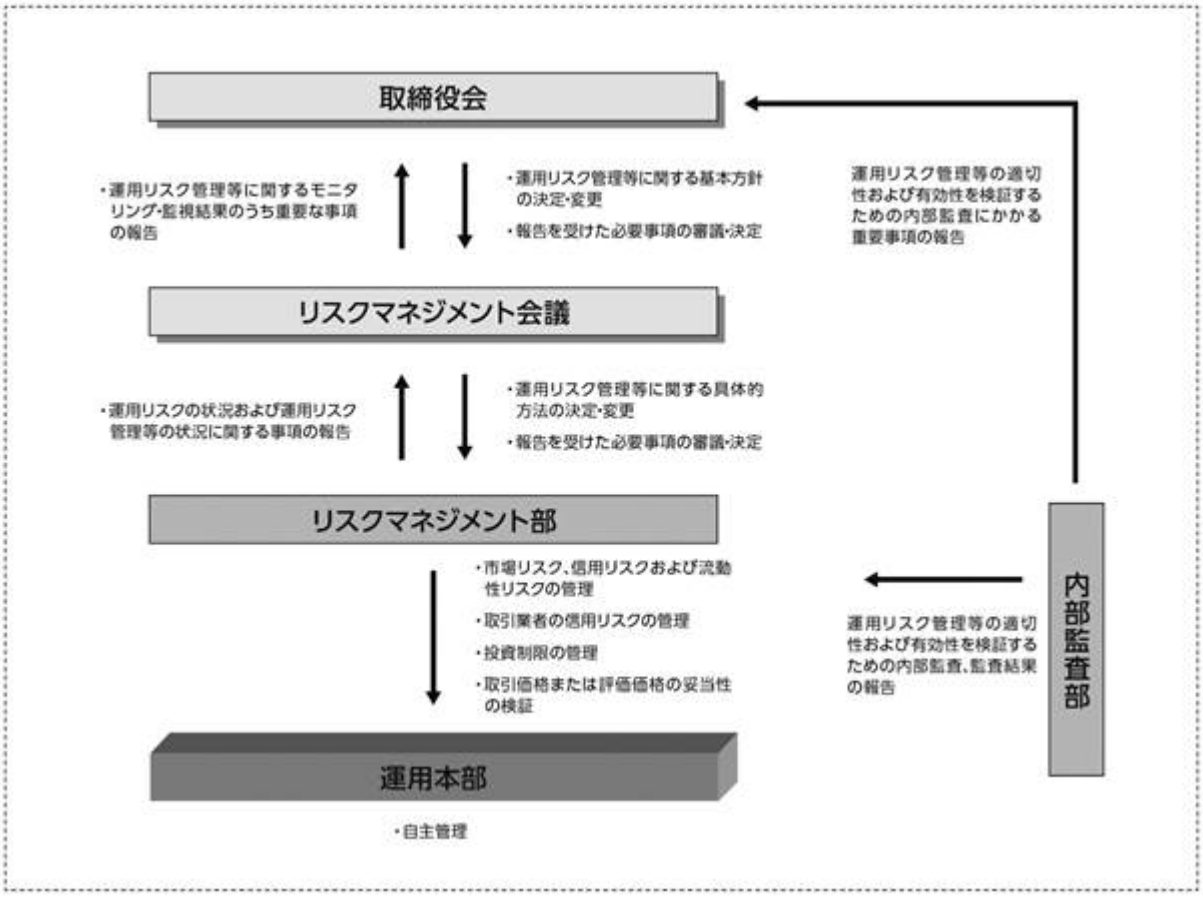
※ 流動性リスクに関する事項

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

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

(4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※　流動性リスクに対する管理体制

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

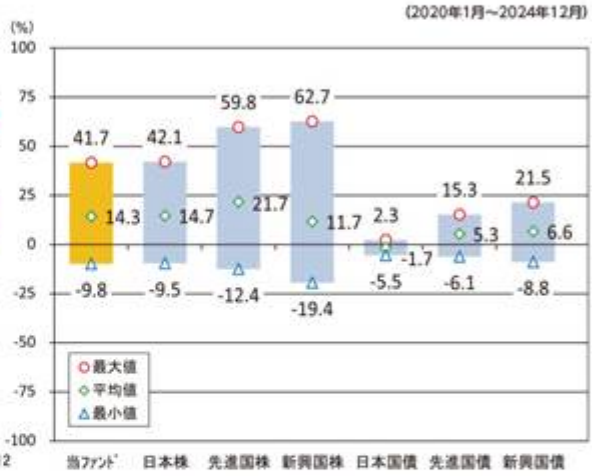
参考情報

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

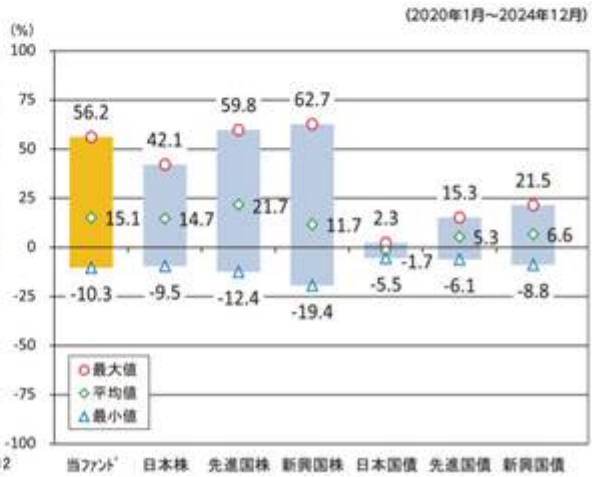
ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

[FW TOPIXインデックス]

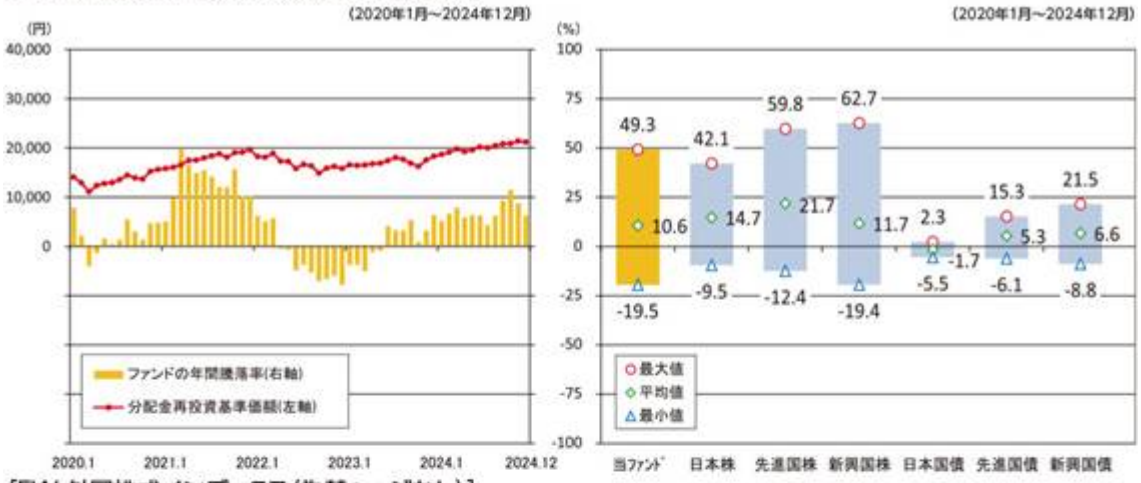
他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



[FW 日経225インデックス]

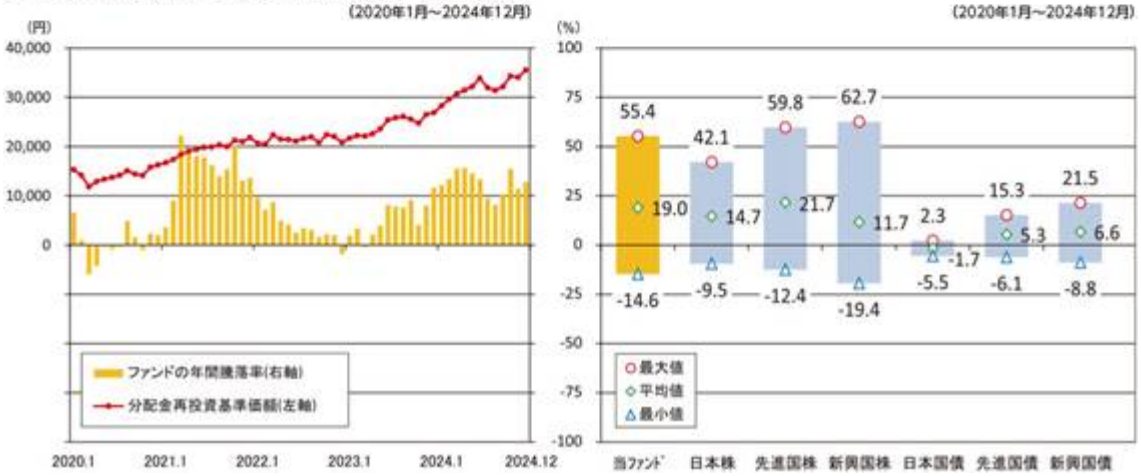


[FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)]

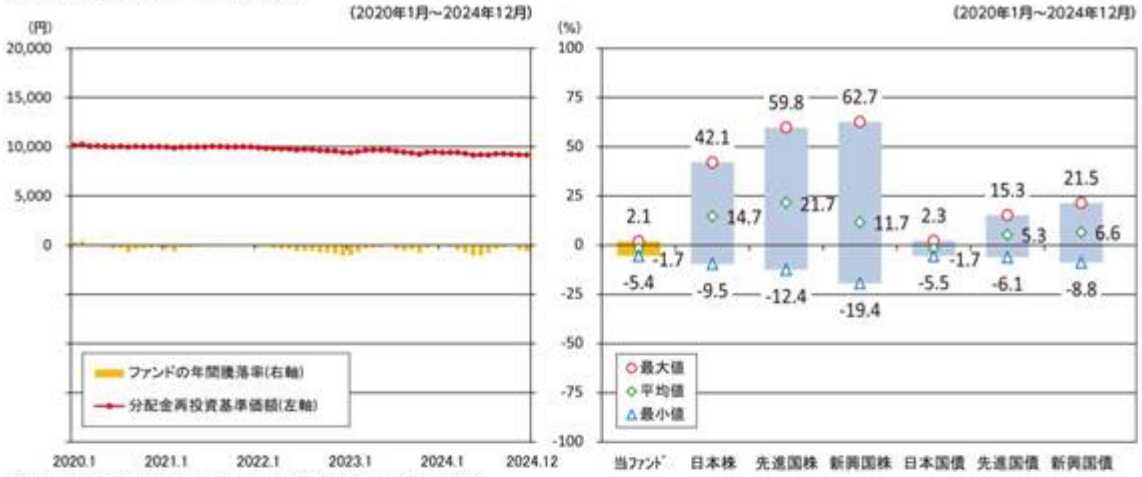


[FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)]

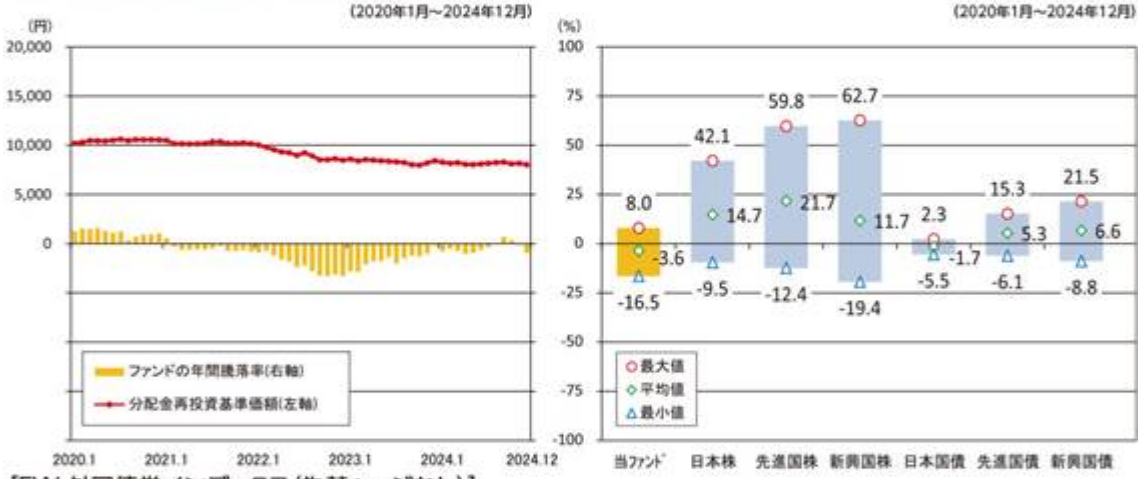
[FW 外国株式インデックスEM+(為替ヘッジなし)]



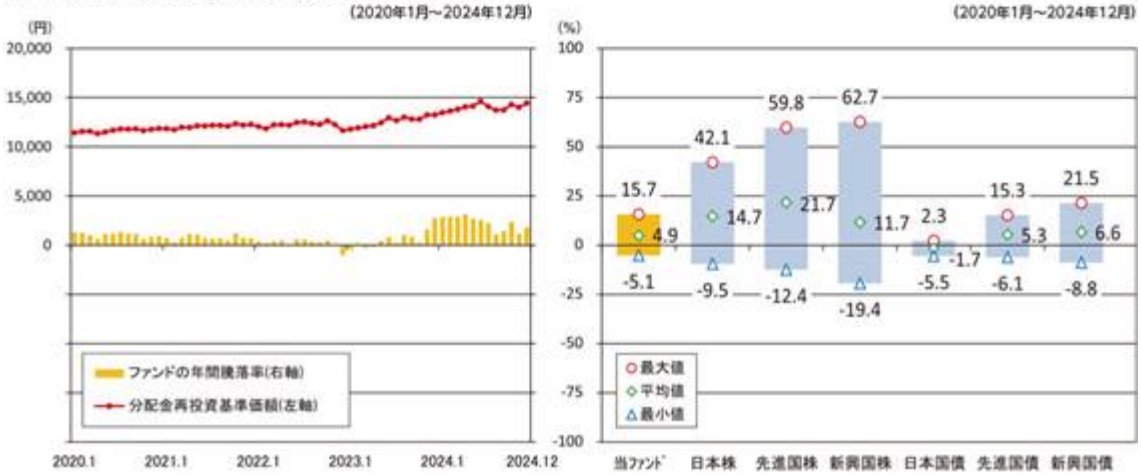
[FW 日本債券インデックス]



[FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)]



[FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)]



[FW 外国債券インデックスEM+(為替ヘッジなし)]

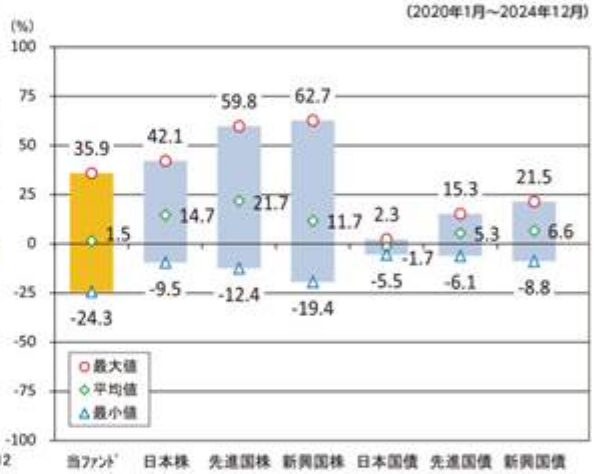
(2020年1月～2024年12月)

(2020年1月～2024年12月)

[FW J-REITインデックス]

(2020年1月～2024年12月)

(2020年1月～2024年12月)

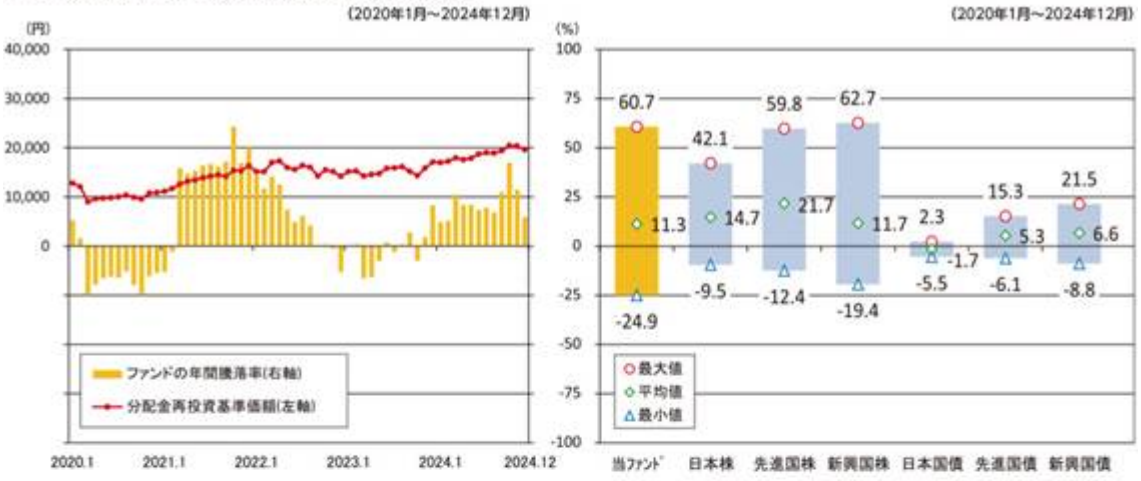


[FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)]

(2020年1月～2024年12月)

(2020年1月～2024年12月)

[FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)]



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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

(2)【換金（解約）手数料】

① 換金手数料

ありません。

② 信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

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

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

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

（新発10年固定利付国債利回りが）

イ．1%未満の場合 …… 年率0.1485%（税抜0.135%）

ロ．1%以上の場合 …… 年率0.3355%（税抜0.305%）

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

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

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FW 日経２２５インデックス＞

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

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 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）

＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

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

＜FW 日本債券インデックス＞

	委託会社	販売会社	受託会社
前①イ.の場合	年率0.075% （税抜）	年率0.05% （税抜）	年率0.01% （税抜）
前①ロ.の場合	年率0.185% （税抜）	年率0.10% （税抜）	年率0.02% （税抜）

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

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）

＜FW 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）

＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

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

＜FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

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

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

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）

＜FW 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。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

① 個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります（「FW ＴＯＰＩＸインデックス」および「FW 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。

②　法人の投資者に対する課税

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

＜注1＞個別元本について

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

＜注2＞収益分配金の課税について

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

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

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

（※）上記は、2024年12月末日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

【ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス】

(1)【投資状況】(2024年12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		32,457,080,207	99.99
	内 日本	32,457,080,207	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		2,244,468	0.01
純資産総額		32,459,324,675	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】(2024年12月30日現在)

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	15,847,409,896	1.9614 31,083,938,265	2.0481 32,457,080,207	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	4,959,328,847	4,959,328,847	1.1964	1.1964
第2計算期間末 (2018年6月15日)	8,562,303,733	8,562,303,733	1.3726	1.3726
第3計算期間末 (2019年6月17日)	8,839,299,537	8,839,299,537	1.2045	1.2045
第4計算期間末 (2020年6月15日)	11,171,069,655	11,171,069,655	1.2246	1.2246
第5計算期間末 (2021年6月15日)	13,378,185,785	13,378,185,785	1.6103	1.6103
第6計算期間末 (2022年6月15日)	14,582,062,122	14,582,062,122	1.5446	1.5446
第7計算期間末 (2023年6月15日)	19,886,764,549	19,886,764,549	1.9542	1.9542
2023年12月末日	21,037,851,559	－	2.0369	－
2024年1月末日	22,915,392,303	－	2.1955	－
2月末日	23,582,525,448	－	2.3027	－
3月末日	24,401,134,685	－	2.4041	－
4月末日	24,509,854,616	－	2.3821	－
5月末日	25,463,122,993	－	2.4085	－
第8計算期間末 (2024年6月17日)	25,395,000,513	25,395,000,513	2.3450	2.3450
6月末日	26,794,001,383	－	2.4428	－
7月末日	27,514,871,627	－	2.4289	－
8月末日	28,108,046,209	－	2.3584	－
9月末日	28,567,459,289	－	2.3210	－
10月末日	29,697,707,389	－	2.3641	－
11月末日	30,542,417,454	－	2.3512	－
12月末日	32,459,324,675	－	2.4452	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
2024年6月18日～ 2024年12月17日	－

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	19.6
第2計算期間	14.7
第3計算期間	△12.2
第4計算期間	1.7
第5計算期間	31.5
第6計算期間	△4.1
第7計算期間	26.5
第8計算期間	20.0
2024年6月18日～ 2024年12月17日	2.0

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
第1計算期間	4,454,641,067	310,563,294
第2計算期間	4,087,459,929	1,994,650,943
第3計算期間	2,901,918,904	1,801,264,876
第4計算期間	4,061,789,160	2,278,428,042
第5計算期間	2,257,267,174	3,071,269,514
第6計算期間	2,926,939,275	1,794,346,768
第7計算期間	2,583,526,613	1,847,644,658
第8計算期間	3,825,653,131	3,172,488,799
2024年6月18日～ 2024年12月17日	3,494,882,184	1,186,313,778

(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（2024年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		409,408,926,410	98.05
	内 日本	409,408,926,410	98.05
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		8,135,524,843	1.95
純資産総額		417,544,451,253	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）		7,885,795,000	1.89
	内 日本	7,885,795,000	1.89

(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（2024年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	ﾄﾖﾀ自動車	日本	株式	輸送用機器	5,475,100	2,614.96 14,317,206,091	3,146.00 17,224,664,600	4.13
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	3,606,800	2,660.14 9,594,618,914	3,369.00 12,151,309,200	2.91
3	三菱UFJﾌｨﾅﾝｼｬﾙG	日本	株式	銀行業	6,507,000	1,472.17 9,579,455,766	1,846.00 12,011,922,000	2.88
4	日 立	日本	株式	電気機器	2,678,700	3,698.65 9,907,589,002	3,937.00 10,546,041,900	2.53
5	ﾘｸﾙｰﾄﾎｰﾙﾃﾞｨﾝｸﾞｽ	日本	株式	サービス業	826,100	9,284.68 7,670,075,400	11,145.00 9,206,884,500	2.21
6	三井住友ﾌｨﾅﾝｼｬﾙG	日本	株式	銀行業	2,116,100	3,021.75 6,394,328,172	3,764.00 7,965,000,400	1.91

7	キーエンス	日本	株式	電気機器	103,000	67,273.86 6,929,208,002	64,630.00 6,656,890,000	1.59
8	任天堂	日本	株式	その他製品	650,200	7,726.52 5,023,788,446	9,264.00 6,023,452,800	1.44
9	伊藤忠	日本	株式	卸売業	732,500	7,670.91 5,618,945,172	7,832.00 5,736,940,000	1.37
10	東京海上HD	日本	株式	保険業	990,400	5,229.36 5,179,159,357	5,728.00 5,673,011,200	1.36
11	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,369,200	2,881.87 3,945,857,046	3,873.00 5,302,911,600	1.27
12	三井物産	日本	株式	卸売業	1,601,100	2,952.90 4,727,902,127	3,311.00 5,301,242,100	1.27
13	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	218,000	23,096.03 5,034,934,623	24,185.00 5,272,330,000	1.26
14	三菱商事	日本	株式	卸売業	2,014,000	2,874.32 5,788,881,262	2,604.00 5,244,456,000	1.26
15	信越化学	日本	株式	化学	925,100	5,754.48 5,323,474,405	5,296.00 4,899,329,600	1.17
16	日本電信電話	日本	株式	情報･通信業	30,726,100	150.32 4,618,884,547	158.00 4,854,723,800	1.16
17	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報･通信業	509,600	8,455.19 4,308,768,959	9,185.00 4,680,676,000	1.12
18	第一三共	日本	株式	医薬品	974,900	4,939.02 4,815,051,829	4,352.00 4,242,764,800	1.02
19	三菱重工業	日本	株式	機械	1,819,100	1,887.13 3,432,895,554	2,223.00 4,043,859,300	0.97
20	HOYA	日本	株式	精密機器	201,200	19,309.43 3,885,058,431	19,815.00 3,986,778,000	0.95
21	武田薬品	日本	株式	医薬品	919,100	4,259.69 3,915,088,494	4,181.00 3,842,757,100	0.92
22	KDDI	日本	株式	情報･通信業	759,800	4,819.52 3,661,874,722	5,042.00 3,830,911,600	0.92
23	本田技研	日本	株式	輸送用機器	2,440,300	1,537.30 3,751,478,321	1,535.00 3,745,860,500	0.90
24	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	61,300	46,295.58 2,837,919,286	53,820.00 3,299,166,000	0.79
25	ソフトバンク	日本	株式	情報･通信業	16,532,600	197.23 3,260,784,168	198.90 3,288,334,140	0.79
26	セブン&アイ･HLDGS	日本	株式	小売業	1,203,800	2,180.17 2,624,496,192	2,487.00 2,993,850,600	0.72

27	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	324,600	6,563.78 2,130,603,490	9,198.00 2,985,670,800	0.72
28	三菱電機	日本	株式	電気機器	1,058,100	2,266.72 2,398,426,554	2,687.00 2,843,114,700	0.68
29	富 士 通	日本	株式	電気機器	957,200	2,914.77 2,790,024,240	2,799.50 2,679,681,400	0.64
30	キヤノン	日本	株式	電気機器	513,700	4,759.83 2,445,127,571	5,161.00 2,651,205,700	0.63

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.05%
合計	98.05%

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

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	0.24%
建設業	2.11%
食料品	2.99%
繊維製品	0.40%
パルプ・紙	0.13%
化学	5.05%
医薬品	4.26%
石油・石炭製品	0.54%
ゴム製品	0.56%
ガラス・土石製品	0.65%
鉄鋼	0.80%
非鉄金属	0.82%
金属製品	0.48%
機械	5.45%
電気機器	17.28%
輸送用機器	7.74%
精密機器	2.35%
その他製品	2.61%
電気・ガス業	1.23%
陸運業	2.20%

海運業	0.68%
空運業	0.33%
倉庫・運輸関連業	0.14%
情報・通信業	7.33%
卸売業	6.68%
小売業	4.51%
銀行業	8.39%
証券、商品先物取引業	0.87%
保険業	3.22%
その他金融業	1.18%
不動産業	1.73%
サービス業	5.04%
合計	98.05%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	日本	TOPIX　　先物 0703月	買建	283	7,766,705,650	7,885,795,000	1.89%

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

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

（参考情報）運用実績

●FW TOPIXインデックス

2024年12月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	24,452円
純資産総額	324億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	4.0%
3カ月間	5.4%
6カ月間	0.1%
1年間	20.0%
3年間	49.1%
5年間	79.5%
設定来	144.5%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：0円　　設定来分配金合計額：0円

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

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

主要な資産の状況　　※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
国内株式	2,090	98.0%
国内株式先物	1	1.9%
不動産投資信託等	－	－
コール・ローン、その他		2.0%
合計	2,091	－

株式　市場・上場別構成	比率
東証プライム市場	97.7%
東証スタンダード市場	0.4%
東証グロース市場	0.0%
地方市場・その他	－
合計	98.0%

株式東証33業種別構成	比率
電気機器	17.3%
銀行業	8.4%
輸送用機器	7.7%
情報・通信業	7.3%
卸売業	6.7%
機械	5.4%
化学	5.0%
サービス業	5.0%
小売業	4.5%
その他	30.6%
合計	98.0%

組入上位10銘柄	業種名	比率
トヨタ自動車	輸送用機器	4.1%
ソニーグループ	電気機器	2.9%
三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	2.9%
日 立	電気機器	2.5%
リクルートホールディングス	サービス業	2.2%
三井住友フィナンシャルG	銀行業	1.9%
TOPIX　先物 0703月	－	1.9%
キーエンス	電気機器	1.6%
任 天 堂	その他製品	1.4%
伊 藤 忠	卸売業	1.4%
合計		22.8%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数（TOPIX）（配当込み）です。

・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2016年※は設定日（9月26日）から年末、2024年は12月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 日経２２５インデックス】

(1) 【投資状況】 (2024年12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		25,439,116,063	99.98
	内 日本	25,439,116,063	99.98
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,404,402	0.02
純資産総額		25,443,520,465	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】（2024年12月30日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	ストックインデックス225・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	4,584,367,927	5.2627 24,126,369,015	5.5491 25,439,116,063	99.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	3,303,197,938	3,303,197,938	1.2007	1.2007
第2計算期間末 (2018年6月15日)	6,623,555,793	6,623,555,793	1.4057	1.4057
第3計算期間末 (2019年6月17日)	8,152,341,843	8,152,341,843	1.3227	1.3227
第4計算期間末 (2020年6月15日)	11,210,563,802	11,210,563,802	1.3749	1.3749
第5計算期間末 (2021年6月15日)	14,516,397,552	14,516,397,552	1.9054	1.9054
第6計算期間末 (2022年6月15日)	14,452,677,600	14,452,677,600	1.7300	1.7300
第7計算期間末 (2023年6月15日)	19,299,142,442	19,299,142,442	2.2421	2.2421
2023年12月末日	20,645,812,391	－	2.2594	－
2024年1月末日	22,569,536,100	－	2.4498	－
2月末日	23,808,330,545	－	2.6456	－
3月末日	24,265,028,560	－	2.7442	－
4月末日	23,524,586,189	－	2.6100	－
5月末日	24,093,281,075	－	2.6153	－
第8計算期間末 (2024年6月17日)	24,047,464,398	24,047,464,398	2.5884	2.5884
6月末日	25,083,926,278	－	2.6911	－
7月末日	24,568,388,125	－	2.6579	－
8月末日	24,246,781,477	－	2.6278	－
9月末日	23,997,666,229	－	2.5938	－
10月末日	24,707,734,679	－	2.6721	－
11月末日	24,226,615,290	－	2.6120	－
12月末日	25,443,520,465	－	2.7294	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000

第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
2024年6月18日～ 2024年12月17日	―

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	20.1
第2計算期間	17.1
第3計算期間	△5.9
第4計算期間	3.9
第5計算期間	38.6
第6計算期間	△9.2
第7計算期間	29.6
第8計算期間	15.4
2024年6月18日～ 2024年12月17日	4.0

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
第1計算期間	2,867,193,216	117,139,415
第2計算期間	2,980,382,583	1,019,368,476
第3計算期間	2,731,635,338	1,280,509,751
第4計算期間	3,775,885,438	1,785,574,418
第5計算期間	2,128,271,246	2,663,324,439
第6計算期間	2,488,303,056	1,752,829,196
第7計算期間	1,947,250,912	1,693,734,159
第8計算期間	3,716,226,558	3,033,069,088
2024年6月18日～ 2024年12月17日	965,277,055	955,972,637

(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（2024年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		357,919,892,150	98.09
	内 日本	357,919,892,150	98.09
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		6,972,483,258	1.91
純資産総額		364,892,375,408	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）		7,102,200,000	1.95
	内 日本	7,102,200,000	1.95

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

(注2) 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（2024年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	796,500	45,925.22 36,579,438,000	53,820.00 42,867,630,000	11.75
2	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	2,360,000	6,224.52 14,689,872,000	9,198.00 21,707,280,000	5.95
3	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	885,000	23,066.77 20,414,100,000	24,185.00 21,403,725,000	5.87
4	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	1,770,000	8,407.74 14,881,710,000	9,185.00 16,257,450,000	4.46
5	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	885,000	9,200.75 8,142,672,000	11,145.00 9,863,325,000	2.70
6	ＴＤＫ	日本	株式	電気機器	4,425,000	1,781.05 7,881,156,000	2,072.50 9,170,812,500	2.51
7	KDDI	日本	株式	情報・通信業	1,770,000	4,809.27 8,512,422,000	5,042.00 8,924,340,000	2.45
8	信越化学	日本	株式	化学	1,475,000	5,755.24 8,488,990,000	5,296.00 7,811,600,000	2.14

9	テ ル モ	日本	株式	精密機器	2,360,000	2,687.03 6,341,412,000	3,062.00 7,226,320,000	1.98
10	中外製薬	日本	株式	医薬品	885,000	6,808.28 6,025,332,000	6,999.00 6,194,115,000	1.70
11	ファナック	日本	株式	電気機器	1,475,000	3,830.79 5,650,425,000	4,175.00 6,158,125,000	1.69
12	ダイキン工業	日本	株式	機械	295,000	17,914.44 5,284,760,000	18,660.00 5,504,700,000	1.51
13	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	1,475,000	2,636.64 3,889,055,000	3,369.00 4,969,275,000	1.36
14	ﾄﾖﾀ自動車	日本	株式	輸送用機器	1,475,000	2,610.08 3,849,872,500	3,146.00 4,640,350,000	1.27
15	NTTデータグループ	日本	株式	情報･通信業	1,475,000	2,482.14 3,661,165,000	3,030.00 4,469,250,000	1.22
16	コナミグループ	日本	株式	情報･通信業	295,000	14,225.40 4,196,495,000	14,800.00 4,366,000,000	1.20
17	日東電工	日本	株式	化学	1,475,000	2,411.84 3,557,475,000	2,680.00 3,953,000,000	1.08
18	第一三共	日本	株式	医薬品	885,000	4,944.89 4,376,232,000	4,352.00 3,851,520,000	1.06
19	京 セ ラ	日本	株式	電気機器	2,360,000	1,716.24 4,050,348,000	1,575.50 3,718,180,000	1.02
20	バンダイナムコHLDGS	日本	株式	その他製品	885,000	3,305.68 2,925,528,000	3,779.00 3,344,415,000	0.92
21	セコム	日本	株式	サービス業	590,000	5,494.13 3,241,539,000	5,369.00 3,167,710,000	0.87
22	富士フイルムHLDGS	日本	株式	化学	885,000	3,764.41 3,331,506,000	3,309.00 2,928,465,000	0.80
23	ＨＯＹＡ	日本	株式	精密機器	147,500	19,211.06 2,833,632,500	19,815.00 2,922,712,500	0.80
24	オリンパス	日本	株式	精密機器	1,180,000	2,635.17 3,109,508,000	2,370.50 2,797,190,000	0.77
25	ニトリホールディングス	日本	株式	小売業	147,500	22,062.91 3,254,280,000	18,635.00 2,748,662,500	0.75
26	任 天 堂	日本	株式	その他製品	295,000	7,673.02 2,263,541,000	9,264.00 2,732,880,000	0.75
27	本田技研	日本	株式	輸送用機器	1,770,000	1,543.66 2,732,283,000	1,535.00 2,716,950,000	0.74
28	デンソー	日本	株式	輸送用機器	1,180,000	2,083.25 2,458,238,000	2,214.50 2,613,110,000	0.72

29	キッコーマン	日本	株式	食料品	1,475,000	1,635.57 2,412,470,000	1,762.50 2,599,687,500	0.71
30	大塚ホールディングス	日本	株式	医薬品	295,000	7,929.81 2,339,294,000	8,600.00 2,537,000,000	0.70

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.09%
合計	98.09%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.07%
鉱業	0.06%
建設業	1.59%
食料品	2.89%
繊維製品	0.10%
パルプ・紙	0.05%
化学	5.77%
医薬品	5.53%
石油・石炭製品	0.23%
ゴム製品	0.57%
ガラス・土石製品	0.58%
鉄鋼	0.05%
非鉄金属	1.09%
金属製品	0.01%
機械	4.51%
電気機器	25.17%
輸送用機器	4.13%
精密機器	3.76%
その他製品	2.29%
電気・ガス業	0.16%
陸運業	0.84%
海運業	0.43%
空運業	0.22%
倉庫・運輸関連業	0.23%
情報・通信業	11.27%

卸売業	2.98%
小売業	14.70%
銀行業	0.70%
証券、商品先物取引業	0.16%
保険業	1.23%
その他金融業	0.86%
不動産業	1.07%
サービス業	4.76%
合計	98.09%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	日本	NK225　先物 0703月	買建	178	6,975,427,900	7,102,200,000	1.95%

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

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

（参考情報）運用実績

●FW 日経225インデックス

2024年12月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	27,294円
純資産総額	254億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	4.5%
3カ月間	5.2%
6カ月間	1.4%
1年間	20.8%
3年間	45.5%
5年間	82.5%
設定来	172.9%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：0円　　設定来分配金合計額：0円

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

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

主要な資産の状況　　※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
国内株式	225	98.1%
国内株式先物	1	1.9%
不動産投資信託等	－	－
コール・ローン、その他		1.9%
合計	226	－

株式　市場・上場別構成	比率
東証プライム市場	98.1%
東証スタンダード市場	－
東証グロース市場	－
地方市場・その他	－
合計	98.1%

株式東証33業種別構成	比率
電気機器	25.2%
小売業	14.7%
情報・通信業	11.3%
化学	5.8%
医薬品	5.5%
サービス業	4.8%
機械	4.5%
輸送用機器	4.1%
精密機器	3.8%
その他	18.5%
合計	98.1%

組入上位10銘柄	業種名	比率
ファーストリテイリング	小売業	11.7%
アドバンテスト	電気機器	5.9%
東京エレクトロン	電気機器	5.9%
ソフトバンクグループ	情報・通信業	4.5%
リクルートホールディングス	サービス業	2.7%
ＴＤＫ	電気機器	2.5%
KDDI	情報・通信業	2.4%
信越化学	化学	2.1%
テルモ	精密機器	2.0%
NK225　先物 0703月	－	1.9%
合計		41.7%

※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日経平均トータルリターン・インデックスです。

・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2016年※は設定日（9月26日）から年末、2024年は12月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）】

(1) 【投資状況】（2024年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		93,522,060,591	99.98
	内 日本	93,522,060,591	99.98
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		14,161,763	0.02
純資産総額		93,536,222,354	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】（2024年12月30日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	28,060,266,012	3.1508 88,413,081,843	3.3329 93,522,060,591	99.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	16,740,001,185	16,740,001,185	1.1194	1.1194
第2計算期間末 (2018年6月15日)	31,820,531,530	31,820,531,530	1.2400	1.2400
第3計算期間末 (2019年6月17日)	36,065,457,483	36,065,457,483	1.2648	1.2648
第4計算期間末 (2020年6月15日)	42,369,088,321	42,369,088,321	1.2825	1.2825
第5計算期間末 (2021年6月15日)	56,165,645,906	56,165,645,906	1.7819	1.7819
第6計算期間末 (2022年6月15日)	53,716,109,956	53,716,109,956	1.5540	1.5540
第7計算期間末 (2023年6月15日)	68,296,881,791	68,296,881,791	1.7433	1.7433
2023年12月末日	75,251,689,775	―	1.8323	―
2024年1月末日	78,070,702,683	―	1.8697	―
2月末日	80,241,015,865	―	1.9141	―
3月末日	83,239,661,784	―	1.9787	―
4月末日	79,738,973,712	―	1.9267	―
5月末日	81,940,959,625	―	1.9586	―
第8計算期間末 (2024年6月17日)	84,165,891,249	84,165,891,249	2.0021	2.0021
6月末日	86,012,709,380	―	2.0186	―
7月末日	86,749,992,273	―	2.0013	―
8月末日	90,005,360,217	―	2.0433	―
9月末日	92,709,002,229	―	2.0827	―
10月末日	92,900,303,514	―	2.0893	―
11月末日	95,908,985,091	―	2.1401	―
12月末日	93,536,222,354	―	2.1195	―

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000

第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
2024年6月18日～ 2024年12月17日	―

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	11.9
第2計算期間	10.8
第3計算期間	2.0
第4計算期間	1.4
第5計算期間	38.9
第6計算期間	△12.8
第7計算期間	12.2
第8計算期間	14.8
2024年6月18日～ 2024年12月17日	8.0

(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	15,911,823,542	958,970,794
第2計算期間	15,243,885,793	4,536,508,120
第3計算期間	9,938,067,643	7,085,414,359
第4計算期間	12,720,408,945	8,198,873,384
第5計算期間	7,978,557,364	9,493,197,837
第6計算期間	10,317,685,523	7,272,108,784
第7計算期間	12,181,359,226	7,570,904,254
第8計算期間	13,600,258,382	10,737,911,528
2024年6月18日～ 2024年12月17日	6,809,606,401	5,069,036,053

(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（2024年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		136,985,039,776	95.62
	内 香港	664,862,368	0.46
	内 シンガポール	556,548,737	0.39
	内 イスラエル	337,208,239	0.24
	内 ノルウェー	213,098,151	0.15
	内 スウェーデン	1,260,290,484	0.88
	内 デンマーク	1,038,130,917	0.72
	内 イギリス	5,031,691,853	3.51
	内 アイルランド	92,063,061	0.06
	内 オランダ	1,534,802,655	1.07
	内 ベルギー	325,717,895	0.23
	内 フランス	3,601,784,291	2.51
	内 ドイツ	3,073,804,972	2.15
	内 スイス	3,238,367,673	2.26
	内 ポルトガル	55,574,067	0.04
	内 スペイン	899,331,586	0.63
	内 イタリア	929,135,842	0.65
	内 フィンランド	323,808,184	0.23
	内 オーストリア	62,529,940	0.04
	内 カナダ	4,071,246,052	2.84
	内 アメリカ	107,296,522,806	74.90
	内 オーストラリア	2,302,551,379	1.61
	内 ニュージーランド	75,968,624	0.05
投資証券		2,590,911,714	1.81
	内 香港	34,131,201	0.02
	内 シンガポール	36,087,159	0.03
	内 イギリス	36,144,843	0.03
	内 ベルギー	7,614,686	0.01
	内 フランス	46,166,624	0.03
	内 カナダ	3,863,119	0.00
	内 アメリカ	2,201,870,415	1.54
	内 オーストラリア	225,033,667	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,678,794,833	2.57
純資産総額		143,254,746,323	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)		11,161,367,614	7.79
	内 イギリス	357,061,782	0.25
	内 ドイツ	1,414,301,718	0.99
	内 カナダ	654,185,292	0.46
	内 アメリカ	8,532,490,197	5.96
	内 オーストラリア	203,328,625	0.14
為替予約取引(売建)		143,446,637,056	△100.13
	内 日本	143,446,637,056	△100.13

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

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

(注3) 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（2024年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	200,563	30,399.34 6,097,009,235	40,429.22 8,108,606,894	5.66
2	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	323,710	10,089.35 3,266,070,905	21,672.24 7,015,521,393	4.90
3	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	93,166	60,405.30 5,627,729,581	68,101.23 6,344,719,697	4.43
4	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	124,585	24,609.48 3,065,973,327	35,392.77 4,409,408,873	3.08
5	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	28,767	60,506.38 1,740,588,188	94,877.94 2,729,353,867	1.91
6	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	37,946	36,447.83 1,383,053,733	68,279.97 2,590,952,076	1.81

7	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	77,268	22,757.19 1,758,409,473	30,490.77 2,355,961,342	1.64
8	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	58,580	18,222.81 1,067,494,420	38,240.01 2,240,100,079	1.56
9	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	66,340	23,014.71 1,526,801,750	30,693.24 2,036,190,019	1.42
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	37,569	28,029.65 1,053,049,711	38,148.27 1,433,192,378	1.00
11	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	10,665	104,838.38 1,118,102,439	123,881.83 1,321,199,723	0.92
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	17,459	60,149.52 1,050,153,334	72,210.75 1,260,727,516	0.88
13	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	21,960	42,266.32 928,171,790	50,405.63 1,106,907,828	0.77
14	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	58,629	16,124.86 945,392,913	16,843.00 987,488,622	0.69
15	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	12,169	85,989.65 1,046,409,014	80,670.21 981,675,885	0.69
16	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	10,898	68,086.68 742,009,588	84,183.39 917,430,650	0.64
17	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	5,820	110,307.93 641,992,803	148,641.74 865,094,962	0.60
18	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需品	58,267	8,927.36 520,175,436	14,498.77 844,800,344	0.59
19	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	31,048	24,188.09 750,996,912	26,816.25 832,591,098	0.58
20	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	5,653	80,779.36 456,646,281	143,556.25 811,523,532	0.57
21	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	13,054	55,350.66 722,549,302	62,142.59 811,209,433	0.57
22	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	31,794	25,564.41 812,796,214	22,944.00 729,481,822	0.51

23	SALESFORCE.COM INC	アメリカ	株式	情報技術	12,574	41,122.37 517,074,517	53,536.02 673,161,928	0.47
24	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	23,259	26,341.71 612,682,150	28,157.62 654,918,125	0.46
25	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	92,149	5,447.56 501,992,311	7,013.70 646,305,552	0.45
26	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	株式	ヘルスケア	43,969	16,695.72 734,094,874	14,059.74 618,193,104	0.43
27	ORACLE CORP	アメリカ	株式	情報技術	21,920	17,445.19 382,401,370	26,726.09 585,835,954	0.41
28	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	5,127	110,122.52 564,598,572	112,953.70 579,113,661	0.40
29	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	54,033	9,719.05 525,156,730	9,878.34 533,756,399	0.37
30	SAP SE	ドイツ	株式	情報技術	13,397	24,266.32 325,098,238	39,498.34 529,159,261	0.37

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	95.62%
投資証券	1.81%
合計	97.43%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	3.68%
素材	3.08%
資本財・サービス	9.59%
一般消費財・サービス	10.53%
生活必需品	5.93%
ヘルスケア	10.23%
金融	15.48%
情報技術	26.38%
コミュニケーション・サービス	7.98%
公益事業	2.47%
不動産	0.28%
合計	95.62%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 EMINI MAR 25	買建	179	8,659,058,857	8,532,490,197	5.96%
	イギリス	FTSE 100 INDEX MAR 25	買建	22	359,830,250	357,061,782	0.25%
	オーストラリア	SPI 200 MAR 25	買建	10	204,603,708	203,328,625	0.14%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX MAR 25	買建	20	663,561,187	654,185,292	0.46%
	ドイツ	SWISS MKT IX MAR 25	買建	13	265,034,204	263,743,935	0.18%
		EURO STOXX 50 MAR 25	買建	142	1,164,508,696	1,150,557,783	0.80%
為替予約取引	日本	香港ドル売/円買 2025年1月	売建	34,284,800	658,532,152	697,630,538	△0.49%
		イスラエル・シュケル売/円買 2025年1月	売建	3,847,100	158,231,223	164,933,640	△0.12%
		ノルウェー・クローネ売/円買 2025年1月	売建	16,373,200	220,856,457	227,952,602	△0.16%
		豪ドル売/円買 2025年1月	売建	27,289,600	2,649,843,812	2,684,248,718	△1.87%
		カナダ・ドル売/円買 2025年1月	売建	39,853,100	4,250,809,973	4,370,430,431	△3.05%
		スウェーデン・クローネ売/円買 2025年1月	売建	80,479,700	1,102,547,746	1,157,249,798	△0.81%
		ユーロ売/円買 2025年1月	売建	66,245,500	10,447,147,209	10,915,098,796	△7.62%
		米ドル売/円買 2025年1月	売建	714,669,700	106,797,819,672	112,889,225,812	△78.80%
		シンガポール・ドル売/円買 2025年1月	売建	4,353,000	485,381,735	506,673,964	△0.35%
		ニュージーランド・ドル売/円買 2025年1月	売建	838,400	73,933,465	74,664,969	△0.05%

		英ポンド売/円買 2025年1月	売建	26,373,500	5,002,948,726	5,240,992,028	△3.66%
		デンマーク・クローネ売/円買 2025年1月	売建	53,001,800	1,120,675,359	1,170,931,666	△0.82%
		スイス・フラン売/円買 2025年1月	売建	19,087,600	3,244,567,510	3,346,604,094	△2.34%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)

2024年12月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	21,195円
純資産総額	935億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	−1.0%
3カ月間	1.8%
6カ月間	5.0%
1年間	15.7%
3年間	7.9%
5年間	52.0%
設定来	112.0%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額:　0円　　設定来分配金合計額:　0円

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

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

主要な資産の状況　　※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国株式・先物	1,156	103.4%
外国リート	51	1.8%
外国投資証券	3	0.1%
外国ワラント	1	0.0%
コール・ローン、その他		2.6%
合計	1,211	−

国・地域別構成	比率
アメリカ	82.4%
イギリス	3.8%
その他	19.0%
合計	105.2%

通貨別構成	比率
日本円	99.6%
米ドル	0.3%
ユーロ	0.3%
シンガポール・ドル	0.0%
香港ドル	0.0%
イスラエル・シュケル	0.0%
スウェーデン・クローネ	0.0%
ニュージーランド・ドル	0.0%
スイス・フラン	−0.0%
その他	−0.2%
合計	100.0%

株式業種別構成	比率
情報技術	26.4%
金融	15.5%
一般消費財・サービス	10.5%
ヘルスケア	10.2%
資本財・サービス	9.6%
コミュニケーション・サービス	8.0%
生活必需品	5.9%
エネルギー	3.7%
素材	3.1%
公益事業、他	2.7%
合計	95.6%

組入上位10銘柄	国・地域名	比率
S&P500 EMINI MAR 25	アメリカ	6.0%
APPLE INC	アメリカ	5.7%
NVIDIA CORP	アメリカ	4.9%
MICROSOFT CORP	アメリカ	4.4%
AMAZON.COM INC	アメリカ	3.1%
META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	1.9%
TESLA INC	アメリカ	1.8%
ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.6%
BROADCOM INC	アメリカ	1.6%
ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.4%
合計		32.4%

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

年間収益率の推移

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

・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2016年※は設定日(9月26日)から年末、2024年は12月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）】

(1) 【投資状況】 (2024年12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		44,274,566,881	99.99
	内 日本	44,274,566,881	99.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,454,454	0.01
純資産総額		44,279,021,335	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】（2024年12月30日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	6,116,961,437	6.6607 40,743,403,301	7.2380 44,274,566,881	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	1,719,851,096	1,719,851,096	1.2232	1.2232
第2計算期間末 (2018年6月15日)	3,307,440,968	3,307,440,968	1.3931	1.3931
第3計算期間末 (2019年6月17日)	4,523,386,578	4,523,386,578	1.4011	1.4011
第4計算期間末 (2020年6月15日)	5,717,881,883	5,717,881,883	1.4231	1.4231
第5計算期間末 (2021年6月15日)	9,292,062,179	9,292,062,179	2.0848	2.0848
第6計算期間末 (2022年6月15日)	10,844,781,442	10,844,781,442	2.1770	2.1770
第7計算期間末 (2023年6月15日)	17,911,076,601	17,911,076,601	2.6685	2.6685
2023年12月末日	25,362,790,278	―	2.9439	―
2024年1月末日	27,611,002,037	―	3.1227	―
2月末日	29,241,024,779	―	3.2725	―
3月末日	31,172,432,749	―	3.4074	―
4月末日	31,845,861,171	―	3.4515	―
5月末日	33,419,829,617	―	3.5319	―
第8計算期間末 (2024年6月17日)	34,939,206,897	34,939,206,897	3.6322	3.6322
6月末日	36,514,886,906	―	3.7458	―
7月末日	35,125,759,509	―	3.5361	―
8月末日	35,768,523,187	―	3.4736	―
9月末日	36,927,668,845	―	3.5128	―
10月末日	40,494,906,616	―	3.7779	―
11月末日	41,981,541,377	―	3.7992	―
12月末日	44,279,021,335	―	3.9491	―

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000

第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
2024年6月18日～ 2024年12月17日	―

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	22.3
第2計算期間	13.9
第3計算期間	0.6
第4計算期間	1.6
第5計算期間	46.5
第6計算期間	4.4
第7計算期間	22.6
第8計算期間	36.1
2024年6月18日～ 2024年12月17日	8.2

(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	1,475,674,063	70,680,538
第2計算期間	1,380,206,909	412,026,062
第3計算期間	1,523,438,524	669,208,679
第4計算期間	1,946,108,703	1,156,513,875
第5計算期間	1,622,654,198	1,183,681,857
第6計算期間	1,798,628,403	1,274,027,097
第7計算期間	2,849,753,966	1,119,335,471
第8計算期間	5,219,463,826	2,312,115,128
2024年6月18日～ 2024年12月17日	2,772,061,876	1,313,363,202

(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（2024年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		664,948,937,471	93.92
	内 香港	3,278,069,956	0.46
	内 シンガポール	2,736,380,178	0.39
	内 イスラエル	1,649,747,543	0.23
	内 ノルウェー	1,001,666,836	0.14
	内 スウェーデン	6,198,717,354	0.88
	内 デンマーク	5,046,887,127	0.71
	内 イギリス	23,304,665,468	3.29
	内 アイルランド	449,777,616	0.06
	内 オランダ	7,450,885,512	1.05
	内 ベルギー	1,577,865,510	0.22
	内 フランス	17,623,980,655	2.49
	内 ドイツ	14,974,676,166	2.12
	内 スイス	14,493,342,974	2.05
	内 ポルトガル	264,776,302	0.04
	内 スペイン	4,398,985,152	0.62
	内 イタリア	4,514,558,654	0.64
	内 フィンランド	1,574,034,058	0.22
	内 オーストリア	310,533,061	0.04
	内 カナダ	19,423,534,158	2.74
	内 アメリカ	523,827,958,210	73.99
	内 オーストラリア	10,487,651,986	1.48
	内 ニュージーランド	360,242,995	0.05
投資証券		12,479,592,243	1.76
	内 香港	167,156,352	0.02
	内 シンガポール	165,248,323	0.02
	内 イギリス	160,464,025	0.02
	内 ベルギー	35,680,693	0.01
	内 フランス	219,838,528	0.03
	内 カナダ	22,314,046	0.00
	内 アメリカ	10,696,623,768	1.51
	内 オーストラリア	1,012,266,508	0.14
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		30,569,023,036	4.32
純資産総額		707,997,552,750	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)		30,745,648,148	4.34
	内 イギリス	1,931,379,639	0.27
	内 ドイツ	5,022,395,228	0.71
	内 カナダ	2,714,868,962	0.38
	内 アメリカ	19,877,365,431	2.81
	内 オーストラリア	1,199,638,888	0.17
為替予約取引(買建)		19,217,157,600	2.71
	内 日本	19,217,157,600	2.71

(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（2024年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	980,500	37,540.85 36,808,812,642	40,429.22 39,640,856,289	5.60
2	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	1,580,200	21,868.38 34,556,421,977	21,672.24 34,246,476,492	4.84
3	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	454,400	66,982.90 30,437,031,032	68,101.23 30,945,201,366	4.37
4	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	608,200	32,884.04 20,000,073,250	35,392.77 21,525,885,755	3.04
5	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	140,700	90,845.93 12,782,023,420	94,877.94 13,349,326,974	1.89
6	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	185,050	54,597.40 10,103,250,498	68,279.97 12,635,210,077	1.78

7	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	377,000	26,724.51 10,075,140,647	30,490.77 11,495,022,854	1.62
8	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	285,620	25,637.81 7,322,672,549	38,240.01 10,922,113,084	1.54
9	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	323,440	26,968.10 8,722,564,916	30,693.24 9,927,423,874	1.40
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	183,070	39,500.70 7,231,394,906	38,148.27 6,983,803,899	0.99
11	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	51,985	125,808.46 6,540,152,949	123,881.83 6,439,996,964	0.91
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	85,350	76,404.10 6,521,090,242	72,210.75 6,163,187,666	0.87
13	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	金融	107,850	49,839.35 5,375,174,372	50,405.63 5,436,248,145	0.77
14	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	285,809	18,658.91 5,332,885,208	16,843.00 4,813,882,816	0.68
15	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	59,466	96,521.43 5,739,743,713	80,670.21 4,797,135,195	0.68
16	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	金融	53,100	84,300.44 4,476,353,853	84,183.39 4,470,138,328	0.63
17	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	28,560	153,731.97 4,390,585,303	148,641.74 4,245,208,266	0.60
18	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需品	284,500	14,631.65 4,162,704,425	14,498.77 4,124,902,569	0.58
19	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	151,167	28,355.34 4,286,392,710	26,816.25 4,053,732,880	0.57
20	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	27,690	140,275.60 3,884,231,525	143,556.25 3,975,072,812	0.56
21	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	63,950	67,879.78 4,340,912,148	62,142.59 3,974,018,937	0.56
22	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	155,000	24,519.48 3,800,519,679	22,944.00 3,556,321,395	0.50

23	SALESFORCE.COM INC	アメリカ	株式	情報技術	61,566	52,197.81 3,213,610,875	53,536.02 3,295,998,669	0.47
24	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	113,672	28,935.86 3,289,197,919	28,157.62 3,200,733,185	0.45
25	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	449,301	7,515.13 3,376,556,233	7,013.70 3,151,262,963	0.45
26	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	株式	ヘルスケア	213,987	16,743.90 3,582,977,571	14,059.74 3,008,603,509	0.42
27	ORACLE CORP	アメリカ	株式	情報技術	107,033	29,237.99 3,129,429,912	26,726.09 2,860,573,891	0.40
28	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	25,150	108,583.32 2,730,870,699	112,953.70 2,840,785,756	0.40
29	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	263,550	10,136.17 2,671,388,763	9,878.34 2,603,436,771	0.37
30	SAP SE	ドイツ	株式	情報技術	65,778	37,090.50 2,439,739,435	39,498.34 2,598,121,809	0.37

(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	93.92%
投資証券	1.76%
合計	95.68%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	3.59%
素材	2.97%
資本財・サービス	9.42%
一般消費財・サービス	10.38%
生活必需品	5.78%
ヘルスケア	10.00%
金融	15.16%
情報技術	26.07%
コミュニケーション・サービス	7.87%
公益事業	2.41%
不動産	0.27%
合計	93.92%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 EMINI MAR 25	買建	417	20,261,868,299	19,877,365,431	2.81%
	イギリス	FTSE 100 INDEX MAR 25	買建	119	1,952,918,031	1,931,379,639	0.27%
	オーストラリア	SPI 200 MAR 25	買建	59	1,210,854,639	1,199,638,888	0.17%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX MAR 25	買建	83	2,759,761,983	2,714,868,962	0.38%
	ドイツ	SWISS MKT IX MAR 25	買建	91	1,861,448,572	1,846,207,545	0.26%
		EURO STOXX 50 MAR 25	買建	392	3,219,887,690	3,176,187,683	0.45%
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2025年1月	買建	7,500,000	728,422,240	737,712,000	0.10%
		ユーロ買/円売 2025年1月	買建	8,500,000	1,348,394,820	1,400,522,900	0.20%
		米ドル買/円売 2025年1月	買建	78,900,000	11,904,185,770	12,463,044,000	1.76%
		スイス・フラン買/円売 2025年1月	買建	8,100,000	1,378,866,950	1,420,162,470	0.20%
		カナダ・ドル買/円売 2025年1月	買建	17,000,000	1,815,234,350	1,864,279,500	0.26%
		英ポンド買/円売 2025年1月	買建	6,700,000	1,274,462,810	1,331,436,730	0.19%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)

2024年12月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	39,491円
純資産総額	442億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	3.9%
3カ月間	12.4%
6カ月間	5.4%
1年間	34.1%
3年間	66.9%
5年間	149.9%
設定来	294.9%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

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

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

主要な資産の状況　　※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国株式・先物	1,156	98.3%
外国リート	51	1.7%
外国投資証券	3	0.1%
コール・ローン、その他		4.3%
合計	1,210	-

国・地域別構成	比率
アメリカ	78.3%
イギリス	3.6%
その他	18.1%
合計	100.0%

通貨別構成	比率
米ドル	78.6%
ユーロ	8.0%
英ポンド	3.6%
カナダ・ドル	3.1%
スイス・フラン	2.3%
豪ドル	1.8%
スウェーデン・クローネ	0.8%
デンマーク・クローネ	0.7%
香港ドル	0.5%
その他	0.7%
合計	100.0%

株式業種別構成	比率
情報技術	26.1%
金融	15.2%
一般消費財・サービス	10.4%
ヘルスケア	10.0%
資本財・サービス	9.4%
コミュニケーション・サービス	7.9%
生活必需品	5.8%
エネルギー	3.6%
素材	3.0%
公益事業、他	2.7%
合計	93.9%

組入上位10銘柄	国・地域名	比率
APPLE INC	アメリカ	5.6%
NVIDIA CORP	アメリカ	4.8%
MICROSOFT CORP	アメリカ	4.4%
AMAZON.COM INC	アメリカ	3.0%
S&P500 EMINI MAR 25	アメリカ	2.8%
META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	1.9%
TESLA INC	アメリカ	1.8%
ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.6%
BROADCOM INC	アメリカ	1.5%
ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.4%
合計		28.9%

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

年間収益率の推移

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

・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2016年※は設定日（9月26日）から年末、2024年は12月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）】

(1) 【投資状況】 (2024年12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		6,969,085,000	99.22
	内 日本	6,969,085,000	99.22
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		54,696,928	0.78
純資産総額		7,023,781,928	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】（2024年12月30日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	766,252,973	6.6484 5,094,382,049	7.2380 5,546,139,018	78.96
2	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	495,058,269	2.7143 1,343,764,077	2.8743 1,422,945,982	20.26

(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	99.22%
合計	99.22%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	826,097,593	826,097,593	1.2158	1.2158
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,697,993,255	1,697,993,255	1.3778	1.3778
第3計算期間末 (2019年6月17日)	1,747,579,023	1,747,579,023	1.3793	1.3793
第4計算期間末 (2020年6月15日)	1,800,845,481	1,800,845,481	1.3573	1.3573
第5計算期間末 (2021年6月15日)	2,402,518,423	2,402,518,423	1.9822	1.9822
第6計算期間末 (2022年6月15日)	2,605,876,138	2,605,876,138	2.0510	2.0510
第7計算期間末 (2023年6月15日)	3,957,729,997	3,957,729,997	2.4679	2.4679
2023年12月末日	4,961,740,304	－	2.6901	－
2024年1月末日	5,344,408,605	－	2.8306	－
2月末日	5,653,934,664	－	2.9665	－
3月末日	5,875,943,846	－	3.0716	－
4月末日	5,984,821,514	－	3.1454	－
5月末日	6,268,805,458	－	3.2169	－
第8計算期間末 (2024年6月17日)	6,422,264,022	6,422,264,022	3.2881	3.2881
6月末日	6,666,729,636	－	3.3888	－
7月末日	6,216,340,554	－	3.1953	－
8月末日	6,173,171,400	－	3.1410	－
9月末日	6,337,479,338	－	3.2145	－
10月末日	6,723,478,493	－	3.4304	－
11月末日	6,742,435,216	－	3.4051	－
12月末日	7,023,781,928	－	3.5548	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000

第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
2024年6月18日～ 2024年12月17日	―

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	21.6
第2計算期間	13.3
第3計算期間	0.1
第4計算期間	△1.6
第5計算期間	46.0
第6計算期間	3.5
第7計算期間	20.3
第8計算期間	33.2
2024年6月18日～ 2024年12月17日	7.4

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	702,644,049	33,190,572
第2計算期間	695,338,362	142,407,106
第3計算期間	339,152,791	304,533,894
第4計算期間	415,919,823	356,157,946
第5計算期間	193,724,602	308,457,694
第6計算期間	295,982,191	237,478,525
第7計算期間	541,659,096	208,501,672
第8計算期間	802,382,236	452,915,615
2024年6月18日～ 2024年12月17日	188,991,323	175,903,607

(注)　当初設定数量は10,000,000口です。

（参考）マザーファンド

外国株式インデックスマザーファンド

前記「ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）」の記載と同じ。

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（2024年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		37,453,929,774	88.28
	内 中国	16,420,914,760	38.71
	内 台湾	7,105,523,321	16.75
	内 タイ	1,247,545,348	2.94
	内 マレーシア	272,389,257	0.64
	内 インドネシア	407,435,929	0.96
	内 インド	4,361,048,332	10.28
	内 サウジアラビア	920,483,703	2.17
	内 トルコ	644,799,003	1.52
	内 カナダ	16,020,787	0.04
	内 メキシコ	705,151,330	1.66
	内 チリ	114,447,136	0.27
	内 ブラジル	3,761,832,105	8.87
	内 南アフリカ	1,476,338,763	3.48
投資証券		2,976,339,615	7.02
	内 アメリカ	2,922,243,420	6.89
	内 メキシコ	18,286,911	0.04
	内 南アフリカ	35,809,284	0.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,995,108,252	4.70
純資産総額		42,425,377,641	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）		1,590,460,355	3.75
	内 アメリカ	1,590,460,355	3.75
為替予約取引（買建）		15,796,000	0.04
	内 日本	15,796,000	0.04

(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（2024年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	アメリカ	投資証券	―	895,500	3,275.11 2,932,867,184	3,263.25 2,922,243,420	6.89
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技術	486,000	4,835.96 2,350,278,352	5,252.92 2,552,923,008	6.02
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	中国	株式	一般消費財･サービス	948,900	1,536.08 1,457,592,743	1,678.29 1,592,532,228	3.75
4	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	株式	コミュニケーション･サービス	151,100	7,842.04 1,184,933,059	8,506.61 1,285,349,073	3.03
5	IND & COMM BK OF CHINA-H	中国	株式	金融	10,703,000	97.78 1,046,785,969	105.16 1,125,536,042	2.65
6	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	株式	金融	7,825,000	113.88 891,205,923	131.85 1,031,793,545	2.43
7	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	株式	金融	962,000	764.73 735,683,429	944.61 908,717,706	2.14
8	BANK OF CHINA LTD-H	中国	株式	金融	9,391,000	78.32 735,693,093	80.29 754,071,005	1.78
9	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	ブラジル	株式	エネルギー	788,000	951.04 749,424,219	908.32 715,759,618	1.69
10	VALE SA	ブラジル	株式	素材	458,890	1,611.11 739,335,095	1,394.32 639,842,410	1.51
11	JD.COM INC - CL A	中国	株式	一般消費財･サービス	214,195	2,195.27 470,220,324	2,769.64 593,243,468	1.40
12	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	ブラジル	株式	エネルギー	522,300	1,012.47 528,826,896	989.32 516,724,297	1.22

13	XIAOMI CORP-CLASS B	中国	株式	情報技術	717,600	360.21 258,498,313	695.97 499,433,095	1.18
14	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	505,902	1,017.49 514,753,166	898.78 454,695,004	1.07
15	MEDIATEK INC	台湾	株式	情報技術	64,003	6,571.17 420,575,222	6,891.45 441,073,858	1.04
16	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国	株式	エネルギー	4,543,800	108.21 491,799,200	89.46 406,525,607	0.96
17	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	中国	株式	金融	3,946,000	71.77 283,298,308	89.87 354,649,907	0.84
18	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	株式	エネルギー	151,264	2,856.13 432,031,353	2,271.15 343,543,687	0.81
19	HDFC BANK LIMITED	インド	株式	金融	101,736	3,205.91 326,156,707	3,344.74 340,280,977	0.80
20	MEITUAN-CLASS B	中国	株式	一般消費財･サービス	106,890	2,516.95 269,037,316	3,152.78 337,001,296	0.79
21	CHINA MERCHANTS BANK-H	中国	株式	金融	357,000	702.43 250,770,420	808.06 288,479,919	0.68
22	PETROCHINA CO LTD-H	中国	株式	エネルギー	2,192,000	167.01 366,123,887	122.89 269,377,949	0.63
23	INFOSYS LTD	インド	株式	情報技術	74,637	3,149.10 235,039,810	3,565.15 266,092,474	0.63
24	EVERGREEN MARINE CORP LTD	台湾	株式	資本財･サービス	235,800	916.88 216,201,326	1,089.13 256,819,023	0.61
25	PTT PCL-NVDR	タイ	株式	エネルギー	1,616,100	152.78 246,914,112	147.95 239,110,076	0.56
26	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	ブラジル	株式	金融	304,836	847.82 258,449,064	784.02 238,998,132	0.56
27	BAIDU INC-CLASS A	中国	株式	コミュニケーション･サービス	124,350	1,787.52 222,280,046	1,732.30 215,411,505	0.51
28	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	台湾	株式	情報技術	257,000	794.17 204,103,515	795.16 204,358,176	0.48
29	NASPERS LTD-N SHS	南アフリカ	株式	一般消費財･サービス	5,483	30,532.37 167,409,039	35,972.93 197,239,614	0.46
30	QUANTA COMPUTER INC	台湾	株式	情報技術	125,000	1,468.20 183,526,326	1,402.38 175,298,400	0.41

(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	88.28%
投資証券	7.02%
合計	95.30%

(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	9.13%
素材	7.58%
資本財・サービス	4.07%
一般消費財・サービス	9.82%
生活必需品	2.83%
ヘルスケア	0.83%
金融	27.79%
情報技術	16.37%
コミュニケーション・サービス	6.32%
公益事業	2.35%
不動産	1.19%
合計	88.28%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	アメリカ	MSCI EMER MKT INDEX (ICE) MAR 25	買建	185	1,616,490,060	1,590,460,355	3.75%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2025年1月	買建	100,000	14,920,560	15,796,000	0.04%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●FW 外国株式インデックスEM+(為替ヘッジなし)

2024年12月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	35,548円
純資産総額	70億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	4.4%
3カ月間	10.6%
6カ月間	4.9%
1年間	32.1%
3年間	63.0%
5年間	129.5%
設定来	255.5%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

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

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

主要な資産の状況　　※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国株式・先物	1,574	96.2%
外国投資証券	4	1.4%
外国リート	53	1.4%
コール・ローン、その他		5.1%
合計	1,631	-

国・地域別構成	比率
アメリカ	64.0%
中国	7.8%
その他	27.2%
合計	99.0%

通貨別構成	比率
米ドル	64.1%
香港ドル	7.1%
ユーロ	6.3%
台湾ドル	3.4%
英ポンド	2.8%
カナダ・ドル	2.5%
インド・ルピー	2.1%
ブラジル・レアル	1.9%
スイス・フラン	1.8%
その他	8.0%
合計	100.0%

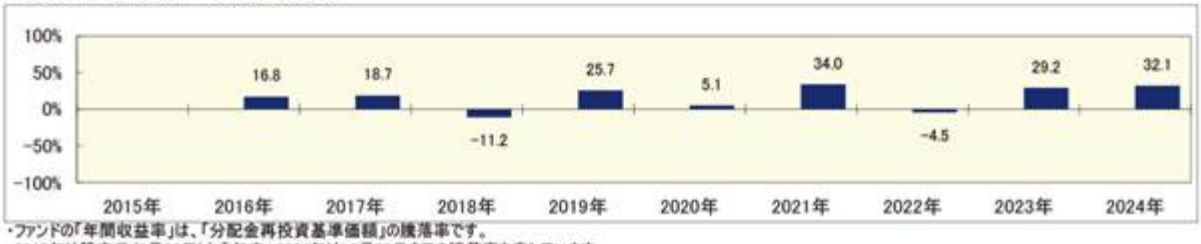
株式業種別構成	比率
情報技術	23.9%
金融	17.6%
一般消費財・サービス	10.2%
資本財・サービス	8.3%
ヘルスケア	8.1%
コミュニケーション・サービス	7.5%
生活必需品	5.1%
エネルギー	4.7%
素材	3.9%
公益事業、他	2.8%
合計	92.0%

組入上位10銘柄	国・地域名	比率
APPLE INC	アメリカ	4.4%
NVIDIA CORP	アメリカ	3.8%
MICROSOFT CORP	アメリカ	3.5%
AMAZON.COM INC	アメリカ	2.4%
S&P500 EMINI MAR 25	アメリカ	2.2%
META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	1.5%
TESLA INC	アメリカ	1.4%
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	アメリカ	1.4%
ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.3%
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	1.2%
合計		23.1%

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

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2016年は設定日(9月26日)から年末、2024年は12月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 日本債券インデックス】

(1) 【投資状況】 (2024年12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		39,618,427,755	99.90
	内 日本	39,618,427,755	99.90
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		38,517,235	0.10
純資産総額		39,656,944,990	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】 (2024年12月30日現在)

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本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	30,247,692,591	1.3188 39,892,712,367	1.3098 39,618,427,755	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。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	14,248,194,432	14,248,194,432	0.9858	0.9858
第2計算期間末 (2018年6月15日)	25,120,930,051	25,120,930,051	0.9915	0.9915
第3計算期間末 (2019年6月17日)	27,372,292,105	27,372,292,105	1.0149	1.0149
第4計算期間末 (2020年6月15日)	33,339,891,042	33,339,891,042	1.0024	1.0024
第5計算期間末 (2021年6月15日)	36,597,337,061	36,597,337,061	0.9987	0.9987
第6計算期間末 (2022年6月15日)	36,841,618,949	36,841,618,949	0.9645	0.9645
第7計算期間末 (2023年6月15日)	36,693,031,052	36,693,031,052	0.9659	0.9659
2023年12月末日	36,646,520,426	－	0.9461	－
2024年1月末日	36,860,960,579	－	0.9392	－
2月末日	36,516,542,141	－	0.9422	－
3月末日	37,569,564,708	－	0.9409	－
4月末日	37,949,415,008	－	0.9301	－
5月末日	37,544,276,489	－	0.9151	－
第8計算期間末 (2024年6月17日)	37,969,994,751	37,969,994,751	0.9244	0.9244
6月末日	37,887,879,628	－	0.9173	－
7月末日	37,866,708,684	－	0.9161	－
8月末日	39,058,962,943	－	0.9267	－
9月末日	39,131,150,616	－	0.9291	－
10月末日	39,108,667,149	－	0.9243	－
11月末日	39,290,331,311	－	0.9179	－
12月末日	39,656,944,990	－	0.9167	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000

第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
2024年6月18日～ 2024年12月17日	―

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	△1.4
第2計算期間	0.6
第3計算期間	2.4
第4計算期間	△1.2
第5計算期間	△0.4
第6計算期間	△3.4
第7計算期間	0.1
第8計算期間	△4.3
2024年6月18日～ 2024年12月17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	15,709,737,796	1,257,184,902
第2計算期間	17,894,969,975	7,012,636,355
第3計算期間	9,926,740,515	8,292,385,149
第4計算期間	14,370,293,804	8,081,979,073
第5計算期間	12,736,682,056	9,351,040,686
第6計算期間	10,246,997,124	8,694,888,536
第7計算期間	6,956,197,111	7,164,976,774
第8計算期間	13,620,058,958	10,530,319,029
2024年6月18日～ 2024年12月17日	6,663,603,258	4,732,006,986

(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（2024年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		107,575,986,620	84.56
	内 日本	107,575,986,620	84.56
地方債証券		6,311,476,800	4.96
	内 日本	6,311,476,800	4.96
特殊債券		3,915,652,200	3.08
	内 日本	3,915,652,200	3.08
社債券		8,907,388,400	7.00
	内 日本	8,907,388,400	7.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		510,090,717	0.40
純資産総額		127,220,594,737	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（2024年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	149 5年国債	日本	国債証券	1,480,000,000	98.94 1,464,341,600	99.05 1,465,999,200	0.005000 2026/09/20	1.15
2	150 5年国債	日本	国債証券	1,480,000,000	98.79 1,462,179,500	98.90 1,463,838,400	0.005000 2026/12/20	1.15
3	370 10年国債	日本	国債証券	1,500,000,000	96.80 1,452,015,000	96.61 1,449,195,000	0.500000 2033/03/20	1.14
4	147 5年国債	日本	国債証券	1,350,000,000	99.31 1,340,705,200	99.43 1,342,426,500	0.005000 2026/03/20	1.06
5	365 10年国債	日本	国債証券	1,400,000,000	95.23 1,333,290,000	95.07 1,331,050,000	0.100000 2031/12/20	1.05
6	349 10年国債	日本	国債証券	1,250,000,000	98.40 1,230,012,500	98.53 1,231,675,000	0.100000 2027/12/20	0.97
7	373 10年国債	日本	国債証券	1,160,000,000	96.78 1,122,659,100	96.59 1,120,478,800	0.600000 2033/12/20	0.88
8	163 5年国債	日本	国債証券	1,130,000,000	98.97 1,118,427,500	99.05 1,119,366,700	0.400000 2028/09/20	0.88
9	369 10年国債	日本	国債証券	1,140,000,000	97.07 1,106,609,400	96.85 1,104,101,400	0.500000 2032/12/20	0.87

10	364 10年国債	日本	国債証券	1,140,000,000	95.49 1,088,629,800	95.36 1,087,138,200	0.100000 2031/09/20	0.85
11	354 10年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	97.43 1,071,818,000	97.53 1,072,852,000	0.100000 2029/03/20	0.84
12	360 10年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	96.30 1,059,373,600	96.36 1,060,015,000	0.100000 2030/09/20	0.83
13	348 10年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	98.55 1,034,838,000	98.69 1,036,297,500	0.100000 2027/09/20	0.81
14	154 5年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	98.55 1,034,838,000	98.69 1,036,297,500	0.100000 2027/09/20	0.81
15	363 10年国債	日本	国債証券	1,080,000,000	95.73 1,033,938,000	95.61 1,032,663,600	0.100000 2031/06/20	0.81
16	367 10年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	95.33 1,000,971,300	95.14 999,012,000	0.200000 2032/06/20	0.79
17	166 5年国債	日本	国債証券	980,000,000	98.83 968,612,400	98.92 969,435,600	0.400000 2028/12/20	0.76
18	362 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	95.97 959,780,000	95.89 958,930,000	0.100000 2031/03/20	0.75
19	368 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	95.03 950,380,000	94.85 948,540,000	0.200000 2032/09/20	0.75
20	345 10年国債	日本	国債証券	950,000,000	98.98 940,395,500	99.09 941,374,000	0.100000 2026/12/20	0.74
21	158 5年国債	日本	国債証券	950,000,000	98.22 933,147,000	98.36 934,496,000	0.100000 2028/03/20	0.73
22	371 10年国債	日本	国債証券	960,000,000	95.69 918,624,000	95.54 917,251,200	0.400000 2033/06/20	0.72
23	466 2年国債	日本	国債証券	900,000,000	99.79 898,128,000	99.85 898,695,000	0.500000 2026/11/01	0.71
24	2 CT5年国債	日本	国債証券	900,000,000	98.96 890,694,000	99.02 891,261,000	0.500000 2029/06/20	0.70
25	347 10年国債	日本	国債証券	900,000,000	98.70 888,376,500	98.83 889,551,000	0.100000 2027/06/20	0.70
26	372 10年国債	日本	国債証券	900,000,000	98.74 888,678,000	98.55 887,004,000	0.800000 2033/09/20	0.70
27	161 5年国債	日本	国債証券	880,000,000	98.73 868,868,000	98.85 869,888,800	0.300000 2028/06/20	0.68
28	148 5年国債	日本	国債証券	870,000,000	99.12 862,420,700	99.23 863,353,200	0.005000 2026/06/20	0.68
29	156 5年国債	日本	国債証券	870,000,000	98.75 859,132,300	98.82 859,768,800	0.200000 2027/12/20	0.68

30	151 5年国債	日本	国債証券	850,000,000	98.64 838,457,000	98.77 839,562,000	0.005000 2027/03/20	0.66

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	84.56%
地方債証券	4.96%
特殊債券	3.08%
社債券	7.00%
合計	99.60%

(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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（参考情報）運用実績

●FW 日本債券インデックス

2024年12月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	9,167円
純資産総額	396億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	−0.1%
3カ月間	−1.3%
6カ月間	−0.1%
1年間	−3.1%
3年間	−8.0%
5年間	−9.1%
設定来	−8.3%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

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

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

主要な資産の状況　　※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
国内債券	429	99.5%
国内債券先物	−	−
コール・ローン、その他		0.5%
合計	429	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	0.8
最終利回り(%)	1.1
修正デュレーション	8.7
残存年数	9.7

債券種別構成	比率
国債	84.3%
事業債	7.7%
地方債	5.9%
政府保証債	1.2%
その他	0.4%
合計	99.5%

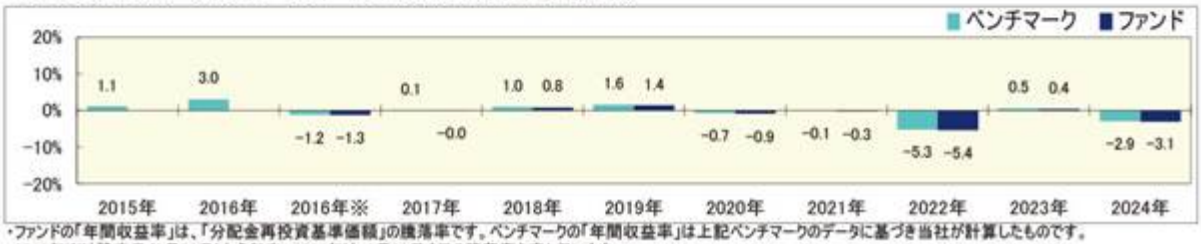
格付別構成	比率
AAA	87.5%
AA	7.3%
A	2.9%
BBB	−
BB以下・無格付	2.3%
合計	100.0%

組入上位10銘柄	利率(%)	償還日	比率
149 5年国債	0.005	2026/09/20	1.2%
150 5年国債	0.005	2026/12/20	1.1%
370 10年国債	0.500	2033/03/20	1.1%
147 5年国債	0.005	2026/03/20	1.1%
365 10年国債	0.100	2031/12/20	1.0%
349 10年国債	0.100	2027/12/20	1.0%
373 10年国債	0.600	2033/12/20	0.9%
163 5年国債	0.400	2028/09/20	0.9%
369 10年国債	0.500	2032/12/20	0.9%
364 10年国債	0.100	2031/09/20	0.9%
合計			10.0%

※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2.3%保有しております。
※格付別構成については、当社所定の基準で採用した格付けを基準に算出しています。

年間収益率の推移

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



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2016年※は設定日（9月26日）から年末、2024年は12月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）】

(1) 【投資状況】 (2024年12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		97,555,001,044	99.71
	内 日本	97,555,001,044	99.71
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		287,167,081	0.29
純資産総額		97,842,168,125	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】（2024年12月30日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	117,380,581,211	0.8410 98,725,173,218	0.8311 97,555,001,044	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。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	33,745,104,093	33,745,104,093	0.9710	0.9710
第2計算期間末 (2018年6月15日)	61,154,884,176	61,154,884,176	0.9475	0.9475
第3計算期間末 (2019年6月17日)	72,847,478,521	72,847,478,521	0.9905	0.9905
第4計算期間末 (2020年6月15日)	87,728,604,640	87,728,604,640	1.0451	1.0451
第5計算期間末 (2021年6月15日)	98,409,882,734	98,409,882,734	1.0198	1.0198
第6計算期間末 (2022年6月15日)	97,518,003,285	97,518,003,285	0.8787	0.8787
第7計算期間末 (2023年6月15日)	98,451,825,948	98,451,825,948	0.8378	0.8378
2023年12月末日	99,884,566,371	－	0.8426	－
2024年1月末日	98,355,809,367	－	0.8273	－
2月末日	96,757,679,645	－	0.8177	－
3月末日	99,073,955,786	－	0.8224	－
4月末日	97,930,200,870	－	0.8061	－
5月末日	97,295,992,982	－	0.8036	－
第8計算期間末 (2024年6月17日)	98,185,393,699	98,185,393,699	0.8148	0.8148
6月末日	98,491,676,633	－	0.8108	－
7月末日	99,638,447,635	－	0.8174	－
8月末日	100,814,474,495	－	0.8249	－
9月末日	101,613,874,608	－	0.8302	－
10月末日	99,102,892,558	－	0.8110	－
11月末日	100,046,458,876	－	0.8167	－
12月末日	97,842,168,125	－	0.8036	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000

第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
2024年6月18日～ 2024年12月17日	―

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	△2.9
第2計算期間	△2.4
第3計算期間	4.5
第4計算期間	5.5
第5計算期間	△2.4
第6計算期間	△13.8
第7計算期間	△4.7
第8計算期間	△2.7
2024年6月18日～ 2024年12月17日	△0.3

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	37,021,440,339	2,368,454,114
第2計算期間	41,568,085,908	11,780,237,725
第3計算期間	27,255,813,662	18,253,054,308
第4計算期間	32,566,137,503	22,163,944,927
第5計算期間	31,995,491,437	19,438,727,028
第6計算期間	32,610,525,682	18,127,288,357
第7計算期間	26,147,697,038	19,623,292,759
第8計算期間	32,679,578,644	29,682,567,886
2024年6月18日～ 2024年12月17日	13,120,570,749	12,515,262,621

(注) 当初設定数量は100,000,000口です。

（参考）マザーファンド

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

(1) 投資状況（2024年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		124,970,077,095	101.35
	内 ユーロ	37,879,231,817	30.72
	内 中国	14,677,093,397	11.90
	内 シンガポール	564,578,300	0.46
	内 マレーシア	697,309,011	0.57
	内 イスラエル	395,874,464	0.32
	内 ノルウェー	190,578,079	0.15
	内 スウェーデン	240,945,894	0.20
	内 デンマーク	305,994,631	0.25
	内 イギリス	6,456,858,047	5.24
	内 ポーランド	640,769,620	0.52
	内 カナダ	2,446,257,799	1.98
	内 アメリカ	57,589,782,428	46.71
	内 メキシコ	939,163,375	0.76
	内 オーストラリア	1,591,807,921	1.29
	内 ニュージーランド	353,832,312	0.29
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△1,666,662,606	△1.35
純資産総額		123,303,414,489	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）		2,113,724,985	1.71
	内 ドイツ	149,170,140	0.12
	内 アメリカ	1,964,554,845	1.59
為替予約取引（売建）		131,685,636,363	△106.80
	内 日本	131,685,636,363	△106.80

(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（2024年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	14,000,000	93.65 2,074,075,141	94.83 2,100,073,606	2.250000 2027/08/15	1.70
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,350,000	94.19 1,542,060,201	95.84 1,569,073,390	2.000000 2026/11/15	1.27
3	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,500,000	101.06 1,358,818,226	100.21 1,347,407,294	4.500000 2026/03/31	1.09
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,950,000	105.63 1,328,430,597	104.81 1,318,068,542	6.125000 2027/11/15	1.07
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	94.91 1,201,153,957	95.81 1,212,418,064	2.250000 2027/02/15	0.98
6	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	100.15 1,108,940,876	99.97 1,106,994,257	4.250000 2026/01/31	0.90
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,865,000	94.42 1,025,323,020	96.44 1,047,345,188	1.625000 2026/05/15	0.85
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	93.11 957,401,058	93.22 958,501,200	2.625000 2029/02/15	0.78
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	100.42 953,132,571	99.77 946,944,570	4.375000 2028/11/30	0.77
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,750,000	93.62 851,515,762	95.58 869,360,839	1.500000 2026/08/15	0.71
11	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	91.04 864,095,713	90.02 854,428,251	1.750000 2029/01/31	0.69
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,550,000	94.35 828,341,601	95.58 839,122,201	2.375000 2027/05/15	0.68
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	89.30 776,970,669	90.55 787,845,544	1.250000 2028/03/31	0.64
14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	5,000,000	103.19 816,153,437	99.17 784,390,893	4.250000 2029/06/30	0.64
15	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	5,900,000	87.98 821,152,399	83.82 782,334,869	1.875000 2032/02/15	0.63
16	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,500,000	102.17 727,320,339	99.21 706,243,645	4.500000 2033/11/15	0.57
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,500,000	94.66 673,799,346	96.51 687,017,657	1.875000 2026/06/30	0.56
18	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,500,000	93.79 667,620,835	91.58 651,911,188	3.375000 2033/05/15	0.53

19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,300,000	95.35 648,552,710	95.41 649,001,625	3.125000 2028/11/15	0.53
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,000,000	81.51 644,702,135	81.54 644,915,678	0.875000 2030/11/15	0.52
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,500,000	88.09 627,097,491	89.82 639,376,214	0.625000 2027/11/30	0.52
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,900,000	82.51 639,589,915	82.24 637,458,440	1.125000 2031/02/15	0.52
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,500,000	86.39 614,961,131	86.52 615,907,838	1.500000 2030/02/15	0.50
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,600,000	84.68 616,177,219	84.06 611,644,096	1.625000 2031/05/15	0.50
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,000,000	93.44 591,219,895	96.20 608,701,948	0.375000 2025/12/31	0.49
26	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,700,000	81.91 608,986,356	81.33 604,659,500	1.250000 2031/08/15	0.49
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,000,000	94.58 598,470,866	95.25 602,672,127	2.750000 2028/02/15	0.49
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,000,000	94.57 598,363,304	94.85 600,179,210	2.875000 2028/08/15	0.49
29	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,000,000	92.44 584,918,004	94.38 597,161,136	1.250000 2026/11/30	0.48
30	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,000,000	94.83 600,008,376	92.70 586,575,730	3.500000 2033/02/15	0.48

(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	101.35%
合計	101.35%

(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

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
債券先物取引	アメリカ	US LONG BOND MAR 25	買建	2	37,395,739	35,837,656	0.03%
		US 10YR NOTE MAR 25	買建	10	174,917,469	171,526,438	0.14%
		US 5YR NOTE MAR 25	買建	15	254,312,724	251,598,878	0.20%
		US 2YR NOTE MAR 25	買建	40	1,301,791,599	1,299,349,869	1.05%
		US ULTRA T-BOND MAR 25	買建	11	218,101,099	206,242,004	0.17%
	ドイツ	EURO-SCHATZ MAR 25	買建	5	88,625,864	88,190,970	0.07%
		EURO-OAT MAR 25	買建	3	62,375,581	60,979,170	0.05%
為替予約取引	日本	イスラエル・シュケル売/円買 2025年1月	売建	9,521,000	391,560,646	408,238,581	△0.33%
		ノルウェー・クローネ売/円買 2025年1月	売建	15,718,000	212,461,777	218,855,860	△0.18%
		ポーランド・ズロチ売/円買 2025年1月	売建	19,066,000	699,470,528	734,544,342	△0.60%
		豪ドル売/円買 2025年1月	売建	17,192,000	1,674,062,404	1,691,249,246	△1.37%
		カナダ・ドル売/円買 2025年1月	売建	22,804,000	2,437,302,922	2,500,987,652	△2.03%
		メキシコ・ペソ売/円買 2025年1月	売建	132,169,000	968,494,781	1,024,018,978	△0.83%
		スウェーデン・クローネ売/円買 2025年1月	売建	22,059,000	302,543,596	317,215,037	△0.26%
		ユーロ売/円買 2025年1月	売建	241,584,000	38,191,020,992	39,808,525,579	△32.29%
		米ドル売/円買 2025年1月	売建	385,354,000	57,584,382,549	60,878,224,920	△49.37%
		マレーシア・リンギット売/円買 2025年1月	売建	19,130,000	673,004,878	674,923,617	△0.55%
		シンガポール・ドル売/円買 2025年1月	売建	5,029,000	561,447,618	585,409,797	△0.47%
		ニュージーランド・ドル売/円買 2025年1月	売建	4,284,000	378,865,821	381,562,171	△0.31%
		英ポンド売/円買 2025年1月	売建	35,854,000	6,809,585,174	7,125,946,646	△5.78%
		デンマーク・クローネ売/円買 2025年1月	売建	18,525,000	392,817,067	409,289,497	△0.33%

		オフショア人民元売/円買 2025年1月	売建	689,771,000	14,239,064,957	14,926,644,440	△12.11%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

2024年12月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	8,036円
純資産総額	978億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	−1.6%
3カ月間	−3.2%
6カ月間	−0.9%
1年間	−4.6%
3年間	−20.8%
5年間	−19.8%
設定来	−19.6%

※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：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

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

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

主要な資産の状況　　※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国債券・先物	691	102.8%
コール・ローン、その他		−1.1%
合計	691	−

債券種別構成	比率
国債	101.1%
合計	101.1%

通貨別構成	比率
日本円	102.7%
オフショア人民元	0.1%
マレーシア・リンギット	0.0%
カナダ・ドル	0.0%
デンマーク・クローネ	0.0%
南アフリカ・ランド	0.0%
イスラエル・シュケル	−0.0%
ニュージーランド・ドル	−0.0%
ノルウェー・クローネ	−0.0%
その他	−2.8%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	2.9
最終利回り(%)	3.6
修正デュレーション	6.3
残存年数	8.3

格付別構成	比率
AAA	72.3%
AA	18.6%
A	9.2%
BBB	−
BB	−
合計	100.0%

組入上位10銘柄	償還日	比率
United States Treasury Note/Bond	2027/08/15	1.7%
United States Treasury Note/Bond	2026/11/15	1.3%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2026/03/31	1.1%
United States Treasury Note/Bond	2027/11/15	1.1%
US 2YR NOTE MAR 25	−	1.1%
United States Treasury Note/Bond	2027/02/15	1.0%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2026/01/31	0.9%
United States Treasury Note/Bond	2026/05/15	0.8%
United States Treasury Note/Bond	2029/02/15	0.8%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2028/11/30	0.8%
合計		10.4%

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。
※格付別構成については、当社所定の基準で採用した格付けを基準に算出しています。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

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

・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2016年※は設定日（9月26日）から年末、2024年は12月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）】

(1) 【投資状況】（2024年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		23,719,787,239	99.71
	内 日本	23,719,787,239	99.71
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		69,707,686	0.29
純資産総額		23,789,494,925	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】（2024年12月30日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	6,304,932,681	3.7194 23,450,715,258	3.7621 23,719,787,239	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。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	1,404,884,490	1,404,884,490	1.0622	1.0622
第2計算期間末 (2018年6月15日)	2,405,883,300	2,405,883,300	1.0709	1.0709
第3計算期間末 (2019年6月17日)	3,676,403,565	3,676,403,565	1.0978	1.0978
第4計算期間末 (2020年6月15日)	4,949,959,877	4,949,959,877	1.1579	1.1579
第5計算期間末 (2021年6月15日)	6,651,390,787	6,651,390,787	1.2187	1.2187
第6計算期間末 (2022年6月15日)	7,620,837,859	7,620,837,859	1.2025	1.2025
第7計算期間末 (2023年6月15日)	10,267,011,957	10,267,011,957	1.2526	1.2526
2023年12月末日	13,176,237,534	－	1.3234	－
2024年1月末日	13,781,634,064	－	1.3462	－
2月末日	14,080,222,686	－	1.3632	－
3月末日	14,950,827,337	－	1.3797	－
4月末日	16,787,784,967	－	1.4051	－
5月末日	17,681,024,816	－	1.4123	－
第8計算期間末 (2024年6月17日)	18,536,758,820	18,536,758,820	1.4350	1.4350
6月末日	19,280,960,734	－	1.4606	－
7月末日	19,554,970,153	－	1.4071	－
8月末日	20,149,449,625	－	1.3707	－
9月末日	20,865,801,921	－	1.3733	－
10月末日	22,197,991,286	－	1.4293	－
11月末日	22,424,088,656	－	1.3999	－
12月末日	23,789,494,925	－	1.4431	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000

第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
2024年6月18日～ 2024年12月17日	―

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	6.2
第2計算期間	0.8
第3計算期間	2.5
第4計算期間	5.5
第5計算期間	5.3
第6計算期間	△1.3
第7計算期間	4.2
第8計算期間	14.6
2024年6月18日～ 2024年12月17日	△0.6

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
第1計算期間	1,394,396,399	72,737,713
第2計算期間	1,454,615,593	530,660,407
第3計算期間	1,649,381,625	547,264,585
第4計算期間	2,078,908,391	1,152,538,780
第5計算期間	1,968,605,898	785,747,124
第6計算期間	2,102,589,183	1,223,247,507
第7計算期間	2,866,101,938	1,006,563,093
第8計算期間	6,628,810,445	1,907,908,319
2024年6月18日～ 2024年12月17日	4,481,358,207	1,067,412,070

(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（2024年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		329,561,475,020	97.63
	内 ユーロ	98,988,156,413	29.32
	内 中国	37,401,130,797	11.08
	内 シンガポール	1,183,190,219	0.35
	内 マレーシア	1,652,564,172	0.49
	内 イスラエル	981,866,029	0.29
	内 ノルウェー	449,279,632	0.13
	内 スウェーデン	470,488,647	0.14
	内 デンマーク	677,336,592	0.20
	内 イギリス	16,896,608,775	5.01
	内 ポーランド	1,667,863,602	0.49
	内 カナダ	6,186,807,335	1.83
	内 アメリカ	155,950,958,216	46.20
	内 メキシコ	2,303,723,398	0.68
	内 オーストラリア	3,954,516,301	1.17
	内 ニュージーランド	796,984,892	0.24
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		8,000,731,379	2.37
純資産総額		337,562,206,399	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）		1,731,096,765	0.51
	内 日本	1,731,096,765	0.51

(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（2024年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率 (%)
1	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	85,000,000	100.98 1,859,386,851	101.70 1,872,607,291	1.850000 2027/05/15	0.55
2	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	11,000,000	97.76 1,701,056,647	94.85 1,650,388,429	3.875000 2033/08/15	0.49

3	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	73,000,000	101.70 1,608,365,710	102.66 1,623,435,886	2.050000 2029/04/15	0.48
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	102.31 1,618,434,488	99.21 1,569,430,324	4.500000 2033/11/15	0.46
5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,500,000	97.46 1,618,703,394	94.24 1,565,255,953	3.875000 2034/08/15	0.46
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	84.02 1,422,144,971	82.24 1,392,001,083	1.125000 2031/02/15	0.41
7	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	60,000,000	101.85 1,323,855,025	102.38 1,330,665,621	2.390000 2026/11/15	0.39
8	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	90.78 1,364,205,219	88.39 1,328,335,531	2.750000 2032/08/15	0.39
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	83.24 1,356,321,369	81.33 1,325,104,863	1.250000 2031/08/15	0.39
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,500,000	101.38 1,363,111,404	98.14 1,319,629,304	4.375000 2034/05/15	0.39
11	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,300,000	91.87 1,351,490,394	89.52 1,316,920,155	2.875000 2032/05/15	0.39
12	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	58,000,000	102.85 1,292,252,908	103.84 1,304,703,908	2.370000 2029/01/15	0.39
13	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,300,000	99.59 1,307,576,779	98.14 1,288,500,429	4.000000 2029/07/31	0.38
14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	83.41 1,319,411,016	81.43 1,288,138,830	1.375000 2031/11/15	0.38
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	83.18 1,289,472,920	81.54 1,264,034,728	0.875000 2030/11/15	0.37
16	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,200,000	98.51 1,277,814,421	95.43 1,237,864,480	4.000000 2034/02/15	0.37
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	96.32 1,177,582,525	96.44 1,179,159,644	1.625000 2026/05/15	0.35
18	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	95.37 1,206,951,363	92.70 1,173,151,460	3.500000 2033/02/15	0.35
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,700,000	85.94 1,182,773,392	84.06 1,156,805,139	1.625000 2031/05/15	0.34
20	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	50,000,000	103.99 1,126,423,568	105.44 1,142,128,663	2.540000 2030/12/25	0.34
21	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,800,000	94.32 1,163,822,637	91.58 1,129,979,393	3.375000 2033/05/15	0.33
22	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	99.04 1,096,718,884	98.49 1,090,628,954	3.750000 2027/08/15	0.32

23	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	103.98 1,151,373,238	96.82 1,072,137,712	4.625000 2054/05/15	0.32
24	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	94.40 1,045,275,585	94.39 1,045,231,294	1.125000 2026/10/31	0.31
25	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,700,000	99.87 1,058,491,840	97.21 1,030,301,000	4.125000 2032/11/15	0.31
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	82.41 1,042,849,104	80.94 1,024,361,025	0.625000 2030/08/15	0.30
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	95.76 1,014,902,019	94.85 1,005,300,177	2.875000 2028/08/15	0.30
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	90.08 997,441,953	89.61 992,226,758	0.750000 2028/01/31	0.29
29	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	44,000,000	102.43 976,307,555	104.00 991,319,460	2.280000 2031/03/25	0.29
30	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	44,000,000	100.68 959,694,381	103.69 988,374,267	2.110000 2034/08/25	0.29

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.63%
合計	97.63%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(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	英ポンド買/円売 2025年1月	買建	295,000	57,271,816	58,644,857	0.02%
		ニュージーランド・ドル買/円売 2025年1月	買建	595,000	52,491,554	52,994,746	0.02%

		オフショア人民元買/円売 2025年1月	買建	26,825,000	556,578,360	580,512,483	0.17%
		米ドル買/円売 2025年1月	買建	3,052,000	475,309,857	482,262,300	0.14%
		スウェーデン・クローネ買/円売 2025年1月	買建	848,000	11,623,366	12,194,494	0.00%
		ノルウェー・クローネ買/円売 2025年1月	買建	1,911,000	25,771,172	26,608,572	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2025年1月	買建	671,000	72,177,138	73,596,623	0.02%
		メキシコ・ペソ買/円売 2025年1月	買建	14,865,000	108,144,361	115,171,047	0.03%
		ユーロ買/円売 2025年1月	買建	1,997,000	324,038,591	329,111,643	0.10%

(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

●FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)

2024年12月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	14,431円
純資産総額	237億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	3.1%
3カ月間	5.1%
6カ月間	-1.2%
1年間	9.0%
3年間	17.6%
5年間	27.3%
設定来	44.3%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

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

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

主要な資産の状況　　※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国債券	1,025	97.3%
コール・ローン、その他		2.7%
合計	1,025	100.0%

債券種別構成	比率
国債	97.3%

通貨別構成	比率
米ドル	46.8%
ユーロ	29.8%
オフショア人民元	11.5%
英ポンド	5.1%
カナダ・ドル	1.9%
豪ドル	1.2%
メキシコ・ペソ	0.8%
ポーランド・ズロチ	0.5%
マレーシア・リンギット	0.5%
その他	1.8%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	2.9
最終利回り(%)	3.6
修正デュレーション	6.4
残存年数	8.2

格付別構成	比率
AAA	73.2%
AA	17.8%
A	8.9%
BBB	-
BB	-
合計	100.0%

組入上位10銘柄	償還日	比率
CHINA GOVERNMENT BOND	2027/05/15	0.6%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2033/08/15	0.5%
CHINA GOVERNMENT BOND	2029/04/15	0.5%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2033/11/15	0.5%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2034/08/15	0.5%
United States Treasury Note/Bond	2031/02/15	0.4%
CHINA GOVERNMENT BOND	2026/11/15	0.4%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2032/08/15	0.4%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2031/08/15	0.4%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2034/05/15	0.4%
合計		4.4%

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。
※格付別構成については、当社所定の基準で採用した格付けを基準に算出しています。

年間収益率の推移

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

・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2016年※は設定日（9月26日）から年末、2024年は12月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）】

(1) 【投資状況】（2024年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		4,637,693,408	99.72
	内 日本	4,637,693,408	99.72
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		13,094,026	0.28
純資産総額		4,650,787,434	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】（2024年12月30日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	外国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	985,524,020	3.7294 3,675,462,981	3.7621 3,707,639,915	79.72
2	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	481,967,919	1.8794 905,831,111	1.9297 930,053,493	20.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	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。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	599,181,409	599,181,409	1.0747	1.0747
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,195,532,865	1,195,532,865	1.0746	1.0746
第3計算期間末 (2019年6月17日)	1,344,487,088	1,344,487,088	1.1026	1.1026
第4計算期間末 (2020年6月15日)	1,706,986,677	1,706,986,677	1.1508	1.1508
第5計算期間末 (2021年6月15日)	1,952,886,340	1,952,886,340	1.2204	1.2204
第6計算期間末 (2022年6月15日)	2,294,610,149	2,294,610,149	1.1993	1.1993
第7計算期間末 (2023年6月15日)	3,070,851,690	3,070,851,690	1.2748	1.2748
2023年12月末日	3,446,589,258	－	1.3493	－
2024年1月末日	3,571,862,247	－	1.3740	－
2月末日	3,660,002,209	－	1.3924	－
3月末日	3,763,154,904	－	1.4063	－
4月末日	4,202,499,370	－	1.4327	－
5月末日	4,359,283,328	－	1.4416	－
第8計算期間末 (2024年6月17日)	4,464,179,145	4,464,179,145	1.4566	1.4566
6月末日	4,556,185,578	－	1.4841	－
7月末日	4,459,711,196	－	1.4309	－
8月末日	4,339,629,585	－	1.3967	－
9月末日	4,387,238,650	－	1.4046	－
10月末日	4,569,358,932	－	1.4567	－
11月末日	4,491,645,021	－	1.4245	－
12月末日	4,650,787,434	－	1.4703	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000

第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
2024年6月18日～ 2024年12月17日	―

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	7.5
第2計算期間	△0.0
第3計算期間	2.6
第4計算期間	4.4
第5計算期間	6.0
第6計算期間	△1.7
第7計算期間	6.3
第8計算期間	14.3
2024年6月18日～ 2024年12月17日	△0.3

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	571,935,222	15,390,972
第2計算期間	683,181,594	128,182,978
第3計算期間	364,448,905	257,568,148
第4計算期間	564,211,268	300,318,547
第5計算期間	288,268,635	171,349,249
第6計算期間	483,164,155	170,071,251
第7計算期間	728,642,263	233,099,150
第8計算期間	1,231,686,050	575,660,196
2024年6月18日～ 2024年12月17日	235,723,747	154,254,560

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

（参考）マザーファンド

外国債券インデックスマザーファンド

前記「ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）」の記載と同じ。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（2024年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		50,237,477,132	97.06
	内 中国	5,234,762,800	10.11
	内 タイ	4,888,279,344	9.44
	内 マレーシア	5,175,469,649	10.00
	内 インドネシア	5,060,499,715	9.78
	内 インド	3,102,256,219	5.99
	内 ポーランド	3,650,743,941	7.05
	内 ハンガリー	1,252,286,247	2.42
	内 セルビア	165,057,924	0.32
	内 ルーマニア	1,739,256,729	3.36
	内 トルコ	701,311,135	1.35
	内 チェコ	2,725,281,525	5.27
	内 メキシコ	5,088,529,215	9.83
	内 ドミニカ共和国	128,634,952	0.25
	内 コロンビア	1,911,659,466	3.69
	内 ペルー	1,077,251,633	2.08
	内 チリ	880,598,511	1.70
	内 ブラジル	3,117,755,402	6.02
	内 ウルグアイ	90,040,975	0.17
	内 南アフリカ	4,247,801,750	8.21
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,521,514,018	2.94
純資産総額		51,758,991,150	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引（買建）		355,162,950	0.69
	内 日本	355,162,950	0.69

(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（2024年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	31,500,000	80.19 643,421,870	80.25 643,911,311	－ 2026/07/01	1.24
2	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	26,000,000	84.99 562,870,330	86.54 573,178,670	－ 2026/01/01	1.11
3	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	78,020,000	76.12 503,023,339	80.60 532,635,104	8.750000 2048/02/28	1.03
4	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	58,650,000	104.12 517,232,238	104.16 517,455,783	10.500000 2026/12/21	1.00
5	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	63,000,000	92.60 494,133,532	95.85 511,507,873	8.000000 2030/01/31	0.99
6	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	68,700,000	89.43 477,850,957	91.57 489,252,686	5.500000 2027/03/04	0.95
7	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	65,500,000	93.00 473,761,903	95.37 485,841,450	5.750000 2026/03/05	0.94
8	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	61,700,000	86.16 450,271,298	91.14 476,296,728	8.875000 2035/02/28	0.92
9	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	67,850,000	89.20 470,733,867	89.34 471,437,286	7.750000 2031/05/29	0.91
10	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	59,800,000	88.17 446,586,340	92.73 469,718,469	8.250000 2032/03/31	0.91
11	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	21,400,000	93.86 511,638,495	84.48 460,524,794	10.000000 2029/01/01	0.89
12	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	60,500,000	93.46 439,750,910	94.98 446,933,402	7.500000 2027/06/03	0.86
13	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	58,800,000	80.05 398,702,719	85.03 423,499,932	8.500000 2037/01/31	0.82
14	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	18,000,000	96.76 443,669,340	90.92 416,888,799	10.000000 2027/01/01	0.81
15	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	54,730,000	94.28 401,320,136	94.77 403,410,400	8.500000 2029/05/31	0.78
16	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	53,000,000	94.68 390,270,815	94.70 390,366,054	8.500000 2029/03/01	0.75

17	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	52,000,000	93.53 378,259,118	95.72 387,141,860	7.000000 2026/09/03	0.75
18	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	9,400,000	106.96 388,119,805	106.67 387,074,755	7.500000 2028/07/25	0.75
19	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	9,900,000	101.83 389,186,124	100.94 385,761,919	6.000000 2033/10/25	0.75
20	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	62,620,000	80.52 392,169,090	76.85 374,299,941	7.750000 2042/11/13	0.72
21	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	10,850,000	87.27 365,524,294	88.59 371,052,958	2.750000 2029/10/25	0.72
22	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	55,400,000	85.76 369,537,438	84.58 364,448,909	7.500000 2033/05/26	0.70
23	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	49,400,000	80.38 336,324,388	85.28 356,851,975	9.000000 2040/01/31	0.69
24	INDONESIA TREASURY BOND	インドネシア	国債証券	36,300,000,000	96.23 342,339,274	96.20 342,232,552	6.375000 2032/04/15	0.66
25	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	47,700,000	76.61 309,518,955	81.18 328,014,945	8.750000 2044/01/31	0.63
26	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	54,800,000	80.58 343,444,733	75.87 323,355,039	8.000000 2053/07/31	0.62
27	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	48,000,000	86.20 321,796,355	83.82 312,927,152	7.750000 2034/11/23	0.60
28	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	8,190,000	94.79 299,712,057	96.19 304,125,585	2.500000 2026/07/25	0.59
29	Indonesia Treasury Bond	インドネシア	国債証券	26,920,000,000	109.07 287,744,111	108.66 286,678,294	8.375000 2034/03/15	0.55
30	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	9,400,000	77.35 280,697,416	78.83 286,064,181	1.250000 2030/10/25	0.55

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.06%
合計	97.06%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
為替予約取引	日本	チェコ・コルナ買/円売 2025年1月	買建	19,000,000	124,374,000	124,197,300	0.24%
		米ドル買/円売 2025年1月	買建	800,000	126,422,640	126,432,000	0.24%
		メキシコ・ペソ買/円売 2025年1月	買建	5,000,000	38,774,000	38,783,000	0.07%
		ポーランド・ズロチ買/円売 2025年1月	買建	500,000	18,274,410	19,259,400	0.04%
		南アフリカ・ランド買/円売 2025年1月	買建	5,500,000	45,922,375	46,491,250	0.09%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●FW 外国債券インデックスEM+(為替ヘッジなし)

2024年12月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	14,703円
純資産総額	46億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	3.2%
3カ月間	4.7%
6カ月間	−0.9%
1年間	9.0%
3年間	20.7%
5年間	28.1%
設定来	47.0%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

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

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

主要な資産の状況　　※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国債券	1,286	97.2%
コール・ローン、その他		2.8%
合計	1,286	100.0%

債券種別構成	比率
国債	97.2%

通貨別構成	比率
米ドル	37.5%
ユーロ	23.8%
オフショア人民元	11.2%
英ポンド	4.1%
メキシコ・ペソ	2.6%
マレーシア・リンギット	2.4%
インドネシア・ルピア	2.0%
タイ・バーツ	1.9%
ポーランド・ズロチ	1.9%
その他	12.6%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	3.6
最終利回り(%)	4.3
修正デュレーション	6.2
残存年数	8.1

格付別構成	比率
AAA	58.6%
AA	19.8%
A	15.5%
BBB	5.7%
BB	0.3%
合計	100.0%

組入上位10銘柄	償還日	比率
CHINA GOVERNMENT BOND	2027/05/15	0.5%
CHINA GOVERNMENT BOND	2029/04/15	0.4%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2033/08/15	0.4%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2033/11/15	0.4%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2034/08/15	0.4%
CHINA GOVERNMENT BOND	2026/11/15	0.3%
United States Treasury Note/Bond	2031/02/15	0.3%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2032/08/15	0.3%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2031/08/15	0.3%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2034/05/15	0.3%
合計		3.6%

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。
※格付別構成については、当社所定の基準で採用した格付けを基準に算出しています。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。

・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2016年は設定日（9月26日）から年末、2024年は12月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス】

(1) 【投資状況】（2024年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		13,889,576,495	99.95
	内 日本	13,889,576,495	99.95
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		7,015,645	0.05
純資産総額		13,896,592,140	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】（2024年12月30日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	ダイワJ－REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	4,452,500,880	3.1466 14,010,632,006	3.1195 13,889,576,495	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。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	1,224,211,506	1,224,211,506	0.9906	0.9906
第2計算期間末 (2018年6月15日)	2,355,374,969	2,355,374,969	1.0250	1.0250
第3計算期間末 (2019年6月17日)	3,254,479,810	3,254,479,810	1.1818	1.1818
第4計算期間末 (2020年6月15日)	4,081,513,165	4,081,513,165	1.0318	1.0318
第5計算期間末 (2021年6月15日)	6,102,975,985	6,102,975,985	1.4075	1.4075
第6計算期間末 (2022年6月15日)	6,943,298,664	6,943,298,664	1.2709	1.2709
第7計算期間末 (2023年6月15日)	8,364,043,604	8,364,043,604	1.3091	1.3091
2023年12月末日	9,684,733,822	－	1.2958	－
2024年1月末日	9,946,372,547	－	1.2943	－
2月末日	9,637,787,216	－	1.2311	－
3月末日	10,845,879,678	－	1.3028	－
4月末日	11,602,410,061	－	1.3158	－
5月末日	11,576,279,875	－	1.2699	－
第8計算期間末 (2024年6月17日)	11,714,101,865	11,714,101,865	1.2514	1.2514
6月末日	11,956,131,094	－	1.2623	－
7月末日	12,249,014,918	－	1.2659	－
8月末日	13,083,838,611	－	1.3012	－
9月末日	13,155,540,703	－	1.2795	－
10月末日	13,095,513,702	－	1.2504	－
11月末日	13,405,533,652	－	1.2391	－
12月末日	13,896,592,140	－	1.2391	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000

第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
2024年6月18日～ 2024年12月17日	―

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	△0.9
第2計算期間	3.5
第3計算期間	15.3
第4計算期間	△12.7
第5計算期間	36.4
第6計算期間	△9.7
第7計算期間	3.0
第8計算期間	△4.4
2024年6月18日～ 2024年12月17日	△3.2

(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	1,295,129,456	60,344,463
第2計算期間	1,366,263,589	304,124,518
第3計算期間	1,052,662,291	596,816,922
第4計算期間	2,033,327,838	831,339,359
第5計算期間	1,408,443,585	1,028,117,605
第6計算期間	1,972,084,634	844,873,025
第7計算期間	1,930,903,164	1,005,022,992
第8計算期間	4,354,491,040	1,382,986,259
2024年6月18日～ 2024年12月17日	2,630,409,857	892,705,554

（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（2024年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資証券		256,272,413,516	96.55
	内 日本	256,272,413,516	96.55
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		9,152,197,159	3.45
純資産総額		265,424,610,675	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引（買建）		9,153,200,000	3.45
	内 日本	9,153,200,000	3.45

(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（2024年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	156,018	135,124.92 21,081,921,045	122,400.00 19,096,603,200	7.19
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	137,377	118,330.10 16,255,834,641	107,900.00 14,822,978,300	5.58
3	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	138,698	101,068.66 14,018,022,106	90,200.00 12,510,559,600	4.71
4	野村不動産マスターF	日本	投資証券	85,621	151,202.24 12,946,087,280	137,700.00 11,790,011,700	4.44
5	KDX不動産投資法人	日本	投資証券	74,832	154,542.00 11,564,687,160	149,500.00 11,187,384,000	4.21
6	GLP投資法人	日本	投資証券	89,846	135,128.57 12,140,762,239	123,400.00 11,086,996,400	4.18
7	日本プロロジスリート	日本	投資証券	46,596	267,755.64 12,476,342,176	222,900.00 10,386,248,400	3.91
8	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	147,371	58,073.25 8,558,313,070	66,200.00 9,755,960,200	3.68

9	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	39,889	235,181.83 9,381,168,201	231,800.00 9,246,270,200	3.48
10	オリックス不動産投資	日本	投資証券	53,295	155,475.95 8,286,090,852	164,100.00 8,745,709,500	3.29
11	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	59,401	140,297.92 8,333,836,789	140,800.00 8,363,660,800	3.15
12	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	26,287	336,149.58 8,836,364,188	292,400.00 7,686,318,800	2.90
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	98,265	68,629.73 6,743,901,313	70,600.00 6,937,509,000	2.61
14	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	80,376	80,353.83 6,458,520,073	77,300.00 6,213,064,800	2.34
15	三井不ロジパーク	日本	投資証券	58,304.94	108,254.92 6,311,797,353	101,500.00 5,917,951,816	2.23
16	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	18,293	352,775.63 6,453,324,612	315,500.00 5,771,441,500	2.17
17	産業ファンド	日本	投資証券	48,974	120,748.00 5,913,512,785	114,900.00 5,627,112,600	2.12
18	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	9,236	658,381.27 6,080,809,461	587,000.00 5,421,532,000	2.04
19	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	34,244	144,786.71 4,958,076,180	142,100.00 4,866,072,400	1.83
20	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	17,972	277,305.17 4,983,728,613	263,200.00 4,730,230,400	1.78
21	ＡＰＩ投資法人	日本	投資証券	13,001	326,026.70 4,238,673,243	328,500.00 4,270,828,500	1.61
22	イオンリート投資	日本	投資証券	32,811	135,026.70 4,430,361,323	126,700.00 4,157,153,700	1.57
23	森ヒルズリート	日本	投資証券	31,453	127,183.56 4,000,304,679	123,900.00 3,897,026,700	1.47
24	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	49,622	86,537.49 4,294,163,452	77,700.00 3,855,629,400	1.45
25	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	13,543	331,568.96 4,490,438,481	277,900.00 3,763,599,700	1.42
26	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	39,505	101,989.12 4,029,080,581	89,100.00 3,519,895,500	1.33
27	NTT都市開発リート投資法人	日本	投資証券	27,187	116,411.23 3,164,872,257	119,600.00 3,251,565,200	1.23
28	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	23,635	140,160.11 3,312,684,357	137,300.00 3,245,085,500	1.22

29	三菱地所物流REIT	日本	投資証券	9,236	374,273.23 3,456,787,593	346,500.00 3,200,274,000	1.21
30	森トラストリート投資法人	日本	投資証券	51,557	64,871.65 3,344,587,897	61,600.00 3,175,911,200	1.20

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	96.55%
合計	96.55%

(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。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
不動産投信指数先物取引	日本	TREIT　先物 0703月	買建	5,600	9,004,856,000	9,153,200,000	3.45%

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

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

（参考情報）運用実績

●FW J-REITインデックス

2024年12月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	12,391円
純資産総額	138億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.0%
3カ月間	-3.2%
6カ月間	-1.8%
1年間	-4.4%
3年間	-10.0%
5年間	-7.1%
設定来	23.9%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

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

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

主要な資産の状況　　※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	種別構成	比率	組入上位10銘柄	種別名	比率
国内リート	57	96.5%	各種不動産投資信託	29.6%	日本ビルファンド	オフィス不動産投資信託	7.2%
国内リート 先物	1	3.4%	オフィス不動産投資信託	23.8%	ジャパンリアルエステイト	オフィス不動産投資信託	5.6%
			工業用不動産投資信託	18.4%	日本都市ファンド投資法人	店舗用不動産投資信託	4.7%
			店舗用不動産投資信託	8.6%	野村不動産マスターF	各種不動産投資信託	4.4%
			集合住宅用不動産投資信託	8.2%	KDX不動産投資法人	各種不動産投資信託	4.2%
			ホテル・リゾート不動産投資信託	7.6%	GLP投資法人	工業用不動産投資信託	4.2%
			ヘルスケア不動産投資信託	0.3%	日本プロロジスリート	工業用不動産投資信託	3.9%
					インヴィンシブル投資法人	ホテル・リゾート不動産投資信託	3.7%
					大和ハウスリート投資法人	各種不動産投資信託	3.5%
コール・ローン、その他		3.5%			TREIT　先物 0703月	-	3.4%
合計	58	-	合計	96.5%	合計		44.8%

※種別構成は、原則としてS&PとMSCI Inc.が共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証REIT指数（配当込み）です。

・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2016年※は設定日（9月26日）から年末、2024年は12月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）】

(1) 【投資状況】（2024年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	21,255,011,001	100.00
内 日本	21,255,011,001	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	△757,441	△0.00
純資産総額	21,254,253,560	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】（2024年12月30日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	24,400,196,305	0.8456 20,633,474,907	0.8711 21,255,011,001	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	100.00%
合計	100.00%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	5,285,588,386	5,285,588,386	0.9844	0.9844
第2計算期間末 (2018年6月15日)	8,688,426,682	8,688,426,682	0.9722	0.9722
第3計算期間末 (2019年6月17日)	10,895,667,977	10,895,667,977	1.0760	1.0760
第4計算期間末 (2020年6月15日)	12,056,922,582	12,056,922,582	0.9117	0.9117
第5計算期間末 (2021年6月15日)	17,785,453,405	17,785,453,405	1.2187	1.2187
第6計算期間末 (2022年6月15日)	16,269,529,050	16,269,529,050	1.0481	1.0481
第7計算期間末 (2023年6月15日)	18,252,096,148	18,252,096,148	1.0021	1.0021
2023年12月末日	20,999,187,029	―	1.0584	―
2024年1月末日	20,093,381,712	―	1.0045	―
2月末日	20,230,102,421	―	0.9980	―
3月末日	21,290,079,260	―	1.0282	―
4月末日	19,902,501,724	―	0.9673	―
5月末日	20,292,025,142	―	0.9765	―
第8計算期間末 (2024年6月17日)	20,782,102,925	20,782,102,925	0.9952	0.9952
6月末日	20,942,548,447	―	0.9934	―
7月末日	21,953,542,102	―	1.0571	―
8月末日	22,931,646,536	―	1.0927	―
9月末日	23,789,901,204	―	1.1281	―
10月末日	23,126,923,298	―	1.1076	―
11月末日	23,605,727,752	―	1.1242	―
12月末日	21,254,253,560	―	1.0287	―

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000

第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
2024年6月18日～ 2024年12月17日	―

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	△1.6
第2計算期間	△1.2
第3計算期間	10.7
第4計算期間	△15.3
第5計算期間	33.7
第6計算期間	△14.0
第7計算期間	△4.4
第8計算期間	△0.7
2024年6月18日～ 2024年12月17日	7.1

(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	5,609,575,520	250,487,506
第2計算期間	4,660,565,456	1,092,724,304
第3計算期間	3,628,593,466	2,439,154,634
第4計算期間	5,683,570,118	2,585,491,447
第5計算期間	4,211,375,221	2,841,924,781
第6計算期間	5,111,449,724	4,182,934,798
第7計算期間	5,389,055,347	2,696,863,327
第8計算期間	6,627,669,356	3,958,936,952
2024年6月18日～ 2024年12月17日	2,613,606,027	2,970,260,687

(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（2024年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券		403,044,617	1.51
	内 アメリカ	403,044,617	1.51
投資証券		26,498,004,453	99.35
	内 ガーンジィ	38,114,699	0.14
	内 韓国	46,846,376	0.18
	内 香港	232,395,993	0.87
	内 シンガポール	854,592,314	3.20
	内 イスラエル	38,729,545	0.15
	内 イギリス	1,077,933,854	4.04
	内 アイルランド	8,846,863	0.03
	内 オランダ	32,017,342	0.12
	内 ベルギー	198,254,017	0.74
	内 フランス	399,300,487	1.50
	内 ドイツ	7,533,664	0.03
	内 スペイン	97,014,152	0.36
	内 イタリア	2,741,538	0.01
	内 カナダ	337,348,895	1.26
	内 アメリカ	21,044,780,170	78.91
	内 オーストラリア	2,057,802,591	7.72
	内 ニュージーランド	23,751,953	0.09
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△230,824,392	△0.87
純資産総額		26,670,224,678	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）		1,303,981,380	4.89
	内 ドイツ	223,888,795	0.84
	内 アメリカ	1,080,092,585	4.05
為替予約取引（売建）		29,732,918,527	△111.48
	内 日本	29,732,918,527	△111.48

(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（2024年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	107,511	19,558.00 2,102,716,171	16,646.86 1,789,720,909	6.71
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	11,200	133,488.26 1,495,069,330	149,109.95 1,670,031,539	6.26
3	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	68,668	18,685.17 1,283,075,601	19,772.50 1,357,738,030	5.09
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	36,195	24,003.81 868,818,236	28,178.18 1,019,909,413	3.82
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	35,601	24,928.06 887,468,014	27,208.54 968,651,297	3.63
6	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	18,294	51,137.37 935,507,235	47,153.45 862,625,361	3.23
7	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	236,727	3,484.63 824,914,089	3,633.66 860,186,614	3.23
8	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	101,595	9,545.68 969,811,716	8,329.75 846,261,845	3.17
9	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	16,489	33,899.39 558,968,371	34,986.25 576,888,316	2.16
10	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	24,607	26,496.25 651,994,435	23,424.87 576,415,929	2.16
11	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	34,065	17,279.58 588,629,617	16,564.60 564,273,426	2.12
12	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	122,369	5,018.41 614,102,771	4,577.72 560,172,144	2.10
13	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	48,697	9,316.96 453,712,829	9,315.22 453,623,278	1.70
14	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	39,632	11,296.74 447,713,392	11,322.52 448,734,287	1.68
15	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	28,710	15,024.25 431,346,499	14,038.47 403,044,617	1.51
16	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	66,134	5,562.39 367,864,835	5,077.57 335,800,543	1.26
17	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	7,460	45,384.53 338,568,701	44,991.13 335,633,885	1.26
18	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	13,568	24,324.44 330,035,014	24,320.17 329,976,134	1.24

19	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	78,248	3,496.88 273,631,871	3,696.66 289,256,768	1.08
20	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	18,055	17,973.04 324,505,413	15,557.00 280,881,689	1.05
21	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	13,900	20,882.76 290,271,312	19,560.53 271,891,489	1.02
22	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	81,192	3,456.07 280,609,251	3,176.25 257,886,447	0.97
23	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	アメリカ	投資証券	31,852	7,865.34 250,531,430	7,568.91 241,085,017	0.90
24	UDR INC	アメリカ	投資証券	34,855	6,643.24 231,554,204	6,866.59 239,335,127	0.90
25	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	22,177	11,294.84 250,486,227	10,534.78 233,629,993	0.88
26	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	81,144	2,571.69 208,684,467	2,843.28 230,715,559	0.87
27	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	12,384	18,995.99 235,247,844	18,227.08 225,724,176	0.85
28	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	644,344	338.74 218,277,261	347.70 224,041,631	0.84
29	REGENCY CENTERS CORP	アメリカ	投資証券	18,962	11,136.03 211,164,161	11,697.41 221,806,307	0.83
30	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	159,462	1,792.57 285,876,155	1,379.20 219,931,362	0.82

(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	1.51%
投資証券	99.35%
合計	100.87%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
不動産投信指数先物取引	アメリカ	DOW JONES US REAL ESTATE MAR 25	買建	191	1,127,489,972	1,080,092,585	4.05%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE MAR 25	買建	216	223,973,577	223,888,795	0.84%
為替予約取引	日本	米ドル売/円買 2025年1月	売建	150,870,800	22,544,756,971	23,831,551,568	△89.36%
		ユーロ売/円買 2025年1月	売建	5,194,300	819,147,343	855,851,305	△3.21%
		香港ドル売/円買 2025年1月	売建	12,634,000	242,656,184	257,077,895	△0.96%
		豪ドル売/円買 2025年1月	売建	21,680,700	2,104,600,780	2,132,548,340	△8.00%
		カナダ・ドル売/円買 2025年1月	売建	3,498,300	373,094,744	383,635,822	△1.44%
		シンガポール・ドル売/円買 2025年1月	売建	7,696,500	858,121,267	895,845,662	△3.36%
		ニュージーランド・ドル売/円買 2025年1月	売建	364,200	32,118,178	32,434,377	△0.12%
		英ポンド売/円買 2025年1月	売建	6,553,000	1,243,049,054	1,302,224,610	△4.88%
		イスラエル・シュケル売/円買 2025年1月	売建	973,800	40,052,394	41,748,948	△0.16%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

2024年12月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,287円
純資産総額	212億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	−8.5%
3カ月間	−8.8%
6カ月間	3.6%
1年間	−2.8%
3年間	−23.9%
5年間	−7.0%
設定来	2.9%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

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

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

主要な資産の状況　　※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国リート・先物	290	104.2%
外国投資信託等	2	1.5%
コール・ローン、その他		−0.9%
合計	292	−

国・地域別構成	比率
アメリカ	84.5%
オーストラリア	7.7%
イギリス	4.0%
シンガポール	3.2%
その他	6.3%
合計	105.8%

通貨別構成	比率
日本円	107.4%
韓国ウォン	0.3%
ユーロ	0.1%
イスラエル・シュケル	0.0%
ニュージーランド・ドル	0.0%
香港ドル	0.0%
シンガポール・ドル	−0.0%
カナダ・ドル	−0.1%
豪ドル	−0.3%
その他	−7.4%
合計	100.0%

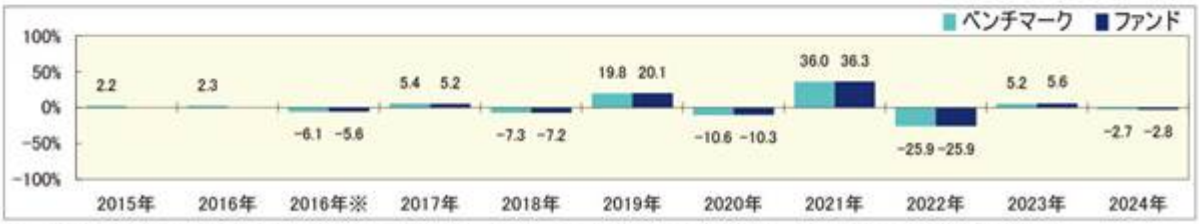
リート用途別構成	比率
小売	19.5%
産業用	15.7%
住宅	14.5%
ヘルスケア	12.2%
データセンター	10.3%
倉庫	8.9%
ダイバーシファイド	7.5%
オフィススペース	4.4%
特殊	3.8%
その他	2.7%
合計	99.3%

組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
PROLOGIS INC	産業用	アメリカ	6.7%
EQUINIX INC	データセンター	アメリカ	6.3%
WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	5.1%
DOW JONES US REAL ESTATE MAR 25	−	アメリカ	4.0%
DIGITAL REALTY TRUST INC	データセンター	アメリカ	3.8%
SIMON PROPERTY GROUP INC	小売	アメリカ	3.6%
PUBLIC STORAGE	倉庫	アメリカ	3.2%
GOODMAN GROUP	産業用	オーストラリア	3.2%
REALTY INCOME CORP	小売	アメリカ	3.2%
AVALONBAY COMMUNITIES INC	住宅	アメリカ	2.2%
合計			41.4%

※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

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



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2016年※は設定日（9月26日）から年末、2024年は12月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）】

(1) 【投資状況】（2024年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	9,175,715,364	100.00
内 日本	9,175,715,364	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	232,804	0.00
純資産総額	9,175,948,168	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】（2024年12月30日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,241,752,062	3.8497 8,630,189,470	4.0931 9,175,715,364	100.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	100.00%
合計	100.00%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	609,843,907	609,843,907	1.0729	1.0729
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,189,127,891	1,189,127,891	1.0864	1.0864
第3計算期間末 (2019年6月17日)	1,667,702,163	1,667,702,163	1.1931	1.1931
第4計算期間末 (2020年6月15日)	2,091,937,862	2,091,937,862	1.0120	1.0120
第5計算期間末 (2021年6月15日)	3,226,829,877	3,226,829,877	1.4252	1.4252
第6計算期間末 (2022年6月15日)	3,454,275,087	3,454,275,087	1.4737	1.4737
第7計算期間末 (2023年6月15日)	4,650,947,962	4,650,947,962	1.5400	1.5400
2023年12月末日	6,161,706,461	－	1.7120	－
2024年1月末日	6,220,072,467	－	1.6958	－
2月末日	6,353,715,449	－	1.7252	－
3月末日	6,743,129,540	－	1.7926	－
4月末日	6,824,056,091	－	1.7586	－
5月末日	7,158,505,586	－	1.7865	－
第8計算期間末 (2024年6月17日)	7,453,636,072	7,453,636,072	1.8320	1.8320
6月末日	7,697,758,472	－	1.8717	－
7月末日	8,035,064,074	－	1.9009	－
8月末日	8,278,389,696	－	1.8909	－
9月末日	8,615,917,339	－	1.9387	－
10月末日	9,158,288,327	－	2.0424	－
11月末日	9,362,201,844	－	2.0379	－
12月末日	9,175,948,168	－	1.9632	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000

第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
2024年6月18日～ 2024年12月17日	―

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	7.3
第2計算期間	1.3
第3計算期間	9.8
第4計算期間	△15.2
第5計算期間	40.8
第6計算期間	3.4
第7計算期間	4.5
第8計算期間	19.0
2024年6月18日～ 2024年12月17日	8.1

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
第1計算期間	593,727,416	35,333,000
第2計算期間	637,956,340	111,827,964
第3計算期間	579,621,490	276,337,306
第4計算期間	1,036,279,306	366,994,605
第5計算期間	758,967,899	561,930,084
第6計算期間	709,209,320	629,454,617
第7計算期間	1,053,030,359	376,743,698
第8計算期間	1,871,437,793	823,067,892
2024年6月18日～ 2024年12月17日	1,005,482,549	450,367,207

(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（2024年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券		1,169,404,968	2.41
	内 アメリカ	1,169,404,968	2.41
投資証券		45,980,596,214	94.74
	内 ガーンジィ	64,537,239	0.13
	内 韓国	74,209,961	0.15
	内 香港	400,803,882	0.83
	内 シンガポール	1,462,102,253	3.01
	内 イスラエル	65,161,614	0.13
	内 イギリス	1,884,279,250	3.88
	内 アイルランド	13,358,296	0.03
	内 オランダ	52,096,823	0.11
	内 ベルギー	335,240,995	0.69
	内 フランス	686,244,707	1.41
	内 ドイツ	12,486,370	0.03
	内 スペイン	166,474,234	0.34
	内 イタリア	3,909,646	0.01
	内 カナダ	578,406,097	1.19
	内 アメリカ	36,591,851,397	75.39
	内 オーストラリア	3,548,765,058	7.31
	内 ニュージーランド	40,668,392	0.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,385,754,381	2.86
純資産総額		48,535,755,563	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）		1,436,275,772	2.96
	内 ドイツ	373,147,992	0.77
	内 アメリカ	1,063,127,780	2.19
為替予約取引（買建）		537,788,422	1.11
	内 日本	537,788,422	1.11

(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（2024年12月30日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	187,400	18,404.24 3,448,984,718	16,646.86 3,119,622,164	6.43
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	19,506	154,857.42 3,020,649,077	149,109.95 2,908,538,856	5.99
3	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	119,635	21,744.53 2,601,414,249	19,772.50 2,365,483,038	4.87
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	63,004	30,837.50 1,942,886,464	28,178.18 1,775,338,380	3.66
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	62,030	28,983.79 1,797,873,247	27,208.54 1,687,745,848	3.48
6	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	31,803	54,821.23 1,743,482,762	47,153.45 1,499,621,425	3.09
7	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	408,653	3,725.86 1,522,585,017	3,633.66 1,484,908,103	3.06
8	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	177,116	9,127.61 1,616,650,730	8,329.75 1,475,333,560	3.04
9	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	83,300	15,261.20 1,271,261,087	14,038.47 1,169,404,968	2.41
10	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	28,697	37,157.43 1,066,308,297	34,986.25 1,004,000,485	2.07
11	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	42,821	26,924.60 1,152,942,726	23,424.87 1,003,076,624	2.07
12	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	59,313	19,471.00 1,154,892,856	16,564.60 982,496,689	2.02
13	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	213,300	5,135.47 1,095,403,460	4,577.72 976,429,638	2.01
14	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	84,845	10,095.68 856,569,400	9,315.22 790,349,858	1.63
15	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	69,057	12,097.92 835,454,500	11,322.52 781,899,567	1.61
16	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	115,225	5,407.22 623,052,236	5,077.57 585,063,925	1.21
17	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	12,967	48,965.56 634,938,288	44,991.13 583,400,079	1.20
18	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	23,591	25,912.73 611,310,742	24,320.17 573,737,248	1.18

19	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	136,385	4,034.06 550,186,176	3,696.66 504,169,874	1.04
20	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	31,460	17,377.33 546,693,617	15,557.00 489,423,314	1.01
21	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	24,207	19,960.41 483,182,688	19,560.53 473,501,963	0.98
22	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	141,540	3,470.78 491,261,935	3,176.25 449,567,048	0.93
23	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	アメリカ	投資証券	55,436	8,142.31 451,380,227	7,568.91 419,590,261	0.86
24	UDR INC	アメリカ	投資証券	60,760	7,241.63 440,010,983	6,866.59 417,214,239	0.86
25	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	38,566	11,243.59 433,623,703	10,534.78 406,284,634	0.84
26	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	141,386	2,912.88 411,858,030	2,843.28 402,000,764	0.83
27	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	21,568	19,840.20 427,916,350	18,227.08 393,121,692	0.81
28	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	1,112,672	362.38 403,265,903	347.70 386,881,618	0.80
29	REGENCY CENTERS CORP	アメリカ	投資証券	33,007	11,947.49 394,354,466	11,697.41 386,096,445	0.80
30	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	279,635	1,551.95 433,993,685	1,379.20 385,674,997	0.79

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	2.41%
投資証券	94.74%
合計	97.14%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
不動産投信指数先物取引	アメリカ	DOW JONES US REAL ESTATE MAR 25	買建	188	1,116,450,701	1,063,127,780	2.19%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE MAR 25	買建	360	377,907,055	373,147,992	0.77%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2025年1月	買建	2,330,000	351,544,637	368,078,000	0.76%
		ユーロ買/円売 2025年1月	買建	1,030,000	162,423,687	169,710,422	0.35%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

2024年12月30日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	19,632円
純資産総額	91億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-3.7%
3カ月間	1.3%
6カ月間	4.9%
1年間	14.7%
3年間	20.3%
5年間	56.1%
設定来	96.3%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

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

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国リート・先物	291	97.7%
外国投資信託等	2	2.4%
コール・ローン、その他		2.9%
合計	293	-

国・地域別構成	比率
アメリカ	80.0%
オーストラリア	7.3%
イギリス	3.9%
シンガポール	3.0%
その他	5.9%
合計	100.1%

通貨別構成	比率
米ドル	79.8%
豪ドル	7.3%
英ポンド	4.2%
ユーロ	3.3%
シンガポール・ドル	2.9%
カナダ・ドル	1.3%
香港ドル	0.9%
韓国ウォン	0.2%
イスラエル・シュケル	0.2%
その他	0.0%
合計	100.0%

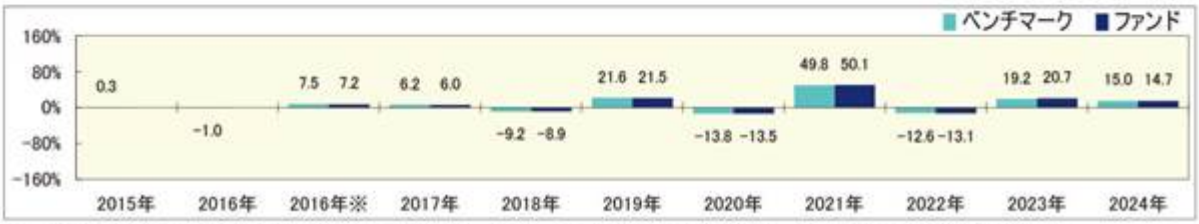
リート用途別構成	比率
小売	18.6%
産業用	15.0%
住宅	13.9%
ヘルスケア	11.6%
データセンター	9.9%
倉庫	8.5%
ダイバーシファイド	7.1%
オフィススペース	4.1%
特殊	3.6%
その他	2.5%
合計	94.7%

組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
PROLOGIS INC	産業用	アメリカ	6.4%
EQUINIX INC	データセンター	アメリカ	6.0%
WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	4.9%
DIGITAL REALTY TRUST INC	データセンター	アメリカ	3.7%
SIMON PROPERTY GROUP INC	小売	アメリカ	3.5%
PUBLIC STORAGE	倉庫	アメリカ	3.1%
GOODMAN GROUP	産業用	オーストラリア	3.1%
REALTY INCOME CORP	小売	アメリカ	3.0%
VANGUARD REAL ESTATE ETF	-	アメリカ	2.4%
DOW JONES US REAL ESTATE MAR 25	-	アメリカ	2.2%
合計			38.2%

※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欄を表示していません。

年間収益率の推移

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



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2016年※は設定日（9月26日）から年末、2024年は12月30日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

（参考情報）ファンドの総経費率

	総経費率(①+②)	運用管理費用の比率 ①	その他費用の比率 ②
ダイワファンドラップ TOPIXインデックス	0.35%	0.34%	0.00%
ダイワファンドラップ 日経225インデックス	0.35%	0.34%	0.00%
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)	0.47%	0.45%	0.02%
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)	0.47%	0.45%	0.02%
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)	0.55%	0.46%	0.10%
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	0.16%	0.15%	0.00%
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)	0.43%	0.42%	0.01%
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)	0.44%	0.42%	0.02%
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)	0.47%	0.43%	0.04%
ダイワファンドラップ J-REITインデックス	0.35%	0.34%	0.00%
ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)	0.48%	0.43%	0.05%
ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)	0.48%	0.43%	0.05%

※対象期間は2023年6月16日～2024年6月17日です。
※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。）を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した値（年率）です。
※詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧下さい。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

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

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

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

ただし、販売会社は、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付けを行ないません。

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

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

＜FW 日本債券インデックス＞

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

＜「FW 日本債券インデックス」以外のファンド＞

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

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

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

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

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

2【換金（解約）手続等】

＜FW 日本債券インデックス＞

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

＜「FW 日本債券インデックス」以外のファンド＞

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

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

＜一部解約＞

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

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

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

解約価額は、各ファンドについて後掲の別表Ｂに掲げる価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止（「FW ＴＯＰＩＸインデックス」、「FW 日経２２５インデックス」、「FW 日本債券インデックス」および「FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス」を除きます。）その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等*）があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、上記に準じて算出した価額とします。

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

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

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

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

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

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

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

［別表Ｂ］

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

３【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

*「FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス」は除きます。

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

3. 価格情報会社の提供する価額

・不動産投資信託証券：原則として金融商品取引所における計算日の最終相場で評価します。

・海外の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算時において知り得る直近の日の最終相場で評価します。

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

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

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

(5)【その他】

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合、特定の指数が改廃された場合（「FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）」および「FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）」を除きます。）、もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

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

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

② 信託約款の変更等

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

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

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

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

③ 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

④ 運用報告書

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

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

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

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

⑤ 公告

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

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

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

⑥ 関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

＜収益分配金および償還金にかかる請求権＞

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

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

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

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

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

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

＜換金請求権＞

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

第３ 【ファンドの経理状況】

【ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2023年6月16日から2024年6月17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】

ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	33,512,392	48,219,241
親投資信託受益証券	19,885,366,153	25,393,167,933
流動資産合計	19,918,878,545	25,441,387,174
資産合計	19,918,878,545	25,441,387,174
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,205,465	5,342,110
未払受託者報酬	1,835,424	2,605,967
未払委託者報酬	26,614,314	37,787,180
その他未払費用	458,793	651,404
流動負債合計	32,113,996	46,386,661
負債合計	32,113,996	46,386,661
純資産の部		
元本等		
元本	※1 10,176,374,027	※1 10,829,538,359
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	9,710,390,522	14,565,462,154
（分配準備積立金）	5,064,169,009	7,213,805,976
元本等合計	19,886,764,549	25,395,000,513
純資産合計	19,886,764,549	25,395,000,513
負債純資産合計	19,918,878,545	25,441,387,174

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期 自　2022年6月16日 至　2023年6月15日	第8期 自　2023年6月16日 至　2024年6月17日
営業収益		
受取利息	8	10,721
有価証券売買等損益	4,089,754,572	4,077,801,780
営業収益合計	4,089,754,580	4,077,812,501
営業費用		
支払利息	11,150	5,817
受託者報酬	3,540,394	4,809,651
委託者報酬	51,336,963	69,741,328
その他費用	884,959	1,202,247
営業費用合計	55,773,466	75,759,043
営業利益又は営業損失（△）	4,033,981,114	4,002,053,458
経常利益又は経常損失（△）	4,033,981,114	4,002,053,458
当期純利益又は当期純損失（△）	4,033,981,114	4,002,053,458
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（△）	203,990,652	494,333,546
期首剰余金又は期首欠損金（△）	5,141,570,050	9,710,390,522
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,761,500,330	4,407,245,589
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,761,500,330	4,407,245,589
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,022,670,320	3,059,893,869
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,022,670,320	3,059,893,869
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	9,710,390,522	14,565,462,154

(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8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日
1．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2024年6月15日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2024年6月17日としております。このため、当計算期間は368日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	第7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
1．　※1 期首元本額	9,440,492,072円	10,176,374,027円
期中追加設定元本額	2,583,526,613円	3,825,653,131円
期中一部解約元本額	1,847,644,658円	3,172,488,799円
2．　計算期間末日における受益権の総数	10,176,374,027口	10,829,538,359口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第7期 自2022年6月16日 至2023年6月15日	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日

※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（3,334,144,496円）、投資信託約款に規定される収益調整金（4,646,231,876円）及び分配準備積立金（1,730,024,513円）より分配対象額は9,710,400,885円（1万口当たり9,542.10円）であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（5,877円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（3,507,706,443円）、投資信託約款に規定される収益調整金（7,351,656,178円）及び分配準備積立金（3,706,093,656円）より分配対象額は14,565,462,154円（1万口当たり13,449.75円）であり、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	第8期 2024年6月17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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	3,968,016,068	3,732,492,992
合計	3,968,016,068	3,732,492,992

(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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17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8期 自2023年6月16日 至2024年6月17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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.9542円 (19,542円)	2.3450円 (23,450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	12,952,393,743	25,393,167,933	
親投資信託受益証券 合計			25,393,167,933	
合計			25,393,167,933	

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

	2023年6月15日現在 金 額（円）	2024年6月17日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		

コール・ローン		9,847,640,355	13,587,748,333
株式	※2※3	246,890,055,590	343,000,160,660
派生商品評価勘定		158,655,300	-
未収入金		43,048	10,915,000
未収配当金		1,741,868,748	2,265,208,148
未収利息		219,298	-
前払金		-	89,950,000
その他未収収益	※4	33,476,156	19,964,962
差入委託証拠金		-	11,887,237
流動資産合計		258,671,958,495	358,985,834,340
資産合計		258,671,958,495	358,985,834,340
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		44,400	249,710,050
前受金		174,345,000	-
未払金		-	5,061,600
未払解約金		117,376,660	50,517,570
受入担保金		5,397,399,408	7,592,342,003
流動負債合計		5,689,165,468	7,897,631,223
負債合計		5,689,165,468	7,897,631,223
純資産の部			
元本等			
元本	※1	155,385,420,480	179,077,569,301
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）		97,597,372,547	172,010,633,816
元本等合計		252,982,793,027	351,088,203,117
純資産合計		252,982,793,027	351,088,203,117
負債純資産合計		258,671,958,495	358,985,834,340

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2024年6月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023年6月15日現在	2024年6月17日現在
1.　※1 期首	2022年6月16日	2023年6月16日
期首元本額	144,235,597,142円	155,385,420,480円
期中追加設定元本額	24,516,960,234円	39,993,423,771円
期中一部解約元本額	13,367,136,896円	16,301,274,950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	2,763,331,050円	2,805,279,280円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	4,549,268,951円	4,071,973,852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	914,313円	907,848円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	15,842,998円	9,102,808円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	232,173,822円	139,851,291円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	14,489,300円	11,667,234円

ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	458,537,106円	344,658,301円
国内株式ファンド（適格機関投資家専用）	-円	1,209,547,484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）	582,804,567円	725,039,138円
Ｄ－Ｉ's ＴＯＰＩＸインデックス	13,712,330円	12,953,393円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	229,391,516円	240,654,595円
ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	6,660,285,892円	8,054,701,433円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	4,433,279,381円	4,637,002,543円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	853,672,461円	1,099,589,540円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	33,003円	3,602,255円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	69,999,592,782円	71,150,512,428円
ダイワ・ライフ・バランス３０	3,190,866,818円	2,999,401,241円
ダイワ・ライフ・バランス５０	4,808,803,528円	4,894,560,071円
ダイワ・ライフ・バランス７０	5,092,334,666円	5,901,383,202円
年金ダイワ日本株式インデックス	7,112,802,899円	7,735,661,770円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	52,526,177円	46,288,571円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	71,291,017円	72,209,078円
ダイワつみたてインデックス日本株式	3,604,211,746円	5,724,760,722円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	12,632,163円	12,074,009円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	10,199,775円	11,970,580円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	30,561,440円	30,025,521円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	5,506,825,594円	17,911,277,269円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	68,265,420円	46,931,794円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	24,867,151円	19,120,292円

ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	4,335,922,285円	3,211,199,892円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	414,580,439円	316,893,779円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	59,675,537円	40,650,926円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	91,079,592円	59,424,894円
ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	209,652,121円	240,955,317円
ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	12,213,848,138円	12,952,393,743円
ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	3,507,075,117円	9,075,948,646円
ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	3,544,218,031円	3,363,788,425円
スタイル9（4資産分散・保守型）	-円	318,862円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	-円	2,618,805円
スタイル9（4資産分散・積極型）	-円	3,657,307円
スタイル9（6資産分散・保守型）	-円	193,671円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	-円	4,615,927円
スタイル9（6資産分散・積極型）	-円	5,822,082円
スタイル9（8資産分散・保守型）	-円	258,358円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	-円	3,813,320円
スタイル9（8資産分散・積極型）	-円	11,114,936円
ダイワ・インデックスセレクト ＴＯＰＩＸ	1,174,135,074円	1,057,446,757円
ダイワライフスタイル２５	116,204,199円	92,819,702円
ダイワライフスタイル５０	519,385,919円	440,379,096円
ダイワライフスタイル７５	418,052,331円	381,811,643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）	8,388,073,831円	7,888,735,670円

計	155,385,420,480円	179,077,569,301円
2. 期末日における受益権の総数	155,385,420,480口	179,077,569,301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 5,180,231,870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 7,145,926,840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 1,143,110,000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 731,860,000円
5. ※4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年6月16日 至2024年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年6月17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	2023年6月15日現在	2024年6月17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	36,794,494,621	32,396,981,321
合計	36,794,494,621	32,396,981,321

（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	2023年6月15日現在				2024年6月17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	5,846,285,000	-	6,005,040,000	158,755,000	8,087,635,000	-	7,838,085,000	△249,550,000
合計	5,846,285,000	-	6,005,040,000	158,755,000	8,087,635,000	-	7,838,085,000	△249,550,000

（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6月15日現在	2024年6月17日現在
１口当たり純資産額	1.6281円	1.9605円
（1万口当たり純資産額）	(16,281円)	(19,605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	5,200	3,865.00	20,098,000	
ニッスイ	126,400	849.30	107,351,520	
マルハニチロ	18,700	3,102.00	58,007,400	
雪国まいたけ	10,800	982.00	10,605,600	貸付株式数　2,200株
カネコ種苗	3,600	1,399.00	5,036,400	
サカタのタネ	14,400	3,355.00	48,312,000	貸付株式数　5,600株
ホクト	10,100	1,863.00	18,816,300	
ホクリヨウ	700	995.00	696,500	貸付株式数　200株
ショーボンドＨＤ	17,200	5,748.00	98,865,600	
ミライト・ワン	38,200	2,012.50	76,877,500	
タマホーム	7,900	3,775.00	29,822,500	貸付株式数　3,100株
サンヨーホームズ	500	753.00	376,500	貸付株式数　100株 (100株)

日本アクア	1,700	927.00	1,575,900	
ファーストコーポレーション	1,200	743.00	891,600	貸付株式数 400株
ベステラ	1,000	1,005.00	1,005,000	貸付株式数 300株 (300株)
キャンディル	700	618.00	432,600	貸付株式数 200株
住石ホールディングス	16,100	1,321.00	21,268,100	貸付株式数 6,400株
日鉄鉱業	5,100	5,040.00	25,704,000	
三井松島HLDGS	7,500	4,685.00	35,137,500	貸付株式数 3,000株
ＩＮＰＥＸ	424,700	2,268.00	963,219,600	
石油資源開発	14,700	6,350.00	93,345,000	
K&Oエナジーグループ	5,700	4,170.00	23,769,000	
リョーサン菱洋HD	17,100	3,070.00	52,497,000	
ダイセキ環境ソリューション	800	969.00	775,200	貸付株式数 300株
第一カッター興業	3,600	1,541.00	5,547,600	
明豊ファシリティワークス	1,500	880.00	1,320,000	
安藤・間	73,200	1,091.00	79,861,200	
東急建設	39,500	752.00	29,704,000	
コムシスホールディングス	40,400	3,087.00	124,714,800	
ビーアールホールディングス	18,500	357.00	6,604,500	貸付株式数 6,700株
高松コンストラクションGP	9,400	2,881.00	27,081,400	
東建コーポレーション	3,200	12,130.00	38,816,000	
ソネック	400	941.00	376,400	貸付株式数 100株
ヤマウラ	6,400	1,275.00	8,160,000	貸付株式数 2,400株
オリエンタル白石	46,600	342.00	15,937,200	
大成建設	81,000	5,754.00	466,074,000	
大 林 組	316,400	1,773.00	560,977,200	
清水建設	250,900	836.00	209,752,400	
飛島建設	9,100	1,442.00	13,122,200	
長谷工コーポレーシヨン	81,100	1,710.50	138,721,550	
松井建設	8,300	828.00	6,872,400	
錢 高 組	500	4,220.00	2,110,000	貸付株式数 100株
鹿島建設	196,100	2,669.00	523,390,900	
不動テトラ	6,100	2,541.00	15,500,100	
大末建設	1,200	1,690.00	2,028,000	
鉄建建設	6,300	2,515.00	15,844,500	
西松建設	16,900	4,378.00	73,988,200	
三井住友建設	65,800	392.00	25,793,600	

大豊建設	3,100	3,375.00	10,462,500	
佐田建設	1,800	723.00	1,301,400	貸付株式数 700株
ナカノフドー建設	2,000	502.00	1,004,000	
奥 村 組	14,300	4,840.00	69,212,000	
東鉄工業	11,000	3,110.00	34,210,000	
イチケン	700	2,502.00	1,751,400	
富士ピー・エス	1,300	452.00	587,600	貸付株式数 500株
淺沼組	6,500	3,600.00	23,400,000	
戸田建設	119,800	1,041.00	124,711,800	
熊 谷 組	14,600	3,515.00	51,319,000	
北野建設	500	3,580.00	1,790,000	
植 木 組	800	1,614.00	1,291,200	
矢作建設	12,000	1,545.00	18,540,000	
ピーエス三菱	11,200	985.00	11,032,000	
日本ハウスHLDGS	18,900	315.00	5,953,500	貸付株式数 6,500株
大東建託	32,500	16,435.00	534,137,500	
新日本建設	12,400	1,583.00	19,629,200	
サムティホールディングス	13,800	2,473.00	34,127,400	
東亜道路	17,300	1,200.00	20,760,000	
日本道路	10,400	1,729.00	17,981,600	
東亜建設	26,700	1,018.00	27,180,600	
日本国土開発	25,400	447.00	11,353,800	貸付株式数 10,000株
若築建設	3,100	3,475.00	10,772,500	
東洋建設	22,200	1,382.00	30,680,400	
五洋建設	125,400	629.30	78,914,220	
世紀東急	11,300	1,660.00	18,758,000	貸付株式数 4,100株
福 田 組	3,300	5,530.00	18,249,000	
日本ドライケミカル	700	2,577.00	1,803,900	貸付株式数 100株
住友林業	76,400	5,380.00	411,032,000	
日本基礎技術	1,800	704.00	1,267,200	
巴コーポレーション	3,700	806.00	2,982,200	
大和ハウス	244,700	4,000.00	978,800,000	
ライト工業	17,600	2,037.00	35,851,200	
積水ハウス	268,300	3,423.00	918,390,900	
日特建設	8,400	1,090.00	9,156,000	
北陸電気工事	6,100	1,163.00	7,094,300	貸付株式数 2,100株
ユアテック	19,500	1,549.00	30,205,500	
日本リーテック	6,900	1,186.00	8,183,400	
四電工	3,700	3,540.00	13,098,000	
中電工	13,800	3,090.00	42,642,000	

関 電 工	55,400	1,675.00	92,795,000	
きんでん	61,500	3,350.00	206,025,000	
東京エネシス	8,300	1,334.00	11,072,200	
トーエネック	2,900	5,900.00	17,110,000	
住友電設	8,400	3,895.00	32,718,000	
日本電設工業	16,600	1,884.00	31,274,400	
エクシオグループ	86,500	1,569.00	135,718,500	
新日本空調	5,700	4,055.00	23,113,500	
九電工	19,100	5,780.00	110,398,000	
三機工業	19,100	2,103.00	40,167,300	
日揮ホールディングス	87,500	1,221.50	106,881,250	
中外炉工業	2,900	3,215.00	9,323,500	
ヤマト	2,500	963.00	2,407,500	
太平電業	5,500	5,520.00	30,360,000	
高砂熱学	23,700	6,150.00	145,755,000	
三晃金属	400	4,335.00	1,734,000	
NECネッツエスアイ	35,300	2,309.00	81,507,700	
朝日工業社	8,300	1,358.00	11,271,400	
明星工業	17,100	1,250.00	21,375,000	
大 氣 社	10,200	5,090.00	51,918,000	
ダイダン	11,600	3,190.00	37,004,000	
日比谷総合設備	6,400	3,535.00	22,624,000	貸付株式数 2,500株
ニップン	26,600	2,248.00	59,796,800	貸付株式数 10,200株
日清製粉Ｇ本社	82,100	1,791.00	147,041,100	
日東富士製粉	1,600	7,570.00	12,112,000	
昭和産業	8,600	3,095.00	26,617,000	
鳥越製粉	2,700	683.00	1,844,100	
中部飼料	12,400	1,528.00	18,947,200	
フィード・ワン	13,000	936.00	12,168,000	
東洋精糖	500	1,600.00	800,000	
日本甜菜糖	5,200	2,113.00	10,987,600	
DM三井製糖ホールディ	8,800	3,370.00	29,656,000	
塩水港精糖	3,900	272.00	1,060,800	貸付株式数 1,400株
ウェルネオシュガー	4,400	2,339.00	10,291,600	
ＬＩＦＵＬＬ	22,400	164.00	3,673,600	貸付株式数 8,800株
ＭＩＸＩ	19,900	2,862.00	56,953,800	
ジェイエイシーリクルートメント	33,400	645.00	21,543,000	
日本M&Aセンターホールデ	147,800	795.90	117,634,020	
メンバーズ	3,200	873.00	2,793,600	貸付株式数 800株

中広	500	486.00	243,000		
ＵＴグループ	12,100	2,839.00	34,351,900		
アイティメディア	3,500	1,907.00	6,674,500	貸付株式数	100株
ケアネット	19,000	538.00	10,222,000		
E・Jホールディングス	5,400	1,790.00	9,666,000	貸付株式数	1,800株
オープンアップグループ	27,900	1,946.00	54,293,400		
コシダカホールディングス	27,800	851.00	23,657,800	貸付株式数	10,800株
アルトナー	1,300	1,907.00	2,479,100	貸付株式数	400株
パソナグループ	11,200	2,180.00	24,416,000		
ＣＤＳ	800	1,807.00	1,445,600		
リンクアンドモチベーション	26,700	460.00	12,282,000	貸付株式数	7,900株
エス・エム・エス	32,500	2,043.00	66,397,500		
サニーサイドアップG	1,100	656.00	721,600		
パーソルホールディングス	944,000	210.30	198,523,200		
リニカル	1,900	394.00	748,600		
クックパッド	25,400	192.00	4,876,800	貸付株式数	10,100株
エスクリ	1,200	281.00	337,200	貸付株式数	400株
アイ・ケイ・ケイホールディンク	1,500	785.00	1,177,500	貸付株式数	600株 (400株)
森永製菓	37,500	2,498.00	93,675,000		
中 村 屋	2,200	3,230.00	7,106,000	貸付株式数	600株
江崎グリコ	25,400	4,206.00	106,832,400		
名糖産業	3,500	1,875.00	6,562,500		
井村屋グループ	5,300	2,442.00	12,942,600		
不 二 家	6,100	2,564.00	15,640,400	貸付株式数	2,200株
山崎製パン	59,400	3,440.00	204,336,000		
第一屋製パン	600	677.00	406,200	貸付株式数	200株
モロゾフ	2,900	4,555.00	13,209,500	貸付株式数	1,000株
亀田製菓	5,100	4,105.00	20,935,500		
寿スピリッツ	42,000	1,877.50	78,855,000		
カルビー	40,700	3,075.00	125,152,500		
森永乳業	31,000	3,248.00	100,688,000		
六甲バター	6,500	1,485.00	9,652,500	貸付株式数	2,500株
ヤクルト	126,900	2,815.00	357,223,500		
明治ホールディングス	108,900	3,472.00	378,100,800		
雪印メグミルク	21,500	2,478.00	53,277,000		
プリマハム	12,000	2,378.00	28,536,000		
日本ハム	38,200	4,634.00	177,018,800		
林兼産業	1,000	530.00	530,000	貸付株式数	300株

丸大食品	9,000	1,680.00	15,120,000		
Ｓ Ｆｏｏｄｓ	9,800	2,853.00	27,959,400		
柿安本店	3,400	2,545.00	8,653,000	貸付株式数	1,300株
伊藤ハム米久HLDGS	13,600	4,160.00	56,576,000		
学情	4,700	1,869.00	8,784,300	貸付株式数	200株
スタジオアリス	4,600	2,135.00	9,821,000	貸付株式数	1,800株 (800株)
クロスキャット	5,700	1,366.00	7,786,200	貸付株式数	1,800株
エプコ	800	818.00	654,400		
システナ	137,100	294.00	40,307,400		
ＮＪＳ	2,000	3,900.00	7,800,000	貸付株式数	800株
デジタルアーツ	5,700	3,845.00	21,916,500		
日鉄ソリューションズ	15,400	5,130.00	79,002,000		
綜合警備保障	155,000	941.80	145,979,000		
キューブシステム	4,800	1,127.00	5,409,600	貸付株式数	600株
いちご	90,200	378.00	34,095,600		
日本駐車場開発	105,700	198.00	20,928,600	貸付株式数	42,200株
コア	4,000	1,873.00	7,492,000		
カカクコム	60,200	2,008.50	120,911,700		
アイロムグループ	3,700	2,789.00	10,319,300		
セントケア・ホールディング	6,800	827.00	5,623,600	貸付株式数	2,000株
サイネックス	500	731.00	365,500		
ルネサンス	7,200	960.00	6,912,000	貸付株式数	2,700株
ディップ	14,200	2,614.00	37,118,800		
SBSホールディングス	8,000	2,679.00	21,432,000	貸付株式数	600株
デジタルホールディングス	4,800	1,043.00	5,006,400		
新日本科学	8,400	1,354.00	11,373,600	貸付株式数	3,200株
キャリアデザインセンター	600	1,757.00	1,054,200	貸付株式数	200株
エムスリー	183,300	1,476.50	270,642,450		
ツカダ・グローバルHOLD	1,900	462.00	877,800	貸付株式数	600株
ブラス	400	680.00	272,000	貸付株式数	100株
ウェルネット	2,700	635.00	1,714,500	貸付株式数	1,000株
ワールドホールディングス	4,200	2,129.00	8,941,800	貸付株式数	400株
ディー・エヌ・エー	32,900	1,535.50	50,517,950		
博報堂ＤＹHLDGS	118,300	1,094.00	129,420,200		
ぐるなび	17,200	322.00	5,538,400	貸付株式数	6,800株
タカミヤ	12,500	487.00	6,087,500	貸付株式数	3,100株
ファンコミュニケーションズ	12,800	412.00	5,273,600		

ライク	3,400	1,505.00	5,117,000	貸付株式数	1,300株 (1,200株)
Ａｏｂａ－ＢＢＴ	1,100	348.00	382,800	貸付株式数	400株
エスプール	26,700	314.00	8,383,800	貸付株式数	10,000株
WDBホールディングス	4,700	1,841.00	8,652,700	貸付株式数	1,800株
手間いらず	1,500	3,000.00	4,500,000	貸付株式数	500株
ティア	2,000	459.00	918,000	貸付株式数	700株
ＣＤＧ	300	1,320.00	396,000	貸付株式数	100株
アドウェイズ	12,700	388.00	4,927,600		
バリューコマース	8,200	1,215.00	9,963,000		
インフォマート	96,300	309.00	29,756,700		
サッポロホールディングス	29,200	5,615.00	163,958,000		
アサヒグループホールディン	205,200	5,630.00	1,155,276,000		
キリンＨＤ	370,000	2,068.00	765,160,000		
宝ホールディングス	60,000	1,063.00	63,780,000		
オエノンホールディングス	26,600	367.00	9,762,200	貸付株式数	2,800株
養 命 酒	2,900	2,276.00	6,600,400		
コカ・コーラボトラーズJHD	69,600	1,927.50	134,154,000		
サントリー食品インター	62,500	5,684.00	355,250,000		
ダイドーグループHD	10,100	2,675.00	27,017,500	貸付株式数	4,000株
伊 藤 園	30,100	3,419.00	102,911,900		
キーコーヒー	9,900	2,054.00	20,334,600	貸付株式数	3,700株
ユニカフェ	1,000	918.00	918,000	貸付株式数	300株
ジャパンフーズ	500	1,992.00	996,000	貸付株式数	100株
日清オイリオグループ	12,500	4,765.00	59,562,500		
不二製油グループ	20,700	2,832.50	58,632,750		
かどや製油	400	3,650.00	1,460,000		
Ｊ－オイルミルズ	10,200	1,937.00	19,757,400		
サンエー	7,300	4,840.00	35,332,000	貸付株式数	1,300株
カワチ薬品	7,500	2,810.00	21,075,000		
エービーシー・マート	41,800	2,809.50	117,437,100		
ハードオフコーポレーション	3,800	2,143.00	8,143,400		
高千穂交易	3,400	3,800.00	12,920,000	貸付株式数	1,300株
アスクル	23,000	2,175.00	50,025,000	貸付株式数	2,100株
ゲオホールディングス	10,700	1,563.00	16,724,100		
アダストリア	11,500	3,480.00	40,020,000		
ジーフット	2,500	287.00	717,500	貸付株式数	1,000株

シー・ヴイ・エス・ベイエリア	400	635.00	254,000	貸付株式数	100株
オルバヘルスケアHLDGS	500	2,135.00	1,067,500	貸付株式数	200株 (200株)
伊藤忠食品	2,200	7,240.00	15,928,000		
くら寿司	11,200	4,300.00	48,160,000	貸付株式数	4,400株
キャンドゥ	3,400	3,165.00	10,761,000	貸付株式数	1,200株
エレマテック	8,500	1,984.00	16,864,000		
IKホールディングス	1,100	386.00	424,600	貸付株式数	400株
パルグループHLDGS	18,700	1,782.00	33,323,400		
エディオン	37,800	1,578.00	59,648,400		
あらた	14,600	3,375.00	49,275,000		
サーラコーポレーション	20,100	800.00	16,080,000		
ワッツ	1,400	687.00	961,800	貸付株式数	500株
トーメンデバイス	1,400	7,680.00	10,752,000		
ハローズ	4,300	4,250.00	18,275,000		
JPホールディングス	23,700	540.00	12,798,000	貸付株式数	1,200株
フジオフードG本社	10,700	1,479.00	15,825,300	貸付株式数	4,200株 (300株)
あみやき亭	2,300	6,080.00	13,984,000	貸付株式数	800株
東京エレクトロンデバイス	9,500	4,140.00	39,330,000		
ひらまつ	7,300	210.00	1,533,000	貸付株式数	2,900株
円谷フィールズホールディ	16,400	1,720.00	28,208,000	貸付株式数	6,400株
双日	106,200	3,838.00	407,595,600		
アルフレッサホールディングス	95,800	2,120.00	203,096,000		
大黒天物産	2,900	8,410.00	24,389,000	貸付株式数	1,100株
ハニーズホールディングス	8,500	1,582.00	13,447,000	貸付株式数	3,300株
ファーマライズHD	700	640.00	448,000	貸付株式数	200株
キッコーマン	294,300	1,811.00	532,977,300		
味 の 素	211,100	5,744.00	1,212,558,400		
ブルドックソース	4,700	1,947.00	9,150,900		
キユーピー	47,700	3,156.00	150,541,200		
ハウス食品G本社	30,600	2,887.00	88,342,200		
カ ゴ メ	38,200	3,340.00	127,588,000		
アリアケジャパン	8,900	5,170.00	46,013,000		
ピエトロ	400	1,794.00	717,600	貸付株式数	100株
エバラ食品工業	2,100	2,898.00	6,085,800	貸付株式数	200株
やまみ	400	3,390.00	1,356,000	貸付株式数	100株
ニチレイ	40,700	3,616.00	147,171,200		

横浜冷凍	24,000	1,016.00	24,384,000		
東洋水産	44,900	9,638.00	432,746,200		
イートアンドHLDGS	4,200	2,105.00	8,841,000	貸付株式数	1,400株
大冷	400	1,912.00	764,800		
ヨシムラ・フード・HLDGS	4,000	1,797.00	7,188,000	貸付株式数	1,400株
日清食品ＨＤ	93,700	4,183.00	391,947,100		
永谷園ホールディングス	4,300	3,095.00	13,308,500	貸付株式数	1,600株
一正蒲鉾	1,300	767.00	997,100	貸付株式数	400株
フジッコ	9,100	1,850.00	16,835,000	貸付株式数	3,500株
ロックフィールド	10,800	1,416.00	15,292,800	貸付株式数	4,100株
日本たばこ産業	539,600	4,481.00	2,417,947,600		
ケンコーマヨネーズ	6,100	1,947.00	11,876,700		
わらべや日洋HD	5,900	2,282.00	13,463,800	貸付株式数	2,200株
なとり	5,600	2,121.00	11,877,600		
イフジ産業	600	1,382.00	829,200	貸付株式数	200株
ファーマフーズ	11,800	975.00	11,505,000	貸付株式数	4,600株
北の達人コーポ	38,300	182.00	6,970,600	貸付株式数	15,300株 (1,300株)
ユーグレナ	55,400	544.00	30,137,600	貸付株式数	22,100株
紀文食品	7,700	1,258.00	9,686,600		
ピックルスホールディングス	5,200	1,160.00	6,032,000	貸付株式数	1,900株
スター・マイカ・HLDGS	10,300	607.00	6,252,100		
SREホールディングス	3,800	4,640.00	17,632,000	貸付株式数	1,400株
ADワークスグループ	7,400	228.00	1,687,200	貸付株式数	100株
片倉工業	8,300	2,056.00	17,064,800		
グ ン ゼ	6,400	5,710.00	36,544,000		
ヒューリック	207,300	1,447.00	299,963,100		
神 栄	500	1,827.00	913,500	貸付株式数	100株
ラサ商事	4,300	1,741.00	7,486,300	貸付株式数	900株
アルペン	7,900	2,048.00	16,179,200	貸付株式数	3,000株
ハブ	1,000	869.00	869,000	貸付株式数	300株
ラクーンホールディングス	6,700	560.00	3,752,000		
クオールホールディングス	13,100	1,431.00	18,746,100		
アルコニックス	12,600	1,475.00	18,585,000		
神戸物産	73,800	3,459.00	255,274,200		
ソリトンシステムズ	4,700	1,139.00	5,353,300		
ジンズホールディングス	7,300	3,885.00	28,360,500	貸付株式数	2,800株
ビックカメラ	57,100	1,613.00	92,102,300	貸付株式数	19,600株
DCMホールディングス	49,400	1,468.00	72,519,200		

ペッパーフードサービス	24,100	127.00	3,060,700	
ハイパー	700	312.00	218,400	貸付株式数 200株
ＭｏｎｏｔａＲＯ	135,300	1,859.00	251,522,700	
東京一番フーズ	900	512.00	460,800	
ＤＤグループ	2,000	1,212.00	2,424,000	貸付株式数 800株
あい ホールディングス	15,300	2,402.00	36,750,600	
ディーブイエックス	900	1,001.00	900,900	
きちりホールディングス	900	914.00	822,600	貸付株式数 300株
Ｊ．フロント リテイリング	109,500	1,640.50	179,634,750	
ドトール・日レスＨＤ	16,900	2,179.00	36,825,100	
マツキヨココカラ&カンパニー	173,600	2,150.50	373,326,800	
ブロンコビリー	5,600	3,920.00	21,952,000	貸付株式数 2,100株
ＺＯＺＯ	60,800	3,816.00	232,012,800	
トレジャー・ファクトリー	5,900	1,771.00	10,448,900	
物語コーポレーション	15,900	3,430.00	54,537,000	貸付株式数 6,300株
三越伊勢丹ＨＤ	158,000	3,138.00	495,804,000	
東洋紡	39,200	1,030.00	40,376,000	
ユニチカ	29,400	275.00	8,085,000	貸付株式数 11,100株
富士紡ホールディングス	4,000	4,845.00	19,380,000	
日清紡ホールディングス	68,400	1,092.00	74,692,800	
倉敷紡績	6,400	4,855.00	31,072,000	
ダイワボウＨＤ	42,100	2,679.00	112,785,900	
シキボウ	5,800	1,084.00	6,287,200	貸付株式数 1,800株
日東紡績	11,500	6,530.00	75,095,000	
トヨタ紡織	38,000	2,073.00	78,774,000	
マクニカホールディングス	22,600	6,422.00	145,137,200	
Ｈａｍｅｅ	3,800	1,130.00	4,294,000	
マーケットエンタープライズ	300	910.00	273,000	
ラクト・ジャパン	3,700	2,926.00	10,826,200	貸付株式数 1,300株
ウエルシアＨＤ	49,500	1,993.50	98,678,250	
クリエイトＳＤＨ	13,500	3,545.00	47,857,500	貸付株式数 5,100株
グリムス	4,000	2,515.00	10,060,000	貸付株式数 1,500株
バイタルＫＳＫＨＤ	14,400	1,331.00	19,166,400	
八洲電機	7,700	1,593.00	12,266,100	
メディアスホールディングス	5,500	967.00	5,318,500	貸付株式数 2,000株
レスター	8,100	3,130.00	25,353,000	
ジオリーブグループ	700	1,190.00	833,000	

丸善CHI HD	3,900	338.00	1,318,200	貸付株式数	1,400株 (1,400株)
大光	1,700	609.00	1,035,300	貸付株式数	600株
OCHIホールディングス	700	1,441.00	1,008,700		
TOKAIホールディングス	51,700	956.00	49,425,200		
黒谷	900	684.00	615,600	貸付株式数	300株 (300株)
ミサワ	700	621.00	434,700		
ティーライフ	400	1,427.00	570,800	貸付株式数	100株
Ｃｏｍｉｎｉｘ	600	881.00	528,600		
エー・ピーホールディングス	800	952.00	761,600	貸付株式数	200株
三洋貿易	9,700	1,524.00	14,782,800		
チムニー	1,000	1,314.00	1,314,000	貸付株式数	300株
シュッピン	8,600	1,335.00	11,481,000		
ビューティガレージ	3,000	1,592.00	4,776,000	貸付株式数	1,200株
オイシックス・ラ・大地	12,800	1,183.00	15,142,400	貸付株式数	5,100株
ウイン・パートナーズ	6,100	1,182.00	7,210,200	貸付株式数	2,300株
ネクステージ	21,800	2,417.00	52,690,600	貸付株式数	8,700株 (300株)
ジョイフル本田	27,700	2,129.00	58,973,300	貸付株式数	10,600株
エターナルホスピタリティグル	3,500	3,675.00	12,862,500	貸付株式数	1,200株 (1,200株)
ホットランド	7,300	2,531.00	18,476,300	貸付株式数	2,900株
すかいらーくHD	130,500	2,271.00	296,365,500	貸付株式数	52,200株
SFPホールディングス	4,600	2,094.00	9,632,400	貸付株式数	1,600株
綿半ホールディングス	7,300	1,661.00	12,125,300		
日本毛織	23,200	1,314.00	30,484,800		
ダイトウボウ	4,700	102.00	479,400	貸付株式数	1,800株
トーア紡コーポレーション	1,100	431.00	474,100	貸付株式数	400株
ダイドーリミテツド	3,700	728.00	2,693,600	貸付株式数	1,400株
ヨシックスホールディングス	2,200	2,835.00	6,237,000		
ユナイテッド・スーパーマーケ	26,800	872.00	23,369,600	貸付株式数	10,600株
野村不動産HLDGS	49,500	3,940.00	195,030,000		
三重交通グループHD	18,900	589.00	11,132,100	貸付株式数	7,400株
地主	6,800	2,290.00	15,572,000	貸付株式数	2,600株
プレサンスコーポレーション	11,800	1,881.00	22,195,800	貸付株式数	4,500株

フィル・カンパニー	1,400	686.00	960,400	貸付株式数	500株
ハウスコム	500	1,038.00	519,000	貸付株式数	100株
ＪＰＭＣ	5,100	1,200.00	6,120,000		
サンセイランディック	900	1,007.00	906,300	貸付株式数	300株
エストラスト	300	707.00	212,100		
フージャースHD	13,700	1,143.00	15,659,100		
オープンハウスグループ	32,600	4,717.00	153,774,200		
東急不動産ＨＤ	267,100	1,051.00	280,722,100		
飯田ＧＨＤ	85,100	2,101.50	178,837,650		
イーグランド	400	1,543.00	617,200	貸付株式数	100株
帝国繊維	10,200	2,348.00	23,949,600	貸付株式数	3,900株
日本コークス工業	91,900	126.00	11,579,400	貸付株式数	17,800株
ゴルフダイジェスト・オン	4,300	549.00	2,360,700	貸付株式数	1,700株
ミタチ産業	900	1,073.00	965,700	貸付株式数	300株
ＢＥＥＮＯＳ	5,700	2,300.00	13,110,000		
あさひ	8,800	1,480.00	13,024,000	貸付株式数	1,800株
日本調剤	6,300	1,405.00	8,851,500	貸付株式数	2,300株
コスモス薬品	8,100	12,720.00	103,032,000	貸付株式数	3,000株
シップヘルスケアHD	34,300	2,281.50	78,255,450		
トーエル	1,400	814.00	1,139,600	貸付株式数	100株
ソフトクリエイトHD	7,400	2,002.00	14,814,800		
セブン&アイ・HLDGS	977,000	1,997.50	1,951,557,500		
クリエイト・レストランツ・ホール	64,600	1,118.00	72,222,800	貸付株式数	25,200株
明治電機工業	3,500	1,719.00	6,016,500		
ツルハホールディングス	20,000	9,049.00	180,980,000		
デリカフーズHLDGS	1,400	569.00	796,600		
スターティアホールディングス	800	2,103.00	1,682,400	貸付株式数	300株
サンマルクホールディングス	7,700	2,149.00	16,547,300		
フェリシモ	800	927.00	741,600	貸付株式数	200株
トリドールホールディングス	26,700	3,577.00	95,505,900	貸付株式数	10,600株
帝 人	86,800	1,397.50	121,303,000		
東 レ	605,500	731.80	443,104,900		
ク ラ レ	131,600	1,816.00	238,985,600		
旭 化 成	611,300	998.50	610,383,050		
TOKYO BASE	10,200	323.00	3,294,600	貸付株式数	3,800株
稲葉製作所	5,200	1,944.00	10,108,800	貸付株式数	2,000株

宮地エンジニアリングG	4,700	4,705.00	22,113,500		
トーカロ	26,800	1,909.00	51,161,200		
アルファCO	1,100	1,372.00	1,509,200		
ＳＵＭＣＯ	165,300	2,346.50	387,876,450		
川田テクノロジーズ	6,600	2,645.00	17,457,000		
RS TECHNOLOGIES	6,200	3,530.00	21,886,000		
ジェイテックコーポレーション	500	1,616.00	808,000	貸付株式数	200株
信和	2,000	741.00	1,482,000	貸付株式数	700株
ビーロット	2,000	901.00	1,802,000	貸付株式数	700株
ファーストブラザーズ	600	1,185.00	711,000		
AND DOホールディングス	5,300	1,144.00	6,063,200	貸付株式数	2,100株
シーアールイー	4,000	1,452.00	5,808,000		
ケイアイスター不動産	4,300	3,365.00	14,469,500	貸付株式数	1,700株
アグレ都市デザイン	500	1,567.00	783,500	貸付株式数	200株
ジェイ・エス・ビー	4,400	2,929.00	12,887,600		
ロードスターキャピタル	5,800	2,769.00	16,060,200		
テンポイノベーション	900	873.00	785,700	貸付株式数	300株
グロバルリンクマネジメント	600	2,148.00	1,288,800		
フェイスネットワーク	800	1,710.00	1,368,000	貸付株式数	300株
霞ヶ関キャピタル	3,600	14,020.00	50,472,000	貸付株式数	1,400株
住江織物	600	2,490.00	1,494,000	貸付株式数	200株 (200株)
日本フエルト	1,600	475.00	760,000		
イチカワ	400	1,774.00	709,600		
エコナックホールディングス	2,600	127.00	330,200	貸付株式数	1,000株
日東製網	300	1,476.00	442,800	貸付株式数	100株
芦森工業	600	2,426.00	1,455,600		
アツギ	2,100	650.00	1,365,000		
ウイルプラスHLDGS	600	1,135.00	681,000	貸付株式数	200株
JMホールディングス	7,200	2,769.00	19,936,800	貸付株式数	2,800株
コメダホールディングス	23,400	2,718.00	63,601,200		
サツドラホールディングス	1,300	890.00	1,157,000	貸付株式数	500株
アレンザホールディングス	7,100	1,098.00	7,795,800	貸付株式数	1,900株
串カツ田中HLDGS	2,500	1,665.00	4,162,500	貸付株式数	900株
バロックジャパン	7,300	797.00	5,818,100	貸付株式数	2,900株
クスリのアオキHLDGS	28,700	3,095.00	88,826,500		
ダイニック	1,000	814.00	814,000		

共和レザー	1,800	766.00	1,378,800		
ピーバンドットコム	400	378.00	151,200	貸付株式数	100株
力の源HD	5,500	1,461.00	8,035,500	貸付株式数	2,200株
FOOD&LIFE COMPAN	50,900	2,599.50	132,314,550		
アセンテック	3,700	559.00	2,068,300		
セーレン	17,400	2,442.00	42,490,800	貸付株式数	6,800株
ソトー	900	718.00	646,200	貸付株式数	300株
東海染工	300	832.00	249,600		
小松マテーレ	13,100	724.00	9,484,400		
ワコールホールディングス	18,500	4,391.00	81,233,500		
ホギメディカル	11,900	3,925.00	46,707,500		
クラウディアHLDGS	800	426.00	340,800	貸付株式数	300株
ＴＳＩホールディングス	27,100	920.00	24,932,000	貸付株式数	11,000株
マツオカコーポレーション	900	1,657.00	1,491,300		
ワールド	12,700	2,004.00	25,450,800		
ＴＩＳ	95,600	2,840.50	271,551,800		
テクミラホールディングス	1,300	395.00	513,500	貸付株式数	500株
グリー	30,200	530.00	16,006,000		
GMOペパボ	1,100	1,453.00	1,598,300	貸付株式数	400株
コーエーテクモHD	56,700	1,368.00	77,565,600	貸付株式数	22,100株
三菱総合研究所	4,400	4,740.00	20,856,000		
ボルテージ	800	257.00	205,600	貸付株式数	300株
電算	400	1,482.00	592,800	貸付株式数	100株
ＡＧＳ	1,200	996.00	1,195,200	貸付株式数	400株
ファインデックス	7,200	1,060.00	7,632,000		
ブレインパッド	7,500	1,050.00	7,875,000		
ＫＬａｂ	16,600	228.00	3,784,800	貸付株式数	6,600株
ポールトゥウィンホールディン	15,400	494.00	7,607,600		
ネクソン	198,500	2,906.00	576,841,000		
アイスタイル	30,200	504.00	15,220,800	貸付株式数	11,800株
エムアップホールディングス	11,100	1,340.00	14,874,000		
エイチーム	5,900	718.00	4,236,200	貸付株式数	2,000株
エニグモ	11,600	320.00	3,712,000	貸付株式数	4,600株
テクノスジャパン	2,700	636.00	1,717,200		
ｅｎｉｓｈ	3,200	271.00	867,200	貸付株式数	1,200株
コロプラ	30,700	621.00	19,064,700	貸付株式数	11,800株
オルトプラス	2,800	132.00	369,600	貸付株式数	1,100株

ブロードリーフ	42,900	536.00	22,994,400	貸付株式数	16,800株
クロス・マーケティングG	1,400	611.00	855,400	貸付株式数	500株
デジタルハーツHLDGS	5,600	1,065.00	5,964,000	貸付株式数	2,000株
メディアドゥ	4,100	1,459.00	5,981,900	貸付株式数	1,500株
じげん	26,400	617.00	16,288,800		
ブイキューブ	10,900	246.00	2,681,400	貸付株式数	4,000株
エンカレッジ・テクノロジ	700	626.00	438,200	貸付株式数	200株
サイバーリンクス	1,200	754.00	904,800	貸付株式数	400株
ディー・エル・イー	4,300	164.00	705,200		
フィックスターズ	9,100	1,895.00	17,244,500	貸付株式数	3,500株
CARTA HOLDINGS	4,200	1,591.00	6,682,200	貸付株式数	1,600株
オプティム	9,300	640.00	5,952,000	貸付株式数	3,600株
セレス	3,700	1,952.00	7,222,400	貸付株式数	1,400株
ＳＨＩＦＴ	6,000	15,245.00	91,470,000	貸付株式数	2,400株
特種東海製紙	4,900	3,595.00	17,615,500	貸付株式数	1,700株
ティーガイア	9,500	1,969.00	18,705,500		
セック	1,200	4,480.00	5,376,000		
テクマトリックス	16,500	1,914.00	31,581,000	貸付株式数	6,400株
プロシップ	4,300	1,399.00	6,015,700	貸付株式数	700株
ガンホー・オンライン・エンター	23,500	2,764.00	64,954,000		
GMOペイメントゲートウェイ	20,700	8,026.00	166,138,200		
ザッパラス	700	434.00	303,800	貸付株式数	100株
システムリサーチ	6,200	1,537.00	9,529,400	貸付株式数	700株
インターネットイニシアティブ	43,300	2,174.50	94,155,850		
さくらインターネット	10,100	4,950.00	49,995,000	貸付株式数	4,000株
GMOグローバルサインHD	2,800	3,010.00	8,428,000	貸付株式数	1,000株
SRAホールディングス	4,600	3,995.00	18,377,000		
システムインテグレータ	900	371.00	333,900	貸付株式数	300株
朝日ネット	9,700	642.00	6,227,400		
ｅＢＡＳＥ	12,800	703.00	8,998,400	貸付株式数	4,800株
アバントグループ	11,500	1,337.00	15,375,500		
アドソル日進	3,800	1,801.00	6,843,800		
ODKソリューションズ	600	572.00	343,200	貸付株式数	200株
フリービット	3,900	1,187.00	4,629,300	貸付株式数	1,500株
コムチュア	13,100	1,788.00	23,422,800		
アステリア	7,100	532.00	3,777,200	貸付株式数	2,700株
アイル	5,100	2,441.00	12,449,100		

王子ホールディングス	376,500	611.00	230,041,500		
日本製紙	51,000	954.00	48,654,000		
三菱製紙	4,100	807.00	3,308,700	貸付株式数	1,500株
北越コーポレーション	44,400	1,133.00	50,305,200	貸付株式数	17,700株
中越パルプ	1,200	1,529.00	1,834,800	貸付株式数	400株
巴川コーポレーション	800	978.00	782,400	貸付株式数	300株
大王製紙	40,000	866.40	34,656,000		
阿波製紙	800	527.00	421,600	貸付株式数	300株
マークラインズ	4,900	2,961.00	14,508,900		
メディカル・データ・ビジ	10,800	572.00	6,177,600	貸付株式数	4,300株
ｇｕｍｉ	14,700	322.00	4,733,400	貸付株式数	5,800株
ショーケース	700	299.00	209,300	貸付株式数	200株
モバイルファクトリー	600	659.00	395,400	貸付株式数	200株
テラスカイ	3,900	1,950.00	7,605,000	貸付株式数	1,500株
デジタル・インフォメーション	4,700	1,836.00	8,629,200		
PCIホールディングス	1,200	967.00	1,160,400	貸付株式数	200株
アイビーシー	500	457.00	228,500		
ネオジャパン	3,000	1,646.00	4,938,000		
ＰＲ ＴＩＭＥＳ	1,800	1,839.00	3,310,200	貸付株式数	700株
ラクス	42,800	1,894.50	81,084,600		
ランドコンピュータ	1,400	805.00	1,127,000		
ダブルスタンダード	2,800	1,681.00	4,706,800	貸付株式数	1,000株
オープンドア	5,300	626.00	3,317,800	貸付株式数	2,100株
マイネット	900	340.00	306,000	貸付株式数	300株
アカツキ	4,400	2,302.00	10,128,800		
ベネフィットジャパン	200	1,203.00	240,600		
UBICOMホールディングス	2,800	1,261.00	3,530,800	貸付株式数	1,100株
カナミックネットワーク	11,300	579.00	6,542,700		
ノムラシステムコーポレーション	3,200	131.00	419,200	貸付株式数	1,200株
レンゴー	82,300	999.50	82,258,850		
トーモク	5,200	2,707.00	14,076,400		
ザ・パック	6,700	3,560.00	23,852,000	貸付株式数	2,600株
チェンジホールディングス	19,700	1,157.00	22,792,900		
シンクロ・フード	1,900	507.00	963,300		
オークネット	3,300	2,580.00	8,514,000	貸付株式数	1,200株
キャピタル・アセット・プラン	600	841.00	504,600		

セグエグループ	2,700	606.00	1,636,200	貸付株式数	1,000株
エイトレッド	400	1,565.00	626,000		
マクロミル	17,800	876.00	15,592,800		
ビーグリー	600	1,066.00	639,600		
オロ	3,300	2,462.00	8,124,600	貸付株式数	1,200株
ユーザーローカル	3,800	1,969.00	7,482,200	貸付株式数	1,500株
テモナ	700	213.00	149,100	貸付株式数	200株
ニーズウェル	3,200	377.00	1,206,400		
マネーフォワード	20,200	5,128.00	103,585,600	貸付株式数	5,900株
サインポスト	1,200	695.00	834,000	貸付株式数	400株
レゾナック・ホールディングス	87,300	3,450.00	301,185,000		
住友化学	670,800	308.90	207,210,120		
住友精化	4,300	5,100.00	21,930,000		
日産化学	42,100	4,597.00	193,533,700		
ラサ工業	3,500	2,993.00	10,475,500		
クレハ	19,800	2,731.00	54,073,800		
多木化学	3,500	4,150.00	14,525,000	貸付株式数	1,300株
テイカ	7,400	1,661.00	12,291,400	貸付株式数	2,100株
石原産業	15,000	1,530.00	22,950,000		
片倉コープアグリ	700	1,141.00	798,700	貸付株式数	200株
日本曹達	10,700	5,010.00	53,607,000		
東ソー	120,600	2,034.50	245,360,700		
トクヤマ	29,200	2,920.50	85,278,600		
セントラル硝子	9,600	3,525.00	33,840,000		
東亞合成	43,500	1,479.50	64,358,250		
大阪ソーダ	6,300	10,670.00	67,221,000	貸付株式数	1,600株
関東電化	17,500	929.00	16,257,500		
SUN ASTERISK	6,400	866.00	5,542,400	貸付株式数	2,400株
デンカ	32,900	2,087.00	68,662,300		
イビデン	47,500	6,630.00	314,925,000		
信越化学	810,300	5,943.00	4,815,612,900		
日本カーバイド	4,300	1,928.00	8,290,400		
電算システムＨＤ	4,000	2,649.00	10,596,000	貸付株式数	1,500株
堺 化 学	6,900	2,731.00	18,843,900		
第一稀元素化学工	9,900	799.00	7,910,100	貸付株式数	3,800株
エア・ウォーター	85,300	2,144.50	182,925,850		
日本酸素HLDGS	87,700	4,543.00	398,421,100		
日本化学工業	3,300	2,519.00	8,312,700		
東邦アセチレン	3,200	362.00	1,158,400		

日本パーカライジング	40,300	1,223.00	49,286,900	
高圧ガス	13,300	940.00	12,502,000	貸付株式数 3,500株
チタン工業	400	1,005.00	402,000	貸付株式数 100株
四国化成ホールディンク	10,200	2,041.00	20,818,200	
戸田工業	2,100	2,033.00	4,269,300	貸付株式数 600株
ステラ ケミファ	4,900	4,185.00	20,506,500	
保土谷化学	2,800	5,530.00	15,484,000	
日本触媒	52,600	1,537.50	80,872,500	
大日精化	6,300	3,185.00	20,065,500	
カネカ	22,300	4,183.00	93,280,900	
協和キリン	109,300	2,717.50	297,022,750	
APPIER GROUP	31,000	1,268.00	39,308,000	
三菱瓦斯化学	66,000	3,039.00	200,574,000	
三井化学	74,500	4,337.00	323,106,500	
東京応化工業	43,100	4,475.00	192,872,500	
大阪有機化学	7,600	3,545.00	26,942,000	貸付株式数 3,000株
三菱ケミカルグループ	660,600	804.80	531,650,880	
ＫＨネオケム	13,800	2,215.00	30,567,000	
ビジョナル	10,600	7,150.00	75,790,000	貸付株式数 4,200株
ダイセル	116,200	1,539.50	178,889,900	
住友ベークライト	25,300	4,696.00	118,808,800	
積水化学	181,500	2,211.00	401,296,500	
日本ゼオン	61,900	1,383.50	85,638,650	
アイカ工業	22,800	3,459.00	78,865,200	
ＵＢＥ	43,000	2,684.50	115,433,500	
積水樹脂	13,500	2,320.00	31,320,000	
タキロンシーアイ	23,000	679.00	15,617,000	
旭有機材	6,000	4,815.00	28,890,000	貸付株式数 2,200株
ニチバン	4,900	1,880.00	9,212,000	
リケンテクノス	16,900	979.00	16,545,100	
大倉工業	4,200	2,786.00	11,701,200	
積水化成品	12,800	451.00	5,772,800	
群栄化学	2,100	3,175.00	6,667,500	
タイガース ポリマー	1,300	831.00	1,080,300	
ミライアル	1,000	1,546.00	1,546,000	貸付株式数 300株
ダイキアクシス	1,200	727.00	872,400	貸付株式数 400株
ダイキョーニシカワ	20,100	670.00	13,467,000	
竹本容器	1,100	871.00	958,100	
森六ホールディングス	4,700	2,731.00	12,835,700	
恵和	6,500	1,668.00	10,842,000	

日本化薬	69,100	1,206.50	83,369,150		
カーリットホールディングス	9,700	1,310.00	12,707,000		
ソルクシーズ	2,300	322.00	740,600	貸付株式数	900株
CLホールディングス	2,200	1,288.00	2,833,600	貸付株式数	800株
プレステージ・インター	43,400	652.00	28,296,800	貸付株式数	12,900株
フェイス	800	435.00	348,000	貸付株式数	300株
プロトコーポレーション	9,900	1,400.00	13,860,000		
ハイマックス	2,800	1,342.00	3,757,600		
アミューズ	5,700	1,625.00	9,262,500		
野村総合研究所	195,900	4,221.00	826,893,900		
ドリームインキュベータ	3,200	2,177.00	6,966,400		
クイック	6,400	2,095.00	13,408,000		
ＴＡＣ	1,500	180.00	270,000	貸付株式数	500株
ＣＥホールディングス	1,400	580.00	812,000		
日本システム技術	7,500	1,571.00	11,782,500		
電通グループ	91,100	3,916.00	356,747,600		
インテージホールディングス	10,200	1,411.00	14,392,200		
テイクアンドギヴニーズ	4,000	936.00	3,744,000	貸付株式数	800株
東邦システムサイエンス	3,800	1,605.00	6,099,000		
ぴあ	3,100	3,040.00	9,424,000	貸付株式数	500株
イオンファンタジー	3,300	2,300.00	7,590,000	貸付株式数	1,200株
ソースネクスト	41,400	194.00	8,031,600	貸付株式数	16,100株
シーティーエス	11,500	790.00	9,085,000		
NEXYZ.GROUP	1,000	604.00	604,000	貸付株式数	300株
インフォコム	11,700	5,740.00	67,158,000		
メディカルシステムネットワーク	10,300	579.00	5,963,700		
日本精化	6,000	2,534.00	15,204,000	貸付株式数	1,600株
扶桑化学工業	9,600	3,800.00	36,480,000		
トリケミカル	10,900	3,905.00	42,564,500		
シンプレクスＨＤ	13,700	2,791.00	38,236,700		
ＨＥＲＯＺ	3,600	1,222.00	4,399,200	貸付株式数	1,400株
ラクスル	21,900	960.00	21,024,000	貸付株式数	5,900株
メルカリ	44,100	2,094.00	92,345,400		
ＩＰＳ	2,600	2,187.00	5,686,200		
ＦＩＧ	3,400	330.00	1,122,000	貸付株式数	1,300株
システムサポート	3,500	1,713.00	5,995,500		
ＡＤＥＫＡ	31,500	3,179.00	100,138,500		

日油	81,800	2,040.00	166,872,000		
ミヨシ油脂	1,100	1,323.00	1,455,300		
新日本理化	4,400	180.00	792,000	貸付株式数	1,600株
ハリマ化成グループ	6,200	887.00	5,499,400		
イーソル	6,500	910.00	5,915,000	貸付株式数	2,500株
東海ソフト	500	1,290.00	645,000	貸付株式数	200株
ウイングアーク1ST	9,400	2,721.00	25,577,400		
ヒト・コミュニケーションズHD	3,000	881.00	2,643,000	貸付株式数	1,100株
サーバーワークス	1,900	3,215.00	6,108,500	貸付株式数	300株
東名	300	2,388.00	716,400	貸付株式数	100株
ヴィッツ	300	809.00	242,700	貸付株式数	100株
トビラシステムズ	900	785.00	706,500	貸付株式数	100株
Ｓａｎｓａｎ	29,700	1,683.00	49,985,100		
LINK-Uグループ	600	596.00	357,600		
ギフティ	7,900	1,109.00	8,761,100	貸付株式数	3,100株
花 王	204,300	6,756.00	1,380,250,800		
第一工業製薬	3,600	3,690.00	13,284,000		
石原ケミカル	4,000	2,035.00	8,140,000		
日華化学	1,200	1,107.00	1,328,400	貸付株式数	400株
ニイタカ	600	1,895.00	1,137,000	貸付株式数	200株
三洋化成	5,600	3,905.00	21,868,000		
メドレー	12,200	3,650.00	44,530,000	貸付株式数	3,800株
ベース	3,200	2,764.00	8,844,800	貸付株式数	1,000株
ＪＭＤＣ	15,400	3,374.00	51,959,600	貸付株式数	6,100株
武田薬品	800,700	4,167.00	3,336,516,900		
アステラス製薬	793,500	1,509.50	1,197,788,250		
住友ファーマ	67,200	349.00	23,452,800	貸付株式数	26,800株
塩野義製薬	110,000	6,147.00	676,170,000		
わかもと製薬	3,200	259.00	828,800		
日本新薬	23,700	3,212.00	76,124,400		
中外製薬	283,200	4,942.00	1,399,574,400		
科研製薬	15,500	3,756.00	58,218,000		
エーザイ	110,100	6,375.00	701,887,500		
理研ビタミン	7,700	2,574.00	19,819,800		
ロート製薬	87,600	3,132.00	274,363,200		
小野薬品	185,100	2,142.50	396,576,750		
久光製薬	20,100	3,728.00	74,932,800		
有機合成薬品	2,300	299.00	687,700	貸付株式数	600株
持田製薬	10,100	2,972.00	30,017,200	貸付株式数	2,100株

参天製薬	159,600	1,587.00	253,285,200	
扶桑薬品	3,200	2,277.00	7,286,400	
日本ケミファ	400	1,569.00	627,600	
ツムラ	28,500	4,063.00	115,795,500	
テ ル モ	502,900	2,574.50	1,294,716,050	
ＨＵグループＨＤ	27,200	2,492.00	67,782,400	
キッセイ薬品工業	15,000	3,145.00	47,175,000	
生化学工業	15,400	841.00	12,951,400	
栄研化学	15,600	2,084.00	32,510,400	
鳥居薬品	4,900	3,580.00	17,542,000	
ＪＣＲファーマ	30,700	587.00	18,020,900	
東和薬品	13,900	3,025.00	42,047,500	
富士製薬工業	6,700	1,463.00	9,802,100	
ゼリア新薬工業	12,500	2,058.00	25,725,000	
ネクセラファーマ	39,600	1,532.00	60,667,200	貸付株式数　15,800株
第一三共	788,200	5,400.00	4,256,280,000	
杏林製薬	19,600	1,695.00	33,222,000	
大幸薬品	18,800	398.00	7,482,400	貸付株式数　6,800株
ダイト	6,900	2,241.00	15,462,900	
大塚ホールディングス	188,200	6,257.00	1,177,567,400	
ペプチドリーム	43,900	2,257.00	99,082,300	
大日本塗料	10,000	1,266.00	12,660,000	
日本ペイントHOLD	479,800	1,043.00	500,431,400	
関西ペイント	78,100	2,563.00	200,170,300	
神東塗料	3,000	128.00	384,000	貸付株式数　900株
中国塗料	18,500	1,989.00	36,796,500	
日本特殊塗料	2,200	1,211.00	2,664,200	
藤倉化成	10,400	574.00	5,969,600	
太陽ホールディングス	15,700	3,210.00	50,397,000	
ＤＩＣ	35,300	3,162.00	111,618,600	
サカタインクス	20,100	1,828.00	36,742,800	
ARTIENCE	19,600	3,360.00	65,856,000	
アルプス技研	8,800	2,491.00	21,920,800	貸付株式数　1,100株
サニックス	14,800	297.00	4,395,600	
日本空調サービス	10,000	1,046.00	10,460,000	
オリエンタルランド	490,700	4,385.00	2,151,719,500	
フォーカスシステムズ	6,000	1,141.00	6,846,000	
ダスキン	20,200	3,679.00	74,315,800	
パーク２４	57,700	1,498.00	86,434,600	
明光ネットワークジャパン	11,200	736.00	8,243,200	貸付株式数　4,400株

ファルコホールディングス	4,100	2,295.00	9,409,500	
クレスコ	7,400	2,330.00	17,242,000	
フジ・メディア・HD	86,900	1,809.00	157,202,100	
秀英予備校	700	301.00	210,700	貸付株式数 200株
田谷	500	386.00	193,000	
ラウンドワン	87,400	793.00	69,308,200	
リゾートトラスト	40,300	2,351.00	94,745,300	
オービック	30,200	20,355.00	614,721,000	
ジャストシステム	13,000	2,900.00	37,700,000	
ＴＤＣソフト	16,900	1,040.00	17,576,000	
ＬＩＮＥヤフー	1,288,200	364.60	469,677,720	
ビー・エム・エル	11,400	2,767.00	31,543,800	
トレンドマイクロ	42,800	6,567.00	281,067,600	
IDホールディングス	6,100	1,418.00	8,649,800	
リソー教育	47,300	252.00	11,919,600	
日本オラクル	17,300	11,750.00	203,275,000	
早稲田アカデミー	5,100	1,585.00	8,083,500	貸付株式数 2,000株 (200株)
アルファシステムズ	2,400	3,000.00	7,200,000	
フューチャー	19,300	1,497.00	28,892,100	
CAC HOLDINGS	4,800	1,932.00	9,273,600	
トーセ	800	697.00	557,600	貸付株式数 100株
ユー・エス・エス	208,100	1,258.00	261,789,800	
オービックビジネスＣ	12,700	6,221.00	79,006,700	
アイティフォー	11,600	1,400.00	16,240,000	
東京個別指導学院	11,000	408.00	4,488,000	貸付株式数 4,200株
東計電算	2,500	3,715.00	9,287,500	
サイバーエージェント	205,000	974.30	199,731,500	
楽天グループ	795,900	786.00	625,577,400	貸付株式数 311,000株
エックスネット	400	1,488.00	595,200	貸付株式数 100株
クリーク・アンド・リバー社	4,700	1,756.00	8,253,200	
SBIグローバルアセット	18,100	647.00	11,710,700	
テー・オー・ダブリュー	18,100	363.00	6,570,300	
大塚商会	89,700	2,885.50	258,829,350	
サイボウズ	12,500	1,828.00	22,850,000	貸付株式数 4,800株
山田コンサルティングGP	4,000	1,929.00	7,716,000	
セントラルスポーツ	3,500	2,484.00	8,694,000	貸付株式数 1,300株
パラカ	2,800	2,012.00	5,633,600	
電通総研	11,000	5,330.00	58,630,000	

ＡＣＣＥＳＳ	9,400	1,394.00	13,103,600	貸付株式数 3,700株
デジタルガレージ	14,500	2,181.00	31,624,500	
イーエムシステムズ	15,100	627.00	9,467,700	
ウェザーニューズ	2,800	4,480.00	12,544,000	貸付株式数 1,100株
ＣＩＪ	22,500	452.00	10,170,000	
ビジネスエンジニアリング	1,900	3,480.00	6,612,000	
日本エンタープライズ	3,000	136.00	408,000	貸付株式数 1,100株
WOWOW	6,900	1,075.00	7,417,500	貸付株式数 2,500株
スカラ	8,200	715.00	5,863,000	
インテリジェント ウェイブ	1,600	1,022.00	1,635,200	
フルキャストホールディングス	8,900	1,500.00	13,350,000	
エン・ジャパン	15,100	2,570.00	38,807,000	
セルソース	3,300	1,345.00	4,438,500	貸付株式数 1,300株
あすか製薬ＨＤ	9,300	2,399.00	22,310,700	
サワイグループHD	20,700	5,650.00	116,955,000	
富士フイルムHLDGS	503,500	3,640.00	1,832,740,000	
コニカミノルタ	203,400	443.30	90,167,220	
資 生 堂	188,900	5,003.00	945,066,700	
ライオン	115,100	1,277.50	147,040,250	
高砂香料	6,800	3,665.00	24,922,000	
マンダム	19,500	1,209.00	23,575,500	
ミルボン	12,300	3,384.00	41,623,200	
ファンケル	39,600	2,774.50	109,870,200	
コーセー	18,400	11,115.00	204,516,000	
コタ	9,100	1,469.00	13,367,900	
シーボン	400	1,393.00	557,200	
ポーラ・オルビスHD	46,400	1,355.00	62,872,000	貸付株式数 17,200株
ノエビアホールディングス	8,100	5,400.00	43,740,000	
アジュバンホールディング	700	867.00	606,900	貸付株式数 200株 (200株)
新日本製薬	5,200	1,670.00	8,684,000	
アクシージア	5,900	1,013.00	5,976,700	貸付株式数 2,300株
エステー	7,000	1,543.00	10,801,000	
アグロカネショウ	3,600	1,188.00	4,276,800	
コ ニ シ	26,200	1,212.00	31,754,400	貸付株式数 5,600株
長谷川香料	17,300	3,085.00	53,370,500	貸付株式数 6,600株
小林製薬	26,300	5,609.00	147,516,700	貸付株式数 10,200株
荒川化学工業	7,800	1,130.00	8,814,000	
メック	7,400	4,425.00	32,745,000	貸付株式数 100株

日本高純度化学	2,000	3,155.00	6,310,000	
タカラバイオ	24,400	1,016.00	24,790,400	
ＪＣＵ	10,000	3,710.00	37,100,000	
新田ゼラチン	2,000	787.00	1,574,000	貸付株式数 700株
ＯＡＴアグリオ	3,300	1,585.00	5,230,500	貸付株式数 1,300株
デクセリアルズ	22,300	7,332.00	163,503,600	
アース製薬	8,200	4,765.00	39,073,000	貸付株式数 3,200株
北興化学	9,100	1,498.00	13,631,800	
大成ラミック	2,600	2,812.00	7,311,200	
クミアイ化学	35,800	776.00	27,780,800	
日本農薬	16,600	778.00	12,914,800	
富士興産	900	1,713.00	1,541,700	
ニチレキ	11,700	2,427.00	28,395,900	
ユシロ化学	4,700	1,834.00	8,619,800	
ビーピー・カストロール	1,100	978.00	1,075,800	
富士石油	26,300	541.00	14,228,300	
ＭＯＲＥＳＣＯ	1,100	1,341.00	1,475,100	貸付株式数 400株 (400株)
出光興産	469,800	1,059.00	497,518,200	
ENEOSホールディングス	1,432,400	807.00	1,155,946,800	
コスモエネルギーHLDGS	26,800	7,779.00	208,477,200	
テスホールディングス	19,100	417.00	7,964,700	貸付株式数 7,600株
インフロニアＨＤ	102,000	1,243.00	126,786,000	
横浜ゴム	45,700	3,544.00	161,960,800	
TOYO TIRE	51,900	2,564.50	133,097,550	
ブリヂストン	264,800	6,448.00	1,707,430,400	
住友ゴム	88,700	1,618.50	143,560,950	
藤倉コンポジット	7,800	1,388.00	10,826,400	
オカモト	4,300	4,845.00	20,833,500	
アキレス	5,700	1,591.00	9,068,700	
フ コ ク	4,700	2,430.00	11,421,000	
ニッタ	9,200	3,845.00	35,374,000	
クリエートメディック	1,000	984.00	984,000	
住友理工	14,000	1,328.00	18,592,000	
三ツ星ベルト	10,400	4,360.00	45,344,000	
バンドー化学	13,400	1,835.00	24,589,000	
ＡＧＣ	80,700	5,204.00	419,962,800	
日本板硝子	43,200	418.00	18,057,600	貸付株式数 16,800株
石塚硝子	500	2,856.00	1,428,000	貸付株式数 100株
有沢製作所	15,800	1,555.00	24,569,000	

日本山村硝子	1,100	1,668.00	1,834,800	貸付株式数	400株
日本電気硝子	36,900	3,636.00	134,168,400		
オハラ	4,300	1,305.00	5,611,500	貸付株式数	100株
住友大阪セメント	15,100	3,988.00	60,218,800		
太平洋セメント	53,500	3,988.00	213,358,000		
リソルホールディングス	300	4,720.00	1,416,000	貸付株式数	100株
日本ヒユーム	7,900	1,265.00	9,993,500	貸付株式数	2,900株
日本コンクリート	17,500	361.00	6,317,500		
三谷セキサン	3,800	5,870.00	22,306,000		
アジアパイルＨＤ	12,800	1,002.00	12,825,600		
東海カーボン	83,500	918.00	76,653,000		
日本カーボン	4,800	5,370.00	25,776,000		
東洋炭素	6,400	6,960.00	44,544,000		
ノリタケ	10,000	3,860.00	38,600,000		
ＴＯＴＯ	59,700	3,678.00	219,576,600		
日本碍子	105,200	1,993.50	209,716,200		
日本特殊陶業	75,800	4,610.00	349,438,000		
ダントーホールディングス	2,000	801.00	1,602,000	貸付株式数	800株
ＭＡＲＵＷＡ	3,300	37,800.00	124,740,000		
品川リフラクトリーズ	11,100	1,988.00	22,066,800		
黒崎播磨	7,400	2,827.00	20,919,800	貸付株式数	2,100株
ヨータイ	5,300	1,800.00	9,540,000		
東京窯業	3,200	430.00	1,376,000		
ニッカトー	1,400	556.00	778,400		
フジミインコーポレーテッド	24,300	2,858.00	69,449,400		
クニミネ工業	900	1,137.00	1,023,300	貸付株式数	300株
エーアンドエーマテリアル	600	1,320.00	792,000		
ニチアス	22,900	4,720.00	108,088,000		
日本製鉄	417,200	3,304.00	1,378,428,800		
神戸製鋼所	187,200	1,946.50	364,384,800		
中山製鋼所	21,300	930.00	19,809,000	貸付株式数	7,900株
合同製鐵	5,200	5,200.00	27,040,000		
ＪＦＥホールディングス	258,900	2,256.00	584,078,400		
東京製鐵	26,200	1,661.00	43,518,200		
共英製鋼	10,600	2,047.00	21,698,200		
大和工業	17,500	7,609.00	133,157,500		
東京鐵鋼	4,100	5,260.00	21,566,000		
大阪製鐵	4,300	2,361.00	10,152,300	貸付株式数	800株
淀川製鋼所	10,600	5,420.00	57,452,000		

中部鋼鈑	6,100	2,945.00	17,964,500	
丸一鋼管	28,300	3,717.00	105,191,100	
モリ工業	2,100	5,040.00	10,584,000	
大同特殊鋼	58,600	1,461.50	85,643,900	
日本高周波	1,200	453.00	543,600	貸付株式数 400株
日本冶金工	6,800	4,540.00	30,872,000	
山陽特殊製鋼	9,200	2,081.00	19,145,200	
愛知製鋼	5,400	3,615.00	19,521,000	
日本金属	800	739.00	591,200	貸付株式数 300株
ミガロホールディングス	400	4,960.00	1,984,000	貸付株式数 100株
大平洋金属	7,900	1,257.00	9,930,300	貸付株式数 2,200株
新日本電工	46,300	282.00	13,056,600	
栗本鉄工所	4,300	4,655.00	20,016,500	
虹 技	400	1,163.00	465,200	
日本鋳鉄管	300	1,542.00	462,600	貸付株式数 100株
日本製鋼所	25,100	4,297.00	107,854,700	
三菱製鋼	6,900	1,483.00	10,232,700	
日亜鋼業	3,300	321.00	1,059,300	
日本精線	7,300	1,196.00	8,730,800	貸付株式数 500株
エンビプロＨＤ	8,200	530.00	4,346,000	貸付株式数 3,200株
大紀アルミニウム	11,800	1,252.00	14,773,600	
日本軽金属ＨＤ	27,200	1,791.00	48,715,200	
三井金属	27,100	4,783.00	129,619,300	
東邦亜鉛	5,900	773.00	4,560,700	貸付株式数 2,300株
三菱マテリアル	66,500	2,853.00	189,724,500	
住友鉱山	107,900	4,688.00	505,835,200	
DOWAホールディングス	23,000	5,398.00	124,154,000	
古河機金	12,300	1,826.00	22,459,800	
エス・サイエンス	17,900	23.00	411,700	貸付株式数 7,100株
大阪チタニウム	16,100	2,804.00	45,144,400	貸付株式数 6,000株
東邦チタニウム	19,200	1,323.00	25,401,600	貸付株式数 7,600株
ＵＡＣＪ	13,000	3,925.00	51,025,000	
ＣＫサンエツ	2,300	3,655.00	8,406,500	貸付株式数 600株
古河電工	31,000	4,183.00	129,673,000	
住友電工	348,200	2,549.00	887,561,800	
フジクラ	109,800	3,273.00	359,375,400	
ＳＷＣＣ	10,400	4,775.00	49,660,000	
タツタ電線	16,400	769.00	12,611,600	貸付株式数 900株
カナレ電気	500	1,544.00	772,000	
平河ヒューテック	5,900	1,451.00	8,560,900	貸付株式数 1,500株

いよぎんホールディンク	105,700	1,389.00	146,817,300	
しずおかフィナンシャルク	197,400	1,429.50	282,183,300	
ちゅうぎんフィナンシャ	74,800	1,589.50	118,894,600	
楽天銀行	41,200	2,706.00	111,487,200	
京都フィナンシャルG	111,800	2,557.50	285,928,500	
リョービ	9,900	2,295.00	22,720,500	
アーレステイ	3,400	690.00	2,346,000	貸付株式数 1,300株
AREホールディングス	35,000	1,997.00	69,895,000	
東洋製罐グループHD	53,400	2,477.50	132,298,500	
ホッカンホールディングス	4,600	1,716.00	7,893,600	
コロナ	5,200	929.00	4,830,800	
横河ブリッジHLDGS	14,600	2,609.00	38,091,400	
駒井ハルテック	600	1,795.00	1,077,000	
高田機工	200	3,660.00	732,000	
三和ホールディングス	92,700	2,851.00	264,287,700	
文化シヤツター	24,300	1,670.00	40,581,000	貸付株式数 400株
三協立山	11,700	787.00	9,207,900	貸付株式数 3,500株
アルインコ	7,000	1,070.00	7,490,000	貸付株式数 1,100株
東洋シヤツター	700	943.00	660,100	貸付株式数 200株
ＬＩＸＩＬ	145,300	1,658.50	240,980,050	
日本フイルコン	2,000	517.00	1,034,000	貸付株式数 700株
ノーリツ	14,700	1,786.00	26,254,200	貸付株式数 900株
長府製作所	9,300	2,150.00	19,995,000	
リンナイ	44,500	3,725.00	165,762,500	
ユニプレス	16,200	1,354.00	21,934,800	
ダイニチ工業	1,600	673.00	1,076,800	貸付株式数 500株
日東精工	13,400	574.00	7,691,600	
三洋工業	300	3,255.00	976,500	
岡 部	16,500	755.00	12,457,500	
ジーテクト	11,800	1,873.00	22,101,400	
東 プ レ	16,400	2,165.00	35,506,000	
高周波熱錬	13,700	1,090.00	14,933,000	貸付株式数 2,600株
東京製綱	6,000	1,292.00	7,752,000	
サンコール	9,400	450.00	4,230,000	
モリテックスチル	2,800	229.00	641,200	貸付株式数 1,000株
パイオラックス	11,500	2,225.00	25,587,500	
エイチワン	9,600	920.00	8,832,000	貸付株式数 3,600株
日本発条	82,400	1,540.50	126,937,200	
中央発條	6,900	1,328.00	9,163,200	
アドバネクス	400	1,114.00	445,600	貸付株式数 100株

三浦工業	38,100	3,167.00	120,662,700		
タ ク マ	30,800	1,615.00	49,742,000		
テクノプロ・ホールディング	54,300	2,570.00	139,551,000		
アトラグループ	900	162.00	145,800	貸付株式数	100株
アイ・アールジャパンHD	4,800	1,230.00	5,904,000	貸付株式数	1,800株
ＫｅｅＰｅｒ技研	5,700	4,070.00	23,199,000	貸付株式数	2,200株
ファーストロジック	900	516.00	464,400	貸付株式数	300株
三機サービス	500	1,112.00	556,000		
Ｇｕｎｏｓｙ	7,300	773.00	5,642,900	貸付株式数	2,800株
デザインワン・ジャパン	1,000	149.00	149,000	貸付株式数	400株
イー・ガーディアン	4,400	1,932.00	8,500,800		
リブセンス	1,400	217.00	303,800	貸付株式数	500株
ジャパンマテリアル	28,400	1,948.00	55,323,200		
ベクトル	11,100	1,239.00	13,752,900	貸付株式数	4,200株
ウチヤマホールディングス	1,300	343.00	445,900	貸付株式数	500株 (400株)
チャームケアコーポレーション	7,700	1,599.00	12,312,300		
キャリアリンク	3,400	2,460.00	8,364,000		
ＩＢＪ	7,100	585.00	4,153,500	貸付株式数	2,600株
アサンテ	4,500	1,714.00	7,713,000	貸付株式数	1,700株
バリューＨＲ	8,100	1,491.00	12,077,100	貸付株式数	3,000株
M&Aキャピタルパートナー	7,500	2,099.00	15,742,500		
ライドオンエクスプレスHD	3,700	1,034.00	3,825,800		
ERIホールディングス	900	2,271.00	2,043,900	貸付株式数	300株
アビスト	500	3,260.00	1,630,000	貸付株式数	100株
シグマクシス・ホールディンク	12,200	1,518.00	18,519,600		
ウィルグループ	7,600	948.00	7,204,800		
エスクローＡＪ	3,600	139.00	500,400		
メドピア	7,400	598.00	4,425,200	貸付株式数	2,800株
レアジョブ	600	425.00	255,000		
リクルートホールディングス	667,900	7,885.00	5,266,391,500		
エラン	12,300	894.00	10,996,200		
ツ ガ ミ	20,200	1,542.00	31,148,400		
オークマ	8,000	6,624.00	52,992,000		
芝浦機械	9,100	3,610.00	32,851,000		
アマダ	138,100	1,704.50	235,391,450		

アイダエンジニア	21,000	859.00	18,039,000	
ＦＵＪＩ	42,900	2,460.00	105,534,000	
牧野フライス	10,100	6,450.00	65,145,000	
オーエスジー	40,100	1,881.50	75,448,150	
ダイジェット	300	847.00	254,100	貸付株式数 100株
旭ダイヤモンド	21,000	903.00	18,963,000	
DMG森精機	62,200	4,157.00	258,565,400	
ソディツク	22,000	710.00	15,620,000	
ディスコ	43,900	63,880.00	2,804,332,000	
日東工器	4,400	2,325.00	10,230,000	
日進工具	8,500	958.00	8,143,000	貸付株式数 600株
パンチ工業	2,900	463.00	1,342,700	貸付株式数 1,100株
冨士ダイス	6,100	787.00	4,800,700	貸付株式数 100株
土木管理総合試験	1,400	326.00	456,400	
日本郵政	969,400	1,475.00	1,429,865,000	
ベルシステム24HLDGS	10,000	1,438.00	14,380,000	
鎌倉新書	7,900	445.00	3,515,500	貸付株式数 3,000株 (1,300株)
ＳＭＮ	600	303.00	181,800	
一蔵	400	572.00	228,800	貸付株式数 100株
グローバルキッズCOMP	600	675.00	405,000	
エアトリ	6,800	1,337.00	9,091,600	貸付株式数 2,700株
アトラエ	7,000	793.00	5,551,000	貸付株式数 2,700株
ストライク	4,600	4,215.00	19,389,000	
ソラスト	25,700	452.00	11,616,400	
セラク	2,900	1,167.00	3,384,300	貸付株式数 1,000株
インソース	20,100	891.00	17,909,100	貸付株式数 4,800株
豊田自動織機	76,900	12,940.00	995,086,000	
豊和工業	1,600	813.00	1,300,800	貸付株式数 600株
石川製作所	800	1,697.00	1,357,600	貸付株式数 300株
リケンＮＰＲ	9,900	2,666.00	26,393,400	
東洋機械金属	2,500	718.00	1,795,000	
津田駒工業	500	409.00	204,500	貸付株式数 200株
エンシュウ	700	702.00	491,400	
島精機製作所	14,500	1,671.00	24,229,500	貸付株式数 5,500株
オプトラン	14,900	2,028.00	30,217,200	
NCホールディングス	700	2,208.00	1,545,600	
イワキポンプ	6,100	2,498.00	15,237,800	
フリュー	8,600	1,075.00	9,245,000	貸付株式数 3,400株

ヤマシンフィルタ	21,700	363.00	7,877,100	貸付株式数	8,300株
日阪製作所	9,900	1,023.00	10,127,700		
やまびこ	14,800	2,170.00	32,116,000		
野村マイクロ・サイエンス	12,300	4,385.00	53,935,500	貸付株式数	4,900株
平田機工	4,400	6,570.00	28,908,000	貸付株式数	500株
ＰＥＧＡＳＵＳ	10,000	554.00	5,540,000		
マルマエ	4,000	2,103.00	8,412,000	貸付株式数	1,500株
タツモ	5,500	3,560.00	19,580,000	貸付株式数	2,200株
ナブテスコ	57,200	2,693.00	154,039,600		
三井海洋開発	11,500	2,642.00	30,383,000		
レオン自動機	10,500	1,552.00	16,296,000		
ＳＭＣ	27,300	76,500.00	2,088,450,000		
ホソカワミクロン	6,300	3,970.00	25,011,000		
ユニオンツール	4,000	5,980.00	23,920,000		
瑞 光	6,500	1,055.00	6,857,500	貸付株式数	200株
オイレス工業	12,300	2,290.00	28,167,000		
日精エーエスビー	3,100	5,320.00	16,492,000		
サト－ホールディングス	13,000	2,066.00	26,858,000		
技研製作所	8,600	1,916.00	16,477,600	貸付株式数	3,300株
日本エアーテック	4,200	1,181.00	4,960,200		
カ ワ タ	900	890.00	801,000		
日精樹脂工業	6,600	1,011.00	6,672,600		
オカダアイヨン	1,000	2,385.00	2,385,000		
ワイエイシイホールディングス	3,800	2,461.00	9,351,800	貸付株式数	700株
小松製作所	427,100	4,379.00	1,870,270,900		
住友重機械	53,900	4,109.00	221,475,100		
日立建機	36,300	3,995.00	145,018,500		
日 工	13,600	738.00	10,036,800		
巴工業	3,500	4,615.00	16,152,500	貸付株式数	1,300株
井関農機	8,500	1,032.00	8,772,000	貸付株式数	3,300株
ＴＯＷＡ	10,100	11,220.00	113,322,000		
丸山製作所	500	2,330.00	1,165,000		
北川鉄工所	3,600	1,415.00	5,094,000		
シンニッタン	3,900	233.00	908,700		
ローツェ	4,800	30,650.00	147,120,000		
タカキタ	1,000	458.00	458,000	貸付株式数	100株
クボタ	476,300	2,202.50	1,049,050,750		
荏原実業	4,800	3,645.00	17,496,000		
東洋エンジニア	13,000	892.00	11,596,000		

三菱化工機	3,200	4,165.00	13,328,000	
月島ホールディングス	12,300	1,382.00	16,998,600	
帝国電機製作所	6,200	2,406.00	14,917,200	
東京機械	800	402.00	321,600	
新東工業	18,400	1,043.00	19,191,200	
渋谷工業	8,500	3,820.00	32,470,000	
アイチ コーポレーション	12,600	1,178.00	14,842,800	
小森コーポレーション	22,400	1,288.00	28,851,200	
鶴見製作所	7,000	4,135.00	28,945,000	
日本ギア工業	1,100	562.00	618,200	貸付株式数 400株
酒井重工業	1,600	5,800.00	9,280,000	
荏原製作所	37,400	11,910.00	445,434,000	
石井鉄工所	300	2,821.00	846,300	
酉島製作所	7,800	3,375.00	26,325,000	
北越工業	9,200	2,450.00	22,540,000	貸付株式数 1,200株
ダイキン工業	108,800	22,960.00	2,498,048,000	
オルガノ	10,900	8,390.00	91,451,000	
トーヨーカネツ	3,100	3,810.00	11,811,000	
栗田工業	51,000	6,700.00	341,700,000	
椿本チエイン	12,500	6,070.00	75,875,000	
大同工業	1,300	876.00	1,138,800	
日 機 装	21,000	1,151.00	24,171,000	
木村化工機	6,900	703.00	4,850,700	
レイズネクスト	12,800	1,780.00	22,784,000	
アネスト岩田	14,000	1,476.00	20,664,000	
ダイフク	153,800	2,900.00	446,020,000	
サムコ	2,200	3,785.00	8,327,000	貸付株式数 800株
加藤製作所	1,600	1,260.00	2,016,000	
油研工業	500	2,333.00	1,166,500	
タダノ	52,400	1,087.00	56,958,800	
フジテック	21,300	4,167.00	88,757,100	
ＣＫＤ	25,200	3,230.00	81,396,000	
平和	27,000	2,026.00	54,702,000	
理想科学工業	7,300	3,190.00	23,287,000	貸付株式数 900株
ＳＡＮＫＹＯ	87,700	1,668.00	146,283,600	
日本金銭機械	11,000	1,328.00	14,608,000	貸付株式数 4,200株
マースグループHLDGS	4,500	3,740.00	16,830,000	
フクシマガリレイ	6,000	6,390.00	38,340,000	
オーイズミ	1,100	357.00	392,700	貸付株式数 400株
ダイコク電機	4,500	4,005.00	18,022,500	貸付株式数 1,800株

竹内製作所	16,500	5,620.00	92,730,000	
ア マ ノ	25,900	3,990.00	103,341,000	
ＪＵＫＩ	14,000	501.00	7,014,000	貸付株式数　5,500株
サンデン	4,300	165.00	709,500	貸付株式数　1,700株
ジャノメ	9,200	674.00	6,200,800	
ブラザー工業	121,700	2,777.50	338,021,750	
マックス	12,800	3,850.00	49,280,000	
モリタホールディングス	15,800	1,843.00	29,119,400	
グローリー	21,900	2,711.50	59,381,850	
新晃工業	9,200	3,775.00	34,730,000	
大和冷機工業	14,000	1,487.00	20,818,000	
セガサミーホールディングス	81,400	2,390.00	194,546,000	
ＴＰＲ	11,600	2,442.00	28,327,200	貸付株式数　1,000株
ツバキ・ナカシマ	18,200	758.00	13,795,600	
ホシザキ	53,800	5,064.00	272,443,200	
大豊工業	8,000	770.00	6,160,000	貸付株式数　3,100株
日本精工	168,700	749.20	126,390,040	
Ｎ Ｔ Ｎ	197,500	294.30	58,124,250	
ジェイテクト	81,100	1,055.00	85,560,500	
不 二 越	6,700	3,425.00	22,947,500	貸付株式数　2,600株
ミネベアミツミ	158,500	3,179.00	503,871,500	
日本トムソン	24,700	595.00	14,696,500	
Ｔ Ｈ Ｋ	52,600	2,845.00	149,647,000	
ユーシン精機	7,100	714.00	5,069,400	
前澤給装工業	6,500	1,323.00	8,599,500	
イーグル工業	10,100	1,879.00	18,977,900	
前澤工業	1,900	1,435.00	2,726,500	
日本ピラー工業	8,400	5,270.00	44,268,000	
キッツ	30,500	1,115.00	34,007,500	
日 立	437,900	16,725.00	7,323,877,500	
三菱電機	1,014,100	2,530.00	2,565,673,000	
富士電機	55,400	8,957.00	496,217,800	
東洋電機製造	1,100	1,069.00	1,175,900	
安川電機	99,000	5,850.00	579,150,000	
シンフォニア テクノロジー	10,000	3,405.00	34,050,000	
明 電 舎	16,900	4,065.00	68,698,500	
オリジン	700	1,325.00	927,500	
山洋電気	3,900	6,780.00	26,442,000	
デンヨー	6,900	2,721.00	18,774,900	

PHCホールディングス	17,000	1,143.00	19,431,000	貸付株式数	6,800株
KOKUSAI ELECTRIC	47,300	5,000.00	236,500,000	貸付株式数	18,900株
ソシオネクスト	66,400	4,030.00	267,592,000		
ベイカレントコンサルティング	68,200	3,121.00	212,852,200		
ORCHESTRA HLDGS	2,000	1,462.00	2,924,000		
アイモバイル	11,700	509.00	5,955,300		
キャリアインデックス	1,000	175.00	175,000	貸付株式数	400株
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	3,800	1,047.00	3,978,600	貸付株式数	1,200株
船場	600	1,214.00	728,400		
ジャパンエレベーターSHD	30,000	2,424.00	72,720,000		
フルテック	400	1,145.00	458,000	貸付株式数	100株
グリーンズ	1,100	1,905.00	2,095,500	貸付株式数	400株
ツナググループHLDGS	900	640.00	576,000	貸付株式数	100株
GAMEWITH	1,200	261.00	313,200	貸付株式数	400株
MS&CONSULTING	400	611.00	244,400		
エル・ティー・エス	1,100	2,086.00	2,294,600		
ミダックホールディングス	5,600	1,520.00	8,512,000	貸付株式数	2,100株
キュービーネットHLDGS	5,300	1,058.00	5,607,400	貸付株式数	2,000株
オープングループ	12,700	271.00	3,441,700	貸付株式数	4,900株
三桜工業	13,800	980.00	13,524,000		
マキタ	103,900	4,413.00	458,510,700		
東芝テック	11,700	3,170.00	37,089,000		
芝浦メカトロニクス	5,200	7,820.00	40,664,000	貸付株式数	1,200株
マブチモーター	44,800	2,410.50	107,990,400		
ニデック	201,100	7,255.00	1,458,980,500		
ユーエムシーエレクトロニクス	5,800	397.00	2,302,600	貸付株式数	2,200株
トレックス・セミコンダクター	4,700	1,850.00	8,695,000	貸付株式数	1,300株
東光高岳	5,500	1,996.00	10,978,000		
ダブル・スコープ	26,000	534.00	13,884,000	貸付株式数	10,400株
宮越ホールディングス	4,000	1,820.00	7,280,000	貸付株式数	1,600株
ダイヘン	8,600	8,150.00	70,090,000		
ヤーマン	17,700	909.00	16,089,300	貸付株式数	7,000株 (200株)
ＪＶＣケンウッド	71,900	888.00	63,847,200		
ミマキエンジニアリング	8,500	2,138.00	18,173,000		
Ｉ－ＰＥＸ	6,300	1,972.00	12,423,600		
大崎電気	20,000	654.00	13,080,000		

オムロン	69,600	5,126.00	356,769,600	
日東工業	12,300	3,340.00	41,082,000	
ＩＤＥＣ	13,400	2,892.00	38,752,800	
正興電機製作所	1,000	1,558.00	1,558,000	
不二電機工業	600	1,122.00	673,200	貸付株式数　200株
ジーエス・ユアサ コーポ	35,600	3,231.00	115,023,600	
サクサホールディングス	700	2,604.00	1,822,800	
メルコホールディングス	2,800	3,485.00	9,758,000	
テクノメディカ	2,200	1,782.00	3,920,400	
ダイヤモンドエレクトリクHD	3,400	695.00	2,363,000	貸付株式数　1,100株
日本電気	119,600	12,345.00	1,476,462,000	
富 士 通	838,400	2,376.50	1,992,457,600	
沖 電 気	40,500	984.00	39,852,000	
岩崎通信機	1,400	1,601.00	2,241,400	
電気興業	3,600	2,075.00	7,470,000	
サンケン電気	8,500	6,529.00	55,496,500	
ナカヨ	500	1,167.00	583,500	
アイホン	4,900	2,991.00	14,655,900	
ルネサスエレクトロニクス	567,900	3,143.00	1,784,909,700	
セイコーエプソン	116,900	2,401.00	280,676,900	
ワコム	66,300	711.00	47,139,300	
アルバック	20,000	10,555.00	211,100,000	
アクセル	4,100	1,542.00	6,322,200	
ＥＩＺＯ	6,600	4,715.00	31,119,000	貸付株式数　400株
ジャパンディスプレイ	61,700	14.00	863,800	
日本信号	20,800	994.00	20,675,200	
京三製作所	19,000	662.00	12,578,000	
能美防災	12,300	2,243.00	27,588,900	
ホーチキ	6,800	2,223.00	15,116,400	
星和電機	1,300	555.00	721,500	
エレコム	21,300	1,562.00	33,270,600	
パナソニック ホールディンク	1,076,300	1,259.00	1,355,061,700	
シャープ	153,600	983.10	151,004,160	貸付株式数　61,400株
アンリツ	64,200	1,143.50	73,412,700	
富士通ゼネラル	25,800	2,098.50	54,141,300	
ソニーグループ	631,700	12,695.00	8,019,431,500	※
ＴＤＫ	144,300	8,863.00	1,278,930,900	
帝国通信工業	3,900	1,965.00	7,663,500	

タムラ製作所	36,300	714.00	25,918,200	
アルプスアルパイン	81,400	1,527.50	124,338,500	
池上通信機	900	769.00	692,100	
日本電波工業	10,900	1,108.00	12,077,200	貸付株式数 200株
鈴木	4,800	1,497.00	7,185,600	
メイコー	9,000	7,440.00	66,960,000	
日本トリム	2,100	3,380.00	7,098,000	
ローランド ディー.ジー.	4,700	5,340.00	25,098,000	
フオスター電機	6,700	1,784.00	11,952,800	
ＳＭＫ	2,400	2,385.00	5,724,000	
ヨコオ	8,000	2,106.00	16,848,000	
ティアック	4,800	95.00	456,000	貸付株式数 1,900株
ホシデン	20,700	2,025.00	41,917,500	
ヒロセ電機	13,400	17,910.00	239,994,000	
日本航空電子	21,800	2,475.00	53,955,000	
ＴＯＡ	10,300	1,080.00	11,124,000	
マクセル	20,200	1,859.00	37,551,800	
古野電気	11,700	1,999.00	23,388,300	
スミダコーポレーション	12,200	1,161.00	14,164,200	
アイコム	3,400	3,015.00	10,251,000	貸付株式数 400株
リオン	3,700	2,799.00	10,356,300	
横河電機	99,700	3,780.00	376,866,000	
新電元工業	3,500	2,970.00	10,395,000	
アズビル	62,100	4,127.00	256,286,700	
東亜ディーケーケー	1,400	852.00	1,192,800	
日本光電工業	38,700	4,678.00	181,038,600	
チノー	3,700	2,460.00	9,102,000	貸付株式数 1,300株
共和電業	2,700	443.00	1,196,100	
日本電子材料	5,500	3,545.00	19,497,500	
堀場製作所	17,200	11,750.00	202,100,000	
アドバンテスト	258,400	5,337.00	1,379,080,800	
小野測器	1,200	686.00	823,200	
エスペック	7,200	3,135.00	22,572,000	
キーエンス	90,200	67,790.00	6,114,658,000	
日置電機	4,200	6,750.00	28,350,000	貸付株式数 1,600株
シスメックス	233,500	2,529.00	590,521,500	
日本マイクロニクス	16,200	5,890.00	95,418,000	
メガチップス	7,100	4,235.00	30,068,500	
OBARA GROUP	5,600	4,200.00	23,520,000	貸付株式数 1,800株
IMAGICA GROUP	8,800	538.00	4,734,400	貸付株式数 3,500株

澤藤電機	300	1,218.00	365,400	
デンソー	744,300	2,341.00	1,742,406,300	
原田工業	1,300	576.00	748,800	貸付株式数 500株
コーセル	9,600	1,332.00	12,787,200	
イリソ電子工業	8,200	2,944.00	24,140,800	
オプテックスグループ	16,500	1,558.00	25,707,000	
千代田インテグレ	3,500	3,230.00	11,305,000	貸付株式数 800株
レーザーテック	41,300	36,170.00	1,493,821,000	
スタンレー電気	57,800	2,789.50	161,233,100	
ウシオ電機	39,800	2,042.50	81,291,500	
岡谷電機	2,200	245.00	539,000	貸付株式数 800株
ヘリオステクノH	2,900	880.00	2,552,000	貸付株式数 800株
エノモト	800	1,498.00	1,198,400	
日本セラミック	7,300	2,532.00	18,483,600	
遠藤照明	1,300	1,502.00	1,952,600	
古河電池	6,700	1,316.00	8,817,200	貸付株式数 2,400株
山一電機	8,100	3,465.00	28,066,500	
図 研	7,400	3,855.00	28,527,000	
日本電子	22,600	6,507.00	147,058,200	
カ シ オ	65,100	1,171.00	76,232,100	
ファナック	439,900	4,265.00	1,876,173,500	
日本シイエムケイ	21,200	604.00	12,804,800	
エンプラス	2,600	8,020.00	20,852,000	貸付株式数 1,000株 (100株)
大真空	13,400	692.00	9,272,800	貸付株式数 5,200株
ロ ー ム	166,800	2,123.50	354,199,800	
浜松ホトニクス	72,400	4,444.00	321,745,600	
三井ハイテック	8,000	6,278.00	50,224,000	貸付株式数 3,200株
新光電気工業	31,900	5,689.00	181,479,100	
京 セ ラ	560,500	1,811.50	1,015,345,750	
協栄産業	300	2,795.00	838,500	貸付株式数 100株
太陽誘電	43,900	4,057.00	178,102,300	
村田製作所	820,800	3,238.00	2,657,750,400	
双葉電子工業	17,400	600.00	10,440,000	
日東電工	58,100	12,265.00	712,596,500	
北陸電気工業	1,100	1,371.00	1,508,100	
東海理化電機	25,400	2,066.00	52,476,400	
ニチコン	23,700	1,156.00	27,397,200	
日本ケミコン	9,600	1,579.00	15,158,400	
K O A	13,600	1,464.00	19,910,400	貸付株式数 3,800株

三井Ｅ＆Ｓ	45,200	1,373.00	62,059,600	貸付株式数	17,300株
日立造船	80,400	1,028.00	82,651,200		
三菱重工業	1,593,200	1,488.00	2,370,681,600		
川崎重工業	73,600	5,641.00	415,177,600		
ＩＨＩ	67,800	3,758.00	254,792,400		
名村造船所	25,300	2,103.00	53,205,900	貸付株式数	9,800株
サノヤスホールディングス	4,300	195.00	838,500	貸付株式数	1,700株
スプリックス	900	778.00	700,200		
マネジメントソリューションズ	4,000	1,405.00	5,620,000	貸付株式数	1,500株
プロレド・パートナーズ	2,300	721.00	1,658,300	貸付株式数	200株
AND FACTORY	900	320.00	288,000	貸付株式数	300株
テノ.ホールディングス	400	410.00	164,000	貸付株式数	100株
フロンティア・マネジメント	2,300	1,272.00	2,925,600		
ピアラ	600	270.00	162,000		
コプロ・ホールディングス	1,000	1,655.00	1,655,000		
ギークス	400	471.00	188,400		
アンビスホールディングス	19,800	2,365.00	46,827,000		
カーブスホールディングス	25,400	749.00	19,024,600		
フォーラムエンジニアリング	12,600	832.00	10,483,200		
FAST FITNESS JAP	3,200	1,377.00	4,406,400		
日本車輌	3,000	2,350.00	7,050,000	貸付株式数	300株
三菱ロジスネクスト	14,400	1,367.00	19,684,800		
近畿車輌	400	1,930.00	772,000		
一家ホールディングス	800	682.00	545,600	貸付株式数	300株
フルサト・マルカHD	8,500	2,124.00	18,054,000	貸付株式数	2,200株
ヤマエグループHD	8,400	2,394.00	20,109,600	貸付株式数	2,800株
ジャパンクラフトホールディ	2,700	157.00	423,900	貸付株式数	900株
ＦＰＧ	33,000	2,094.00	69,102,000		
島根銀行	800	549.00	439,200	貸付株式数	300株
じもとホールディングス	2,600	350.00	910,000	貸付株式数	1,000株
全国保証	23,200	5,678.00	131,729,600		
めぶきフィナンシャルG	411,600	585.90	241,156,440		
ジャパンインベストメントA	14,400	1,457.00	20,980,800	貸付株式数	5,500株
東京きらぼしFG	11,400	4,500.00	51,300,000		
九州フィナンシャルG	171,900	930.70	159,987,330		
かんぽ生命保険	90,500	2,922.50	264,486,250		

ゆうちょ銀行	976,300	1,464.50	1,429,791,350	
あんしん保証	1,200	219.00	262,800	貸付株式数　100株
富山第一銀行	28,200	1,149.00	32,401,800	
コンコルディア・フィナンシャル	472,600	881.20	416,455,120	
ジェイリース	5,900	1,263.00	7,451,700	
西日本フィナンシャルHD	49,700	1,877.00	93,286,900	
イントラスト	1,100	800.00	880,000	
日本モーゲージサービス	1,600	416.00	665,600	貸付株式数　600株
Ｃａｓａ	1,100	883.00	971,300	貸付株式数　400株
ＳＢＩアルヒ	8,600	861.00	7,404,600	
プレミアグループ	15,000	2,048.00	30,720,000	
日産自動車	1,187,000	519.80	617,002,600	
いすゞ自動車	253,300	1,979.00	501,280,700	
トヨタ自動車	4,953,200	3,036.00	15,037,915,200	※
日野自動車	135,800	415.90	56,479,220	
三菱自動車工業	352,000	411.60	144,883,200	
エフテック	2,100	620.00	1,302,000	貸付株式数　800株
レシップホールディングス	1,300	656.00	852,800	
ＧＭＢ	600	1,430.00	858,000	貸付株式数　200株
ファルテック	500	540.00	270,000	
武蔵精密工業	22,000	1,863.00	40,986,000	
日産車体	9,200	990.00	9,108,000	
新明和工業	26,000	1,371.00	35,646,000	
極東開発工業	14,900	2,435.00	36,281,500	
トピー工業	7,300	2,378.00	17,359,400	
ティラド	2,000	3,465.00	6,930,000	
タチエス	16,700	1,894.00	31,629,800	
ＮＯＫ	35,000	2,100.00	73,500,000	
フタバ産業	24,200	841.00	20,352,200	
カヤバ	8,500	5,310.00	45,135,000	
市光工業	16,300	541.00	8,818,300	
大同メタル工業	17,800	597.00	10,626,600	
プレス工業	35,800	626.00	22,410,800	
ミクニ	3,700	397.00	1,468,900	
太平洋工業	20,800	1,486.00	30,908,800	
河西工業	4,600	192.00	883,200	貸付株式数　1,800株
アイシン	69,600	5,397.00	375,631,200	
マツダ	298,400	1,441.00	429,994,400	

今仙電機製作所	1,900	607.00	1,153,300	
本田技研	2,137,400	1,642.50	3,510,679,500	
スズキ	662,700	1,787.50	1,184,576,250	
SUBARU	279,700	3,262.00	912,381,400	
安永	1,300	595.00	773,500	貸付株式数 500株
ヤマハ発動機	389,800	1,470.00	573,006,000	
小糸製作所	93,500	2,146.50	200,697,750	
ＴＢＫ	3,100	302.00	936,200	貸付株式数 1,200株
エクセディ	14,800	2,865.00	42,402,000	貸付株式数 5,700株
ミツバ	16,900	1,086.00	18,353,400	
豊田合成	25,900	2,702.00	69,981,800	
愛三工業	15,000	1,309.00	19,635,000	
盟和産業	400	1,003.00	401,200	貸付株式数 100株
日本プラスト	2,500	417.00	1,042,500	
ヨ ロ ズ	8,400	1,116.00	9,374,400	貸付株式数 2,700株
エフ・シー・シー	16,000	2,266.00	36,256,000	
新家工業	700	5,270.00	3,689,000	
シマノ	36,400	25,155.00	915,642,000	
テイ・エス テック	32,100	1,849.50	59,368,950	
３３ＦＧ	7,900	2,035.00	16,076,500	
第四北越フィナンシャルG	13,900	4,900.00	68,110,000	
ひろぎんHLDGS	126,400	1,182.50	149,468,000	
マーキュリアホールディングス	1,500	919.00	1,378,500	貸付株式数 100株
おきなわＦＧ	7,600	2,456.00	18,665,600	
ダイレクトマケティングミクス	9,600	231.00	2,217,600	
ポピンズ	1,400	1,204.00	1,685,600	
LITALICO	7,200	1,802.00	12,974,400	貸付株式数 2,700株
コンフィデンス・インターワーク	300	1,838.00	551,400	貸付株式数 100株
十六ＦＧ	11,500	4,415.00	50,772,500	
北國ＦＨＤ	9,400	5,240.00	49,256,000	
ネットプロＨＤ	29,600	199.00	5,890,400	
プロクレアホールディングス	10,200	1,806.00	18,421,200	貸付株式数 3,000株
あいちフィナンシャルグル	18,200	2,708.00	49,285,600	
ジャムコ	4,900	1,425.00	6,982,500	貸付株式数 1,900株
小 野 建	9,600	1,583.00	15,196,800	
はるやまHLDGS	1,500	592.00	888,000	貸付株式数 300株

南 陽	1,300	1,096.00	1,424,800		
ノ ジ マ	27,700	1,569.00	43,461,300		
佐鳥電機	5,900	2,022.00	11,929,800	貸付株式数	300株
カッパ・クリエイト	15,000	1,700.00	25,500,000	貸付株式数	6,000株 (300株)
エコートレーディング	600	1,313.00	787,800		
伯東	5,500	5,120.00	28,160,000	貸付株式数	2,100株
コンドーテック	7,300	1,363.00	9,949,900	貸付株式数	2,000株
中山福	1,800	372.00	669,600		
ライトオン	2,300	389.00	894,700	貸付株式数	900株
ナガイレーベン	12,100	2,482.00	30,032,200	貸付株式数	4,100株
三菱食品	8,800	5,370.00	47,256,000		
良品計画	113,600	2,704.00	307,174,400		
パリミキホールディングス	4,000	394.00	1,576,000		
松田産業	7,300	2,765.00	20,184,500	貸付株式数	1,400株
第一興商	37,000	1,616.50	59,810,500		
メディパルHD	97,000	2,344.50	227,416,500		
アドヴァングループ	8,100	955.00	7,735,500		
ＳＰＫ	4,200	2,197.00	9,227,400		
萩原電気HLDGS	4,100	4,100.00	16,810,000		
アルビス	3,100	2,602.00	8,066,200		
アズワン	29,600	2,613.00	77,344,800		
スズデン	3,300	1,935.00	6,385,500	貸付株式数	1,300株
尾家産業	800	2,034.00	1,627,200	貸付株式数	100株
シモジマ	6,400	1,288.00	8,243,200		
ドウシシャ	8,900	2,235.00	19,891,500		
小津産業	700	1,616.00	1,131,200	貸付株式数	200株
コナカ	3,700	271.00	1,002,700		
高速	5,700	2,241.00	12,773,700		
ハウス ローゼ	400	1,588.00	635,200	貸付株式数	100株
G-7ホールディングス	10,400	1,506.00	15,662,400		
たけびし	3,600	2,145.00	7,722,000	貸付株式数	800株
イオン北海道	28,300	909.00	25,724,700		
コ ジ マ	18,400	914.00	16,817,600	貸付株式数	7,000株 (1,700株)
ヒマラヤ	1,100	912.00	1,003,200	貸付株式数	400株
コーナン商事	11,700	4,080.00	47,736,000		
ネットワンシステムズ	35,100	2,624.00	92,102,400		
エコス	3,500	2,234.00	7,819,000		

ワタミ	10,000	897.00	8,970,000	貸付株式数	3,800株
マルシェ	1,100	249.00	273,900	貸付株式数	400株
リックス	2,200	2,970.00	6,534,000		
システムソフト	31,400	62.00	1,946,800	貸付株式数	12,000株
パンパシフィックHD	192,800	3,708.00	714,902,400		
丸文	8,500	1,258.00	10,693,000		
西松屋チェーン	18,800	2,176.00	40,908,800	貸付株式数	7,300株
ゼンショーホールディングス	48,600	6,076.00	295,293,600	貸付株式数	18,600株
ハピネット	8,100	3,760.00	30,456,000		
幸楽苑ホールディングス	7,000	1,326.00	9,282,000	貸付株式数	2,700株
ハークスレイ	1,000	790.00	790,000		
橋本総業HLDGS	3,800	1,349.00	5,126,200	貸付株式数	1,400株
日本ライフライン	25,600	1,067.00	27,315,200		
サイゼリヤ	14,100	5,240.00	73,884,000		
タカショー	8,300	510.00	4,233,000	貸付株式数	3,300株
ＶＴホールディングス	37,200	486.00	18,079,200		
アルゴグラフィックス	8,200	4,525.00	37,105,000		
魚力	3,300	2,438.00	8,045,400	貸付株式数	700株
ＩＤＯＭ	25,200	1,376.00	34,675,200		
日本エム・ディ・エム	7,200	627.00	4,514,400		
ポプラ	800	254.00	203,200	貸付株式数	300株 (100株)
フジ・コーポレーション	4,500	2,095.00	9,427,500		
ユナイテッドアローズ	11,200	1,903.00	21,313,600		
進和	5,800	2,789.00	16,176,200		
エスケイジャパン	800	870.00	696,000		
ダイトロン	3,800	2,982.00	11,331,600		
ハイデイ日高	14,100	3,060.00	43,146,000	貸付株式数	5,500株
シークス	13,600	1,302.00	17,707,200		
YU-WA CREATION H	2,000	132.00	264,000	貸付株式数	600株
コロワイド	41,000	2,013.00	82,533,000	貸付株式数	16,400株
田中商事	900	799.00	719,100	貸付株式数	100株
オーハシテクニカ	5,000	1,713.00	8,565,000	貸付株式数	1,400株
壱番屋	37,700	1,131.00	42,638,700	貸付株式数	7,800株
白銅	2,600	2,915.00	7,579,000	貸付株式数	1,000株
トップカルチャー	1,500	166.00	249,000	貸付株式数	400株
ＰＬＡＮＴ	700	1,541.00	1,078,700		
スギホールディングス	57,700	2,335.50	134,758,350		
ダイコー通産	300	1,182.00	354,600	貸付株式数	100株

薬王堂ホールディングス	4,700	2,803.00	13,174,100	
島津製作所	119,900	3,917.00	469,648,300	
ＪＭＳ	8,400	531.00	4,460,400	
クボテック	800	212.00	169,600	貸付株式数　300株
長野計器	6,500	3,065.00	19,922,500	
ブイ・テクノロジー	4,700	3,120.00	14,664,000	
スター精密	16,600	2,126.00	35,291,600	
東京計器	6,900	3,395.00	23,425,500	
愛知時計	3,900	2,249.00	8,771,100	
インターアクション	5,400	1,589.00	8,580,600	貸付株式数　1,200株
オーバル	2,600	453.00	1,177,800	
東京精密	18,500	11,825.00	218,762,500	
マニー	36,000	1,881.00	67,716,000	
ニコン	130,400	1,519.50	198,142,800	
トプコン	43,800	1,705.00	74,679,000	
オリンパス	516,400	2,600.00	1,342,640,000	
理研計器	12,800	3,805.00	48,704,000	
SCREENホールディングス	30,800	14,725.00	453,530,000	
キヤノン電子	10,000	2,279.00	22,790,000	貸付株式数　3,800株
タムロン	5,500	8,460.00	46,530,000	
ＨＯＹＡ	177,600	18,080.00	3,211,008,000	
シ ー ド	1,800	551.00	991,800	貸付株式数　600株
ノーリツ鋼機	8,500	4,480.00	38,080,000	
A&Dホロンホールディングス	13,100	2,773.00	36,326,300	
朝日インテック	109,900	2,185.00	240,131,500	
キヤノン	449,900	4,359.00	1,961,114,100	
リ コ ー	226,200	1,358.00	307,179,600	
シチズン時計	83,000	1,004.00	83,332,000	
リズム	700	3,725.00	2,607,500	貸付株式数　200株
大研医器	2,500	532.00	1,330,000	
メニコン	31,000	1,266.00	39,246,000	
シンシア	300	453.00	135,900	
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	4,300	165.00	709,500	
中本パックス	1,000	1,616.00	1,616,000	
パラマウントベッドHD	18,700	2,733.00	51,107,100	
トランザクション	6,000	1,935.00	11,610,000	
粧美堂	800	555.00	444,000	
ニホンフラッシュ	8,500	901.00	7,658,500	
前田工繊	8,000	3,160.00	25,280,000	
永大産業	3,400	241.00	819,400	

アートネイチャー	8,000	814.00	6,512,000	
フルヤ金属	2,900	13,060.00	37,874,000	
バンダイナムコHLDGS	247,100	2,989.00	738,581,900	
アイフィスジャパン	800	594.00	475,200	
ＳＨＯＥＩ	25,300	2,024.00	51,207,200	
フランスベッドHLDGS	11,700	1,168.00	13,665,600	貸付株式数　4,500株
マーベラス	14,600	631.00	9,212,600	
パイロットコーポレーション	12,700	4,330.00	54,991,000	
萩原工業	6,000	1,502.00	9,012,000	貸付株式数　2,400株
エイベックス	15,400	1,200.00	18,480,000	
フジシールインターナショナル	18,300	2,423.00	44,340,900	
タカラトミー	41,000	3,079.00	126,239,000	
広済堂ホールディングス	26,200	590.00	15,458,000	貸付株式数　7,400株
エステールホールディングス	700	651.00	455,700	
レック	11,600	1,473.00	17,086,800	貸付株式数　4,300株
タカノ	1,100	886.00	974,600	
三光合成	11,300	674.00	7,616,200	
プロネクサス	9,400	1,253.00	11,778,200	
ホクシン	2,200	117.00	257,400	
ウッドワン	1,100	911.00	1,002,100	貸付株式数　300株
き も と	5,100	215.00	1,096,500	
TOPPANホールディングス	110,900	4,416.00	489,734,400	
大日本印刷	93,500	5,246.00	490,501,000	
共同印刷	2,600	3,555.00	9,243,000	
ＮＩＳＳＨＡ	15,400	2,050.00	31,570,000	
光村印刷	200	1,611.00	322,200	
藤森工業	7,200	4,200.00	30,240,000	
ヴィア・ホールディングス	4,700	110.00	517,000	貸付株式数　1,800株
TAKARA & COMPANY	5,300	2,961.00	15,693,300	
前澤化成工業	5,800	1,800.00	10,440,000	貸付株式数　2,200株
未来工業	3,200	4,230.00	13,536,000	貸付株式数　1,200株
アシックス	76,900	9,071.00	697,559,900	
ツ ツ ミ	2,100	2,104.00	4,418,400	
ウェーブロックHLDGS	1,100	638.00	701,800	
ジェイ エス ピー	6,300	2,209.00	13,916,700	貸付株式数　2,300株
ニ チ ハ	11,300	3,375.00	38,137,500	貸付株式数　4,300株
ローランド	6,600	4,085.00	26,961,000	

エフピコ	17,100	2,302.00	39,364,200	貸付株式数 3,400株
小松ウオール工業	3,700	3,165.00	11,710,500	
ヤマハ	56,900	3,682.00	209,505,800	
河合楽器	2,700	3,235.00	8,734,500	
クリナップ	8,700	715.00	6,220,500	
ピジョン	57,400	1,507.00	86,501,800	
天馬	6,600	2,683.00	17,707,800	
キングジム	8,000	896.00	7,168,000	貸付株式数 3,000株 (200株)
象印マホービン	24,500	1,466.00	35,917,000	
リンテック	18,100	3,260.00	59,006,000	
信越ポリマー	19,500	1,429.00	27,865,500	
東 リ	6,500	389.00	2,528,500	
イトーキ	17,200	1,679.00	28,878,800	
任 天 堂	569,500	8,411.00	4,790,064,500	
三菱鉛筆	12,800	2,504.00	32,051,200	
松 風	4,100	4,235.00	17,363,500	
タカラスタンダード	18,400	1,677.00	30,856,800	
コ ク ヨ	36,900	2,620.00	96,678,000	
ナカバヤシ	9,800	536.00	5,252,800	
ニ フ コ	27,100	3,697.00	100,188,700	
立川ブラインド	4,200	1,324.00	5,560,800	
グローブライド	8,100	2,136.00	17,301,600	貸付株式数 3,000株
オカムラ	27,200	2,155.00	58,616,000	
バルカー	7,600	3,565.00	27,094,000	
MUTOHホールディングス	400	2,626.00	1,050,400	
伊 藤 忠	641,600	7,379.00	4,734,366,400	
丸 紅	791,600	2,982.00	2,360,551,200	
スクロール	14,300	1,056.00	15,100,800	
高 島	2,100	1,038.00	2,179,800	貸付株式数 800株
ヨンドシーホールディングス	9,000	1,908.00	17,172,000	貸付株式数 3,300株
三陽商会	3,800	2,432.00	9,241,600	
長瀬産業	43,700	2,997.00	130,968,900	
ナイガイ	1,000	262.00	262,000	貸付株式数 300株
蝶 理	6,000	3,475.00	20,850,000	貸付株式数 1,400株
豊田通商	83,600	8,812.00	736,683,200	
オンワードホールディングス	53,300	609.00	32,459,700	
三共生興	13,200	723.00	9,543,600	

兼 松	39,900	2,588.00	103,261,200	
美 津 濃	9,000	8,180.00	73,620,000	
ツカモトコーポレーション	500	1,186.00	593,000	
ルックホールディングス	2,800	2,715.00	7,602,000	
三井物産	714,900	7,430.00	5,311,707,000	
日本紙パルプ	4,500	5,910.00	26,595,000	
東京エレクトロン	190,900	34,080.00	6,505,872,000	
カメイ	10,200	2,159.00	22,021,800	
東都水産	200	6,460.00	1,292,000	
OUGホールディングス	500	2,723.00	1,361,500	
スターゼン	6,600	2,755.00	18,183,000	
セイコーグループ	12,600	4,855.00	61,173,000	
山 善	28,900	1,432.00	41,384,800	
椿本興業	5,900	2,148.00	12,673,200	
住友商事	577,600	3,899.00	2,252,062,400	
ＢＩＰＲＯＧＹ	29,600	4,175.00	123,580,000	
内田洋行	3,900	7,540.00	29,406,000	
三菱商事	1,832,600	3,080.00	5,644,408,000	
第一実業	9,000	2,331.00	20,979,000	
キヤノンマーケティングJPN	22,100	4,411.00	97,483,100	
西華産業	3,700	4,435.00	16,409,500	
佐藤商事	6,600	1,624.00	10,718,400	
東京産業	8,700	666.00	5,794,200	貸付株式数　3,200株
ユアサ商事	7,500	5,480.00	41,100,000	
神鋼商事	2,400	7,270.00	17,448,000	
トルク	2,300	222.00	510,600	
阪和興業	17,100	5,930.00	101,403,000	
正栄食品	6,400	4,615.00	29,536,000	貸付株式数　2,500株
カナデン	7,200	1,571.00	11,311,200	
ＲＹＯＤＥＮ	7,700	2,609.00	20,089,300	
ニプロ	75,200	1,211.50	91,104,800	
岩谷産業	21,700	9,243.00	200,573,100	
ナイス	2,500	1,860.00	4,650,000	
ニチモウ	1,000	2,104.00	2,104,000	
極東貿易	5,700	1,711.00	9,752,700	貸付株式数　2,100株
アステナホールディングス	18,000	485.00	8,730,000	
三愛オブリ	22,300	2,113.00	47,119,900	
稲畑産業	18,800	3,380.00	63,544,000	
ＧＳＩクレオス	5,100	2,156.00	10,995,600	貸付株式数　1,000株
明和産業	11,200	712.00	7,974,400	

クワザワホールディングス	1,100	848.00	932,800	貸付株式数	400株
ゴールドウイン	16,000	8,545.00	136,720,000		
ユニ・チャーム	188,500	5,232.00	986,232,000		
デサント	15,600	3,345.00	52,182,000		
キ ン グ	1,200	718.00	861,600		
ワ キ タ	15,800	1,702.00	26,891,600		
ヤマトインターナシヨナル	2,300	345.00	793,500		
東邦ホールディングス	25,800	3,842.00	99,123,600	貸付株式数	9,800株
サンゲツ	22,000	3,040.00	66,880,000		
ミツウロコグループ	12,200	1,573.00	19,190,600	貸付株式数	4,700株
シナネンホールディングス	2,600	4,730.00	12,298,000		
伊藤忠エネクス	23,700	1,505.00	35,668,500		
サンリオ	77,500	2,771.50	214,791,250		
サンワ テクノス	4,900	2,264.00	11,093,600		
新光商事	12,800	955.00	12,224,000	貸付株式数	4,800株
トーホー	3,700	3,740.00	13,838,000		
三信電気	3,900	2,105.00	8,209,500		
東陽テクニカ	8,800	1,596.00	14,044,800		
モスフード サービス	14,000	3,600.00	50,400,000		
加賀電子	8,700	5,560.00	48,372,000		
三益半導体	8,400	3,675.00	30,870,000		
都築電気	4,700	2,303.00	10,824,100	貸付株式数	1,500株
ソーダニツカ	9,100	1,101.00	10,019,100		
立花エレテック	6,300	3,080.00	19,404,000		
木曽路	14,400	2,538.00	36,547,200	貸付株式数	5,500株
SRSホールディングス	15,700	1,273.00	19,986,100	貸付株式数	5,800株
千 趣 会	17,700	321.00	5,681,700	貸付株式数	6,000株
タカキユー	2,100	93.00	195,300	貸付株式数	800株
リテールパートナーズ	14,200	1,595.00	22,649,000	貸付株式数	5,500株
上新電機	9,500	2,559.00	24,310,500		
日本瓦斯	50,600	2,363.50	119,593,100		
ロイヤルホールディングス	16,800	2,595.00	43,596,000	貸付株式数	6,700株
東 天 紅	300	910.00	273,000		
いなげや	9,300	1,242.00	11,550,600		
チヨダ	9,300	894.00	8,314,200		
ライフコーポレーション	10,000	3,950.00	39,500,000		
リンガーハツト	12,300	2,366.00	29,101,800	貸付株式数	4,900株
ＭｒＭａｘＨＤ	12,100	657.00	7,949,700		
テンアライド	4,300	297.00	1,277,100	貸付株式数	1,600株

AOKIホールディングス	20,500	1,232.00	25,256,000	
オークワ	13,800	938.00	12,944,400	貸付株式数 4,900株
コメリ	14,700	3,490.00	51,303,000	
青山商事	20,400	1,456.00	29,702,400	
しまむら	22,400	7,167.00	160,540,800	
はせがわ	1,500	357.00	535,500	
高 島 屋	60,800	2,602.00	158,201,600	
松 屋	16,200	1,046.00	16,945,200	貸付株式数 6,300株
エイチ・ツー・オーリテイリング	42,200	2,279.00	96,173,800	貸付株式数 16,500株
近鉄百貨店	4,100	2,295.00	9,409,500	貸付株式数 1,500株
丸井グループ	63,300	2,235.50	141,507,150	
クレディセゾン	56,300	3,316.00	186,690,800	
アクシアル リテイリング	26,000	1,004.00	26,104,000	
井 筒 屋	1,500	455.00	682,500	貸付株式数 500株
イオン	323,500	3,424.00	1,107,664,000	
イ ズ ミ	16,900	3,133.00	52,947,700	
フオーバル	3,700	1,429.00	5,287,300	貸付株式数 1,000株
平 和 堂	15,900	2,268.00	36,061,200	貸付株式数 5,800株
フ ジ	14,600	2,011.00	29,360,600	貸付株式数 5,400株
ヤオコー	11,300	9,765.00	110,344,500	貸付株式数 3,800株
ゼビオホールディングス	13,000	1,200.00	15,600,000	
ケーズホールディングス	64,100	1,409.50	90,348,950	
ＰＡＬＴＡＣ	12,900	4,341.00	55,998,900	
三谷産業	16,800	350.00	5,880,000	
OLYMPICグループ	1,500	549.00	823,500	貸付株式数 500株
日産東京販売ＨＤ	4,700	494.00	2,321,800	
あおぞら銀行	63,800	2,595.00	165,561,000	貸付株式数 25,200株
三菱UFJフィナンシャルG	5,410,400	1,544.50	8,356,362,800	貸付株式数 2,115,200株
りそなホールディングス	1,027,500	971.60	998,319,000	
三井住友トラストHD	319,300	3,522.00	1,124,574,600	
三井住友フィナンシャルG	622,200	9,860.00	6,134,892,000	※
千葉銀行	247,600	1,359.50	336,612,200	
群馬銀行	172,300	967.00	166,614,100	
武蔵野銀行	12,400	3,130.00	38,812,000	
千葉興業銀行	18,900	977.00	18,465,300	
筑波銀行	39,000	304.00	11,856,000	
七十七銀行	25,800	4,235.00	109,263,000	
秋田銀行	5,900	2,590.00	15,281,000	
山形銀行	9,900	1,139.00	11,276,100	

岩手銀行	5,600	2,788.00	15,612,800	
東邦銀行	70,300	316.00	22,214,800	
東北銀行	1,400	1,179.00	1,650,600	
ふくおかフィナンシャルG	77,400	4,050.00	313,470,000	
スルガ銀行	63,000	1,032.00	65,016,000	
八十二銀行	190,600	994.90	189,627,940	
山梨中央銀行	10,000	1,875.00	18,750,000	
大垣共立銀行	16,900	2,134.00	36,064,600	
福井銀行	8,000	2,007.00	16,056,000	貸付株式数 3,000株
清水銀行	3,600	1,620.00	5,832,000	
富山銀行	500	1,723.00	861,500	貸付株式数 200株
滋賀銀行	14,800	4,245.00	62,826,000	
南都銀行	13,400	3,370.00	45,158,000	
百五銀行	83,500	656.00	54,776,000	
紀陽銀行	31,800	1,870.00	59,466,000	
ほくほくフィナンシャルG	55,000	2,044.50	112,447,500	
山陰合同銀行	55,600	1,347.00	74,893,200	
鳥取銀行	1,000	1,370.00	1,370,000	
百十四銀行	8,800	3,270.00	28,776,000	
四国銀行	13,100	1,099.00	14,396,900	
阿波銀行	12,500	2,667.00	33,337,500	
大分銀行	5,300	3,330.00	17,649,000	
宮崎銀行	5,300	3,355.00	17,781,500	
佐賀銀行	5,200	2,533.00	13,171,600	
琉球銀行	18,900	1,194.00	22,566,600	
セブン銀行	278,500	259.30	72,215,050	
みずほフィナンシャルG	1,199,200	3,024.00	3,626,380,800	
高知銀行	1,000	898.00	898,000	
山口フィナンシャルG	87,100	1,710.00	148,941,000	
芙蓉総合リース	8,200	11,780.00	96,596,000	
みずほリース	74,400	1,104.00	82,137,600	
東京センチュリー	66,500	1,434.50	95,394,250	
SBIホールディングス	142,600	3,932.00	560,703,200	
日本証券金融	32,700	1,588.00	51,927,600	
アイフル	130,800	376.00	49,180,800	
日本アジア投資	2,100	239.00	501,900	貸付株式数 800株
名古屋銀行	5,600	7,230.00	40,488,000	
北洋銀行	134,600	529.00	71,203,400	
大光銀行	1,000	1,578.00	1,578,000	
愛媛銀行	12,000	1,232.00	14,784,000	

トマト銀行	1,100	1,224.00	1,346,400	
京葉銀行	36,600	854.00	31,256,400	
栃木銀行	44,400	354.00	15,717,600	
北日本銀行	2,900	2,539.00	7,363,100	
東和銀行	16,400	685.00	11,234,000	
福島銀行	3,100	271.00	840,100	貸付株式数 1,200株
大東銀行	1,300	743.00	965,900	貸付株式数 500株
リコーリース	8,400	5,020.00	42,168,000	貸付株式数 3,200株
イオンフィナンシャルサービス	51,000	1,290.00	65,790,000	
ア コ ム	158,800	379.00	60,185,200	
ジャックス	9,400	4,725.00	44,415,000	
オ リ コ	29,100	1,014.00	29,507,400	
オリックス	532,800	3,364.00	1,792,339,200	
三菱HCキャピタル	396,000	1,018.00	403,128,000	
ジャフコ グループ	26,500	1,877.50	49,753,750	
九州 リースサービス	1,200	1,033.00	1,239,600	貸付株式数 400株
トモニホールディングス	84,100	397.00	33,387,700	
大和証券G本社	688,300	1,169.00	804,622,700	
野村ホールディングス	1,494,200	898.00	1,341,791,600	
岡三証券グループ	78,000	772.00	60,216,000	貸付株式数 7,200株
丸三証券	29,500	991.00	29,234,500	
東洋証券	23,600	376.00	8,873,600	
東海東京ＨＤ	105,500	569.00	60,029,500	
光世証券	700	605.00	423,500	貸付株式数 200株
水戸証券	26,200	535.00	14,017,000	
いちよし証券	16,600	817.00	13,562,200	
松井証券	43,700	797.00	34,828,900	
SOMPOホールディングス	400,900	3,163.00	1,268,046,700	
日本取引所グループ	229,100	3,573.00	818,574,300	
マネックスＧ	87,000	715.00	62,205,000	
極東証券	12,100	1,417.00	17,145,700	貸付株式数 4,600株
岩井コスモホールディング	10,100	2,160.00	21,816,000	
アイザワ証券グループ	12,800	2,216.00	28,364,800	
フィデアホール	9,200	1,574.00	14,480,800	
池田泉州ＨＤ	123,100	388.00	47,762,800	
アニコム ホールディングス	30,100	640.00	19,264,000	
ＭＳ＆ＡＤ	596,800	3,059.00	1,825,611,200	
マネーパートナーズGP	3,000	246.00	738,000	

スパークス・グループ	9,900	1,642.00	16,255,800		
小林洋行	1,200	285.00	342,000	貸付株式数	400株
第一生命HLDGS	417,700	3,864.00	1,613,992,800		
東京海上ＨＤ	867,400	5,263.00	4,565,126,200		
アドバンテッジリスクマネ	1,600	503.00	804,800		
イー・ギャランティ	14,500	1,358.00	19,691,000		
アサックス	1,300	818.00	1,063,400	貸付株式数	500株
NECキャピタルソリューション	4,300	3,835.00	16,490,500		
T&Dホールディングス	238,600	2,590.00	617,974,000		
アドバンスクリエイト	6,900	1,056.00	7,286,400	貸付株式数	200株
三井不動産	1,232,500	1,416.00	1,745,220,000		
三菱地所	580,800	2,480.00	1,440,384,000		
平和不動産	14,400	3,895.00	56,088,000		
東京建物	77,600	2,401.00	186,317,600		
京阪神ビルディング	16,600	1,713.00	28,435,800		
住友不動産	128,500	4,664.00	599,324,000		
太平洋興発	1,200	780.00	936,000	貸付株式数	400株
テーオーシー	15,800	681.00	10,759,800		
スターツコーポレーション	12,800	3,390.00	43,392,000		
フジ住宅	11,200	738.00	8,265,600		
空港施設	12,500	596.00	7,450,000		
明和地所	5,700	920.00	5,244,000	貸付株式数	1,800株
ゴールドクレスト	7,300	2,624.00	19,155,200	貸付株式数	1,500株
リログループ	46,500	1,677.00	77,980,500		
エスリード	4,200	4,415.00	18,543,000	貸付株式数	1,500株
日神グループHLDGS	14,200	519.00	7,369,800	貸付株式数	5,200株
日本エスコン	16,600	1,043.00	17,313,800		
MIRARTHホールディング	40,800	489.00	19,951,200		
ＡＶＡＮＴＩＡ	1,600	836.00	1,337,600	貸付株式数	600株
イオンモール	46,000	1,946.00	89,516,000	貸付株式数	17,500株
毎日コムネット	1,100	741.00	815,100	貸付株式数	100株
ファースト住建	1,200	1,066.00	1,279,200	貸付株式数	400株
ランド	491,400	9.00	4,422,600	貸付株式数	177,800株
カチタス	23,900	1,678.00	40,104,200		
東祥	6,500	703.00	4,569,500	貸付株式数	2,400株
トーセイ	14,800	2,291.00	33,906,800		
穴吹興産	700	2,211.00	1,547,700	貸付株式数	200株
サンフロンティア不動産	13,200	1,920.00	25,344,000		
インテリックス	700	537.00	375,900		

ランドビジネス	1,000	238.00	238,000	貸付株式数	400株
サンネクスタグループ	1,000	1,059.00	1,059,000	貸付株式数	300株
グランディハウス	7,400	588.00	4,351,200	貸付株式数	300株
東武鉄道	99,100	2,612.00	258,849,200		
相鉄ホールディングス	32,300	2,331.00	75,291,300		
東急	253,000	1,753.50	443,635,500		
京浜急行	111,700	1,130.50	126,276,850		
小田急電鉄	149,200	1,508.00	224,993,600		
京王電鉄	43,400	3,541.00	153,679,400		
京成電鉄	58,200	5,342.00	310,904,400		
富士急行	11,100	2,770.00	30,747,000		
東日本旅客鉄道	497,200	2,505.50	1,245,734,600		
西日本旅客鉄道	214,000	2,890.00	618,460,000		
東海旅客鉄道	347,500	3,289.00	1,142,927,500		
西武ホールディングス	109,100	2,188.50	238,765,350		
鴻池運輸	15,400	2,365.00	36,421,000		
西日本鉄道	24,100	2,511.50	60,527,150		
ハマキョウレックス	7,700	4,190.00	32,263,000		
サカイ引越センター	10,000	2,449.00	24,490,000		
近鉄グループHLDGS	90,000	3,257.00	293,130,000		
阪急阪神HLDGS	120,100	3,952.00	474,635,200		
南海電鉄	40,200	2,533.50	101,846,700		
京阪ホールディングス	49,600	2,776.00	137,689,600		
神戸電鉄	2,400	2,724.00	6,537,600	貸付株式数	900株
名古屋鉄道	92,900	1,683.50	156,397,150		
山陽電鉄	6,700	2,046.00	13,708,200	貸付株式数	1,200株
アルプス物流	7,200	5,710.00	41,112,000	貸付株式数	800株
トランコム	2,600	6,330.00	16,458,000		
ヤマトホールディングス	109,500	1,669.00	182,755,500		
山 九	21,700	5,378.00	116,702,600		
日 新	6,800	4,505.00	30,634,000		
丸 運	1,700	373.00	634,100	貸付株式数	600株
丸全昭和運輸	5,600	5,080.00	28,448,000		
センコーグループHLDGS	47,800	1,108.00	52,962,400		
トナミホールディングス	2,000	5,490.00	10,980,000		
ニッコンホールディングス	27,700	2,988.00	82,767,600		
日石輸送	300	3,030.00	909,000		
福山通運	10,300	4,060.00	41,818,000	貸付株式数	4,000株
セイノーホールディングス	50,600	2,062.50	104,362,500		
エスライングループ本社	800	1,466.00	1,172,800	貸付株式数	300株

神奈川中央交通	2,600	3,025.00	7,865,000		
AZ-COM丸和ホールディ	23,100	1,173.00	27,096,300		
C&Fロジホールディングス	8,300	5,730.00	47,559,000		
日本郵船	233,300	4,677.00	1,091,144,100		
商船三井	195,600	4,850.00	948,660,000		
川崎汽船	217,000	2,270.00	492,590,000	貸付株式数	31,800株
NSユナイテッド海運	4,800	4,780.00	22,944,000	貸付株式数	1,500株
明海グループ	3,300	687.00	2,267,100	貸付株式数	1,200株
飯野海運	33,000	1,269.00	41,877,000		
共栄タンカー	600	1,272.00	763,200	貸付株式数	200株
九州旅客鉄道	63,700	3,326.00	211,866,200		
SGホールディングス	151,300	1,461.50	221,124,950		
NIPPON EXPRESS	30,600	7,275.00	222,615,000		
ID&E ホールディングス	5,600	4,250.00	23,800,000		
日本航空	221,100	2,462.00	544,348,200		
ANAホールディングス	245,000	2,888.50	707,682,500		
ビーウィズ	1,900	1,829.00	3,475,100	貸付株式数	700株
パスコ	600	1,757.00	1,054,200		
TREホールディングス	17,700	1,174.00	20,779,800	貸付株式数	3,400株
人・夢・技術グループ	3,800	1,696.00	6,444,800		
西本WISMETTAC HD	2,400	4,355.00	10,452,000	貸付株式数	600株
シルバーライフ	2,600	969.00	2,519,400		
ヤマシタヘルスケアHLDGS	200	2,633.00	526,600		
GENKY DRUGSTORES	4,200	5,650.00	23,730,000	貸付株式数	1,600株
コーア商事HLDGS	6,700	690.00	4,623,000	貸付株式数	2,400株
KPPグループホールディン	24,700	797.00	19,685,900		
ナルミヤ・インターナショナル	500	1,321.00	660,500	貸付株式数	100株
ブックオフＧＨＤ	6,200	1,586.00	9,833,200	貸付株式数	100株
ギフトホールディングス	4,000	2,626.00	10,504,000	貸付株式数	1,500株
三菱倉庫	21,500	5,163.00	111,004,500		
三井倉庫HOLD	8,400	4,485.00	37,674,000		
住友倉庫	24,000	2,534.00	60,816,000		
渋沢倉庫	4,100	3,020.00	12,382,000		
ヤマタネ	4,200	2,855.00	11,991,000		
東陽倉庫	800	1,493.00	1,194,400		
乾汽船	10,500	1,105.00	11,602,500	貸付株式数	4,100株
日本トランスシティ	18,200	959.00	17,453,800		
ケイヒン	500	2,340.00	1,170,000		
中央倉庫	4,800	1,210.00	5,808,000	貸付株式数	1,400株

川西倉庫	600	1,190.00	714,000	貸付株式数	200株
安田倉庫	6,200	1,623.00	10,062,600	貸付株式数	2,200株
ファイズホールディングス	400	1,047.00	418,800	貸付株式数	100株
ＮＩＳＳＯＨＤ	8,000	816.00	6,528,000	貸付株式数	2,900株
大栄環境	16,800	2,501.00	42,016,800		
日本管財ホールディンク	9,700	2,599.00	25,210,300		
東洋埠頭	900	1,358.00	1,222,200		
上 組	41,600	3,283.00	136,572,800		
サンリツ	700	886.00	620,200	貸付株式数	200株
キムラユニティー	1,400	1,705.00	2,387,000		
キユーソー流通システム	4,600	1,644.00	7,562,400	貸付株式数	1,800株
東海運	1,700	293.00	498,100	貸付株式数	600株
エーアイテイー	5,600	1,815.00	10,164,000	貸付株式数	2,100株
内外トランスライン	3,600	2,702.00	9,727,200	貸付株式数	1,300株
ショーエイコーポ	1,000	582.00	582,000	貸付株式数	300株
日本コンセプト	3,200	1,901.00	6,083,200		
TBSホールディングス	45,500	3,954.00	179,907,000	貸付株式数	17,000株
日本テレビHLDS	80,100	2,215.00	177,421,500	貸付株式数	17,900株
朝日放送グループHD	8,500	660.00	5,610,000	貸付株式数	3,200株
テレビ朝日ＨＤ	22,000	2,069.00	45,518,000		
スカパーJSATHD	70,300	858.00	60,317,400		
テレビ東京ＨＤ	6,500	3,375.00	21,937,500	貸付株式数	2,300株
日本ＢＳ放送	1,100	904.00	994,400	貸付株式数	400株
ビジョン	13,500	1,170.00	15,795,000		
スマートバリュー	800	388.00	310,400	貸付株式数	300株
U-NEXT HOLDINGS	10,100	4,700.00	47,470,000		
ワイヤレスゲート	1,300	229.00	297,700	貸付株式数	500株
日本通信	88,800	187.00	16,605,600	貸付株式数	33,900株
クロップス	400	1,141.00	456,400		
日本電信電話	26,911,600	144.90	3,899,490,840		
ＫＤＤＩ	699,100	4,175.00	2,918,742,500		
ソフトバンク	1,444,500	1,945.50	2,810,274,750		
光通信	9,100	27,850.00	253,435,000		
エムティーアイ	6,200	824.00	5,108,800	貸付株式数	2,000株
GMOインターネットグループ	33,200	2,386.00	79,215,200		
ファイバーゲート	4,900	1,047.00	5,130,300	貸付株式数	1,900株
アイドママーケティングコミュ	800	230.00	184,000	貸付株式数	300株
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	47,800	2,851.50	136,301,700		

学研ホールディングス	16,600	980.00	16,268,000	
ゼンリン	15,400	906.00	13,952,400	
昭文社ホールディングス	1,200	359.00	430,800	
インプレスホールディングス	2,900	160.00	464,000	貸付株式数 1,100株
東京電力ＨＤ	813,100	855.00	695,200,500	貸付株式数 255,600株
中部電力	332,400	1,910.00	634,884,000	
関西電力	348,300	2,752.50	958,695,750	
中国電力	156,700	1,066.50	167,120,550	
北陸電力	92,200	1,058.50	97,593,700	
東北電力	237,500	1,460.00	346,750,000	
四国電力	84,000	1,426.00	119,784,000	
九州電力	207,900	1,723.50	358,315,650	
北海道電力	87,100	1,415.50	123,290,050	
沖縄電力	23,100	1,101.00	25,433,100	
電源開発	74,100	2,505.00	185,620,500	
エフオン	6,700	410.00	2,747,000	
イーレックス	16,100	675.00	10,867,500	貸付株式数 6,200株
レノバ	24,100	1,008.00	24,292,800	貸付株式数 9,600株
東京瓦斯	175,600	3,548.00	623,028,800	
大阪瓦斯	179,800	3,515.00	631,997,000	
東邦瓦斯	39,100	4,035.00	157,768,500	
北海道瓦斯	5,400	3,415.00	18,441,000	貸付株式数 1,000株
広島ガス	19,100	380.00	7,258,000	
西部ガスHLDGS	9,400	1,981.00	18,621,400	貸付株式数 3,600株
静岡ガス	18,000	935.00	16,830,000	
メタウォーター	10,800	1,902.00	20,541,600	
アイネット	5,500	2,116.00	11,638,000	
松 竹	4,700	9,368.00	44,029,600	貸付株式数 1,800株
東 宝	50,300	4,589.00	230,826,700	
エイチ・アイ・エス	27,000	1,685.00	45,495,000	貸付株式数 10,800株
東 映	14,900	3,670.00	54,683,000	
ラックランド	4,200	2,094.00	8,794,800	貸付株式数 1,600株
NTTデータグループ	236,500	2,211.00	522,901,500	
共立メンテナンス	29,100	2,983.00	86,805,300	貸付株式数 2,800株
イチネンホールディングス	9,800	1,619.00	15,866,200	
建設技術研究所	4,800	4,850.00	23,280,000	
スペース	6,100	1,129.00	6,886,900	
アインホールディングス	13,100	5,723.00	74,971,300	貸付株式数 4,400株
燦ホールディングス	8,600	1,153.00	9,915,800	

ピー・シー・エー	5,200	2,246.00	11,679,200	
スバル興業	3,200	2,531.00	8,099,200	
東京テアトル	1,100	1,114.00	1,225,400	
タナベコンサルティンググル	3,600	1,049.00	3,776,400	
ビジネスＢ太田昭和	3,500	2,149.00	7,521,500	
ナ ガ ワ	2,900	7,760.00	22,504,000	貸付株式数 1,100株
東京都競馬	7,800	4,010.00	31,278,000	貸付株式数 2,700株
常磐興産	1,100	1,208.00	1,328,800	貸付株式数 400株
カナモト	14,400	2,982.00	42,940,800	
ＤＴＳ	19,000	4,135.00	78,565,000	
スクウェア・エニックス・HD	41,300	4,511.00	186,304,300	
シーイーシー	11,400	2,135.00	24,339,000	
カプコン	161,800	2,857.50	462,343,500	
ニシオホールディングス	7,700	4,055.00	31,223,500	
アイ・エス・ビー	4,600	1,385.00	6,371,000	貸付株式数 1,200株
アゴーラ ホスピタリティーG	19,200	43.00	825,600	貸付株式数 7,600株
日本空港ビルデング	31,400	5,404.00	169,685,600	
トランス・コスモス	11,500	3,280.00	37,720,000	貸付株式数 1,400株
乃村工藝社	40,500	825.00	33,412,500	
ジャステック	5,200	1,934.00	10,056,800	
ＳＣＳＫ	63,300	3,068.00	194,204,400	
藤田観光	3,700	6,120.00	22,644,000	貸付株式数 1,400株
KNT-CTホールディングス	5,600	1,331.00	7,453,600	貸付株式数 1,700株
トーカイ	8,200	2,149.00	17,621,800	
白 洋 舎	500	2,447.00	1,223,500	貸付株式数 100株
セコム	94,400	9,260.00	874,144,000	
ＮＳＷ	4,000	3,135.00	12,540,000	
セントラル警備保障	5,000	2,949.00	14,745,000	
アイネス	7,100	1,673.00	11,878,300	
丹青社	18,000	949.00	17,082,000	
メイテックグループホールデ	31,600	3,028.00	95,684,800	
ＴＫＣ	16,200	3,245.00	52,569,000	
富士ソフト	18,200	6,870.00	125,034,000	貸付株式数 5,900株
応用地質	8,600	2,627.00	22,592,200	
船井総研ホールディン	18,600	2,245.00	41,757,000	貸付株式数 1,900株
ＮＳＤ	31,900	3,045.00	97,135,500	

進学会ホールディングス	800	236.00	188,800	貸付株式数 300株 (300株)
丸紅建材リース	200	3,020.00	604,000	
オ オ バ	2,000	1,070.00	2,140,000	貸付株式数 800株 (800株)
コナミグループ	33,900	10,770.00	365,103,000	
いであ	800	2,305.00	1,844,000	
学 究 社	3,700	2,077.00	7,684,900	
イオンディライト	10,000	3,815.00	38,150,000	
ナック	7,800	567.00	4,422,600	貸付株式数 2,400株
福井コンピュータHLDS	5,600	2,364.00	13,238,400	
ダイセキ	18,900	3,280.00	61,992,000	
ステップ	3,400	1,891.00	6,429,400	
泉州電業	5,900	5,230.00	30,857,000	貸付株式数 700株
元気寿司	5,400	3,205.00	17,307,000	貸付株式数 1,900株
トラスコ中山	20,100	2,377.00	47,777,700	
ヤマダホールディングス	293,900	424.30	124,701,770	
オートバックスセブン	33,200	1,514.50	50,281,400	
モリト	6,800	1,414.00	9,615,200	
アークランズ	28,400	1,895.00	53,818,000	
ニトリホールディングス	34,700	16,760.00	581,572,000	
グルメ杵屋	7,700	1,104.00	8,500,800	貸付株式数 2,800株
愛 眼	2,500	179.00	447,500	貸付株式数 900株
ケーユーホールディングス	4,500	1,254.00	5,643,000	
吉野家ホールディングス	35,200	3,018.00	106,233,600	貸付株式数 14,000株 (4,400株)
加藤産業	11,800	4,220.00	49,796,000	
北恵	800	860.00	688,000	
イノテック	6,000	1,711.00	10,266,000	
イエローハット	15,100	2,121.00	32,027,100	
松屋フーズHLDGS	4,500	5,730.00	25,785,000	
JBCCホールディングス	6,000	3,235.00	19,410,000	
JKホールディングス	7,300	1,003.00	7,321,900	
サガミホールディングス	14,300	1,613.00	23,065,900	貸付株式数 300株
日 伝	6,300	3,630.00	22,869,000	
関西フードマーケット	6,500	2,373.00	15,424,500	
ミロク情報サービス	8,200	1,837.00	15,063,400	
北沢産業	1,900	374.00	710,600	貸付株式数 700株
杉本商事	4,600	2,393.00	11,007,800	
因幡電機産業	24,800	3,800.00	94,240,000	

王将フードサービス	7,100	8,700.00	61,770,000	
ミニストップ	6,900	1,718.00	11,854,200	貸付株式数 2,700株 (500株)
アークス	17,500	2,862.00	50,085,000	
バローホールディングス	18,200	2,367.00	43,079,400	
東 テ ク	9,500	2,495.00	23,702,500	
ミスミグループ本社	144,200	2,627.00	378,813,400	
アルテック	1,600	265.00	424,000	
ベ ル ク	4,700	7,280.00	34,216,000	
大 庄	5,100	1,230.00	6,273,000	貸付株式数 2,000株 (500株)
タキヒヨー	800	1,171.00	936,800	貸付株式数 200株
ファーストリテイリング	53,700	39,460.00	2,119,002,000	
ソフトバンクグループ	446,300	10,120.00	4,516,556,000	
蔵王産業	600	2,564.00	1,538,400	
スズケン	34,100	4,629.00	157,848,900	
サンドラッグ	32,200	3,923.00	126,320,600	
サックスバーホールディング	8,100	772.00	6,253,200	貸付株式数 3,000株
ジェコス	5,700	977.00	5,568,900	
ヤマザワ	700	1,265.00	885,500	貸付株式数 200株
や ま や	700	3,075.00	2,152,500	貸付株式数 200株
ベルーナ	23,000	742.00	17,066,000	
合計			343,000,160,660	

（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
トヨタ自動車	60,000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。

【ダイワファンドラップ 日経２２５インデックス】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2023年6月16日から2024年6月17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】

ダイワファンドラップ 日経２２５インデックス

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	85,454,116	52,958,401
親投資信託受益証券	19,295,903,526	24,043,252,557
未収入金	600,000	-
流動資産合計	19,381,957,642	24,096,210,958
資産合計	19,381,957,642	24,096,210,958
負債の部		
流動負債		
未払解約金	54,836,971	8,504,241
未払受託者報酬	1,776,354	2,555,039
未払委託者報酬	25,757,872	37,048,606
その他未払費用	444,003	638,674
流動負債合計	82,815,200	48,746,560
負債合計	82,815,200	48,746,560
純資産の部		
元本等		
元本	※1 8,607,441,935	※1 9,290,599,405
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	10,691,700,507	14,756,864,993
（分配準備積立金）	5,633,411,192	6,746,137,868
元本等合計	19,299,142,442	24,047,464,398
純資産合計	19,299,142,442	24,047,464,398
負債純資産合計	19,381,957,642	24,096,210,958

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期 自　2022年6月16日 至　2023年6月15日	第8期 自　2023年6月16日 至　2024年6月17日
営業収益		
受取利息	163	8,532
有価証券売買等損益	4,448,786,571	3,272,949,031
営業収益合計	4,448,786,734	3,272,957,563
営業費用		
支払利息	13,232	8,811
受託者報酬	3,473,250	4,679,796
委託者報酬	50,363,495	67,858,116
その他費用	868,146	1,169,784
営業費用合計	54,718,123	73,716,507
営業利益又は営業損失（△）	4,394,068,611	3,199,241,056
経常利益又は経常損失（△）	4,394,068,611	3,199,241,056
当期純利益又は当期純損失（△）	4,394,068,611	3,199,241,056
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（△）	225,099,454	454,146,697
期首剰余金又は期首欠損金（△）	6,098,752,418	10,691,700,507
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,676,168,374	5,087,728,958
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,676,168,374	5,087,728,958
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,252,189,442	3,767,658,831
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,252,189,442	3,767,658,831
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	10,691,700,507	14,756,864,993

(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8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日
1．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2024年6月15日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2024年6月17日としております。このため、当計算期間は368日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	第7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
1．　※1 期首元本額	8,353,925,182円	8,607,441,935円
期中追加設定元本額	1,947,250,912円	3,716,226,558円
期中一部解約元本額	1,693,734,159円	3,033,069,088円
2．　計算期間末日における受益権の総数	8,607,441,935口	9,290,599,405口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第7期 自2022年6月16日 至2023年6月15日	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日

※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（3,127,927,727円）、投資信託約款に規定される収益調整金（5,058,301,185円）及び分配準備積立金（2,505,483,465円）より分配対象額は10,691,712,377円（1万口当たり12,421.47円）であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,373円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（2,745,084,545円）、投資信託約款に規定される収益調整金（8,010,727,125円）及び分配準備積立金（4,001,051,950円）より分配対象額は14,756,864,993円（1万口当たり15,883.65円）であり、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	第8期 2024年6月17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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	4,280,988,818	2,910,197,942
合計	4,280,988,818	2,910,197,942

(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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17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8期 自2023年6月16日 至2024年6月17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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.2421円 (22,421円)	2.5884円 (25,884円)

(4)【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	ストックインデックス２２５・マザーファンド	4,577,487,398	24,043,252,557	
親投資信託受益証券 合計			24,043,252,557	
合計			24,043,252,557	

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

	2023年6月15日現在 金 額（円）	2024年6月17日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		

コール・ローン		4,299,179,640	8,530,980,552
株式	※2※3	251,968,590,600	320,521,492,500
派生商品評価勘定		123,941,050	-
未収入金		19,426,800	-
未収配当金		1,520,242,820	1,489,316,400
未収利息		60,059	-
前払金		-	77,380,000
その他未収収益	※4	16,253,348	66,238
差入委託証拠金		13,230,000	-
流動資産合計		257,960,924,317	330,619,235,690
資産合計		257,960,924,317	330,619,235,690
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	252,998,800
前受金		155,290,000	-
未払金		-	13,699,800
未払解約金		1,378,817,000	932,694,000
受入担保金		1,431,695,800	708,094,558
流動負債合計		2,965,802,800	1,907,487,158
負債合計		2,965,802,800	1,907,487,158
純資産の部			
元本等			
元本	※1	56,240,375,491	62,582,339,693
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）		198,754,746,026	266,129,408,839
元本等合計		254,995,121,517	328,711,748,532
純資産合計		254,995,121,517	328,711,748,532
負債純資産合計		257,960,924,317	330,619,235,690

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2024年6月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023年6月15日現在	2024年6月17日現在
1. ※1 期首	2022年6月16日	2023年6月16日
期首元本額	60,104,604,144円	56,240,375,491円
期中追加設定元本額	21,913,993,799円	24,015,857,414円
期中一部解約元本額	25,778,222,452円	17,673,893,212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２２５	21,542,701,854円	23,368,091,905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２２５ＶＡ	232,174,028円	187,814,147円
大和 ストック インデックス ２２５ ファンド	6,944,835,557円	7,615,504,332円
Ｄ－Ｉ's 日経２２５インデックス	57,189,266円	44,597,896円
ｉＦｒｅｅ 日経２２５インデックス	10,715,580,491円	14,577,741,227円

	ＤＣ・ダイワ・ストックインデックス２２５（確定拠出年金専用ファンド）	5,432,929,086円	5,589,483,405円
	ダイワ・ノーロード 日経２２５ファンド	366,133,843円	433,048,723円
	ダイワファンドラップ 日経２２５インデックス	4,255,823,451円	4,577,487,398円
	ダイワ日経２２５インデックス（ダイワＳＭＡ専用）	649,105,523円	657,522,498円
	ダイワ・インデックスセレクト 日経２２５	6,043,902,392円	5,531,048,162円
計		56,240,375,491円	62,582,339,693円
2.	期末日における受益権の総数	56,240,375,491口	62,582,339,693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　1,379,502,900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　679,445,020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　4,542,640,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式　5,008,330,000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。	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年6月16日 至2024年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年6月17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	2023年6月15日現在	2024年6月17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	44,669,937,802	38,890,746,083
合計	44,669,937,802	38,890,746,083

（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	2023年6月15日現在				2024年6月17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	2,849,500,000	-	2,973,490,000	123,990,000	8,460,880,000	-	8,208,000,000	△252,880,000
合計	2,849,500,000	-	2,973,490,000	123,990,000	8,460,880,000	-	8,208,000,000	△252,880,000

（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6月15日現在	2024年6月17日現在
1口当たり純資産額	4.5340円	5.2525円
（1万口当たり純資産額）	(45,340円)	(52,525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	
ニッスイ	275,000	849.30	233,557,500	
ＩＮＰＥＸ	110,000	2,268.00	249,480,000	
コムシスホールディングス	275,000	3,087.00	848,925,000	
大成建設	55,000	5,754.00	316,470,000	
大 林 組	275,000	1,773.00	487,575,000	
清水建設	275,000	836.00	229,900,000	
長谷工コーポレーシヨン	55,000	1,710.50	94,077,500	
鹿島建設	137,500	2,669.00	366,987,500	
大和ハウス	275,000	4,000.00	1,100,000,000	
積水ハウス	275,000	3,423.00	941,325,000	
日揮ホールディングス	275,000	1,221.50	335,912,500	
日清製粉Ｇ本社	275,000	1,791.00	492,525,000	
明治ホールディングス	110,000	3,472.00	381,920,000	
日本ハム	137,500	4,634.00	637,175,000	
エムスリー	660,000	1,476.50	974,490,000	
ディー・エヌ・エー	82,500	1,535.50	126,678,750	
サッポロホールディングス	55,000	5,615.00	308,825,000	
アサヒグループホールディン	275,000	5,630.00	1,548,250,000	
キリンＨＤ	275,000	2,068.00	568,700,000	
双日	27,500	3,838.00	105,545,000	
キッコーマン	1,375,000	1,811.00	2,490,125,000	
味 の 素	275,000	5,744.00	1,579,600,000	
ニチレイ	137,500	3,616.00	497,200,000	
日本たばこ産業	275,000	4,481.00	1,232,275,000	
Ｊ．フロント リテイリング	137,500	1,640.50	225,568,750	
ＺＯＺＯ	275,000	3,816.00	1,049,400,000	
三越伊勢丹ＨＤ	275,000	3,138.00	862,950,000	
東急不動産ＨＤ	275,000	1,051.00	289,025,000	
セブン&アイ・HLDGS	825,000	1,997.50	1,647,937,500	
帝 人	55,000	1,397.50	76,862,500	
東 レ	275,000	731.80	201,245,000	
ク ラ レ	275,000	1,816.00	499,400,000	
旭 化 成	275,000	998.50	274,587,500	
ＳＵＭＣＯ	27,500	2,346.50	64,528,750	
ネクソン	550,000	2,906.00	1,598,300,000	
王子ホールディングス	275,000	611.00	168,025,000	
日本製紙	27,500	954.00	26,235,000	

レゾナック・ホールディング	27,500	3,450.00	94,875,000	
住友化学	275,000	308.90	84,947,500	
日産化学	275,000	4,597.00	1,264,175,000	
東ソー	137,500	2,034.50	279,743,750	
トクヤマ	55,000	2,920.50	160,627,500	
デンカ	55,000	2,087.00	114,785,000	
信越化学	1,375,000	5,943.00	8,171,625,000	
協和キリン	275,000	2,717.50	747,312,500	
三井化学	55,000	4,337.00	238,535,000	
三菱ケミカルグループ	137,500	804.80	110,660,000	
ＵＢＥ	27,500	2,684.50	73,823,750	
電通グループ	275,000	3,916.00	1,076,900,000	貸付株式数　15,800株
メルカリ	275,000	2,094.00	575,850,000	
花 王	275,000	6,756.00	1,857,900,000	
武田薬品	275,000	4,167.00	1,145,925,000	※
アステラス製薬	1,375,000	1,509.50	2,075,562,500	
住友ファーマ	275,000	349.00	95,975,000	
塩野義製薬	275,000	6,147.00	1,690,425,000	
中外製薬	825,000	4,942.00	4,077,150,000	
エーザイ	275,000	6,375.00	1,753,125,000	
テ ル モ	2,200,000	2,574.50	5,663,900,000	
第一三共	825,000	5,400.00	4,455,000,000	
大塚ホールディングス	275,000	6,257.00	1,720,675,000	
ＤＩＣ	27,500	3,162.00	86,955,000	
オリエンタルランド	275,000	4,385.00	1,205,875,000	
ＬＩＮＥヤフー	110,000	364.60	40,106,000	
トレンドマイクロ	275,000	6,567.00	1,805,925,000	
サイバーエージェント	220,000	974.30	214,346,000	
楽天グループ	275,000	786.00	216,150,000	
富士フイルムHLDGS	825,000	3,640.00	3,003,000,000	
コニカミノルタ	275,000	443.30	121,907,500	
資 生 堂	275,000	5,003.00	1,375,825,000	
出光興産	550,000	1,059.00	582,450,000	
ENEOSホールディングス	275,000	807.00	221,925,000	
横浜ゴム	137,500	3,544.00	487,300,000	
ブリヂストン	275,000	6,448.00	1,773,200,000	
ＡＧＣ	55,000	5,204.00	286,220,000	
日本電気硝子	82,500	3,636.00	299,970,000	
太平洋セメント	27,500	3,988.00	109,670,000	

東海カーボン	275,000	918.00	252,450,000	
ＴＯＴＯ	137,500	3,678.00	505,725,000	
日本碍子	275,000	1,993.50	548,212,500	
日本製鉄	27,500	3,304.00	90,860,000	貸付株式数　3,200株
神戸製鋼所	27,500	1,946.50	53,528,750	
ＪＦＥホールディングス	27,500	2,256.00	62,040,000	
日本製鋼所	55,000	4,297.00	236,335,000	
三井金属	27,500	4,783.00	131,532,500	
三菱マテリアル	27,500	2,853.00	78,457,500	
住友鉱山	137,500	4,688.00	644,600,000	
DOWAホールディングス	55,000	5,398.00	296,890,000	貸付株式数　4,400株
古河電工	27,500	4,183.00	115,032,500	
住友電工	275,000	2,549.00	700,975,000	
フジクラ	275,000	3,273.00	900,075,000	
しずおかフィナンシャルク	275,000	1,429.50	393,112,500	
リクルートホールディングス	825,000	7,885.00	6,505,125,000	
オークマ	55,000	6,624.00	364,320,000	
アマダ	275,000	1,704.50	468,737,500	
ディスコ	55,000	63,880.00	3,513,400,000	
日本郵政	275,000	1,475.00	405,625,000	
ＳＭＣ	27,500	76,500.00	2,103,750,000	
小松製作所	275,000	4,379.00	1,204,225,000	
住友重機械	55,000	4,109.00	225,995,000	
日立建機	275,000	3,995.00	1,098,625,000	
クボタ	275,000	2,202.50	605,687,500	
荏原製作所	55,000	11,910.00	655,050,000	
ダイキン工業	275,000	22,960.00	6,314,000,000	※
日本精工	275,000	749.20	206,030,000	
ＮＴＮ	275,000	294.30	80,932,500	
ジェイテクト	275,000	1,055.00	290,125,000	
ミネベアミツミ	275,000	3,179.00	874,225,000	
日 立	55,000	16,725.00	919,875,000	
三菱電機	275,000	2,530.00	695,750,000	
富士電機	55,000	8,957.00	492,635,000	
安川電機	275,000	5,850.00	1,608,750,000	
ソシオネクスト	275,000	4,030.00	1,108,250,000	
ニデック	220,000	7,255.00	1,596,100,000	
オムロン	275,000	5,126.00	1,409,650,000	
ジーエス・ユアサ コーポ	55,000	3,231.00	177,705,000	

日本電気	27,500	12,345.00	339,487,500	
富 士 通	275,000	2,376.50	653,537,500	
ルネサスエレクトロニクス	275,000	3,143.00	864,325,000	
セイコーエプソン	550,000	2,401.00	1,320,550,000	
パナソニック ホールディンク	275,000	1,259.00	346,225,000	
シャープ	275,000	983.10	270,352,500	貸付株式数　113,200株
ソニーグループ	275,000	12,695.00	3,491,125,000	
Ｔ Ｄ Ｋ	825,000	8,863.00	7,311,975,000	
アルプスアルパイン	275,000	1,527.50	420,062,500	
横河電機	275,000	3,780.00	1,039,500,000	
アドバンテスト	2,200,000	5,337.00	11,741,400,000	
キーエンス	27,500	67,790.00	1,864,225,000	
デンソー	1,100,000	2,341.00	2,575,100,000	
レーザーテック	110,000	36,170.00	3,978,700,000	
カ シ オ	275,000	1,171.00	322,025,000	
ファナック	1,375,000	4,265.00	5,864,375,000	
京 セ ラ	2,200,000	1,811.50	3,985,300,000	
太陽誘電	275,000	4,057.00	1,115,675,000	
村田製作所	660,000	3,238.00	2,137,080,000	
日東電工	275,000	12,265.00	3,372,875,000	
日立造船	55,000	1,028.00	56,540,000	
三菱重工業	275,000	1,488.00	409,200,000	
川崎重工業	27,500	5,641.00	155,127,500	
ＩＨＩ	27,500	3,758.00	103,345,000	
コンコルディア・フィナンシャル	275,000	881.20	242,330,000	
日産自動車	275,000	519.80	142,945,000	
いすゞ自動車	137,500	1,979.00	272,112,500	
トヨタ自動車	1,375,000	3,036.00	4,174,500,000	
日野自動車	275,000	415.90	114,372,500	
三菱自動車工業	27,500	411.60	11,319,000	貸付株式数　10,500株
マ ツ ダ	55,000	1,441.00	79,255,000	
本田技研	1,650,000	1,642.50	2,710,125,000	
スズキ	1,100,000	1,787.50	1,966,250,000	
SUBARU	275,000	3,262.00	897,050,000	
ヤマハ発動機	825,000	1,470.00	1,212,750,000	
ニコン	275,000	1,519.50	417,862,500	
オリンパス	1,100,000	2,600.00	2,860,000,000	
SCREENホールディングス	110,000	14,725.00	1,619,750,000	

ＨＯＹＡ	137,500	18,080.00	2,486,000,000	
キヤノン	412,500	4,359.00	1,798,087,500	
リ コ ー	275,000	1,358.00	373,450,000	
シチズン時計	275,000	1,004.00	276,100,000	貸付株式数　　70,000株
バンダイナムコHLDGS	825,000	2,989.00	2,465,925,000	
TOPPANホールディングス	137,500	4,416.00	607,200,000	
大日本印刷	137,500	5,246.00	721,325,000	
ヤマハ	275,000	3,682.00	1,012,550,000	
任 天 堂	275,000	8,411.00	2,313,025,000	
伊 藤 忠	275,000	7,379.00	2,029,225,000	
丸 紅	275,000	2,982.00	820,050,000	
豊田通商	275,000	8,812.00	2,423,300,000	
三井物産	275,000	7,430.00	2,043,250,000	
東京エレクトロン	825,000	34,080.00	28,116,000,000	
住友商事	275,000	3,899.00	1,072,225,000	
三菱商事	825,000	3,080.00	2,541,000,000	
高 島 屋	137,500	2,602.00	357,775,000	
丸井グループ	275,000	2,235.50	614,762,500	
クレディセゾン	275,000	3,316.00	911,900,000	
イオン	275,000	3,424.00	941,600,000	
あおぞら銀行	27,500	2,595.00	71,362,500	貸付株式数　　11,500株
三菱UFJフィナンシャルG	275,000	1,544.50	424,737,500	
りそなホールディングス	27,500	971.60	26,719,000	
三井住友トラストHD	55,000	3,522.00	193,710,000	
三井住友フィナンシャルG	27,500	9,860.00	271,150,000	
千葉銀行	275,000	1,359.50	373,862,500	
ふくおかフィナンシャルG	55,000	4,050.00	222,750,000	
みずほフィナンシャルＧ	27,500	3,024.00	83,160,000	
オリックス	275,000	3,364.00	925,100,000	
大和証券Ｇ本社	275,000	1,169.00	321,475,000	
野村ホールディングス	275,000	898.00	246,950,000	
SOMPOホールディングス	165,000	3,163.00	521,895,000	
日本取引所グループ	275,000	3,573.00	982,575,000	
ＭＳ＆ＡＤ	247,500	3,059.00	757,102,500	
第一生命HLDGS	27,500	3,864.00	106,260,000	
東京海上ＨＤ	412,500	5,263.00	2,170,987,500	
T&Dホールディングス	55,000	2,590.00	142,450,000	
三井不動産	825,000	1,416.00	1,168,200,000	
三菱地所	275,000	2,480.00	682,000,000	
東京建物	137,500	2,401.00	330,137,500	

住友不動産	275,000	4,664.00	1,282,600,000	
東武鉄道	55,000	2,612.00	143,660,000	
東急	137,500	1,753.50	241,106,250	
小田急電鉄	137,500	1,508.00	207,350,000	
京王電鉄	55,000	3,541.00	194,755,000	
京成電鉄	137,500	5,342.00	734,525,000	
東日本旅客鉄道	82,500	2,505.50	206,703,750	
西日本旅客鉄道	55,000	2,890.00	158,950,000	
東海旅客鉄道	137,500	3,289.00	452,237,500	
ヤマトホールディングス	275,000	1,669.00	458,975,000	
日本郵船	82,500	4,677.00	385,852,500	
商船三井	82,500	4,850.00	400,125,000	貸付株式数　31,500株
川崎汽船	247,500	2,270.00	561,825,000	貸付株式数　94,600株
NIPPON EXPRESS	27,500	7,275.00	200,062,500	
日本航空	275,000	2,462.00	677,050,000	
ANAホールディングス	27,500	2,888.50	79,433,750	
三菱倉庫	137,500	5,163.00	709,912,500	
日本電信電話	2,750,000	144.90	398,475,000	
ＫＤＤＩ	1,650,000	4,175.00	6,888,750,000	※
ソフトバンク	275,000	1,945.50	535,012,500	
東京電力ＨＤ	27,500	855.00	23,512,500	
中部電力	27,500	1,910.00	52,525,000	
関西電力	27,500	2,752.50	75,693,750	
東京瓦斯	55,000	3,548.00	195,140,000	
大阪瓦斯	55,000	3,515.00	193,325,000	
東 宝	27,500	4,589.00	126,197,500	
NTTデータグループ	1,375,000	2,211.00	3,040,125,000	
セコム	275,000	9,260.00	2,546,500,000	
コナミグループ	275,000	10,770.00	2,961,750,000	
ニトリホールディングス	137,500	16,760.00	2,304,500,000	
ファーストリテイリング	825,000	39,460.00	32,554,500,000	※
ソフトバンクグループ	1,650,000	10,120.00	16,698,000,000	※
合計			320,521,492,500	

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

武田薬品	50,000株
ダイキン工業	26,000株
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) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2023年6月16日から2024年6月17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】

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	243,647,598	310,011,123
親投資信託受益証券	68,287,135,491	84,152,954,272
流動資産合計	68,530,783,089	84,462,965,395
資産合計	68,530,783,089	84,462,965,395
負債の部		
流動負債		
未払解約金	89,089,199	117,815,199
未払受託者報酬	7,096,994	8,796,710
未払委託者報酬	136,617,948	169,338,022
その他未払費用	1,097,157	1,124,215
流動負債合計	233,901,298	297,074,146
負債合計	233,901,298	297,074,146
純資産の部		
元本等		
元本	※1 39,176,810,504	※1 42,039,157,358
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	29,120,071,287	42,126,733,891
（分配準備積立金）	10,511,929,128	17,883,607,423
元本等合計	68,296,881,791	84,165,891,249
純資産合計	68,296,881,791	84,165,891,249
負債純資産合計	68,530,783,089	84,462,965,395

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期 自　2022年6月16日 至　2023年6月15日	第8期 自　2023年6月16日 至　2024年6月17日
営業収益		
受取利息	27	39,933
有価証券売買等損益	7,527,503,194	11,099,218,781
営業収益合計	7,527,503,221	11,099,258,714
営業費用		
支払利息	49,537	28,613
受託者報酬	13,606,483	16,437,526
委託者報酬	261,926,590	316,424,628
その他費用	2,198,091	2,212,891
営業費用合計	277,780,701	335,103,658
営業利益又は営業損失（△）	7,249,722,520	10,764,155,056
経常利益又は経常損失（△）	7,249,722,520	10,764,155,056
当期純利益又は当期純損失（△）	7,249,722,520	10,764,155,056
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（△）	601,965,844	908,384,730
期首剰余金又は期首欠損金（△）	19,149,754,424	29,120,071,287
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,589,297,350	11,179,628,263
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,589,297,350	11,179,628,263
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,266,737,163	8,028,735,985
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,266,737,163	8,028,735,985
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	29,120,071,287	42,126,733,891

(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8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日
1．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2024年6月15日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2024年6月17日としております。このため、当計算期間は368日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	第7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
1．　※1 期首元本額	34,566,355,532円	39,176,810,504円
期中追加設定元本額	12,181,359,226円	13,600,258,382円
期中一部解約元本額	7,570,904,254円	10,737,911,528円
2．　計算期間末日における受益権の総数	39,176,810,504口	42,039,157,358口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第7期 自2022年6月16日 至2023年6月15日	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日

※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（18,667,763,565円）及び分配準備積立金（10,511,929,128円）より分配対象額は29,179,692,693円（1万口当たり7,448.21円）であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（15,610円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（9,809,962,827円）、投資信託約款に規定される収益調整金（24,243,126,468円）及び分配準備積立金（8,073,628,986円）より分配対象額は42,126,733,891円（1万口当たり10,020.83円）であり、分配を行っておりません。

〔金融商品に関する注記〕

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	第8期 2024年6月17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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	7,102,381,634	10,489,724,984
合計	7,102,381,634	10,489,724,984

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17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8期 自2023年6月16日 至2024年6月17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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7433円 (17,433円)	2.0021円 (20,021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	26,794,330,650	84,152,954,272	
親投資信託受益証券 合計			84,152,954,272	
合計			84,152,954,272	

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

	2023年6月15日現在 金 額（円）	2024年6月17日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		

預金	366,079,227	636,043,580
コール・ローン	2,697,371,556	5,225,800,578
株式	87,395,440,706	111,112,073,954
投資証券	1,911,507,405	2,152,155,033
派生商品評価勘定	31,666,665	345,743,523
未収入金	389,936	1,130,438
未収配当金	116,475,981	137,851,894
差入委託証拠金	1,661,775,387	1,810,735,932
流動資産合計	94,180,706,863	121,421,534,932
資産合計	94,180,706,863	121,421,534,932
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,321,464,731	458,372,784
未払解約金	78,510,020	7,080,100
流動負債合計	1,399,974,751	465,452,884
負債合計	1,399,974,751	465,452,884
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	34,080,983,566	38,512,369,700
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	58,699,748,546	82,443,712,348
元本等合計	92,780,732,112	120,956,082,048
純資産合計	92,780,732,112	120,956,082,048
負債純資産合計	94,180,706,863	121,421,534,932

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2024年6月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の１口当たり純資産額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023年6月15日現在	2024年6月17日現在
1.　※1 期首	2022年6月16日	2023年6月16日
期首元本額	30,012,407,804円	34,080,983,566円
期中追加設定元本額	10,302,331,561円	13,674,132,324円
期中一部解約元本額	6,233,755,799円	9,242,746,190円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	25,083,432,079円	26,794,330,650円

ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	1,215,650,805円	982,447,980円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	3,016,767,590円	3,431,057,533円
ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用）	521,456円	883,016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）	4,764,611,636円	7,303,650,521円
計	34,080,983,566円	38,512,369,700円
2. 期末日における受益権の総数	34,080,983,566口	38,512,369,700口

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年6月16日 至2024年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産について為替変動リスクを回避すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年6月17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	2023年6月15日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2024年6月17日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	7,722,771,889	12,071,986,049
新株予約権証券	-	0
投資証券	△32,305,188	△57,929,406
合計	7,690,466,701	12,014,056,643

（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	2023年6月15日現在				2024年6月17日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)

市場取引 株価指数 先物取引								
買建	4,356,966,188	-	4,388,436,520	31,470,332	7,770,809,548	-	7,922,332,463	151,522,915
合計	4,356,966,188	-	4,388,436,520	31,470,332	7,770,809,548	-	7,922,332,463	151,522,915

（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6月15日現在				2024年6月17日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引 為替予約取引								
売建	86,624,537,257	-	87,945,805,655	△1,321,268,398	112,992,750,187	-	113,256,902,363	△264,152,176
アメリカ・ドル	63,615,660,828	-	64,302,833,035	△687,172,207	84,682,068,669	-	85,049,813,019	△367,744,350
イギリス・ポンド	3,860,722,387	-	3,970,621,518	△109,899,131	4,890,336,769	-	4,886,729,590	3,607,179
イスラエル・シュケル	114,508,325	-	120,329,973	△5,821,648	138,042,327	-	137,790,205	252,122
オーストラリア・ドル	1,957,381,101	-	2,067,209,055	△109,827,954	2,317,050,365	-	2,309,052,569	7,997,796
カナダ・ドル	2,918,355,193	-	3,003,278,338	△84,923,145	3,623,736,477	-	3,605,522,946	18,213,531
シンガポール・ドル	352,979,648	-	359,217,693	△6,238,045	397,697,254	-	398,459,686	△762,432

スイス･フラン	2,644,923,006	-	2,698,143,912	△53,220,906	2,986,745,016	-	3,030,306,200	△43,561,184
スウェーデン･クローナ	885,401,477	-	904,005,432	△18,603,955	1,069,774,556	-	1,073,037,607	△3,263,051
デンマーク･クローネ	839,073,099	-	858,412,696	△19,339,597	1,228,248,419	-	1,215,682,884	12,565,535
ニュージーランド･ドル	56,023,077	-	58,336,347	△2,313,270	72,556,398	-	72,638,907	△82,509
ノルウェー･クローネ	182,039,457	-	190,853,115	△8,813,658	215,030,616	-	212,387,663	2,642,953
ユーロ	8,525,188,522	-	8,733,410,832	△208,222,310	10,763,769,137	-	10,654,821,327	108,947,810
香港･ドル	672,281,137	-	679,153,709	△6,872,572	607,694,184	-	610,659,760	△2,965,576
合計	86,624,537,257	-	87,945,805,655	△1,321,268,398	112,992,750,187	-	113,256,902,363	△264,152,176

（注）　1．　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2．　換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2023年6月15日現在	2024年6月17日現在
1口当たり純資産額	2.7224円	3.1407円
（1万口当たり純資産額）	(27,224円)	(31,407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	1,366	195.130	266,547.580	
	PALO ALTO NETWORKS INC	3,724	317.310	1,181,662.440	
	FIRST SOLAR INC	1,158	273.610	316,840.380	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	2,016	135.980	274,135.680	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,494	150.420	224,727.480	
	SYNCHRONY FINANCIAL	4,706	41.690	196,193.140	
	ABBOTT LABORATORIES	19,862	103.680	2,059,292.160	
	HOWMET AEROSPACE INC	4,451	78.940	351,361.940	
	VERISK ANALYTICS INC	1,635	264.370	432,244.950	
	LAS VEGAS SANDS CORP	4,359	43.250	188,526.750	
	AMPHENOL CORP-CL A	13,830	68.270	944,174.100	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	619	806.570	499,266.830	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	6,623	76.570	507,123.110	
	QORVO INC	1,147	112.380	128,899.860	
	AFLAC INC	6,341	87.040	551,920.640	
	DARDEN RESTAURANTS INC	1,370	148.780	203,828.600	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1,895	88.750	168,181.250	
	ADOBE INC	5,194	525.310	2,728,460.140	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,224	73.260	162,930.240	
	LULULEMON ATHLETICA INC	1,273	306.010	389,550.730	
	GARMIN LTD	1,784	159.530	284,601.520	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2,640	275.140	726,369.600	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	7,461	208.530	1,555,842.330	
	WR BERKLEY CORP	2,512	78.150	196,312.800	
	AUTOZONE INC	189	2,835.820	535,969.980	
	DOLLAR TREE INC	2,380	106.030	252,351.400	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	13,465	17.160	231,059.400	
	CELANESE CORP	1,316	139.390	183,437.240	
	DR HORTON INC	3,356	142.780	479,169.680	
	AUTODESK INC	2,459	225.870	555,414.330	
	MOODY'S CORP	1,930	408.120	787,671.600	
	DEVON ENERGY CORP	7,316	45.560	333,316.960	
	ALBEMARLE CORP	1,389	103.510	143,775.390	
	ATMOS ENERGY CORP	1,683	116.150	195,480.450	
	ALLIANT ENERGY CORP	3,069	49.840	152,958.960	
	CITIGROUP INC	22,136	59.330	1,313,328.880	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	4,669	242.620	1,132,792.780	

AMERICAN ELECTRIC POWER	6,035	88.000	531,080.000	
DOMINO'S PIZZA INC	407	521.410	212,213.870	
HESS CORP	3,230	143.450	463,343.500	
DAVITA INC	609	141.160	85,966.440	
DANAHER CORP	8,149	254.850	2,076,772.650	
FORTIVE CORP	4,057	72.730	295,065.610	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	6,635	135.670	900,170.450	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	5,706	59.500	339,507.000	
TE CONNECTIVITY LTD	3,611	147.350	532,080.850	
APPLE INC	168,963	212.490	35,902,947.870	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	2,919	122.000	356,118.000	
BOEING CO/THE	6,742	177.270	1,195,154.340	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,913	112.270	214,772.510	
BECTON DICKINSON AND CO	3,277	233.730	765,933.210	
LEIDOS HOLDINGS INC	1,482	143.700	212,963.400	
NISOURCE INC	5,311	28.170	149,610.870	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,404	83.600	117,374.400	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	8,684	58.020	503,845.680	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	48,167	39.670	1,910,784.890	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	15,059	405.540	6,107,026.860	
ANSYS INC	967	323.170	312,505.390	
TRUIST FINANCIAL CORP	15,286	35.410	541,277.260	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	8,132	121.250	986,005.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	23,275	41.200	958,930.000	
JPMORGAN CHASE & CO	33,069	193.780	6,408,110.820	
T ROWE PRICE GROUP INC	2,655	114.900	305,059.500	
LKQ CORP	3,287	40.290	132,433.230	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	1,998	43.660	87,232.680	
CADENCE DESIGN SYS INC	3,128	312.100	976,248.800	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,152	423.860	488,286.720	
DOLLAR GENERAL CORP	2,477	125.790	311,581.830	
SERVICENOW INC	2,430	728.580	1,770,449.400	
CATERPILLAR INC	5,718	321.470	1,838,165.460	
BROWN & BROWN INC	2,873	90.080	258,799.840	
ESSENTIAL UTILITIES INC	3,306	37.130	122,751.780	
CHARLES RIVER LABORATORIES	574	209.470	120,235.780	
CMS ENERGY CORP	3,433	59.650	204,778.450	
MOSAIC CO/THE	3,841	27.160	104,321.560	
DELTA AIR LINES INC	2,019	48.720	98,365.680	

CORNING INC	9,470	37.250	352,757.500	
CISCO SYSTEMS INC	46,580	45.680	2,127,774.400	
MORGAN STANLEY	14,088	95.500	1,345,404.000	
DECKERS OUTDOOR CORP	350	1,023.750	358,312.500	
MSCI INC	880	480.530	422,866.400	
FAIR ISAAC CORP	299	1,390.590	415,786.410	
LENNOX INTERNATIONAL INC	370	534.000	197,580.000	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	700	228.840	160,188.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,698	60.690	163,741.620	
BROADCOM INC	5,098	1,735.040	8,845,233.920	
UNITED THERAPEUTICS CORP	500	288.060	144,030.000	
CNH INDUSTRIAL NV	9,900	10.400	102,960.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	700	216.280	151,396.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,505	160.390	241,386.950	
DTE ENERGY COMPANY	2,490	112.140	279,228.600	
CENTENE CORP	6,064	68.930	417,991.520	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,182	167.600	198,103.200	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5,465	34.070	186,192.550	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,520	258.240	650,764.800	
GARTNER INC	923	432.210	398,929.830	
DOMINION ENERGY INC	9,628	50.430	485,540.040	
MONSTER BEVERAGE CORP	9,156	48.030	439,762.680	
SMITH (A.O.) CORP	1,400	82.460	115,444.000	
DEERE & CO	3,009	378.000	1,137,402.000	
QUANTA SERVICES INC	1,726	273.290	471,698.540	
POOL CORP	380	341.310	129,697.800	
GLOBAL PAYMENTS INC	3,094	94.170	291,361.980	
BURLINGTON STORES INC	666	228.020	151,861.320	
NASDAQ INC	4,741	58.600	277,822.600	
TARGA RESOURCES CORP	2,531	119.000	301,189.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	774	124.140	96,084.360	
WESTLAKE CORP	424	149.830	63,527.920	
CONSOLIDATED EDISON INC	3,976	90.870	361,299.120	
TELEFLEX INC	545	208.290	113,518.050	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,028	157.260	161,663.280	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	794	333.250	264,600.500	
BIO-RAD LABORATORIES-A	241	282.260	68,024.660	
CATALENT INC	2,263	55.480	125,551.240	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,806	184.700	333,568.200	

MOLINA HEALTHCARE INC	683	307.040	209,708.320	
CARLISLE COS INC	500	405.300	202,650.000	
IDEX CORP	860	198.230	170,477.800	
COLGATE-PALMOLIVE CO	8,981	94.620	849,782.220	
ROLLINS INC	3,360	48.500	162,960.000	
AECOM	1,700	86.590	147,203.000	
WATSCO INC	400	477.990	191,196.000	
GRACO INC	1,900	79.290	150,651.000	
AMETEK INC	2,665	167.020	445,108.300	
TORO CO	1,300	96.610	125,593.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,947	107.700	317,391.900	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	2,047	46.760	95,717.720	
HEICO CORP	535	225.170	120,465.950	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	421	401.740	169,132.540	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3,106	93.540	290,535.240	
TYLER TECHNOLOGIES INC	514	471.790	242,500.060	
COSTCO WHOLESALE CORP	5,120	855.670	4,381,030.400	
EPAM SYSTEMS INC	663	177.580	117,735.540	
RPM INTERNATIONAL INC	1,636	111.290	182,070.440	
RELIANCE INC	700	277.090	193,963.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	334	3,271.710	1,092,751.140	
CUMMINS INC	1,595	266.480	425,035.600	
CDW CORP/DE	1,587	223.190	354,202.530	
COSTAR GROUP INC	4,763	73.930	352,128.590	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,256	172.740	389,701.440	
MERCADOLIBRE INC	509	1,582.140	805,309.260	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	790	161.570	127,640.300	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	2,887	210.320	607,193.840	
DEXCOM INC	4,435	115.950	514,238.250	
NORDSON CORP	572	228.720	130,827.840	
COPART INC	9,936	53.210	528,694.560	
DIAMONDBACK ENERGY INC	2,050	185.970	381,238.500	
ALIGN TECHNOLOGY INC	762	256.010	195,079.620	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	938	277.170	259,985.460	
TRANSDIGM GROUP INC	610	1,294.760	789,803.600	
BIO-TECHNE CORP	1,764	75.870	133,834.680	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	1,126	135.450	152,516.700	
KINDER MORGAN INC	22,943	19.590	449,453.370	
HCA HEALTHCARE INC	2,345	337.470	791,367.150	

MARKETAXESS HOLDINGS INC	420	200.220	84,092.400	
COTERRA ENERGY INC	8,577	26.730	229,263.210	
T-MOBILE US INC	6,216	175.990	1,093,953.840	
ZILLOW GROUP INC - C	1,786	48.000	85,728.000	
EMCOR GROUP INC	600	377.200	226,320.000	
COCA-COLA CO/THE	47,333	62.550	2,960,679.150	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	2,575	74.050	190,678.750	
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,725	123.390	212,847.750	
FRANKLIN RESOURCES INC	3,373	21.830	73,632.590	
CSX CORP	22,731	32.180	731,483.580	
EXPEDIA GROUP INC	1,496	124.610	186,416.560	
AMAZON.COM INC	107,885	183.660	19,814,159.100	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	6,944	87.290	606,141.760	
EXXON MOBIL CORP	51,629	109.110	5,633,240.190	
AES CORP	8,121	19.340	157,060.140	
EVEREST GROUP LTD	496	367.560	182,309.760	
EOG RESOURCES INC	6,652	118.240	786,532.480	
EQT CORP	4,603	39.340	181,082.020	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	1,710	89.090	152,343.900	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	134	1,631.830	218,665.220	
CENCORA INC	2,062	232.530	479,476.860	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	3,415	129.850	443,437.750	
FORD MOTOR CO	45,078	11.710	527,863.380	
EXACT SCIENCES CORP	2,147	41.880	89,916.360	
ENTEGRIS INC	1,693	133.900	226,692.700	
MICROSTRATEGY INC-CL A	200	1,495.540	299,108.000	
AERCAP HOLDINGS NV	2,401	89.030	213,761.030	
FORTINET INC	7,469	60.780	453,965.820	
MARKEL CORP	150	1,544.070	231,610.500	
NEXTERA ENERGY INC	23,693	73.060	1,731,010.580	
FREEPORT-MCMORAN INC	16,450	48.110	791,409.500	
INSULET CORP	809	200.450	162,164.050	
US BANCORP	17,920	38.830	695,833.600	
UNITED RENTALS INC	796	616.210	490,503.160	
F5 NETWORKS INC	659	167.580	110,435.220	
SUPER MICRO COMPUTER INC	600	844.540	506,724.000	
FASTENAL CO	6,742	63.050	425,083.100	
FISERV INC	6,803	148.940	1,013,238.820	
GENERAL ELECTRIC CO	12,612	155.880	1,965,958.560	

AXON ENTERPRISE INC	800	292.330	233,864.000	
PAYLOCITY HOLDING CORP	500	139.230	69,615.000	
GENERAL MOTORS CO	13,142	46.770	614,651.340	
GENERAL DYNAMICS CORP	2,662	291.780	776,718.360	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	3,689	446.460	1,646,990.940	
ALPHABET INC-CL A	67,868	176.790	11,998,383.720	
ALPHABET INC-CL C	58,840	178.370	10,495,290.800	
OWENS CORNING	983	176.580	173,578.140	
GENERAL MILLS INC	6,535	65.500	428,042.500	
FIRSTENERGY CORP	6,403	38.770	248,244.310	
GENUINE PARTS CO	1,554	136.700	212,431.800	
FIFTH THIRD BANCORP	8,020	35.220	282,464.400	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,213	217.470	481,261.110	
HALLIBURTON CO	10,333	32.920	340,162.360	
REPLIGEN CORP	600	125.620	75,372.000	
HOME DEPOT INC	11,354	346.840	3,938,021.360	
ASSURANT INC	602	165.540	99,655.080	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	16,648	12.370	205,935.760	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	497	238.460	118,514.620	
HERSHEY CO/THE	1,715	186.980	320,670.700	
HUMANA INC	1,408	358.930	505,373.440	
NXP SEMICONDUCTORS NV	2,909	268.850	782,084.650	
HENRY SCHEIN INC	1,491	65.800	98,107.800	
HP INC	11,305	35.510	401,440.550	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	15,338	21.600	331,300.800	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	4,263	97.260	414,619.380	
KRAFT HEINZ CO/THE	10,498	32.380	339,925.240	
ENPHASE ENERGY INC	1,738	124.610	216,572.180	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	10,633	169.210	1,799,209.930	
HUBBELL INC	639	374.740	239,458.860	
INTERNATIONAL PAPER CO	3,824	44.890	171,659.360	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	1,500	67.330	100,995.000	
ZOETIS INC	5,298	170.550	903,573.900	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	2,632	329.640	867,612.480	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	1,700	60.220	102,374.000	
CHENIERE ENERGY INC	2,678	155.880	417,446.640	
HYATT HOTELS CORP - CL A	500	147.470	73,735.000	
ALLEGION PLC	1,042	116.360	121,247.120	

BUILDERS FIRSTSOURCE INC	1,400	149.550	209,370.000	
WASTE CONNECTIONS INC	3,042	168.610	512,911.620	
JUNIPER NETWORKS INC	3,998	35.460	141,769.080	
JM SMUCKER CO/THE	1,225	111.580	136,685.500	
JOHNSON & JOHNSON	27,794	145.540	4,045,138.760	
ABBVIE INC	20,359	168.590	3,432,323.810	
HOLOGIC INC	2,673	71.790	191,894.670	
KIMBERLY-CLARK CORP	3,877	139.490	540,802.730	
KROGER CO	7,792	50.380	392,560.960	
KLA CORP	1,648	824.840	1,359,336.320	
LOCKHEED MARTIN CORP	2,541	458.340	1,164,641.940	
CORPAY INC	840	249.660	209,714.400	
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	2,572	43.260	111,264.720	
LOWE'S COS INC	6,553	223.350	1,463,612.550	
ELI LILLY & CO	9,265	878.450	8,138,839.250	
LAM RESEARCH CORP	1,509	1,035.980	1,563,293.820	
LOEWS CORP	2,228	73.790	164,404.120	
MCDONALD'S CORP	8,309	253.580	2,106,996.220	
3M CO	6,308	100.900	636,477.200	
META PLATFORMS INC CLASS A	25,167	504.160	12,688,194.720	
S&P GLOBAL INC	3,706	434.400	1,609,886.400	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	655	566.850	371,286.750	
PHILLIPS 66	4,933	136.760	674,637.080	
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	1,789	160.090	286,401.010	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	2,667	39.850	106,279.950	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,988	67.790	202,556.520	
METLIFE INC	7,221	68.550	494,999.550	
MARVELL TECHNOLOGY INC	9,868	73.270	723,028.360	
ARISTA NETWORKS INC	3,060	328.500	1,005,210.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,861	375.410	698,638.010	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	232	1,454.740	337,499.680	
BAKER HUGHES CO	11,517	31.090	358,063.530	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,300	254.390	330,707.000	
MERCK & CO. INC.	29,171	129.480	3,777,061.080	
DUPONT DE NEMOURS INC	4,919	79.660	391,847.540	
MASCO CORP	2,587	69.140	178,865.180	
M & T BANK CORP	1,943	142.180	276,255.740	
MARSH & MCLENNAN COS	5,654	208.880	1,181,007.520	

HEICO CORP-CLASS A	947	177.210	167,817.870	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	2,809	239.450	672,615.050	
WORKDAY INC-CLASS A	2,400	209.480	502,752.000	
BLOCK INC CLASS A	6,470	62.150	402,110.500	
TRANSUNION	2,257	71.790	162,030.030	
VISTRA CORP	3,857	87.590	337,834.630	
NETAPP INC	2,397	126.170	302,429.490	
NIKE INC -CL B	13,953	93.390	1,303,070.670	
NORFOLK SOUTHERN CORP	2,619	219.900	575,918.100	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6,172	91.350	563,812.200	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,296	115.670	265,578.320	
ALLY FINANCIAL INC	3,309	38.780	128,323.020	
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,553	424.090	658,611.770	
APTIV PLC	3,076	70.300	216,242.800	
NEWMONT CORP	13,204	40.820	538,987.280	
MCKESSON CORP	1,456	589.950	858,967.200	
XYLEM INC	2,766	138.020	381,763.320	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	17,845	102.200	1,823,759.000	
NUCOR CORP	2,779	154.690	429,883.510	
GODADDY INC - CLASS A	1,630	137.530	224,173.900	
EVERGY INC	2,623	52.740	138,337.020	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	7,524	59.840	450,236.160	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	269	349.820	94,101.580	
OKTA INC	1,795	89.760	161,119.200	
WIX.COM LTD	685	163.610	112,072.850	
EQUITABLE HOLDINGS INC	3,893	39.680	154,474.240	
KKR & CO INC	7,154	109.180	781,073.720	
PAYCHEX INC	3,723	121.990	454,168.770	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	669	1,007.310	673,890.390	
ALTRIA GROUP INC	19,702	44.320	873,192.640	
P G & E CORP	23,248	18.250	424,276.000	
PFIZER INC	64,811	27.530	1,784,246.830	
CIGNA CORP	3,253	333.290	1,084,192.370	
DELL TECHNOLOGIES -C	2,976	134.980	401,700.480	
XCEL ENERGY INC	6,320	53.770	339,826.400	
STERIS PLC	1,093	218.290	238,590.970	
SEA LTD-ADR	4,547	74.420	338,387.740	
FOX CORP - CLASS B	1,530	30.940	47,338.200	
FOX CORP - CLASS A	2,995	33.180	99,374.100	

STRYKER CORP	3,946	344.980	1,361,291.080	
DOW INC	7,960	55.020	437,959.200	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	1,167	104.310	121,729.770	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	2,913	57.740	168,196.620	
PARKER HANNIFIN CORP	1,526	503.300	768,035.800	
UBER TECHNOLOGIES INC	21,624	70.060	1,514,977.440	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	27,148	166.790	4,528,014.920	
EXELON CORP	11,653	35.540	414,147.620	
INGERSOLL-RAND INC	4,626	91.460	423,093.960	
NVR INC	39	7,602.330	296,490.870	
CONOCOPHILLIPS	13,610	109.390	1,488,797.900	
TWILIO INC - A	2,053	54.240	111,354.720	
DOCUSIGN INC	2,333	50.840	118,609.720	
PAYCOM SOFTWARE INC	600	142.780	85,668.000	
DAYFORCE INC	1,944	50.490	98,152.560	
PURE STORAGE INC - CLASS A	3,800	67.680	257,184.000	
PEPSICO INC	15,850	163.810	2,596,388.500	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	500	252.330	126,165.000	
MONGODB INC	796	227.000	180,692.000	
SNAP INC - A	12,010	15.590	187,235.900	
CORTEVA INC	8,049	51.180	411,947.820	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,096	113.110	463,298.560	
AMCOR PLC	17,545	9.960	174,748.200	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	2,601	385.435	1,002,516.430	
ROKU INC	1,627	54.510	88,687.770	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,190	129.300	283,167.000	
ACCENTURE PLC-CL A	7,198	286.710	2,063,738.580	
PENTAIR PLC	2,022	77.330	156,361.260	
QUALCOMM INC	12,851	215.330	2,767,205.830	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	2,695	76.660	206,598.700	
DATADOG INC - CLASS A	3,090	117.840	364,125.600	
PINTEREST INC- CLASS A	6,696	43.510	291,342.960	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,182	1,036.520	1,225,166.640	
REPUBLIC SERVICES INC	2,518	188.640	474,995.520	
BOOKING HOLDINGS INC	396	3,859.100	1,528,203.600	
ROSS STORES INC	3,901	145.930	569,272.930	
PACKAGING CORP OF AMERICA	998	182.680	182,314.640	
RESMED INC	1,697	211.730	359,305.810	
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,327	137.850	182,926.950	

MODERNA INC	3,782	140.030	529,593.460	
HUBSPOT INC	576	584.710	336,792.960	
REVVITY INC	1,376	108.650	149,502.400	
CARRIER GLOBAL CORP	9,328	64.350	600,256.800	
OTIS WORLDWIDE CORP	4,759	97.130	462,241.670	
AVANTOR INC	7,980	21.680	173,006.400	
CARLYLE GROUP INC/THE	2,473	39.050	96,570.650	
DYNATRACE INC	3,205	45.910	147,141.550	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	5,072	95.660	485,187.520	
REGIONS FINANCIAL CORP	10,897	18.650	203,229.050	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	4,330	26.920	116,563.600	
MATCH GROUP INC	3,549	31.550	111,970.950	
CHEVRON CORP	20,158	152.570	3,075,506.060	
ZSCALER INC	1,018	184.220	187,535.960	
EDISON INTERNATIONAL	4,511	73.210	330,250.310	
ETSY INC	1,409	58.870	82,947.830	
TESLA INC	33,046	178.010	5,882,518.460	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	3,456	127.170	439,499.520	
GEN DIGITAL INC	6,605	24.390	161,095.950	
UNITY SOFTWARE INC	2,942	16.400	48,248.800	
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,845	83.550	154,149.750	
SYNOPSYS INC	1,763	590.210	1,040,540.230	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	3,352	75.590	253,377.680	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,096	276.260	302,780.960	
VIATRIS INC	13,681	10.170	139,135.770	
DOORDASH INC - A	3,338	112.050	374,022.900	
ROBLOX CORP -CLASS A	5,470	35.100	191,997.000	
AIRBNB INC-CLASS A	5,097	145.970	744,009.090	
CBRE GROUP INC - A	3,473	86.900	301,803.700	
SOUTHERN CO/THE	12,474	78.650	981,080.100	
SYSCO CORP	5,674	70.690	401,095.060	
TRAVELERS COS INC/THE	2,561	205.850	527,181.850	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	600	71.060	42,636.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,400	64.430	90,202.000	
STEEL DYNAMICS INC	1,727	120.690	208,431.630	
SCHLUMBERGER LTD	16,364	43.000	703,652.000	
AT&T INC	82,023	17.640	1,446,885.720	
APA CORP	4,332	27.820	120,516.240	
SOUTHWEST AIRLINES CO	2,008	28.380	56,987.040	

ON SEMICONDUCTOR CORP	4,883	71.970	351,429.510	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	2,788	36.030	100,451.640	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,829	296.990	840,184.710	
SEMPRA ENERGY	7,178	75.970	545,312.660	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	1,796	50.190	90,141.240	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	21,448	23.570	505,529.360	
UIPATH INC - CLASS A	4,500	11.540	51,930.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	2,338	103.860	242,824.680	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	2,164	244.500	529,098.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	10,528	193.900	2,041,379.200	
SALESFORCE.COM INC	11,174	231.940	2,591,697.560	
WESTROCK CO	3,040	49.660	150,966.400	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	4,586	115.870	531,379.820	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	7,792	69.430	540,998.560	
TERADYNE INC	1,846	145.060	267,780.760	
UNION PACIFIC CORP	7,009	222.100	1,556,698.900	
MARATHON OIL CORP	6,922	27.300	188,970.600	
MARATHON PETROLEUM CORP	4,050	170.070	688,783.500	
RTX CORP	15,171	104.230	1,581,273.330	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	8,424	135.650	1,142,715.600	
IQVIA HOLDINGS INC	2,053	212.750	436,775.750	
AMEREN CORPORATION	3,019	70.120	211,692.280	
UNITEDHEALTH GROUP INC	10,569	497.120	5,254,061.280	
APPLOVIN CORP CLASS A	2,100	77.520	162,792.000	
TOAST INC CLASS A	4,272	22.720	97,059.840	
VERISIGN INC	1,016	180.310	183,194.960	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	8,597	10.880	93,535.360	
ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	6,100	22.420	136,762.000	
VALERO ENERGY CORP	3,788	150.070	568,465.160	
ULTA BEAUTY INC	613	390.820	239,572.660	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	3,008	48.280	145,226.240	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	667	187.850	125,295.950	
ELEVANCE HEALTH INC	2,736	534.810	1,463,240.160	
WALT DISNEY CO/THE	20,975	99.970	2,096,870.750	
WELLS FARGO & CO	40,705	57.400	2,336,467.000	
WASTE MANAGEMENT INC	4,644	203.640	945,704.160	

WILLIAMS COS INC	14,302	41.170	588,813.340	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,218	280.250	341,344.500	
WALMART INC	50,967	67.020	3,415,808.340	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,439	107.190	261,436.410	
WYNN RESORTS LTD	1,145	88.800	101,676.000	
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	25,500	3.600	91,800.000	
CELSIUS HOLDINGS INC	1,671	59.960	100,193.160	
WABTEC CORP	1,969	160.320	315,670.080	
TJX COMPANIES INC	13,065	108.500	1,417,552.500	
WATERS CORP	659	294.940	194,365.460	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	597	301.370	179,917.890	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	8,598	15.550	133,698.900	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,154	255.280	294,593.120	
WILLIAMS-SONOMA INC	700	301.620	211,134.000	
WESTERN DIGITAL CORP	3,844	78.120	300,293.280	
WEC ENERGY GROUP INC	3,720	78.860	293,359.200	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	5,686	72.640	413,031.040	
VISA INC-CLASS A SHARES	18,160	270.660	4,915,185.600	
PPL CORP	8,676	28.080	243,622.080	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	3,620	214.900	777,938.000	
PULTEGROUP INC	2,362	114.090	269,480.580	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	27,348	7.240	197,999.520	
PPG INDUSTRIES INC	2,658	127.320	338,416.560	
NORTHERN TRUST CORP	2,267	81.650	185,100.550	
FERGUSON PLC	2,271	201.470	457,538.370	
NVIDIA CORP	288,010	131.880	37,982,758.800	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	4,563	151.090	689,423.670	
DRAFTKINGS INC CLASS A	4,900	38.910	190,659.000	
ASPEN TECHNOLOGY CORP	300	197.660	59,298.000	
TYSON FOODS INC-CL A	3,533	53.970	190,676.010	
NETFLIX INC	4,953	669.380	3,315,439.140	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	4,397	572.050	2,515,303.850	
NRG ENERGY INC	2,511	78.640	197,465.040	
TEXTRON INC	2,188	85.250	186,527.000	
NEWS CORP - CLASS A	4,349	27.080	117,770.920	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	197	750.000	147,750.000	
OMNICOM GROUP	2,311	88.410	204,315.510	

JACOBS SOLUTIONS INC	1,445	138.200	199,699.000	
ORACLE CORP	18,920	138.130	2,613,419.600	
MASTERCARD INC - A	9,598	444.630	4,267,558.740	
ONEOK INC	6,725	78.100	525,222.500	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,166	549.450	640,658.700	
U HAUL NON VOTING SERIES N	1,137	60.600	68,902.200	
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	2,128	132.630	282,236.640	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	1,413	85.140	120,302.820	
HF SINCLAIR CORP	1,900	52.230	99,237.000	
OVINTIV INC	3,000	45.810	137,430.000	
YUM! BRANDS INC	3,218	136.790	440,190.220	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	1,874	158.960	297,891.040	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	2,176	49.530	107,777.280	
BANK OF AMERICA CORP	82,149	39.240	3,223,526.760	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	504	389.600	196,358.400	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,186	83.510	182,552.860	
AMERICAN EXPRESS CO	6,608	224.820	1,485,610.560	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	5,047	76.490	386,045.030	
LINDE PLC	5,517	436.950	2,410,653.150	
ANALOG DEVICES INC	5,680	231.190	1,313,159.200	
ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	4,500	20.010	90,045.000	
MONDAYCOM LTD	511	226.580	115,782.380	
ADVANCED MICRO DEVICES	18,627	159.630	2,973,428.010	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	2,800	28.350	79,380.000	
LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER	2,269	72.430	164,343.670	
CONFLUENT INC CLASS A	2,100	27.770	58,317.000	
KENVUE INC	22,196	18.070	401,081.720	
GLOBAL E ONLINE LTD	1,200	32.000	38,400.000	
VERALTO CORP	2,832	100.750	285,324.000	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	7,728	73.420	567,389.760	
BUNGE GLOBAL LTD	1,584	102.830	162,882.720	
VERTIV HOLDINGS CLASS A	4,200	91.480	384,216.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,829	104.370	190,892.730	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	2,783	148.500	413,275.500	
AVERY DENNISON CORP	870	226.530	197,081.100	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	5,682	64.260	365,125.320	
EMERSON ELECTRIC CO	6,470	106.460	688,796.200	

AON PLC-CLASS A	2,341	295.390	691,507.990	
AMGEN INC	6,204	298.620	1,852,638.480	
SAMSARA INC CLASS A	2,300	28.070	64,561.000	
EATON CORP PLC	4,636	319.020	1,478,976.720	
COOPER INC	2,392	93.470	223,580.240	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	1,851	253.500	469,228.500	
APPLIED MATERIALS INC	9,598	237.030	2,275,013.940	
CME GROUP INC	4,137	197.130	815,526.810	
ECOLAB INC	3,024	240.050	725,911.200	
EQUIFAX INC	1,376	241.610	332,455.360	
GILEAD SCIENCES INC	14,293	65.060	929,902.580	
KEURIG DR PEPPER INC	12,546	34.040	427,065.840	
HORMEL FOODS CORP	3,480	30.480	106,070.400	
CHORD ENERGY CORP	800	162.420	129,936.000	
STATE STREET CORP	3,452	70.910	244,781.320	
SOLVENTUM CORP	1,677	54.560	91,497.120	
GE VERNOVA	3,203	170.170	545,054.510	
SCHWAB (CHARLES) CORP	17,296	73.250	1,266,932.000	
CRH PUBLIC LIMITED PLC	8,500	76.550	650,675.000	
LABCORP HOLDINGS	971	199.880	194,083.480	
BAXTER INTERNATIONAL INC	6,028	33.780	203,625.840	
CAMPBELL SOUP CO	2,316	43.990	101,880.840	
CROWN HOLDINGS INC	1,392	78.180	108,826.560	
CARDINAL HEALTH INC	2,773	100.200	277,854.600	
FEDEX CORP	2,702	246.430	665,853.860	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	4,414	133.700	590,151.800	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,894	94.540	273,598.760	
INTEL CORP	49,141	30.450	1,496,343.450	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	4,322	29.420	127,153.240	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	3,428	99.470	340,983.160	
ILLINOIS TOOL WORKS	3,443	235.170	809,690.310	
ILLUMINA INC	1,893	108.660	205,693.380	
INTUITIVE SURGICAL INC	4,076	425.780	1,735,479.280	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,139	156.490	178,242.110	
SNAP-ON INC	623	262.240	163,375.520	
CARMAX INC	1,849	69.910	129,263.590	
DUKE ENERGY CORP	8,807	102.360	901,484.520	
TARGET CORP	5,269	141.160	743,772.040	
DOVER CORP	1,584	177.250	280,764.000	

WW GRAINGER INC	466	906.790	422,564.140	
JABIL INC	1,500	119.480	179,220.000	
CINTAS CORP	1,099	695.690	764,563.310	
CONAGRA BRANDS INC	5,699	28.340	161,509.660	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	1,700	86.760	147,492.000	
CLOROX COMPANY	1,427	133.700	190,789.900	
ENTERGY CORP	2,423	107.020	259,309.460	
MICROSOFT CORP	81,266	442.570	35,965,893.620	
INCYTE CORP	2,369	62.110	147,138.590	
CVS HEALTH CORP	14,464	60.220	871,022.080	
MEDTRONIC PLC	15,289	81.040	1,239,020.560	
MICRON TECHNOLOGY INC	12,826	141.360	1,813,083.360	
BLACKROCK INC	1,652	769.330	1,270,933.160	
CENTERPOINT ENERGY INC	7,372	30.850	227,426.200	
KELLOGG CO	3,242	57.520	186,479.840	
KEYCORP	11,265	13.360	150,500.400	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	15,605	65.850	1,027,589.250	
CHUBB LTD	4,658	259.460	1,208,564.680	
ALLSTATE CORP	2,964	157.070	465,555.480	
EBAY INC	5,902	52.130	307,671.260	
PAYPAL HOLDINGS INC	11,710	60.635	710,035.850	
EASTMAN CHEMICAL CO	1,392	99.510	138,517.920	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,731	113.900	311,060.900	
TRIMBLE INC	2,899	54.810	158,894.190	
LENNAR CORP-A	2,758	155.100	427,765.800	
PROGRESSIVE CORP	6,796	203.920	1,385,840.320	
PACCAR INC	6,017	106.720	642,134.240	
BIOGEN INC	1,719	231.690	398,275.110	
IDEXX LABORATORIES INC	958	504.000	482,832.000	
STARBUCKS CORP	12,962	79.650	1,032,423.300	
PTC INC	1,384	173.500	240,124.000	
EVERSOURCE ENERGY	4,018	59.010	237,102.180	
INTUIT INC	3,220	595.700	1,918,154.000	
BEST BUY CO INC	2,316	87.210	201,978.360	
BALL CORP	3,650	66.010	240,936.500	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	16,774	76.760	1,287,572.240	
ELECTRONIC ARTS INC	2,880	135.980	391,622.400	
VULCAN MATERIALS CO	1,456	252.640	367,843.840	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	2,984	480.730	1,434,498.320	

	PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	6,318	10.170	64,254.060	
	CARNIVAL CORP	11,874	15.340	182,147.160	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	6,374	14.910	95,036.340	
	COMCAST CORP-CLASS A	45,635	37.440	1,708,574.400	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	1,900	36.660	69,654.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	13,100	3.220	42,182.000	
アメリカ・ドル 小計				537,077,571.400 (84,605,829,823)	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	75,845	27.110	2,056,157.950	
	HALEON PLC	81,464	3.243	264,187.750	
	WISE PLC CLASS A	7,805	7.135	55,688.670	
	BP PLC	200,985	4.600	924,531.000	
	UNILEVER PLC	29,696	44.500	1,321,472.000	
	BARCLAYS PLC	177,843	2.020	359,242.860	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	98,773	4.578	452,182.790	
	PRUDENTIAL PLC	32,268	7.000	225,876.000	
	NATWEST GROUP PLC	77,840	3.072	239,124.480	
	BAE SYSTEMS PLC	36,338	13.350	485,112.300	
	AVIVA PLC	33,561	4.760	159,750.360	
	GSK	49,140	16.045	788,451.300	
	INFORMA PLC	16,445	8.424	138,532.680	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	15,596	6.006	93,669.570	
	AUTO TRADER GROUP PLC	10,587	8.190	86,707.530	
	DCC PLC	1,276	55.500	70,818.000	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	2,077	138.350	287,352.950	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	948	84.850	80,437.800	
	HALMA PLC	4,886	26.450	129,234.700	
	ENTAIN PLC	8,273	6.560	54,270.880	
	JD SPORTS FASHION PLC	33,388	1.207	40,316.010	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	9,871	4.806	47,440.020	
	M&G PLC	25,964	2.005	52,057.820	
	ENDEAVOUR MINING PLC	2,357	16.100	37,947.700	
	RELX PLC	22,137	35.580	787,634.460	
	DIAGEO PLC	26,248	25.790	676,935.920	
	RIO TINTO PLC	13,223	52.190	690,108.370	
	STANDARD CHARTERED PLC	26,087	7.242	188,922.050	
	TESCO PLC	82,801	3.102	256,848.700	
	SMITH & NEPHEW PLC	11,275	9.996	112,704.900	

GLENCORE PLC	121,769	4.545	553,500.980	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	4,676	10.510	49,144.760	
SMITHS GROUP PLC	4,080	16.810	68,584.800	
PEARSON PLC	7,194	9.490	68,271.060	
SAINSBURY (J) PLC	17,631	2.588	45,629.020	
NEXT PLC	1,450	90.080	130,616.000	
TAYLOR WIMPEY PLC	45,676	1.483	67,737.500	
WHITBREAD PLC	2,465	29.120	71,780.800	
BUNZL PLC	4,088	29.220	119,451.360	
VODAFONE GROUP PLC	281,997	0.689	194,465.130	
CRODA INTERNATIONAL PLC	1,704	41.270	70,324.080	
KINGFISHER PLC	24,703	2.486	61,411.650	
WPP PLC	13,021	7.354	95,756.430	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	8,244	10.365	85,449.060	
SEVERN TRENT PLC	3,476	24.740	85,996.240	
RENTOKIL INITIAL PLC	30,192	4.471	134,988.430	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	8,377	43.930	368,001.610	
SCHRODERS PLC	10,596	3.708	39,289.960	
SSE PLC	12,819	17.670	226,511.730	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	12,368	4.889	60,467.150	
ASTRAZENECA PLC	18,374	125.100	2,298,587.400	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	73,148	2.247	164,363.550	
3I GROUP PLC	11,423	30.400	347,259.200	
ASHTEAD GROUP PLC	5,135	54.220	278,419.700	
SAGE GROUP PLC/THE	12,210	10.565	128,998.650	
NATIONAL GRID PLC	57,437	8.820	506,594.340	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	746,003	0.541	404,184.420	
IMPERIAL BRANDS PLC	10,015	19.995	200,249.920	
CENTRICA PLC	63,200	1.320	83,424.000	
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	1,389	50.300	69,866.700	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	23,633	23.920	565,301.360	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	3,995	24.830	99,195.850	
HSBC HOLDINGS PLC	224,942	6.768	1,522,407.450	
ANGLO AMERICAN PLC	14,912	23.885	356,173.120	
MONDI PLC	5,778	14.630	84,532.140	
COMPASS GROUP PLC	20,477	22.170	453,975.090	
PERSIMMON PLC	3,969	14.200	56,359.800	
BT GROUP PLC	75,578	1.395	105,469.090	

	COCA-COLA HBC AG-DI	2,574	26.920	69,292.080	
	BURBERRY GROUP PLC	4,508	9.802	44,187.410	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	1,938	81.800	158,528.400	
	INTERTEK GROUP PLC	1,891	47.440	89,709.040	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	5,411	94.340	510,473.740	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2,039	19.580	39,923.620	
	ADMIRAL GROUP PLC	3,372	25.510	86,019.720	
	ANTOFAGASTA PLC	4,621	20.410	94,314.610	
	EXPERIAN PLC	10,783	37.070	399,725.810	
イギリス・ポンド 小計				22,978,631.480 (4,592,739,073)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	14,335	18.710	268,207.850	
	AZRIELI GROUP LTD	530	224.200	118,826.000	
	ICL GROUP LTD	8,294	16.490	136,768.060	
	ELBIT SYSTEMS LTD	300	674.800	202,440.000	
	BANK HAPOALIM BM	15,482	33.010	511,060.820	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	18,558	30.490	565,833.420	
	NICE LTD	772	621.700	479,952.400	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,883	130.600	245,919.800	
イスラエル・シュケル 小計				2,529,008.350 (107,105,274)	
オーストラリア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	29,120	5.190	151,132.800	
	TELSTRA GROUP LTD	52,164	3.500	182,574.000	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	35,873	28.750	1,031,348.750	
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	2,196	39.440	86,610.240	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	36,006	3.690	132,862.140	
	BHP GROUP LTD	60,481	43.090	2,606,126.290	
	SOUTH32 LTD	55,815	3.660	204,282.900	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	22,476	27.260	612,695.760	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	20,637	23.200	478,778.400	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	37,011	35.020	1,296,125.220	
	WESTPAC BANKING CORP	40,968	26.790	1,097,532.720	
	SANTOS LTD	37,159	7.470	277,577.730	
	RIO TINTO LTD	4,286	120.200	515,177.200	
	ORIGIN ENERGY LTD	22,247	10.080	224,249.760	
	AURIZON HOLDINGS LTD	19,619	3.650	71,609.350	
	PILBARA MINERALS LTD	37,417	3.240	121,231.080	
	XERO LTD	1,861	130.940	243,679.340	

	PRO MEDICUS LTD	709	131.170	92,999.530	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	2,748	32.390	89,007.720	
	COLES GROUP LTD	16,386	16.990	278,398.140	
	WISETECH GLOBAL LTD	1,980	96.150	190,377.000	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	14,164	13.430	190,222.520	
	REECE LTD	2,322	25.840	60,000.480	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	18,789	5.050	94,884.450	
	SEEK LTD	4,813	23.060	110,987.780	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	10,617	12.060	128,041.020	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	19,958	125.310	2,500,936.980	
	AMPOL LTD	2,596	33.100	85,927.600	
	ORICA LTD	5,978	18.000	107,604.000	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	18,205	18.310	333,333.550	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	15,084	32.590	491,587.560	
	QANTAS AIRWAYS LTD	11,139	6.110	68,059.290	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	5,364	48.300	259,081.200	
	MACQUARIE GROUP LTD	4,341	190.740	828,002.340	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	7,153	46.680	333,902.040	
	CSL LTD	5,762	289.100	1,665,794.200	
	WESFARMERS LTD	13,544	67.400	912,865.600	
	COCHLEAR LTD	820	323.510	265,278.200	
	BLUESCOPE STEEL LTD	5,024	20.540	103,192.960	
	SUNCORP GROUP LTD	14,589	16.390	239,113.710	
	ASX LTD	2,260	56.450	127,577.000	
	COMPUTERSHARE LTD	7,033	26.470	186,163.510	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	28,361	6.590	186,898.990	
	SONIC HEALTHCARE LTD	5,915	25.340	149,886.100	
	BRAMBLES LTD	17,812	14.520	258,630.240	
	CARSALES.COM LTD	4,761	35.070	166,968.270	
	MINERAL RESOURCES LTD	2,298	62.370	143,326.260	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,064	48.290	99,670.560	
	REA GROUP LTD	608	192.080	116,784.640	
オーストラリア・ドル 小計				20,199,097.120 (2,104,139,948)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	8,813	75.900	668,906.700	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	4,176	52.220	218,070.720	
	IMPERIAL OIL LTD	2,095	88.110	184,590.450	

CONSTELLATION SOFTWARE INC	231	3,800.000	877,800.000	
RESTAURANT BRANDS INTERN	3,304	94.650	312,723.600	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	5,269	72.700	383,056.300	
INTACT FINANCIAL CORP	2,031	222.400	451,694.400	
BCE INC	668	45.180	30,180.240	
FRANCO-NEVADA CORP	2,256	159.490	359,809.440	
SUNCOR ENERGY INC	14,787	50.260	743,194.620	
METRO INC/CN	2,450	73.990	181,275.500	
NATIONAL BANK OF CANADA	3,789	106.430	403,263.270	
BANK OF NOVA SCOTIA	13,903	63.700	885,621.100	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	10,680	65.310	697,510.800	
TORONTO-DOMINION BANK	19,937	74.530	1,485,904.610	
GREAT-WEST LIFECO INC	3,335	39.210	130,765.350	
MEG ENERGY CORP	3,100	27.710	85,901.000	
ROYAL BANK OF CANADA	15,990	142.870	2,284,491.300	
TOURMALINE OIL CORP	3,856	63.130	243,429.280	
TC ENERGY CORP	11,554	53.250	615,250.500	
PEMBINA PIPELINE CORP	6,494	50.920	330,674.480	
BARRICK GOLD CORP	19,652	22.010	432,540.520	
CAE INC	3,752	24.770	92,937.040	
THOMSON REUTERS CORP	1,797	229.650	412,681.050	
EMPIRE CO LTD 'A'	1,800	32.110	57,798.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	631	109.730	69,239.630	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,860	72.680	135,184.800	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	4,700	24.210	113,787.000	
HYDRO ONE LTD	4,066	39.420	160,281.720	
LOBLAW COMPANIES LTD	1,861	156.350	290,967.350	
STANTEC INC	1,400	113.270	158,578.000	
NORTHLAND POWER INC	2,632	23.880	62,852.160	
WSP GLOBAL INC	1,357	206.840	280,681.880	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	974	117.560	114,503.440	
PARKLAND CORP	1,621	38.710	62,748.910	
QUEBECOR INC -CL B	1,949	29.120	56,754.880	
EMERA INC	3,524	45.810	161,434.440	
TFI INTERNATIONAL INC	924	188.900	174,543.600	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	1,593	30.460	48,522.780	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	4,043	51.930	209,952.990	
BRP INC/CA- SUB VOTING	403	84.730	34,146.190	
IVANHOE MINES LTD-CL A	7,402	17.480	129,386.960	

AGNICO EAGLE MINES LTD	5,683	88.270	501,638.410	
AIR CANADA	1,700	17.160	29,172.000	
KINROSS GOLD CORP	14,757	10.190	150,373.830	
BANK OF MONTREAL	8,335	114.860	957,358.100	
POWER CORP OF CANADA	6,472	38.450	248,848.400	
SHOPIFY INC - CLASS A	13,461	92.940	1,251,065.340	
NUTRIEN LTD	5,774	70.320	406,027.680	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	1,532	41.300	63,271.600	
CAMECO CORP	5,002	71.290	356,592.580	
FIRSTSERVICE CORP	522	209.380	109,296.360	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	2,482	52.120	129,361.840	
TELUS CORP	600	21.720	13,032.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	5,374	65.610	352,588.140	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	623	135.150	84,198.450	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	24,418	46.620	1,138,367.160	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	244	1,526.560	372,480.640	
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,147	57.970	182,431.590	
WESTON (GEORGE) LTD	700	189.320	132,524.000	
PAN AMERICAN SILVER CORP	4,423	27.310	120,792.130	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	1,000	129.200	129,200.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	6,620	65.340	432,550.800	
ENBRIDGE INC	23,908	48.250	1,153,561.000	
BROOKFIELD CORP	15,642	56.240	879,706.080	
MANULIFE FINANCIAL CORP	20,267	34.500	699,211.500	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	10,526	105.620	1,111,756.120	
IA FINANCIAL CORP INC	1,209	85.180	102,982.620	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	1,864	51.620	96,219.680	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	6,199	167.290	1,037,030.710	
CGI INC - CLASS A	2,406	136.860	329,285.160	
ONEX CORPORATION	804	94.310	75,825.240	
IGM FINANCIAL INC	1,318	36.880	48,607.840	
TMX GROUP LTD	3,490	37.140	129,618.600	
OPEN TEXT CORP	3,210	39.510	126,827.100	
SAPUTO INC	2,900	29.370	85,173.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	7,781	16.490	128,308.690	
FORTIS INC	5,538	53.690	297,335.220	
RB GLOBAL INC	1,996	109.750	219,061.000	
LUNDIN MINING CORP	8,400	14.700	123,480.000	
CENOVUS ENERGY INC	15,831	25.060	396,724.860	

	DOLLARAMA INC	3,334	123.850	412,915.900	
	ALTAGAS LTD	3,201	30.470	97,534.470	
	KEYERA CORP	2,970	36.590	108,672.300	
	ARC RESOURCES LTD	6,834	23.950	163,674.300	
カナダ・ドル 小計				29,818,319.440 (3,419,863,056)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	30,400	2.630	79,952.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	15,400	30.570	470,778.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	24,610	35.480	873,162.800	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	20,050	6.730	134,936.500	
	KEPPEL CORP LTD	17,300	6.530	112,969.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	41,800	14.140	591,052.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	81,200	0.870	70,644.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	100,600	2.550	256,530.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	21,000	3.980	83,580.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	11,400	5.040	57,456.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	11,800	9.530	112,454.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	27,800	3.070	85,346.000	
シンガポール・ドル 小計				2,928,860.300 (341,124,359)	
スイス・フラン	SANDOZ GROUP AG	4,977	31.890	158,716.530	
	AVOLTA AG	1,251	36.120	45,186.120	
	UBS GROUP AG-REG	37,677	26.920	1,014,264.840	
	ROCHE HOLDING AG-BR	400	273.600	109,440.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	89	732.500	65,192.500	
	ADECCO GROUP AG-REG	2,049	31.100	63,723.900	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	8,048	247.600	1,992,684.800	
	SIKA AG-REG	1,744	255.900	446,289.600	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	109,400.000	109,400.000	
	ABB LTD-REG	18,325	49.890	914,234.250	
	SWISS RE AG	3,451	108.900	375,813.900	
	NESTLE SA-REG	30,723	95.280	2,927,287.440	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	260	1,154.500	300,170.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	475	235.400	111,815.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	2,401	50.600	121,490.600	
	SGS SA-REG	1,712	81.800	140,041.600	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	288	230.500	66,384.000	
	TEMENOS AG - REG	793	59.900	47,500.700	

	HELVETIA HOLDING AG-REG	471	117.900	55,530.900	
	VAT GROUP AG	308	497.500	153,230.000	
	BKW AG	250	140.700	35,175.000	
	ALCON INC	5,717	80.440	459,875.480	
	SIG GROUP N AG	3,400	16.060	54,604.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	377	185.250	69,839.250	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,677	471.400	790,537.800	
	BALOISE HOLDING AG - REG	550	155.300	85,415.000	
	CLARIANT AG-REG	2,552	13.500	34,452.000	
	NOVARTIS AG-REG	22,642	95.010	2,151,216.420	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	41	1,553.000	63,673.000	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	390	79.250	30,907.500	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	6,158	143.850	885,828.300	
	SWISSCOM AG-REG	302	496.000	149,792.000	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	357	94.600	33,772.200	
	GEBERIT AG-REG	390	542.200	211,458.000	
	GIVAUDAN-REG	108	4,296.000	463,968.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,303	110.600	144,111.800	
	SONOVA HOLDING AG-REG	613	276.900	169,739.700	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	1,785	88.380	157,758.300	
	LONZA GROUP AG-REG	852	480.300	409,215.600	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	450	36.600	16,470.000	
	HOLCIM LTD	5,964	80.040	477,358.560	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	353	632.200	223,166.600	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	551	256.500	141,331.500	
	SWISS PRIME SITE-REG	946	83.400	78,896.400	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	12	10,750.000	129,000.000	
スイス・フラン 小計				16,685,959.090 (2,950,745,006)	
スウェーデン・クローナ	SAGAX CLASS B	2,526	266.400	672,926.400	
	VOLVO CAR CLASS B	7,177	32.200	231,099.400	
	ERICSSON LM-B SHS	33,189	61.780	2,050,416.420	
	VOLVO AB-B SHS	19,601	263.600	5,166,823.600	
	SKF AB-B SHARES	4,000	207.100	828,400.000	
	TELE2 AB-B SHS	7,026	104.400	733,514.400	
	GETINGE AB-B SHS	2,869	182.800	524,453.200	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	19,581	152.800	2,991,976.800	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	17,775	100.250	1,781,943.750	

	SWEDBANK AB - A SHARES	10,821	214.600	2,322,186.600	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	7,084	188.600	1,336,042.400	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	7,320	155.050	1,134,966.000	
	SKANSKA AB-B SHS	4,566	187.550	856,353.300	
	SANDVIK AB	12,993	215.700	2,802,590.100	
	INVESTOR AB-B SHS	21,358	283.750	6,060,332.500	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	33,145	200.200	6,635,629.000	
	VOLVO AB-A SHS	2,688	268.800	722,534.400	
	HOLMEN AB-B SHARES	1,114	425.800	474,341.200	
	SECURITAS AB-B SHS	6,601	104.000	686,504.000	
	TELIA CO AB	29,088	26.760	778,394.880	
	ALFA LAVAL AB	3,570	464.600	1,658,622.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	19,021	172.950	3,289,681.950	
	ASSA ABLOY AB-B	12,452	302.400	3,765,484.800	
	TRELLEBORG AB-B SHS	2,657	403.600	1,072,365.200	
	SAAB AB-B	4,300	241.000	1,036,300.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	1,710	355.000	607,050.000	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	8,750	68.540	599,725.000	
	INDUTRADE AB	3,600	272.200	979,920.000	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	2,616	270.000	706,320.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	948	516.500	489,642.000	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	2,048	296.000	606,208.000	
	LIFCO AB-B SHS	2,924	283.400	828,661.600	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	18,468	47.260	872,797.680	
	BEIJER REF AB	5,166	164.550	850,065.300	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	7,792	278.600	2,170,851.200	
	BOLIDEN AB	3,171	339.400	1,076,237.400	
	EPIROC AB-A	8,031	211.800	1,700,965.800	
	EPIROC AB-B	5,234	192.500	1,007,545.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	5,400	88.400	477,360.000	
	EQT AB	4,551	312.500	1,422,187.500	
	EVOLUTION AB	2,233	1,056.000	2,358,048.000	
	HEXAGON AB-B SHS	25,301	116.500	2,947,566.500	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,020	353.700	714,474.000	
スウェーデン・クローナ 小計				70,029,507.280 (1,048,341,724)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	40,269	991.000	39,906,579.000	
	DANSKE BANK A/S	8,406	202.400	1,701,374.400	

	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	39	11,120.000	433,680.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	12,307	182.050	2,240,489.350	
	CARLSBERG AS-B	1,200	938.200	1,125,840.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	4,607	407.400	1,876,891.800	
	COLOPLAST-B	1,537	851.600	1,308,909.200	
	DSV PANALPINA A/S	2,051	1,081.500	2,218,156.500	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	98	2,750.000	269,500.000	
	DEMANT A/S	1,352	326.400	441,292.800	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	58	11,400.000	661,200.000	
	TRYG A/S	4,074	143.100	582,989.400	
	PANDORA A/S	1,030	1,052.500	1,084,075.000	
	GENMAB A/S	805	1,832.500	1,475,162.500	
	ORSTED A/S	2,275	385.800	877,695.000	
デンマーク・クローネ 小計				56,203,834.950 (1,270,206,670)	
ニュージーランド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	15,000	6.370	95,550.000	
	MERCURY NZ LTD	8,896	6.690	59,514.240	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	23,635	4.040	95,485.400	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	17,824	7.475	133,234.400	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	7,238	30.770	222,713.260	
ニュージーランド・ドル 小計				606,497.300 (58,624,029)	
ノルウェー・クローネ	DNB BANK	10,469	205.700	2,153,473.300	
	NORSK HYDRO ASA	17,807	64.840	1,154,605.880	
	ORKLA ASA	9,408	90.200	848,601.600	
	TELENOR ASA	7,573	122.900	930,721.700	
	EQUINOR ASA	10,979	289.700	3,180,616.300	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,112	298.200	629,798.400	
	MOWI ASA	6,246	189.450	1,183,304.700	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,000	189.000	378,000.000	
	AKER BP ASA	4,241	255.100	1,081,879.100	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	1,203	871.500	1,048,414.500	
	SALMAR ASA	728	605.000	440,440.000	
ノルウェー・クローネ 小計				13,029,855.480 (192,450,965)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	9,709	28.630	277,968.670	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	6,334	36.470	231,000.980	
	EXOR NV	1,162	96.850	112,539.700	

DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	1,320	70.620	93,218.400	
DSM FIRMENICH AG	2,154	99.240	213,762.960	
FERROVIAL	6,005	36.620	219,903.100	
LOTUS BAKERIES NV	5	9,990.000	49,950.000	
SYENSQO SA	902	88.330	79,673.660	
AMPLIFON	1,440	0.030	43.200	
BAYER AG-REG	11,194	27.065	302,965.610	
EVONIK INDUSTRIES AG	2,431	18.240	44,341.440	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	22,084	14.414	318,318.770	
COMMERZBANK AG	11,980	13.765	164,904.700	
VOLKSWAGEN AG	341	112.400	38,328.400	
VOLKSWAGEN AG-PREF	2,441	104.500	255,084.500	
SIEMENS AG-REG	8,793	165.740	1,457,351.820	
E.ON SE	26,512	12.430	329,544.160	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	3,633	86.900	315,707.700	
GEA GROUP AG	1,908	37.660	71,855.280	
CONTINENTAL AG	1,272	55.000	69,960.000	
BASF SE	10,170	44.585	453,429.450	
ALLIANZ SE-REG	4,532	253.400	1,148,408.800	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	1,959	83.060	162,714.540	
RHEINMETALL AG	515	479.200	246,788.000	
RWE AG	7,483	33.160	248,136.280	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	6,613	5.896	38,990.240	
BRENNTAG SE	1,541	65.000	100,165.000	
FRESENIUS SE & CO KGAA	5,174	29.560	152,943.440	
SAP SE	12,081	174.780	2,111,517.180	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,584	456.800	723,571.200	
ZALANDO SE	2,514	22.150	55,685.100	
HEIDELBERG MATERIALS AG	1,508	95.260	143,652.080	
COVESTRO AG	2,308	50.240	115,953.920	
RATIONAL AG	58	792.500	45,965.000	
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	770	79.300	61,061.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	311	245.700	76,412.700	
TALANX AG	804	71.600	57,566.400	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	1,740	42.460	73,880.400	
DELIVERY HERO SE	2,056	27.840	57,239.040	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	560	84.350	47,236.000	
BECHTLE AG	819	44.460	36,412.740	

NEMETSCHEK SE	659	90.700	59,771.300	
SCOUT24 AG	877	70.400	61,740.800	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	3,206	53.640	171,969.840	
KNORR-BREMSE AG	926	70.400	65,190.400	
SIEMENS ENERGY AG	6,969	23.240	161,959.560	
BEIERSDORF AG	1,167	146.450	170,907.150	
MERCK KGAA	1,497	172.000	257,484.000	
ADIDAS AG	1,846	224.900	415,165.400	
PUMA SE	1,295	45.060	58,352.700	
HENKEL AG & CO KGAA	1,311	73.650	96,555.150	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	36,972	22.630	836,676.360	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	2,341	38.630	90,432.830	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	9,315	63.200	588,708.000	
QIAGEN N.V.	2,672	39.700	106,078.400	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	14,881	36.500	543,156.500	
HANNOVER RUECK SE	686	226.600	155,447.600	
DHL GROUP	11,294	37.750	426,348.500	
DEUTSCHE BOERSE AG	2,165	182.250	394,571.250	
MTU AERO ENGINES AG	612	224.400	137,332.800	
SYMRISE AG	1,510	112.400	169,724.000	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	733	81.400	59,666.200	
VONOVIA SE	8,494	26.980	229,168.120	
LEG IMMOBILIEN SE	869	77.200	67,086.800	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	9,488	24.110	228,755.680	
NN GROUP NV	3,355	41.340	138,695.700	
ARCELORMITTAL	5,361	21.820	116,977.020	
HEINEKEN NV	3,403	94.840	322,740.520	
AEGON LTD	15,606	5.678	88,610.860	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	11,278	28.080	316,686.240	
AKZO NOBEL N.V.	1,973	58.100	114,631.300	
WOLTERS KLUWER	2,832	152.700	432,446.400	
ING GROEP NV	37,867	15.332	580,576.840	
KONINKLIJKE KPN NV	45,931	3.496	160,574.770	
ASML HOLDING NV	4,607	953.000	4,390,471.000	
ABN AMRO BANK NV-CVA	5,593	15.245	85,265.280	
IMCD NV	715	136.550	97,633.250	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	891	153.600	136,857.600	
ASR NEDERLAND NV	2,047	43.550	89,146.850	
ADYEN NV	248	1,197.600	297,004.800	

PROSUS NV	16,668	33.915	565,295.220	
JDE PEET'S NV	1,476	19.570	28,885.320	
INPOST SA	2,468	16.660	41,116.880	
ASM INTERNATIONAL NV	535	675.800	361,553.000	
RANDSTAD NV	1,226	45.420	55,684.920	
HEINEKEN HOLDING NV	1,533	76.550	117,351.150	
OCI NV	1,197	23.230	27,806.310	
TOTALENERGIES SE	24,759	61.420	1,520,697.780	
MICHELIN (CGDE)	8,035	36.900	296,491.500	
AIR LIQUIDE SA	6,678	159.280	1,063,671.840	
KERING	882	302.500	266,805.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	6,296	221.200	1,392,675.200	
BOUYGUES SA	2,238	30.800	68,930.400	
BNP PARIBAS	11,780	58.410	688,069.800	
THALES SA	1,076	150.300	161,722.800	
DANONE	7,337	58.800	431,415.600	
CARREFOUR SA	6,992	14.405	100,719.760	
VIVENDI	7,575	9.500	71,962.500	
L'OREAL	2,784	440.450	1,226,212.800	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	5,194	72.300	375,526.200	
LEGRAND SA	3,128	93.460	292,342.880	
PERNOD RICARD SA	2,330	131.900	307,327.000	
EURAZEO SE	400	71.950	28,780.000	
REXEL SA	2,579	24.600	63,443.400	
SOCIETE GENERALE SA	8,368	22.150	185,351.200	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	3,190	711.400	2,269,366.000	
ACCOR SA	2,257	37.030	83,576.710	
CAPGEMINI SE	1,770	182.300	322,671.000	
PUBLICIS GROUPE	2,706	97.760	264,538.560	
BUREAU VERITAS SA	3,725	26.660	99,308.500	
EIFFAGE	945	84.960	80,287.200	
SODEXO SA	1,085	84.000	91,140.000	
IPSEN	460	120.500	55,430.000	
AMUNDI SA	751	60.250	45,247.750	
TELEPERFORMANCE	615	93.300	57,379.500	
EURONEXT NV	918	89.300	81,977.400	
EUROFINS SCIENTIFIC	1,580	52.120	82,349.600	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	369	178.750	65,958.750	
SEB SA	216	102.800	22,204.800	

ESSILORLUXOTTICA	3,365	201.000	676,365.000	
DASSAULT AVIATION SA	220	174.200	38,324.000	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	1,287	31.000	39,897.000	
AXA SA	20,717	29.430	609,701.310	
EDENRED	3,007	40.540	121,903.780	
RENAULT SA	2,373	48.140	114,236.220	
HERMES INTERNATIONAL	361	2,112.000	762,432.000	
STMICROELECTRONICS NV	7,787	39.405	306,846.730	
REMY COINTREAU	253	80.100	20,265.300	
DASSAULT SYSTEMES SE	7,917	35.710	282,716.070	
ORANGE	21,570	9.292	200,428.440	
ALSTOM	3,668	15.505	56,872.340	
SANOFI	13,170	86.430	1,138,283.100	
VINCI SA	5,705	98.140	559,888.700	
AIRBUS SE	6,876	143.820	988,906.320	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	8,156	27.920	227,715.520	
CREDIT AGRICOLE SA	12,141	13.035	158,257.930	
BIOMERIEUX	457	90.800	41,495.600	
ENGIE	20,811	13.270	276,161.970	
SAFRAN SA	3,954	196.650	777,554.100	
ARKEMA	650	83.700	54,405.000	
ADP	350	112.800	39,480.000	
GETLINK SE	4,114	15.535	63,910.990	
BOLLORE	8,529	5.740	48,956.460	
UCB SA	1,438	137.850	198,228.300	
KBC GROUP NV	3,011	64.160	193,185.760	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,067	66.750	71,222.250	
UMICORE	2,270	13.630	30,940.100	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	10,420	55.460	577,893.200	
AGEAS	1,887	42.200	79,631.400	
D'IETEREN GROUP	296	190.000	56,240.000	
ELIA GROUP SA/NV	358	90.300	32,327.400	
SOFINA	146	215.400	31,448.400	
ARGENX SE	699	360.900	252,269.100	
PRYSMIAN SPA	3,040	56.640	172,185.600	
ASSICURAZIONI GENERALI	11,963	22.590	270,244.170	
MEDIOBANCA SPA	5,735	13.525	77,565.870	
TENARIS SA	5,705	14.315	81,667.070	
UNICREDIT SPA	17,469	32.535	568,353.910	

TELECOM ITALIA SPA	108,503	0.223	24,282.970	
INTESA SANPAOLO	166,657	3.330	554,967.810	
POSTE ITALIANE SPA	5,356	12.175	65,209.300	
MONCLER SPA	2,435	58.640	142,788.400	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	1,285	48.100	61,808.500	
ENI SPA	25,004	13.508	337,754.030	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	7,862	9.620	75,632.440	
BANCO BPM SPA	13,987	5.880	82,243.560	
DIASORIN SPA	277	97.980	27,140.460	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	3,308	9.780	32,352.240	
NEXI SPA	6,511	5.658	36,839.230	
AMPLIFON SPA	1,440	34.640	49,881.600	
LEONARDO SPA	4,767	21.180	100,965.060	
ENEL SPA	92,678	6.337	587,300.480	
SNAM SPA	24,300	4.284	104,101.200	
TERNA SPA	17,234	7.492	129,117.120	
FINECOBANK SPA	7,048	13.985	98,566.280	
STELLANTIS NV	25,721	18.820	484,069.220	
FERRARI NV	1,436	379.700	545,249.200	
TELEFONICA SA	52,944	4.110	217,599.840	
ENDESA SA	3,760	18.620	70,011.200	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	66,593	9.020	600,668.860	
IBERDROLA SA	66,606	12.125	807,597.750	
BANCO DE SABADELL SA	67,130	1.742	116,940.460	
REPSOL SA	14,051	14.305	200,999.550	
GRIFOLS SA	2,795	9.188	25,680.460	
BANCO SANTANDER SA	184,611	4.378	808,319.260	
AMADEUS IT GROUP SA	5,133	64.200	329,538.600	
CAIXABANK SA	42,670	4.875	208,016.250	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,619	39.220	102,717.180	
AENA SME SA	868	184.600	160,232.800	
CELLNEX TELECOM SA	5,750	32.390	186,242.500	
ACCIONA SA	291	115.600	33,639.600	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	12,663	45.960	581,991.480	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,966	17.060	84,719.960	
UPM-KYMMENE OYJ	6,183	32.690	202,122.270	
NOKIA OYJ	60,684	3.387	205,536.700	
WARTSILA OYJ ABP	5,759	18.965	109,219.430	
STORA ENSO OYJ-R SHS	6,840	12.385	84,713.400	

	ELISA OYJ	1,749	42.620	74,542.380	
	SAMPO OYJ-A SHS	5,229	39.290	205,447.410	
	FORTUM OYJ	5,703	14.200	80,982.600	
	KESKO OYJ-B SHS	3,470	16.445	57,064.150	
	KONE OYJ-B	3,936	47.240	185,936.640	
	NESTE OYJ	4,891	17.790	87,010.890	
	ORION OYJ-CLASS B	1,315	37.580	49,417.700	
	METSO CORPORATION	7,104	10.400	73,881.600	
	NORDEA BANK ABP	36,183	11.300	408,867.900	
	VERBUND AG	876	73.550	64,429.800	
	OMV AG	1,727	39.060	67,456.620	
	ERSTE GROUP BANK AG	3,908	42.020	164,214.160	
	VOESTALPINE AG	1,323	24.620	32,572.260	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	2,955	42.140	124,523.700	
	AIB GROUP PLC	20,172	4.786	96,543.190	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	12,691	9.720	123,356.520	
	KINGSPAN GROUP PLC	1,769	81.050	143,377.450	
	JERONIMO MARTINS	3,591	19.620	70,455.420	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	36,939	3.671	135,603.060	
	GALP ENERGIA SGPS SA	5,262	18.725	98,530.950	
	EDP RENOVAVEIS SA	3,029	13.760	41,679.040	
	KERRY GROUP PLC-A	1,937	75.300	145,856.100	
ユーロ 小計				58,592,926.160 (9,881,111,068)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	17,500	42.600	745,500.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	27,000	39.050	1,054,350.000	
	MTR CORP	19,000	24.900	473,100.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	17,500	71.600	1,253,000.000	
	SINO LAND CO	54,000	8.220	443,880.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	32,552	36.850	1,199,541.200	
	WHARF HOLDINGS LTD	14,000	23.150	324,100.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	5,000	70.100	350,500.000	
	CLP HOLDINGS LTD	21,000	65.400	1,373,400.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	18,565	21.450	398,219.250	
	HONG KONG & CHINA GAS	138,027	5.930	818,500.110	
	HANG SENG BANK LTD	9,400	107.200	1,007,680.000	
	WH GROUP LTD	112,000	5.170	579,040.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	14,700	257.600	3,786,720.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	10,000	13.180	131,800.000	

	CK ASSET HOLDINGS LTD	23,552	29.400	692,428.800	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	8,500	43.650	371,025.000	
	AIA GROUP LTD	138,400	55.500	7,681,200.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	17,000	20.700	351,900.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	20,000	21.550	431,000.000	
	SANDS CHINA LTD	32,200	17.800	573,160.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	17,000	95.600	1,625,200.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	45,500	24.400	1,110,200.000	
香港・ドル 小計				26,775,444.360 (539,792,959)	
合計				111,112,073,954 [111,112,073,954]	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	カナダ・ドル	CONSTELLATION SOFTWARE IN-28	261.000	0.000	
	カナダ・ドル 小計			0.000 (0)	
新株予約権証券 合計				0 [0]	
投資証券	アメリカ・ドル	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,560	314,948.400	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	3,792	564,363.360	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,658	102,199.120	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	1,265	247,889.400	
		EQUITY RESIDENTIAL	3,926	261,903.460	
		EQUINIX INC	1,086	832,158.360	
		AMERICAN TOWER CORP	5,357	1,055,489.710	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	8,687	154,802.340	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	3,867	137,046.480	
		KIMCO REALTY CORP	7,871	147,581.250	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	3,100	134,571.000	
		INVITATION HOMES INC	7,188	255,174.000	
		VICI PROPERTIES INC	11,788	333,482.520	
		VENTAS INC	4,594	230,159.400	
		WEYERHAEUSER CO	8,411	243,919.000	
		CROWN CASTLE INTL CORP	5,083	503,725.300	
		IRON MOUNTAIN INC	3,272	288,001.440	
		SUN COMMUNITIES INC	1,387	161,779.680	
		PROLOGIS INC	10,636	1,194,316.440	

	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,837	213,679.840	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	1,345	145,313.800	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	708	197,178.000	
	WELLTOWER INC	6,455	671,578.200	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	8,252	162,151.800	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,326	184,738.320	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,166	135,851.520	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	6,113	123,604.860	
	REALTY INCOME CORP	9,986	532,952.820	
	PUBLIC STORAGE	1,801	510,133.250	
	REGENCY CENTERS CORP	1,961	121,130.970	
	UDR INC	3,580	144,202.400	
	WP CAREY INC	2,562	143,702.580	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	3,623	543,160.160	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	2,389	374,045.730	
アメリカ・ドル 小計			11,366,934.910 (1,790,633,257)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	7,946	49,424.120	
	SEGRO PLC	15,120	137,440.800	
イギリス・ポンド 小計			186,864.920 (37,348,692)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	12,537	81,365.130	
	TRANSURBAN GROUP	35,685	446,062.500	
	APA GROUP	16,458	137,424.300	
	SCENTRE GROUP	64,017	199,733.040	
	GPT GROUP	21,774	88,620.180	
	MIRVAC GROUP	43,513	82,022.000	
	STOCKLAND	30,751	136,534.440	
	GOODMAN GROUP	20,135	720,228.950	
	VICINITY CENTRES	50,371	93,690.060	
オーストラリア・ドル 小計			1,985,680.600 (206,848,348)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	831	36,306.390	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,925	32,147.500	
カナダ・ドル 小計			68,453.890 (7,850,977)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	47,500	122,075.000	

		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	71,526	138,760.440	
	シンガポール・ドル 小計			260,835.440 (30,379,504)	
	ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,341	97,222.500	
		GECINA SA	578	52,915.900	
		KLEPIERRE	2,394	61,142.760	
		COVIVIO	652	29,196.560	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	1,846	46,703.800	
	ユーロ 小計			287,181.520 (48,430,291)	
	香港・ドル	LINK REIT	33,000	1,075,800.000	
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	51,000	445,230.000	
	香港・ドル 小計			1,521,030.000 (30,663,964)	
投資証券 合計				2,152,155,033 [2,152,155,033]	
合計				2,152,155,033 [2,152,155,033]	

新株予約権証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	組入新株予約権証券時価比率	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式 580銘柄 投資証券 34銘柄	97.9%	-%	2.1%	76.3%
イギリス・ポンド	株式 77銘柄 投資証券 2銘柄	99.2%	-%	0.8%	4.1%
イスラエル・シュケル	株式 8銘柄	100%	-%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 49銘柄 投資証券 9銘柄	91%	-%	9.0%	2.0%

カナダ・ドル	投資証券 2銘柄 株式 85銘柄 新株予約権証券 1銘柄	99.8%	0%	0.2%	3.0%
シンガポール・ドル	投資証券 2銘柄 株式 12銘柄	91.8%	-%	8.2%	0.3%
スイス・フラン	株式 45銘柄	100%	-%	-%	2.6%
スウェーデン・クローナ	株式 43銘柄	100%	-%	-%	0.9%
デンマーク・クローネ	株式 15銘柄	100%	-%	-%	1.1%
ニュージーランド・ドル	株式 5銘柄	100%	-%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 11銘柄	100%	-%	-%	0.2%
ユーロ	株式 219銘柄 投資証券 5銘柄	99.5%	-%	0.5%	8.8%
香港・ドル	投資証券 2銘柄 株式 23銘柄	94.6%	-%	5.4%	0.5%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2023年6月16日から2024年6月17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】

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	63,214,766	82,343,951
親投資信託受益証券	17,909,289,003	34,935,703,937
未収入金	232,800	-
流動資産合計	17,972,736,569	35,018,047,888
資産合計	17,972,736,569	35,018,047,888
負債の部		
流動負債		
未払解約金	29,064,278	11,519,811
未払受託者報酬	1,590,000	3,283,928
未払委託者報酬	30,608,268	63,216,356
その他未払費用	397,422	820,896
流動負債合計	61,659,968	78,840,991
負債合計	61,659,968	78,840,991
純資産の部		
元本等		
元本	※1 6,711,991,187	※1 9,619,339,885
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	11,199,085,414	25,319,867,012
（分配準備積立金）	4,555,616,819	10,948,399,392
元本等合計	17,911,076,601	34,939,206,897
純資産合計	17,911,076,601	34,939,206,897
負債純資産合計	17,972,736,569	35,018,047,888

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期 自　2022年6月16日 至　2023年6月15日	第8期 自　2023年6月16日 至　2024年6月17日
営業収益		
受取利息	4	15,287
有価証券売買等損益	3,017,798,861	8,409,173,797
営業収益合計	3,017,798,865	8,409,189,084
営業費用		
支払利息	9,251	7,504
受託者報酬	2,964,145	5,611,997
委託者報酬	57,061,167	108,032,418
その他費用	740,880	1,402,824
営業費用合計	60,775,443	115,054,743
営業利益又は営業損失（△）	2,957,023,422	8,294,134,341
経常利益又は経常損失（△）	2,957,023,422	8,294,134,341
当期純利益又は当期純損失（△）	2,957,023,422	8,294,134,341
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（△）	201,108,362	786,988,409
期首剰余金又は期首欠損金（△）	5,863,208,750	11,199,085,414
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,930,390,494	10,610,671,958
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,930,390,494	10,610,671,958
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,350,428,890	3,997,036,292
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,350,428,890	3,997,036,292
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	11,199,085,414	25,319,867,012

(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8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日
1．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2024年6月15日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2024年6月17日としております。このため、当計算期間は368日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	第7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
1．　※1 期首元本額	4,981,572,692円	6,711,991,187円
期中追加設定元本額	2,849,753,966円	5,219,463,826円
期中一部解約元本額	1,119,335,471円	2,312,115,128円
2．　計算期間末日における受益権の総数	6,711,991,187口	9,619,339,885口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第7期 自2022年6月16日 至2023年6月15日	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日

※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（2,755,920,690円）、投資信託約款に規定される収益調整金（6,643,477,147円）及び分配準備積立金（1,799,696,129円）より分配対象額は11,199,093,966円（1万口当たり16,685.20円）であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（8,797円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（7,507,130,668円）、投資信託約款に規定される収益調整金（14,371,467,620円）及び分配準備積立金（3,441,259,927円）より分配対象額は25,319,867,012円（1万口当たり26,321.83円）であり、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	第8期 2024年6月17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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17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	2,873,405,377	7,924,732,483
合計	2,873,405,377	7,924,732,483

(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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17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8期 自2023年6月16日 至2024年6月17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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.6685円 (26,685円)	3.6322円 (36,322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	5,260,608,935	34,935,703,937	
親投資信託受益証券 合計			34,935,703,937	
合計			34,935,703,937	

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

	2023年6月15日現在 金 額（円）	2024年6月17日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		

預金	896,504,391	2,236,979,602
コール・ローン	6,759,745,232	11,966,362,644
株式	334,734,999,666	545,633,714,414
投資証券	7,355,904,073	10,592,747,681
派生商品評価勘定	216,082,079	569,796,005
未収入金	1,293,865	5,417,991
未収配当金	434,111,359	663,562,906
差入委託証拠金	6,818,551,422	11,832,320,065
流動資産合計	357,217,192,087	583,500,901,308
資産合計	357,217,192,087	583,500,901,308
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,770,268	237,964,360
未払解約金	245,222,600	82,052,800
流動負債合計	246,992,868	320,017,160
負債合計	246,992,868	320,017,160
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	73,496,843,463	87,815,492,483
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	283,473,355,756	495,365,391,665
元本等合計	356,970,199,219	583,180,884,148
純資産合計	356,970,199,219	583,180,884,148
負債純資産合計	357,217,192,087	583,500,901,308

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2024年6月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023年6月15日現在	2024年6月17日現在
1. ※1 期首	2022年6月16日	2023年6月16日
期首元本額	65,283,819,354円	73,496,843,463円
期中追加設定元本額	13,427,703,911円	19,734,159,966円
期中一部解約元本額	5,214,679,802円	5,415,510,946円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国株式インデックスＶＡ	294,550,637円	231,333,447円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	2,653,445円	1,404,824円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	32,907,938円	18,302,724円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	4,853,233円	3,622,837円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	150,057,928円	105,788,926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）	88,037,539円	104,416,847円
ダイワバランスファンド2023-01（適格機関投資家専用）	105,196,680円	80,511,800円
外国株式インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	-円	3,590,641,743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）	643,535,054円	769,541,646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）	3,687,390,929円	5,260,608,935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）	596,634,111円	565,612,570円
Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	18,265,308円	16,220,910円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	50,201,604円	48,106,388円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	6,840,332,577円	8,593,037,781円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,467,364,616円	1,461,674,755円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	284,439,971円	334,612,172円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	160,733円	16,396,142円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	45,291,687,841円	50,051,961,691円
ダイワ・ライフ・バランス３０	528,148,677円	477,517,025円
ダイワ・ライフ・バランス５０	1,053,632,399円	1,037,795,264円
ダイワ・ライフ・バランス７０	923,487,719円	1,023,255,355円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,964,340,492円	1,358,344,119円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	12,421,942円	9,664,774円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	12,657,977円	11,406,458円
ダイワつみたてインデックス外国株式	1,755,886,236円	2,496,704,868円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	2,074,276円	1,881,563円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	2,262,603円	2,480,657円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	5,620,426円	5,066,336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）	5,906,694円	15,003,878円

ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	66,467,884円	43,911,825円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	40,358,122円	29,814,954円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	1,076,709,877円	747,327,456円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	58,861,714円	42,849,718円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	160,197,575円	126,698,728円
スタイル9（4資産分散・保守型）	-円	128,545円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	-円	1,053,961円
スタイル9（4資産分散・積極型）	-円	1,493,797円
スタイル9（6資産分散・保守型）	-円	78,128円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	-円	1,870,987円
スタイル9（6資産分散・積極型）	-円	2,371,238円
スタイル9（8資産分散・保守型）	-円	93,292円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	-円	1,361,677円
スタイル9（8資産分散・積極型）	-円	4,133,920円
ダイワ・インデックスセレクト外国株式	1,271,206,780円	1,290,475,524円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	416,663,223円	422,583,457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）	1,555,615,105円	3,931,003,426円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,938,768,447円	3,177,264,120円
ダイワライフスタイル２５	9,735,152円	7,154,772円
ダイワライフスタイル５０	43,069,169円	34,512,063円
ダイワライフスタイル７５	34,480,830円	29,568,667円
ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	-円	80,244,732円

ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	-円	78,139,734円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	-円	68,441,327円
計	73,496,843,463円	87,815,492,483円
2. 期末日における受益権の総数	73,496,843,463口	87,815,492,483口

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年6月16日 至2024年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年6月17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	2023年6月15日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2024年6月17日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	27,602,300,147	73,225,509,726
投資証券	△203,753,147	406,178,693
合計	27,398,547,000	73,631,688,419

（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	2023年6月15日現在				2024年6月17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	15,125,719,800	-	15,224,191,321	98,471,521	26,529,692,703	-	26,834,236,108	304,543,405
合計	15,125,719,800	-	15,224,191,321	98,471,521	26,529,692,703	-	26,834,236,108	304,543,405

（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6月15日現在				2024年6月17日現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	6,874,421,770	-	6,990,262,060	115,840,290	11,909,403,160	-	11,936,691,400	27,288,240
アメリカ・ドル	3,871,800,380	-	3,903,675,930	31,875,550	6,609,608,630	-	6,644,991,600	35,382,970
イギリス・ポンド	397,116,650	-	407,514,000	10,397,350	578,355,880	-	578,091,800	△264,080
オーストラリア・ドル	469,082,730	-	494,468,000	25,385,270	698,436,580	-	696,371,200	△2,065,380
カナダ・ドル	695,610,640	-	713,864,000	18,253,360	1,516,785,440	-	1,510,344,000	△6,441,440
スイス・フラン	534,308,160	-	544,740,000	10,431,840	1,028,102,860	-	1,042,648,000	14,545,140
ユーロ	906,503,210	-	926,000,130	19,496,920	1,478,113,770	-	1,464,244,800	△13,868,970
合計	6,874,421,770	-	6,990,262,060	115,840,290	11,909,403,160	-	11,936,691,400	27,288,240

（注）　1．時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2023年6月15日現在	2024年6月17日現在
１口当たり純資産額	4.8569円	6.6410円
（1万口当たり純資産額）	(48,569円)	(66,410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	6,800	195.130	1,326,884.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	18,500	317.310	5,870,235.000	
	FIRST SOLAR INC	5,900	273.610	1,614,299.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	10,000	135.980	1,359,800.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	7,500	150.420	1,128,150.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	23,300	41.690	971,377.000	
	ABBOTT LABORATORIES	99,166	103.680	10,281,530.880	
	HOWMET AEROSPACE INC	22,183	78.940	1,751,126.020	
	VERISK ANALYTICS INC	8,200	264.370	2,167,834.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	21,300	43.250	921,225.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	68,800	68.270	4,696,976.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,800	806.570	2,258,396.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	32,900	76.570	2,519,153.000	
	QORVO INC	5,420	112.380	609,099.600	
	AFLAC INC	31,300	87.040	2,724,352.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	6,900	148.780	1,026,582.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	9,200	88.750	816,500.000	

ADOBE INC	25,620	525.310	13,458,442.200	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,800	73.260	791,208.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	6,600	306.010	2,019,666.000	
GARMIN LTD	8,800	159.530	1,403,864.000	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	12,800	275.140	3,521,792.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	37,300	208.530	7,778,169.000	
WR BERKLEY CORP	11,742	78.150	917,637.300	
AUTOZONE INC	1,020	2,835.820	2,892,536.400	
DOLLAR TREE INC	11,871	106.030	1,258,682.130	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	67,900	17.160	1,165,164.000	
CELANESE CORP	6,450	139.390	899,065.500	
DR HORTON INC	17,116	142.780	2,443,822.480	
AUTODESK INC	12,300	225.870	2,778,201.000	
MOODY'S CORP	9,400	408.120	3,836,328.000	
DEVON ENERGY CORP	36,300	45.560	1,653,828.000	
ALBEMARLE CORP	6,800	103.510	703,868.000	
ATMOS ENERGY CORP	8,700	116.150	1,010,505.000	
ALLIANT ENERGY CORP	14,700	49.840	732,648.000	
CITIGROUP INC	109,573	59.330	6,500,966.090	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	23,500	242.620	5,701,570.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	30,100	88.000	2,648,800.000	
DOMINO'S PIZZA INC	2,030	521.410	1,058,462.300	
HESS CORP	15,800	143.450	2,266,510.000	
DAVITA INC	3,150	141.160	444,654.000	
DANAHER CORP	40,250	254.850	10,257,712.500	
FORTIVE CORP	20,100	72.730	1,461,873.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	32,800	135.670	4,449,976.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	29,600	59.500	1,761,200.000	
TE CONNECTIVITY LTD	17,695	147.350	2,607,358.250	
APPLE INC	838,200	212.490	178,109,118.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	14,400	122.000	1,756,800.000	
BOEING CO/THE	33,200	177.270	5,885,364.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	9,015	112.270	1,012,114.050	
BECTON DICKINSON AND CO	16,599	233.730	3,879,684.270	
LEIDOS HOLDINGS INC	7,400	143.700	1,063,380.000	
NISOURCE INC	25,600	28.170	721,152.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,700	83.600	560,120.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	43,171	58.020	2,504,781.420	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	240,304	39.670	9,532,859.680	

BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	74,950	405.540	30,395,223.000	
ANSYS INC	5,000	323.170	1,615,850.000	
TRUIST FINANCIAL CORP	76,317	35.410	2,702,384.970	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	40,900	121.250	4,959,125.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	115,800	41.200	4,770,960.000	
JPMORGAN CHASE & CO	164,070	193.780	31,793,484.600	
T ROWE PRICE GROUP INC	12,800	114.900	1,470,720.000	
LKQ CORP	15,300	40.290	616,437.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	17,012	43.660	742,743.920	
CADENCE DESIGN SYS INC	15,600	312.100	4,868,760.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5,800	423.860	2,458,388.000	
DOLLAR GENERAL CORP	12,600	125.790	1,584,954.000	
SERVICENOW INC	11,800	728.580	8,597,244.000	
CATERPILLAR INC	28,600	321.470	9,194,042.000	
BROWN & BROWN INC	13,900	90.080	1,252,112.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	14,900	37.130	553,237.000	
CHARLES RIVER LABORATORIES	3,000	209.470	628,410.000	
CMS ENERGY CORP	17,100	59.650	1,020,015.000	
MOSAIC CO/THE	18,200	27.160	494,312.000	
DELTA AIR LINES INC	9,300	48.720	453,096.000	
CORNING INC	46,400	37.250	1,728,400.000	
CISCO SYSTEMS INC	231,350	45.680	10,568,068.000	
MORGAN STANLEY	70,152	95.500	6,699,516.000	
DECKERS OUTDOOR CORP	1,500	1,023.750	1,535,625.000	
MSCI INC	4,600	480.530	2,210,438.000	
FAIR ISAAC CORP	1,500	1,390.590	2,085,885.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,900	534.000	1,014,600.000	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	3,600	228.840	823,824.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	12,800	60.690	776,832.000	
BROADCOM INC	25,212	1,735.040	43,743,828.480	
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,600	288.060	748,956.000	
CNH INDUSTRIAL NV	55,600	10.400	578,240.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	3,400	216.280	735,352.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,300	160.390	1,170,847.000	
DTE ENERGY COMPANY	11,900	112.140	1,334,466.000	
CENTENE CORP	30,607	68.930	2,109,740.510	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	6,100	167.600	1,022,360.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	25,900	34.070	882,413.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,400	258.240	3,202,176.000	

GARTNER INC	4,450	432.210	1,923,334.500	
DOMINION ENERGY INC	47,941	50.430	2,417,664.630	
MONSTER BEVERAGE CORP	44,600	48.030	2,142,138.000	
SMITH (A.O.) CORP	7,000	82.460	577,220.000	
DEERE & CO	15,200	378.000	5,745,600.000	
QUANTA SERVICES INC	8,400	273.290	2,295,636.000	
POOL CORP	2,200	341.310	750,882.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	14,784	94.170	1,392,209.280	
BURLINGTON STORES INC	3,700	228.020	843,674.000	
NASDAQ INC	23,300	58.600	1,365,380.000	
TARGA RESOURCES CORP	12,100	119.000	1,439,900.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,100	124.140	508,974.000	
WESTLAKE CORP	2,300	149.830	344,609.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	19,800	90.870	1,799,226.000	
TELEFLEX INC	2,700	208.290	562,383.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,800	157.260	754,848.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,200	333.250	1,399,650.000	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,200	282.260	338,712.000	
CATALENT INC	10,400	55.480	576,992.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	8,800	184.700	1,625,360.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	3,400	307.040	1,043,936.000	
CARLISLE COS INC	2,800	405.300	1,134,840.000	
IDEX CORP	4,400	198.230	872,212.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	44,700	94.620	4,229,514.000	
ROLLINS INC	16,607	48.500	805,439.500	
AECOM	7,800	86.590	675,402.000	
WATSCO INC	2,000	477.990	955,980.000	
GRACO INC	9,700	79.290	769,113.000	
AMETEK INC	13,300	167.020	2,221,366.000	
TORO CO	6,000	96.610	579,660.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	14,000	107.700	1,507,800.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	9,050	46.760	423,178.000	
HEICO CORP	2,600	225.170	585,442.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,200	401.740	883,828.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	14,900	93.540	1,393,746.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,500	471.790	1,179,475.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	25,360	855.670	21,699,791.200	
EPAM SYSTEMS INC	3,400	177.580	603,772.000	
RPM INTERNATIONAL INC	7,400	111.290	823,546.000	

RELIANCE INC	3,300	277.090	914,397.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,600	3,271.710	5,234,736.000	
CUMMINS INC	7,900	266.480	2,105,192.000	
CDW CORP/DE	7,700	223.190	1,718,563.000	
COSTAR GROUP INC	23,400	73.930	1,729,962.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	11,200	172.740	1,934,688.000	
MERCADOLIBRE INC	2,690	1,582.140	4,255,956.600	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,200	161.570	678,594.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	14,416	210.320	3,031,973.120	
DEXCOM INC	22,100	115.950	2,562,495.000	
NORDSON CORP	3,190	228.720	729,616.800	
COPART INC	49,500	53.210	2,633,895.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	9,700	185.970	1,803,909.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,100	256.010	1,049,641.000	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	4,300	277.170	1,191,831.000	
TRANSDIGM GROUP INC	3,190	1,294.760	4,130,284.400	
BIO-TECHNE CORP	9,020	75.870	684,347.400	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	5,700	135.450	772,065.000	
KINDER MORGAN INC	114,181	19.590	2,236,805.790	
HCA HEALTHCARE INC	11,400	337.470	3,847,158.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,200	200.220	440,484.000	
COTERRA ENERGY INC	43,000	26.730	1,149,390.000	
T-MOBILE US INC	30,627	175.990	5,390,045.730	
ZILLOW GROUP INC - C	9,050	48.000	434,400.000	
EMCOR GROUP INC	2,900	377.200	1,093,880.000	
COCA-COLA CO/THE	234,050	62.550	14,639,827.500	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	12,200	74.050	903,410.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	8,150	123.390	1,005,628.500	
FRANKLIN RESOURCES INC	16,500	21.830	360,195.000	
CSX CORP	111,900	32.180	3,600,942.000	
EXPEDIA GROUP INC	7,425	124.610	925,229.250	
AMAZON.COM INC	535,200	183.660	98,294,832.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	34,400	87.290	3,002,776.000	
EXXON MOBIL CORP	256,209	109.110	27,954,963.990	
AES CORP	40,800	19.340	789,072.000	
EVEREST GROUP LTD	2,500	367.560	918,900.000	
EOG RESOURCES INC	33,200	118.240	3,925,568.000	
EQT CORP	24,100	39.340	948,094.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	8,700	89.090	775,083.000	

FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	600	1,631.830	979,098.000	
CENCORA INC	10,300	232.530	2,395,059.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	16,800	129.850	2,181,480.000	
FORD MOTOR CO	222,923	11.710	2,610,428.330	
EXACT SCIENCES CORP	10,400	41.880	435,552.000	
ENTEGRIS INC	8,700	133.900	1,164,930.000	
MICROSTRATEGY INC-CL A	1,000	1,495.540	1,495,540.000	
AERCAP HOLDINGS NV	11,900	89.030	1,059,457.000	
FORTINET INC	37,100	60.780	2,254,938.000	
MARKEL CORP	730	1,544.070	1,127,171.100	
NEXTERA ENERGY INC	117,380	73.060	8,575,782.800	
FREEPORT-MCMORAN INC	82,008	48.110	3,945,404.880	
INSULET CORP	4,100	200.450	821,845.000	
US BANCORP	89,100	38.830	3,459,753.000	
UNITED RENTALS INC	3,900	616.210	2,403,219.000	
F5 NETWORKS INC	3,400	167.580	569,772.000	
SUPER MICRO COMPUTER INC	3,100	844.540	2,618,074.000	
FASTENAL CO	32,800	63.050	2,068,040.000	
FISERV INC	33,733	148.940	5,024,193.020	
GENERAL ELECTRIC CO	62,506	155.880	9,743,435.280	
AXON ENTERPRISE INC	4,100	292.330	1,198,553.000	
PAYLOCITY HOLDING CORP	2,600	139.230	361,998.000	
GENERAL MOTORS CO	76,100	46.770	3,559,197.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	13,400	291.780	3,909,852.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	18,550	446.460	8,281,833.000	
ALPHABET INC-CL A	336,700	176.790	59,525,193.000	
ALPHABET INC-CL C	291,540	178.370	52,001,989.800	
OWENS CORNING	5,000	176.580	882,900.000	
GENERAL MILLS INC	32,300	65.500	2,115,650.000	
FIRSTENERGY CORP	31,218	38.770	1,210,321.860	
GENUINE PARTS CO	8,050	136.700	1,100,435.000	
FIFTH THIRD BANCORP	39,100	35.220	1,377,102.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	10,950	217.470	2,381,296.500	
HALLIBURTON CO	50,900	32.920	1,675,628.000	
REPLIGEN CORP	3,100	125.620	389,422.000	
HOME DEPOT INC	56,650	346.840	19,648,486.000	
ASSURANT INC	3,050	165.540	504,897.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	83,300	12.370	1,030,421.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,310	238.460	550,842.600	

HERSHEY CO/THE	8,600	186.980	1,608,028.000	
HUMANA INC	6,900	358.930	2,476,617.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	14,700	268.850	3,952,095.000	
HENRY SCHEIN INC	7,400	65.800	486,920.000	
HP INC	56,100	35.510	1,992,111.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	74,300	21.600	1,604,880.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	21,500	97.260	2,091,090.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	52,203	32.380	1,690,333.140	
ENPHASE ENERGY INC	7,800	124.610	971,958.000	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	52,400	169.210	8,866,604.000	
HUBBELL INC	3,100	374.740	1,161,694.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	18,900	44.890	848,421.000	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	7,300	67.330	491,509.000	
ZOETIS INC	26,200	170.550	4,468,410.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	12,999	329.640	4,284,990.360	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	7,900	60.220	475,738.000	
CHENIERE ENERGY INC	13,200	155.880	2,057,616.000	
HYATT HOTELS CORP - CL A	2,600	147.470	383,422.000	
ALLEGION PLC	4,950	116.360	575,982.000	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	7,000	149.550	1,046,850.000	
WASTE CONNECTIONS INC	14,737	168.610	2,484,805.570	
JUNIPER NETWORKS INC	16,900	35.460	599,274.000	
JM SMUCKER CO/THE	6,100	111.580	680,638.000	
JOHNSON & JOHNSON	137,800	145.540	20,055,412.000	
ABBVIE INC	101,272	168.590	17,073,446.480	
HOLOGIC INC	13,300	71.790	954,807.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	19,300	139.490	2,692,157.000	
KROGER CO	39,200	50.380	1,974,896.000	
KLA CORP	7,800	824.840	6,433,752.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	12,400	458.340	5,683,416.000	
CORPAY INC	4,000	249.660	998,640.000	
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	12,300	43.260	532,098.000	
LOWE'S COS INC	32,700	223.350	7,303,545.000	
ELI LILLY & CO	46,185	878.450	40,571,213.250	
LAM RESEARCH CORP	7,580	1,035.980	7,852,728.400	
LOEWS CORP	10,800	73.790	796,932.000	
MCDONALD'S CORP	41,250	253.580	10,460,175.000	

3M CO	31,590	100.900	3,187,431.000	
META PLATFORMS INC CLASS A	125,200	504.160	63,120,832.000	
S&P GLOBAL INC	18,339	434.400	7,966,461.600	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,600	566.850	2,040,660.000	
PHILLIPS 66	24,500	136.760	3,350,620.000	
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	9,100	160.090	1,456,819.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	15,250	39.850	607,712.500	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	14,400	67.790	976,176.000	
METLIFE INC	35,000	68.550	2,399,250.000	
MARVELL TECHNOLOGY INC	49,500	73.270	3,626,865.000	
ARISTA NETWORKS INC	15,200	328.500	4,993,200.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,598	375.410	3,603,185.180	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,300	1,454.740	1,891,162.000	
BAKER HUGHES CO	57,223	31.090	1,779,063.070	
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,600	254.390	1,678,974.000	
MERCK & CO. INC.	144,721	129.480	18,738,475.080	
DUPONT DE NEMOURS INC	23,851	79.660	1,899,970.660	
MASCO CORP	12,500	69.140	864,250.000	
M & T BANK CORP	9,599	142.180	1,364,785.820	
MARSH & MCLENNAN COS	28,170	208.880	5,884,149.600	
HEICO CORP-CLASS A	4,320	177.210	765,547.200	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	14,102	239.450	3,376,723.900	
WORKDAY INC-CLASS A	12,100	209.480	2,534,708.000	
BLOCK INC CLASS A	31,812	62.150	1,977,115.800	
TRANSUNION	11,100	71.790	796,869.000	
VISTRA CORP	20,000	87.590	1,751,800.000	
NETAPP INC	11,800	126.170	1,488,806.000	
NIKE INC -CL B	69,300	93.390	6,471,927.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	13,000	219.900	2,858,700.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	30,900	91.350	2,822,715.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,405	115.670	1,319,216.350	
ALLY FINANCIAL INC	15,700	38.780	608,846.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,100	424.090	3,435,129.000	
APTIV PLC	15,700	70.300	1,103,710.000	
NEWMONT CORP	65,911	40.820	2,690,487.020	
MCKESSON CORP	7,600	589.950	4,483,620.000	
XYLEM INC	13,900	138.020	1,918,478.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	88,800	102.200	9,075,360.000	
NUCOR CORP	13,800	154.690	2,134,722.000	

GODADDY INC - CLASS A	7,800	137.530	1,072,734.000	
EVERGY INC	13,150	52.740	693,531.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	38,024	59.840	2,275,356.160	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,450	349.820	507,239.000	
OKTA INC	9,200	89.760	825,792.000	
WIX.COM LTD	3,210	163.610	525,188.100	
EQUITABLE HOLDINGS INC	18,800	39.680	745,984.000	
KKR & CO INC	35,600	109.180	3,886,808.000	
PAYCHEX INC	18,600	121.990	2,269,014.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,400	1,007.310	3,424,854.000	
ALTRIA GROUP INC	98,300	44.320	4,356,656.000	
P G & E CORP	115,900	18.250	2,115,175.000	
PFIZER INC	322,713	27.530	8,884,288.890	
CIGNA CORP	16,300	333.290	5,432,627.000	
DELL TECHNOLOGIES -C	15,101	134.980	2,038,332.980	
XCEL ENERGY INC	31,800	53.770	1,709,886.000	
STERIS PLC	5,700	218.290	1,244,253.000	
SEA LTD-ADR	22,200	74.420	1,652,124.000	
FOX CORP - CLASS B	8,133	30.940	251,635.020	
FOX CORP - CLASS A	13,699	33.180	454,532.820	
STRYKER CORP	19,580	344.980	6,754,708.400	
DOW INC	40,218	55.020	2,212,794.360	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	6,700	104.310	698,877.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	14,200	57.740	819,908.000	
PARKER HANNIFIN CORP	7,400	503.300	3,724,420.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	107,200	70.060	7,510,432.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	134,467	166.790	22,427,750.930	
EXELON CORP	57,222	35.540	2,033,669.880	
INGERSOLL-RAND INC	23,108	91.460	2,113,457.680	
NVR INC	180	7,602.330	1,368,419.400	
CONOCOPHILLIPS	67,202	109.390	7,351,226.780	
TWILIO INC - A	9,900	54.240	536,976.000	
DOCUSIGN INC	11,800	50.840	599,912.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,000	142.780	428,340.000	
DAYFORCE INC	8,500	50.490	429,165.000	
PURE STORAGE INC - CLASS A	18,700	67.680	1,265,616.000	
PEPSICO INC	78,600	163.810	12,875,466.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,620	252.330	661,104.600	
MONGODB INC	4,200	227.000	953,400.000	

SNAP INC - A	59,900	15.590	933,841.000	
CORTEVA INC	39,968	51.180	2,045,562.240	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,600	113.110	2,330,066.000	
AMCOR PLC	82,600	9.960	822,696.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	13,200	385.435	5,087,742.000	
ROKU INC	7,300	54.510	397,923.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,200	129.300	1,448,160.000	
ACCENTURE PLC-CL A	36,000	286.710	10,321,560.000	
PENTAIR PLC	9,475	77.330	732,701.750	
QUALCOMM INC	63,800	215.330	13,738,054.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	13,500	76.660	1,034,910.000	
DATADOG INC - CLASS A	15,800	117.840	1,861,872.000	
PINTEREST INC- CLASS A	34,100	43.510	1,483,691.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,200	1,036.520	6,426,424.000	
REPUBLIC SERVICES INC	12,700	188.640	2,395,728.000	
BOOKING HOLDINGS INC	2,000	3,859.100	7,718,200.000	
ROSS STORES INC	19,200	145.930	2,801,856.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,130	182.680	937,148.400	
RESMED INC	8,500	211.730	1,799,705.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	6,330	137.850	872,590.500	
MODERNA INC	18,700	140.030	2,618,561.000	
HUBSPOT INC	2,780	584.710	1,625,493.800	
REVVITY INC	7,100	108.650	771,415.000	
CARRIER GLOBAL CORP	46,387	64.350	2,985,003.450	
OTIS WORLDWIDE CORP	23,238	97.130	2,257,106.940	
AVANTOR INC	38,900	21.680	843,352.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	13,500	39.050	527,175.000	
DYNATRACE INC	15,200	45.910	697,832.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	25,500	95.660	2,439,330.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	52,485	18.650	978,845.250	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	21,700	26.920	584,164.000	
MATCH GROUP INC	15,100	31.550	476,405.000	
CHEVRON CORP	100,218	152.570	15,290,260.260	
ZSCALER INC	5,200	184.220	957,944.000	
EDISON INTERNATIONAL	22,000	73.210	1,610,620.000	
ETSY INC	6,700	58.870	394,429.000	
TESLA INC	163,850	178.010	29,166,938.500	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	17,300	127.170	2,200,041.000	
GEN DIGITAL INC	32,800	24.390	799,992.000	

UNITY SOFTWARE INC	15,600	16.400	255,840.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	8,802	83.550	735,407.100	
SYNOPSYS INC	8,800	590.210	5,193,848.000	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	17,100	75.590	1,292,589.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	5,405	276.260	1,493,185.300	
VIATRIS INC	66,721	10.170	678,552.570	
DOORDASH INC - A	16,250	112.050	1,820,812.500	
ROBLOX CORP -CLASS A	27,200	35.100	954,720.000	
AIRBNB INC-CLASS A	25,300	145.970	3,693,041.000	
CBRE GROUP INC - A	17,500	86.900	1,520,750.000	
SOUTHERN CO/THE	62,400	78.650	4,907,760.000	
SYSCO CORP	28,500	70.690	2,014,665.000	
TRAVELERS COS INC/THE	13,103	205.850	2,697,252.550	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	3,400	71.060	241,604.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,400	64.430	412,352.000	
STEEL DYNAMICS INC	8,650	120.690	1,043,968.500	
SCHLUMBERGER LTD	81,352	43.000	3,498,136.000	
AT&T INC	408,791	17.640	7,211,073.240	
APA CORP	21,000	27.820	584,220.000	
SOUTHWEST AIRLINES CO	8,650	28.380	245,487.000	
ON SEMICONDUCTOR CORP	24,500	71.970	1,763,265.000	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	12,400	36.030	446,772.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	13,800	296.990	4,098,462.000	
SEMPRA ENERGY	36,200	75.970	2,750,114.000	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	11,900	50.190	597,261.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	108,800	23.570	2,564,416.000	
UIPATH INC - CLASS A	25,300	11.540	291,962.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	11,450	103.860	1,189,197.000	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	10,700	244.500	2,616,150.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	52,100	193.900	10,102,190.000	
SALESFORCE.COM INC	55,466	231.940	12,864,784.040	
WESTROCK CO	14,700	49.660	730,002.000	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	22,809	115.870	2,642,878.830	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	39,034	69.430	2,710,130.620	
TERADYNE INC	8,800	145.060	1,276,528.000	
UNION PACIFIC CORP	34,880	222.100	7,746,848.000	
MARATHON OIL CORP	33,000	27.300	900,900.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	21,088	170.070	3,586,436.160	

RTX CORP	79,879	104.230	8,325,788.170	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	41,700	135.650	5,656,605.000	
IQVIA HOLDINGS INC	10,404	212.750	2,213,451.000	
AMEREN CORPORATION	15,300	70.120	1,072,836.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	52,766	497.120	26,231,033.920	
APPLOVIN CORP CLASS A	10,300	77.520	798,456.000	
TOAST INC CLASS A	20,100	22.720	456,672.000	
VERISIGN INC	5,200	180.310	937,612.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	41,800	10.880	454,784.000	
ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	30,500	22.420	683,810.000	
VALERO ENERGY CORP	18,942	150.070	2,842,625.940	
ULTA BEAUTY INC	2,800	390.820	1,094,296.000	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	14,888	48.280	718,792.640	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,430	187.850	644,325.500	
ELEVANCE HEALTH INC	13,300	534.810	7,112,973.000	
WALT DISNEY CO/THE	104,862	99.970	10,483,054.140	
WELLS FARGO & CO	201,822	57.400	11,584,582.800	
WASTE MANAGEMENT INC	23,000	203.640	4,683,720.000	
WILLIAMS COS INC	69,700	41.170	2,869,549.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,200	280.250	1,737,550.000	
WALMART INC	253,300	67.020	16,976,166.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	11,800	107.190	1,264,842.000	
WYNN RESORTS LTD	5,700	88.800	506,160.000	
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	127,300	3.600	458,280.000	
CELSIUS HOLDINGS INC	8,700	59.960	521,652.000	
WABTEC CORP	10,111	160.320	1,620,995.520	
TJX COMPANIES INC	64,800	108.500	7,030,800.000	
WATERS CORP	3,400	294.940	1,002,796.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	3,000	301.370	904,110.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	42,000	15.550	653,100.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,863	255.280	1,496,706.640	
WILLIAMS-SONOMA INC	3,500	301.620	1,055,670.000	
WESTERN DIGITAL CORP	18,700	78.120	1,460,844.000	
WEC ENERGY GROUP INC	18,100	78.860	1,427,366.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	28,500	72.640	2,070,240.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	90,450	270.660	24,481,197.000	
PPL CORP	42,200	28.080	1,184,976.000	

CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	18,024	214.900	3,873,357.600	
PULTEGROUP INC	12,050	114.090	1,374,784.500	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	132,453	7.240	958,959.720	
PPG INDUSTRIES INC	13,500	127.320	1,718,820.000	
NORTHERN TRUST CORP	11,700	81.650	955,305.000	
FERGUSON PLC	11,600	201.470	2,337,052.000	
NVIDIA CORP	1,429,800	131.880	188,562,024.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	22,813	151.090	3,446,816.170	
DRAFTKINGS INC CLASS A	24,500	38.910	953,295.000	
ASPEN TECHNOLOGY CORP	1,700	197.660	336,022.000	
TYSON FOODS INC-CL A	16,400	53.970	885,108.000	
NETFLIX INC	24,790	669.380	16,593,930.200	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	21,800	572.050	12,470,690.000	
NRG ENERGY INC	12,550	78.640	986,932.000	
TEXTRON INC	10,900	85.250	929,225.000	
NEWS CORP - CLASS A	21,187	27.080	573,743.960	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,150	750.000	862,500.000	
OMNICOM GROUP	11,200	88.410	990,192.000	
JACOBS SOLUTIONS INC	7,220	138.200	997,804.000	
ORACLE CORP	94,233	138.130	13,016,404.290	
MASTERCARD INC - A	47,600	444.630	21,164,388.000	
ONEOK INC	33,400	78.100	2,608,540.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,200	549.450	3,406,590.000	
U HAUL NON VOTING SERIES N	5,600	60.600	339,360.000	
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	10,400	132.630	1,379,352.000	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	6,400	85.140	544,896.000	
HF SINCLAIR CORP	9,400	52.230	490,962.000	
OVINTIV INC	15,500	45.810	710,055.000	
YUM! BRANDS INC	16,100	136.790	2,202,319.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	9,400	158.960	1,494,224.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	10,500	49.530	520,065.000	
BANK OF AMERICA CORP	405,801	39.240	15,923,631.240	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,800	389.600	1,090,880.000	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	10,900	83.510	910,259.000	
AMERICAN EXPRESS CO	32,900	224.820	7,396,578.000	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	24,835	76.490	1,899,629.150	
LINDE PLC	27,546	436.950	12,036,224.700	

ANALOG DEVICES INC	28,391	231.190	6,563,715.290	
ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	19,800	20.010	396,198.000	
MONDAYCOM LTD	2,300	226.580	521,134.000	
ADVANCED MICRO DEVICES	92,427	159.630	14,754,122.010	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	14,200	28.350	402,570.000	
LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER	11,400	72.430	825,702.000	
CONFLUENT INC CLASS A	11,700	27.770	324,909.000	
KENVUE INC	98,500	18.070	1,779,895.000	
GLOBAL E ONLINE LTD	6,100	32.000	195,200.000	
VERALTO CORP	14,216	100.750	1,432,262.000	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	38,972	73.420	2,861,324.240	
BUNGE GLOBAL LTD	8,100	102.830	832,923.000	
VERTIV HOLDINGS CLASS A	20,800	91.480	1,902,784.000	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	9,200	104.370	960,204.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,000	148.500	2,079,000.000	
AVERY DENNISON CORP	4,630	226.530	1,048,833.900	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	28,500	64.260	1,831,410.000	
EMERSON ELECTRIC CO	32,700	106.460	3,481,242.000	
AON PLC-CLASS A	11,400	295.390	3,367,446.000	
AMGEN INC	30,700	298.620	9,167,634.000	
SAMSARA INC CLASS A	11,700	28.070	328,419.000	
EATON CORP PLC	22,936	319.020	7,317,042.720	
COOPER INC	11,400	93.470	1,065,558.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	9,500	253.500	2,408,250.000	
APPLIED MATERIALS INC	47,500	237.030	11,258,925.000	
CME GROUP INC	20,600	197.130	4,060,878.000	
ECOLAB INC	14,800	240.050	3,552,740.000	
EQUIFAX INC	7,100	241.610	1,715,431.000	
GILEAD SCIENCES INC	71,300	65.060	4,638,778.000	
KEURIG DR PEPPER INC	61,900	34.040	2,107,076.000	
HORMEL FOODS CORP	17,300	30.480	527,304.000	
CHORD ENERGY CORP	3,600	162.420	584,712.000	
STATE STREET CORP	17,213	70.910	1,220,573.830	
SOLVENTUM CORP	8,472	54.560	462,232.320	
GE VERNOVA	15,726	170.170	2,676,093.420	
SCHWAB (CHARLES) CORP	86,240	73.250	6,317,080.000	
CRH PUBLIC LIMITED PLC	41,600	76.550	3,184,480.000	

LABCORP HOLDINGS	4,900	199.880	979,412.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	29,100	33.780	982,998.000	
CAMPBELL SOUP CO	11,100	43.990	488,289.000	
CROWN HOLDINGS INC	6,980	78.180	545,696.400	
CARDINAL HEALTH INC	13,900	100.200	1,392,780.000	
FEDEX CORP	13,400	246.430	3,302,162.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	21,854	133.700	2,921,879.800	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	14,613	94.540	1,381,513.020	
INTEL CORP	243,400	30.450	7,411,530.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	21,300	29.420	626,646.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	17,050	99.470	1,695,963.500	
ILLINOIS TOOL WORKS	17,100	235.170	4,021,407.000	
ILLUMINA INC	9,100	108.660	988,806.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	20,300	425.780	8,643,334.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,550	156.490	868,519.500	
SNAP-ON INC	3,100	262.240	812,944.000	
CARMAX INC	9,000	69.910	629,190.000	
DUKE ENERGY CORP	44,128	102.360	4,516,942.080	
TARGET CORP	26,400	141.160	3,726,624.000	
DOVER CORP	7,900	177.250	1,400,275.000	
WW GRAINGER INC	2,600	906.790	2,357,654.000	
JABIL INC	7,100	119.480	848,308.000	
CINTAS CORP	5,300	695.690	3,687,157.000	
CONAGRA BRANDS INC	27,400	28.340	776,516.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	8,300	86.760	720,108.000	
CLOROX COMPANY	7,100	133.700	949,270.000	
ENTERGY CORP	12,200	107.020	1,305,644.000	
MICROSOFT CORP	403,400	442.570	178,532,738.000	
INCYTE CORP	11,000	62.110	683,210.000	
CVS HEALTH CORP	71,869	60.220	4,327,951.180	
MEDTRONIC PLC	75,898	81.040	6,150,773.920	
MICRON TECHNOLOGY INC	63,300	141.360	8,948,088.000	
BLACKROCK INC	8,600	769.330	6,616,238.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	36,200	30.850	1,116,770.000	
KELLOGG CO	15,700	57.520	903,064.000	
KEYCORP	53,000	13.360	708,080.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	76,911	65.850	5,064,589.350	
CHUBB LTD	23,199	259.460	6,019,212.540	
ALLSTATE CORP	15,100	157.070	2,371,757.000	

	EBAY INC	29,600	52.130	1,543,048.000	
	PAYPAL HOLDINGS INC	56,950	60.635	3,453,163.250	
	EASTMAN CHEMICAL CO	6,800	99.510	676,668.000	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	13,400	113.900	1,526,260.000	
	TRIMBLE INC	13,800	54.810	756,378.000	
	LENNAR CORP-A	14,000	155.100	2,171,400.000	
	PROGRESSIVE CORP	33,500	203.920	6,831,320.000	
	PACCAR INC	29,955	106.720	3,196,797.600	
	BIOGEN INC	8,400	231.690	1,946,196.000	
	IDEXX LABORATORIES INC	4,800	504.000	2,419,200.000	
	STARBUCKS CORP	64,700	79.650	5,153,355.000	
	PTC INC	6,900	173.500	1,197,150.000	
	EVERSOURCE ENERGY	20,000	59.010	1,180,200.000	
	INTUIT INC	16,080	595.700	9,578,856.000	
	BEST BUY CO INC	11,150	87.210	972,391.500	
	BALL CORP	18,004	66.010	1,188,444.040	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	84,097	76.760	6,455,285.720	
	ELECTRONIC ARTS INC	14,600	135.980	1,985,308.000	
	VULCAN MATERIALS CO	7,600	252.640	1,920,064.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	14,800	480.730	7,114,804.000	
	PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	30,625	10.170	311,456.250	
	CARNIVAL CORP	57,800	15.340	886,652.000	
	CLEVELAND-CLIFFS INC	28,100	14.910	418,971.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	226,390	37.440	8,476,041.600	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	9,600	36.660	351,936.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	66,800	3.220	215,096.000	
アメリカ・ドル 小計				2,670,079,104.170 (420,617,561,281)	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	357,057	27.110	9,679,815.270	
	HALEON PLC	382,460	3.243	1,240,317.780	
	WISE PLC CLASS A	33,541	7.135	239,315.030	
	BP PLC	938,105	4.600	4,315,283.000	
	UNILEVER PLC	139,961	44.500	6,228,264.500	
	BARCLAYS PLC	838,552	2.020	1,693,875.040	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	469,969	4.578	2,151,518.080	
	PRUDENTIAL PLC	153,543	7.000	1,074,801.000	
	NATWEST GROUP PLC	369,287	3.072	1,134,449.660	
	BAE SYSTEMS PLC	168,965	13.350	2,255,682.750	

AVIVA PLC	149,480	4.760	711,524.800	
GSK	231,552	16.045	3,715,251.840	
INFORMA PLC	74,976	8.424	631,597.820	
MELROSE INDUSTRIES PLC	72,520	6.006	435,555.120	
AUTO TRADER GROUP PLC	50,437	8.190	413,079.030	
DCC PLC	5,390	55.500	299,145.000	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	9,946	138.350	1,376,029.100	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	4,117	84.850	349,327.450	
HALMA PLC	21,214	26.450	561,110.300	
ENTAIN PLC	35,711	6.560	234,264.160	
JD SPORTS FASHION PLC	138,098	1.207	166,753.330	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	39,403	4.806	189,370.810	
M&G PLC	126,560	2.005	253,752.800	
ENDEAVOUR MINING PLC	10,449	16.100	168,228.900	
RELX PLC	104,742	35.580	3,726,720.360	
DIAGEO PLC	124,220	25.790	3,203,633.800	
RIO TINTO PLC	62,972	52.190	3,286,508.680	
STANDARD CHARTERED PLC	123,447	7.242	894,003.170	
TESCO PLC	393,005	3.102	1,219,101.510	
SMITH & NEPHEW PLC	48,799	9.996	487,794.800	
GLENCORE PLC	579,145	4.545	2,632,503.590	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	18,953	10.510	199,196.030	
SMITHS GROUP PLC	19,452	16.810	326,988.120	
PEARSON PLC	33,165	9.490	314,735.850	
SAINSBURY (J) PLC	93,101	2.588	240,945.380	
NEXT PLC	6,612	90.080	595,608.960	
TAYLOR WIMPEY PLC	198,070	1.483	293,737.810	
WHITBREAD PLC	10,175	29.120	296,296.000	
BUNZL PLC	18,847	29.220	550,709.340	
VODAFONE GROUP PLC	1,285,319	0.689	886,355.980	
CRODA INTERNATIONAL PLC	7,238	41.270	298,712.260	
KINGFISHER PLC	102,657	2.486	255,205.300	
WPP PLC	60,259	7.354	443,144.680	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	38,195	10.365	395,891.170	
SEVERN TRENT PLC	15,087	24.740	373,252.380	
RENTOKIL INITIAL PLC	140,949	4.471	630,182.970	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	39,399	43.930	1,730,798.070	
SCHRODERS PLC	42,839	3.708	158,847.010	
SSE PLC	61,058	17.670	1,078,894.860	

	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	54,534	4.889	266,616.720	
	ASTRAZENECA PLC	86,577	125.100	10,830,782.700	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	333,958	2.247	750,403.620	
	3I GROUP PLC	54,343	30.400	1,652,027.200	
	ASHTEAD GROUP PLC	24,447	54.220	1,325,516.340	
	SAGE GROUP PLC/THE	55,580	10.565	587,202.700	
	NATIONAL GRID PLC	287,707	8.820	2,537,575.740	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,535,416	0.541	1,915,488.380	
	IMPERIAL BRANDS PLC	45,589	19.995	911,552.050	
	CENTRICA PLC	294,667	1.320	388,960.440	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	5,933	50.300	298,429.900	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	112,083	23.920	2,681,025.360	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	18,580	24.830	461,341.400	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,053,083	6.768	7,127,265.740	
	ANGLO AMERICAN PLC	70,947	23.885	1,694,569.090	
	MONDI PLC	24,732	14.630	361,829.160	
	COMPASS GROUP PLC	95,031	22.170	2,106,837.270	
	PERSIMMON PLC	17,888	14.200	254,009.600	
	BT GROUP PLC	362,019	1.395	505,197.510	
	COCA-COLA HBC AG-DI	12,288	26.920	330,792.960	
	BURBERRY GROUP PLC	20,044	9.802	196,471.280	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	9,005	81.800	736,609.000	
	INTERTEK GROUP PLC	9,003	47.440	427,102.320	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	25,595	94.340	2,414,632.300	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	9,366	19.580	183,386.280	
	ADMIRAL GROUP PLC	14,613	25.510	372,777.630	
	ANTOFAGASTA PLC	21,985	20.410	448,713.850	
	EXPERIAN PLC	51,271	37.070	1,900,615.970	
イギリス・ポンド 小計				107,705,813.160 (21,527,160,877)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	73,333	18.710	1,372,060.430	
	AZRIELI GROUP LTD	2,516	224.200	564,087.200	
	ICL GROUP LTD	44,023	16.490	725,939.270	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,518	674.800	1,024,346.400	
	BANK HAPOALIM BM	75,312	33.010	2,486,049.120	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	90,278	30.490	2,752,576.220	
	NICE LTD	3,754	621.700	2,333,861.800	

	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,181	130.600	1,199,038.600	
イスラエル・シュケル 小計				12,457,959.040 (527,603,286)	
オーストラリア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	115,728	5.190	600,628.320	
	TELSTRA GROUP LTD	210,415	3.500	736,452.500	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	160,421	28.750	4,612,103.750	
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	10,800	39.440	425,952.000	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	143,205	3.690	528,426.450	
	BHP GROUP LTD	270,550	43.090	11,657,999.500	
	SOUTH32 LTD	241,523	3.660	883,974.180	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	101,302	27.260	2,761,492.520	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	90,350	23.200	2,096,120.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	165,328	35.020	5,789,786.560	
	WESTPAC BANKING CORP	185,049	26.790	4,957,462.710	
	SANTOS LTD	173,184	7.470	1,293,684.480	
	RIO TINTO LTD	19,757	120.200	2,374,791.400	
	ORIGIN ENERGY LTD	91,846	10.080	925,807.680	
	AURIZON HOLDINGS LTD	93,381	3.650	340,840.650	
	PILBARA MINERALS LTD	153,072	3.240	495,953.280	
	XERO LTD	7,773	130.940	1,017,796.620	
	PRO MEDICUS LTD	3,500	131.170	459,095.000	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,201	32.390	395,190.390	
	COLES GROUP LTD	71,432	16.990	1,213,629.680	
	WISETECH GLOBAL LTD	8,876	96.150	853,427.400	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	61,249	13.430	822,574.070	
	REECE LTD	11,443	25.840	295,687.120	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	82,315	5.050	415,690.750	
	SEEK LTD	18,528	23.060	427,255.680	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	43,476	12.060	524,320.560	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	89,275	125.310	11,187,050.250	
	AMPOL LTD	12,749	33.100	421,991.900	
	ORICA LTD	26,028	18.000	468,504.000	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	80,200	18.310	1,468,462.000	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	65,172	32.590	2,123,955.480	
	QANTAS AIRWAYS LTD	44,332	6.110	270,868.520	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	22,831	48.300	1,102,737.300	
	MACQUARIE GROUP LTD	19,377	190.740	3,695,968.980	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	30,048	46.680	1,402,640.640	

	CSL LTD	25,761	289.100	7,447,505.100	
	WESFARMERS LTD	60,570	67.400	4,082,418.000	
	COCHLEAR LTD	3,501	323.510	1,132,608.510	
	BLUESCOPE STEEL LTD	23,673	20.540	486,243.420	
	SUNCORP GROUP LTD	67,897	16.390	1,112,831.830	
	ASX LTD	10,368	56.450	585,273.600	
	COMPUTERSHARE LTD	28,011	26.470	741,451.170	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	124,907	6.590	823,137.130	
	SONIC HEALTHCARE LTD	24,371	25.340	617,561.140	
	BRAMBLES LTD	74,290	14.520	1,078,690.800	
	CARSALES.COM LTD	19,237	35.070	674,641.590	
	MINERAL RESOURCES LTD	9,385	62.370	585,342.450	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,541	48.290	460,734.890	
	REA GROUP LTD	2,750	192.080	528,220.000	
オーストラリア・ドル 小計				89,404,981.950 (9,313,316,971)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	40,600	75.900	3,081,540.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	17,681	52.220	923,301.820	
	IMPERIAL OIL LTD	10,000	88.110	881,100.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,100	3,800.000	4,180,000.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	15,887	94.650	1,503,704.550	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	23,900	72.700	1,737,530.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	9,450	222.400	2,101,680.000	
	BCE INC	3,730	45.180	168,521.400	
	FRANCO-NEVADA CORP	10,200	159.490	1,626,798.000	
	SUNCOR ENERGY INC	67,830	50.260	3,409,135.800	
	METRO INC/CN	12,000	73.990	887,880.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	17,900	106.430	1,905,097.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	64,500	63.700	4,108,650.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	49,500	65.310	3,232,845.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	93,200	74.530	6,946,196.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	14,900	39.210	584,229.000	
	MEG ENERGY CORP	14,200	27.710	393,482.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	74,350	142.870	10,622,384.500	
	TOURMALINE OIL CORP	17,600	63.130	1,111,088.000	
	TC ENERGY CORP	54,750	53.250	2,915,437.500	
	PEMBINA PIPELINE CORP	30,529	50.920	1,554,536.680	

BARRICK GOLD CORP	92,600	22.010	2,038,126.000	
CAE INC	16,900	24.770	418,613.000	
THOMSON REUTERS CORP	8,341	229.650	1,915,510.650	
EMPIRE CO LTD 'A'	7,100	32.110	227,981.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,000	109.730	329,190.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	7,750	72.680	563,270.000	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	20,600	24.210	498,726.000	
HYDRO ONE LTD	17,000	39.420	670,140.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	8,060	156.350	1,260,181.000	
STANTEC INC	6,100	113.270	690,947.000	
NORTHLAND POWER INC	13,200	23.880	315,216.000	
WSP GLOBAL INC	6,600	206.840	1,365,144.000	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	4,400	117.560	517,264.000	
PARKLAND CORP	7,100	38.710	274,841.000	
QUEBECOR INC -CL B	7,700	29.120	224,224.000	
EMERA INC	15,100	45.810	691,731.000	
TFI INTERNATIONAL INC	4,300	188.900	812,270.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	6,800	30.460	207,128.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	18,900	51.930	981,477.000	
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,900	84.730	160,987.000	
IVANHOE MINES LTD-CL A	32,700	17.480	571,596.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	26,317	88.270	2,323,001.590	
AIR CANADA	8,900	17.160	152,724.000	
KINROSS GOLD CORP	63,400	10.190	646,046.000	
BANK OF MONTREAL	38,600	114.860	4,433,596.000	
POWER CORP OF CANADA	29,900	38.450	1,149,655.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	63,700	92.940	5,920,278.000	
NUTRIEN LTD	26,119	70.320	1,836,688.080	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	7,000	41.300	289,100.000	
CAMECO CORP	22,900	71.290	1,632,541.000	
FIRSTSERVICE CORP	2,200	209.380	460,636.000	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	11,600	52.120	604,592.000	
TELUS CORP	10,800	21.720	234,576.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	24,200	65.610	1,587,762.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,800	135.150	378,420.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	113,200	46.620	5,277,384.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,200	1,526.560	1,831,872.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,400	57.970	834,768.000	
WESTON (GEORGE) LTD	3,237	189.320	612,828.840	

	PAN AMERICAN SILVER CORP	19,300	27.310	527,083.000	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	4,600	129.200	594,320.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	30,700	65.340	2,005,938.000	
	ENBRIDGE INC	112,100	48.250	5,408,825.000	
	BROOKFIELD CORP	71,525	56.240	4,022,566.000	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	94,900	34.500	3,274,050.000	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	49,220	105.620	5,198,616.400	
	IA FINANCIAL CORP INC	5,200	85.180	442,936.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,900	51.620	407,798.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	28,750	167.290	4,809,587.500	
	CGI INC - CLASS A	10,900	136.860	1,491,774.000	
	ONEX CORPORATION	3,400	94.310	320,654.000	
	IGM FINANCIAL INC	4,200	36.880	154,896.000	
	TMX GROUP LTD	14,700	37.140	545,958.000	
	OPEN TEXT CORP	14,400	39.510	568,944.000	
	SAPUTO INC	13,500	29.370	396,495.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	36,600	16.490	603,534.000	
	FORTIS INC	26,100	53.690	1,401,309.000	
	RB GLOBAL INC	9,700	109.750	1,064,575.000	
	LUNDIN MINING CORP	34,800	14.700	511,560.000	
	CENOVUS ENERGY INC	73,600	25.060	1,844,416.000	
	DOLLARAMA INC	14,700	123.850	1,820,595.000	
	ALTAGAS LTD	15,700	30.470	478,379.000	
	KEYERA CORP	12,200	36.590	446,398.000	
	ARC RESOURCES LTD	31,500	23.950	754,425.000	
カナダ・ドル 小計				137,911,800.310 (15,817,104,378)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	157,500	2.630	414,225.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	76,600	30.570	2,341,662.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	120,640	35.480	4,280,307.200	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	90,175	6.730	606,877.750	
	KEPPEL CORP LTD	88,200	6.530	575,946.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	205,000	14.140	2,898,700.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	366,100	0.870	318,507.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	499,850	2.550	1,274,617.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	94,500	3.980	376,110.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	54,100	5.040	272,664.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	51,900	9.530	494,607.000	

	WILMAR INTERNATIONAL LTD	116,300	3.070	357,041.000	
シンガポール・ドル 小計				14,211,264.450 (1,655,185,971)	
スイス・フラン	SANDOZ GROUP AG	21,852	31.890	696,860.280	
	AVOLTA AG	4,854	36.120	175,326.480	
	UBS GROUP AG-REG	175,733	26.920	4,730,732.360	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,711	273.600	468,129.600	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	355	732.500	260,037.500	
	ADECCO GROUP AG-REG	9,058	31.100	281,703.800	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	37,585	247.600	9,306,046.000	
	SIKA AG-REG	8,195	255.900	2,097,100.500	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	109,400.000	656,400.000	
	ABB LTD-REG	85,447	49.890	4,262,950.830	
	SWISS RE AG	16,121	108.900	1,755,576.900	
	NESTLE SA-REG	142,676	95.280	13,594,169.280	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,173	1,154.500	1,354,228.500	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,208	235.400	519,763.200	
	JULIUS BAER GROUP LTD	10,962	50.600	554,677.200	
	SGS SA-REG	7,978	81.800	652,600.400	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,291	230.500	297,575.500	
	TEMENOS AG - REG	3,232	59.900	193,596.800	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,028	117.900	239,101.200	
	VAT GROUP AG	1,398	497.500	695,505.000	
	BKW AG	1,174	140.700	165,181.800	
	ALCON INC	26,679	80.440	2,146,058.760	
	SIG GROUP N AG	15,864	16.060	254,775.840	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,500	185.250	277,875.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	7,779	471.400	3,667,020.600	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,416	155.300	375,204.800	
	CLARIANT AG-REG	10,962	13.500	147,987.000	
	NOVARTIS AG-REG	106,153	95.010	10,085,596.530	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	181	1,553.000	281,093.000	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	1,766	79.250	139,955.500	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	28,743	143.850	4,134,680.550	
	SWISSCOM AG-REG	1,341	496.000	665,136.000	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,544	94.600	146,062.400	
	GEBERIT AG-REG	1,834	542.200	994,394.800	
	GIVAUDAN-REG	478	4,296.000	2,053,488.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	5,980	110.600	661,388.000	

	SONOVA HOLDING AG-REG	2,729	276.900	755,660.100	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	8,537	88.380	754,500.060	
	LONZA GROUP AG-REG	3,956	480.300	1,900,066.800	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,686	36.600	98,307.600	
	HOLCIM LTD	27,894	80.040	2,232,635.760	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,530	632.200	967,266.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,815	256.500	722,047.500	
	SWISS PRIME SITE-REG	4,180	83.400	348,612.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	49	10,750.000	526,750.000	
スイス・フラン 小計				77,293,825.730 (13,668,640,142)	
スウェーデン・クローナ	SAGAX CLASS B	13,255	266.400	3,531,132.000	
	VOLVO CAR CLASS B	45,114	32.200	1,452,670.800	
	ERICSSON LM-B SHS	167,894	61.780	10,372,491.320	
	VOLVO AB-B SHS	96,165	263.600	25,349,094.000	
	SKF AB-B SHARES	20,605	207.100	4,267,295.500	
	TELE2 AB-B SHS	32,433	104.400	3,386,005.200	
	GETINGE AB-B SHS	13,892	182.800	2,539,457.600	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	96,073	152.800	14,679,954.400	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	88,268	100.250	8,848,867.000	
	SWEDBANK AB - A SHARES	51,431	214.600	11,037,092.600	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	34,789	188.600	6,561,205.400	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	36,726	155.050	5,694,366.300	
	SKANSKA AB-B SHS	20,570	187.550	3,857,903.500	
	SANDVIK AB	64,508	215.700	13,914,375.600	
	INVESTOR AB-B SHS	104,786	283.750	29,733,027.500	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	162,538	200.200	32,540,107.600	
	VOLVO AB-A SHS	12,071	268.800	3,244,684.800	
	HOLMEN AB-B SHARES	4,577	425.800	1,948,886.600	
	SECURITAS AB-B SHS	29,755	104.000	3,094,520.000	
	TELIA CO AB	142,762	26.760	3,820,311.120	
	ALFA LAVAL AB	17,552	464.600	8,154,659.200	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	94,432	172.950	16,332,014.400	
	ASSA ABLOY AB-B	60,618	302.400	18,330,883.200	
	TRELLEBORG AB-B SHS	13,000	403.600	5,246,800.000	
	SAAB AB-B	19,388	241.000	4,672,508.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	7,455	355.000	2,646,525.000	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	40,092	68.540	2,747,905.680	

	INDUTRADE AB	16,498	272.200	4,490,755.600	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	11,825	270.000	3,192,750.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	4,551	516.500	2,350,591.500	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,943	296.000	2,647,128.000	
	LIFCO AB-B SHS	14,119	283.400	4,001,324.600	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	91,742	47.260	4,335,726.920	
	BEIJER REF AB	21,818	164.550	3,590,151.900	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	36,920	278.600	10,285,912.000	
	BOLIDEN AB	16,514	339.400	5,604,851.600	
	EPIROC AB-A	39,868	211.800	8,444,042.400	
	EPIROC AB-B	23,618	192.500	4,546,465.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	21,195	88.400	1,873,638.000	
	EQT AB	22,637	312.500	7,074,062.500	
	EVOLUTION AB	11,164	1,056.000	11,789,184.000	
	HEXAGON AB-B SHS	125,680	116.500	14,641,720.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	9,520	353.700	3,367,224.000	
スウェーデン・クローナ 小計				340,240,272.340 (5,093,396,876)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	197,487	991.000	195,709,617.000	
	DANSKE BANK A/S	41,790	202.400	8,458,296.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	173	11,120.000	1,923,760.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	61,167	182.050	11,135,452.350	
	CARLSBERG AS-B	5,738	938.200	5,383,391.600	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	22,618	407.400	9,214,573.200	
	COLOPLAST-B	7,677	851.600	6,537,733.200	
	DSV PANALPINA A/S	10,386	1,081.500	11,232,459.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	526	2,750.000	1,446,500.000	
	DEMANT A/S	6,039	326.400	1,971,129.600	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	252	11,400.000	2,872,800.000	
	TRYG A/S	21,099	143.100	3,019,266.900	
	PANDORA A/S	5,012	1,052.500	5,275,130.000	
	GENMAB A/S	4,017	1,832.500	7,361,152.500	
	ORSTED A/S	11,414	385.800	4,403,521.200	
デンマーク・クローネ 小計				275,944,782.550 (6,236,352,085)	
ニュージーランド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	78,352	6.370	499,102.240	
	MERCURY NZ LTD	42,143	6.690	281,936.670	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	109,847	4.040	443,781.880	

	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	80,630	7.475	602,709.250	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	35,319	30.770	1,086,765.630	
ニュージーランド・ドル 小計				2,914,295.670 (281,695,820)	
ノルウェー・クローネ	DNB BANK	51,370	205.700	10,566,809.000	
	NORSK HYDRO ASA	80,355	64.840	5,210,218.200	
	ORKLA ASA	42,457	90.200	3,829,621.400	
	TELENOR ASA	38,133	122.900	4,686,545.700	
	EQUINOR ASA	54,509	289.700	15,791,257.300	
	YARA INTERNATIONAL ASA	10,008	298.200	2,984,385.600	
	MOWI ASA	28,190	189.450	5,340,595.500	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	12,098	189.000	2,286,522.000	
	AKER BP ASA	19,134	255.100	4,881,083.400	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	5,315	871.500	4,632,022.500	
	SALMAR ASA	3,973	605.000	2,403,665.000	
ノルウェー・クローネ 小計				62,612,725.600 (924,789,957)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	45,627	28.630	1,306,301.010	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	29,629	36.470	1,080,569.630	
	EXOR NV	5,534	96.850	535,967.900	
	DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	6,325	70.620	446,671.500	
	DSM FIRMENICH AG	10,288	99.240	1,020,981.120	
	FERROVIAL	28,747	36.620	1,052,715.140	
	LOTUS BAKERIES NV	21	9,990.000	209,790.000	
	SYENSQO SA	3,987	88.330	352,171.710	
	AMPLIFON	6,724	0.030	201.720	
	BAYER AG-REG	54,464	27.065	1,474,068.160	
	EVONIK INDUSTRIES AG	12,581	18.240	229,477.440	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	104,098	14.414	1,500,468.570	
	COMMERZBANK AG	58,418	13.765	804,123.770	
	VOLKSWAGEN AG	1,588	112.400	178,491.200	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	11,475	104.500	1,199,137.500	
	SIEMENS AG-REG	42,118	165.740	6,980,637.320	
	E.ON SE	124,380	12.430	1,546,043.400	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,626	86.900	1,531,699.400	
	GEA GROUP AG	8,802	37.660	331,483.320	
	CONTINENTAL AG	6,139	55.000	337,645.000	
	BASF SE	49,436	44.585	2,204,104.060	

ALLIANZ SE-REG	21,738	253.400	5,508,409.200	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	9,408	83.060	781,428.480	
RHEINMETALL AG	2,442	479.200	1,170,206.400	
RWE AG	35,057	33.160	1,162,490.120	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	33,293	5.896	196,295.520	
BRENNTAG SE	7,127	65.000	463,255.000	
FRESENIUS SE & CO KGAA	23,436	29.560	692,768.160	
SAP SE	57,883	174.780	10,116,790.740	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	7,530	456.800	3,439,704.000	
ZALANDO SE	12,435	22.150	275,435.250	
HEIDELBERG MATERIALS AG	7,596	95.260	723,594.960	
COVESTRO AG	10,449	50.240	524,957.760	
RATIONAL AG	268	792.500	212,390.000	
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	3,800	79.300	301,340.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,407	245.700	345,699.900	
TALANX AG	3,571	71.600	255,683.600	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	8,487	42.460	360,358.020	
DELIVERY HERO SE	10,712	27.840	298,222.080	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,094	84.350	176,628.900	
BECHTLE AG	4,423	44.460	196,646.580	
NEMETSCHEK SE	3,219	90.700	291,963.300	
SCOUT24 AG	4,119	70.400	289,977.600	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	15,646	53.640	839,251.440	
KNORR-BREMSE AG	3,902	70.400	274,700.800	
SIEMENS ENERGY AG	33,594	23.240	780,724.560	
BEIERSDORF AG	5,614	146.450	822,170.300	
MERCK KGAA	7,141	172.000	1,228,252.000	
ADIDAS AG	9,001	224.900	2,024,324.900	
PUMA SE	5,826	45.060	262,519.560	
HENKEL AG & CO KGAA	5,821	73.650	428,716.650	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	179,577	22.630	4,063,827.510	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	11,413	38.630	440,884.190	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	44,494	63.200	2,812,020.800	
QIAGEN N.V.	12,275	39.700	487,317.500	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	72,338	36.500	2,640,337.000	
HANNOVER RUECK SE	3,339	226.600	756,617.400	
DHL GROUP	54,938	37.750	2,073,909.500	
DEUTSCHE BOERSE AG	10,505	182.250	1,914,536.250	
MTU AERO ENGINES AG	2,991	224.400	671,180.400	

SYMRISE AG	7,331	112.400	824,004.400	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,273	81.400	266,422.200	
VONOVIA SE	40,677	26.980	1,097,465.460	
LEG IMMOBILIEN SE	3,986	77.200	307,719.200	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	44,527	24.110	1,073,545.970	
NN GROUP NV	14,972	41.340	618,942.480	
ARCELORMITTAL	27,534	21.820	600,791.880	
HEINEKEN NV	15,968	94.840	1,514,405.120	
AEGON LTD	77,964	5.678	442,679.590	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	52,248	28.080	1,467,123.840	
AKZO NOBEL N.V.	9,476	58.100	550,555.600	
WOLTERS KLUWER	13,747	152.700	2,099,166.900	
ING GROEP NV	182,969	15.332	2,805,280.700	
KONINKLIJKE KPN NV	221,749	3.496	775,234.500	
ASML HOLDING NV	22,151	953.000	21,109,903.000	
ABN AMRO BANK NV-CVA	25,561	15.245	389,677.440	
IMCD NV	3,159	136.550	431,361.450	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	4,239	153.600	651,110.400	
ASR NEDERLAND NV	8,762	43.550	381,585.100	
ADYEN NV	1,167	1,197.600	1,397,599.200	
PROSUS NV	78,562	33.915	2,664,430.230	
JDE PEET'S NV	6,885	19.570	134,739.450	
INPOST SA	12,100	16.660	201,586.000	
ASM INTERNATIONAL NV	2,622	675.800	1,771,947.600	
RANDSTAD NV	6,064	45.420	275,426.880	
HEINEKEN HOLDING NV	7,171	76.550	548,940.050	
OCI NV	5,520	23.230	128,229.600	
TOTALENERGIES SE	118,894	61.420	7,302,469.480	
MICHELIN (CGDE)	37,679	36.900	1,390,355.100	
AIR LIQUIDE SA	31,978	159.280	5,093,455.840	
KERING	4,098	302.500	1,239,645.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	30,127	221.200	6,664,092.400	
BOUYGUES SA	10,549	30.800	324,909.200	
BNP PARIBAS	57,265	58.410	3,344,848.650	
THALES SA	5,279	150.300	793,433.700	
DANONE	35,682	58.800	2,098,101.600	
CARREFOUR SA	31,445	14.405	452,965.220	
VIVENDI	40,308	9.500	382,926.000	
L'OREAL	13,324	440.450	5,868,555.800	

COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	25,279	72.300	1,827,671.700	
LEGRAND SA	14,680	93.460	1,371,992.800	
PERNOD RICARD SA	11,383	131.900	1,501,417.700	
EURAZEO SE	2,589	71.950	186,278.550	
REXEL SA	12,800	24.600	314,880.000	
SOCIETE GENERALE SA	40,008	22.150	886,177.200	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	15,330	711.400	10,905,762.000	
ACCOR SA	10,771	37.030	398,850.130	
CAPGEMINI SE	8,644	182.300	1,575,801.200	
PUBLICIS GROUPE	12,692	97.760	1,240,769.920	
BUREAU VERITAS SA	17,179	26.660	457,992.140	
EIFFAGE	4,126	84.960	350,544.960	
SODEXO SA	4,756	84.000	399,504.000	
IPSEN	2,131	120.500	256,785.500	
AMUNDI SA	3,414	60.250	205,693.500	
TELEPERFORMANCE	3,077	93.300	287,084.100	
EURONEXT NV	4,471	89.300	399,260.300	
EUROFINS SCIENTIFIC	7,253	52.120	378,026.360	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,570	178.750	280,637.500	
SEB SA	1,302	102.800	133,845.600	
ESSILORLUXOTTICA	16,344	201.000	3,285,144.000	
DASSAULT AVIATION SA	1,089	174.200	189,703.800	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,498	31.000	170,438.000	
AXA SA	100,643	29.430	2,961,923.490	
EDENRED	13,805	40.540	559,654.700	
RENAULT SA	10,620	48.140	511,246.800	
HERMES INTERNATIONAL	1,801	2,112.000	3,803,712.000	
STMICROELECTRONICS NV	37,507	39.405	1,477,963.330	
REMY COINTREAU	1,209	80.100	96,840.900	
DASSAULT SYSTEMES SE	37,089	35.710	1,324,448.190	
ORANGE	103,206	9.292	958,990.150	
ALSTOM	16,033	15.505	248,591.660	
SANOFI	63,036	86.430	5,448,201.480	
VINCI SA	27,790	98.140	2,727,310.600	
AIRBUS SE	32,940	143.820	4,737,430.800	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	38,213	27.920	1,066,906.960	
CREDIT AGRICOLE SA	58,685	13.035	764,958.970	
BIOMERIEUX	2,352	90.800	213,561.600	
ENGIE	101,195	13.270	1,342,857.650	

SAFRAN SA	18,958	196.650	3,728,090.700	
ARKEMA	3,234	83.700	270,685.800	
ADP	1,912	112.800	215,673.600	
GETLINK SE	18,646	15.535	289,665.610	
BOLLORE	38,368	5.740	220,232.320	
UCB SA	6,990	137.850	963,571.500	
KBC GROUP NV	13,847	64.160	888,423.520	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,884	66.750	326,007.000	
UMICORE	11,664	13.630	158,980.320	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	49,950	55.460	2,770,227.000	
AGEAS	8,892	42.200	375,242.400	
D'IETEREN GROUP	1,222	190.000	232,180.000	
ELIA GROUP SA/NV	1,662	90.300	150,078.600	
SOFINA	831	215.400	178,997.400	
ARGENX SE	3,279	360.900	1,183,391.100	
PRYSMIAN SPA	14,609	56.640	827,453.760	
ASSICURAZIONI GENERALI	56,535	22.590	1,277,125.650	
MEDIOBANCA SPA	28,218	13.525	381,648.450	
TENARIS SA	26,153	14.315	374,380.190	
UNICREDIT SPA	83,772	32.535	2,725,522.020	
TELECOM ITALIA SPA	556,274	0.223	124,494.120	
INTESA SANPAOLO	810,587	3.330	2,699,254.710	
POSTE ITALIANE SPA	24,593	12.175	299,419.770	
MONCLER SPA	12,262	58.640	719,043.680	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	5,629	48.100	270,754.900	
ENI SPA	117,844	13.508	1,591,836.750	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	34,206	9.620	329,061.720	
BANCO BPM SPA	71,900	5.880	422,772.000	
DIASORIN SPA	1,144	97.980	112,089.120	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	17,591	9.780	172,039.980	
NEXI SPA	32,804	5.658	185,605.030	
AMPLIFON SPA	6,724	34.640	232,919.360	
LEONARDO SPA	22,428	21.180	475,025.040	
ENEL SPA	450,723	6.337	2,856,231.650	
SNAM SPA	111,765	4.284	478,801.260	
TERNA SPA	77,941	7.492	583,933.970	
FINECOBANK SPA	33,884	13.985	473,867.740	
STELLANTIS NV	122,796	18.820	2,311,020.720	
FERRARI NV	6,970	379.700	2,646,509.000	

TELEFONICA SA	262,515	4.110	1,078,936.650	
ENDESA SA	17,655	18.620	328,736.100	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	323,534	9.020	2,918,276.680	
IBERDROLA SA	329,598	12.125	3,996,375.750	
BANCO DE SABADELL SA	329,300	1.742	573,640.600	
REPSOL SA	67,472	14.305	965,186.960	
GRIFOLS SA	15,613	9.188	143,452.240	
BANCO SANTANDER SA	875,213	4.378	3,832,120.120	
AMADEUS IT GROUP SA	24,995	64.200	1,604,679.000	
CAIXABANK SA	207,840	4.875	1,013,220.000	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11,352	39.220	445,225.440	
AENA SME SA	4,128	184.600	762,028.800	
CELLNEX TELECOM SA	27,557	32.390	892,571.230	
ACCIONA SA	1,333	115.600	154,094.800	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	60,486	45.960	2,779,936.560	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	22,557	17.060	384,822.420	
UPM-KYMMENE OYJ	29,566	32.690	966,512.540	
NOKIA OYJ	295,558	3.387	1,001,054.940	
WARTSILA OYJ ABP	28,085	18.965	532,632.020	
STORA ENSO OYJ-R SHS	32,332	12.385	400,431.820	
ELISA OYJ	7,914	42.620	337,294.680	
SAMPO OYJ-A SHS	25,046	39.290	984,057.340	
FORTUM OYJ	24,889	14.200	353,423.800	
KESKO OYJ-B SHS	15,138	16.445	248,944.410	
KONE OYJ-B	18,855	47.240	890,710.200	
NESTE OYJ	23,470	17.790	417,531.300	
ORION OYJ-CLASS B	6,025	37.580	226,419.500	
METSO CORPORATION	35,673	10.400	370,999.200	
NORDEA BANK ABP	174,733	11.300	1,974,482.900	
VERBUND AG	3,805	73.550	279,857.750	
OMV AG	7,924	39.060	309,511.440	
ERSTE GROUP BANK AG	18,467	42.020	775,983.340	
VOESTALPINE AG	6,073	24.620	149,517.260	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	14,509	42.140	611,409.260	
AIB GROUP PLC	94,963	4.786	454,492.910	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	56,730	9.720	551,415.600	
KINGSPAN GROUP PLC	8,673	81.050	702,946.650	
JERONIMO MARTINS	15,764	19.620	309,289.680	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	173,888	3.671	638,342.840	

	GALP ENERGIA SGPS SA	25,805	18.725	483,198.620	
	EDP RENOVAVEIS SA	17,370	13.760	239,011.200	
	KERRY GROUP PLC-A	8,694	75.300	654,658.200	
ユーロ 小計				280,622,467.880 (47,324,172,983)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	84,000	42.600	3,578,400.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	133,000	39.050	5,193,650.000	
	MTR CORP	94,500	24.900	2,353,050.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	88,000	71.600	6,300,800.000	
	SINO LAND CO	236,000	8.220	1,939,920.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	162,669	36.850	5,994,352.650	
	WHARF HOLDINGS LTD	65,000	23.150	1,504,750.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	26,000	70.100	1,822,600.000	
	CLP HOLDINGS LTD	99,500	65.400	6,507,300.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	88,507	21.450	1,898,475.150	
	HONG KONG & CHINA GAS	678,475	5.930	4,023,356.750	
	HANG SENG BANK LTD	46,300	107.200	4,963,360.000	
	WH GROUP LTD	505,000	5.170	2,610,850.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	73,000	257.600	18,804,800.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	71,000	13.180	935,780.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	117,669	29.400	3,459,468.600	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	38,500	43.650	1,680,525.000	
	AIA GROUP LTD	680,200	55.500	37,751,100.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	82,000	20.700	1,697,400.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	102,000	21.550	2,198,100.000	
	SANDS CHINA LTD	147,200	17.800	2,620,160.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	83,500	95.600	7,982,600.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	224,000	24.400	5,465,600.000	
香港・ドル 小計				131,286,398.150 (2,646,733,787)	
合計				545,633,714,414 [545,633,714,414]	

(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	8,137	1,642,778.930	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	18,707	2,784,162.810	
		BOSTON PROPERTIES INC	8,600	530,104.000	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	6,200	1,214,952.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	20,100	1,340,871.000	

	EQUINIX INC	5,508	4,220,560.080	
	AMERICAN TOWER CORP	26,700	5,260,701.000	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	40,243	717,130.260	
	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	18,900	669,816.000	
	KIMCO REALTY CORP	38,600	723,750.000	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	15,600	677,196.000	
	INVITATION HOMES INC	35,000	1,242,500.000	
	VICI PROPERTIES INC	59,700	1,688,913.000	
	VENTAS INC	23,000	1,152,300.000	
	WEYERHAEUSER CO	41,714	1,209,706.000	
	CROWN CASTLE INTL CORP	24,900	2,467,590.000	
	IRON MOUNTAIN INC	16,800	1,478,736.000	
	SUN COMMUNITIES INC	7,200	839,808.000	
	PROLOGIS INC	52,954	5,946,204.660	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,200	1,070,144.000	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	6,200	669,848.000	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,700	1,030,450.000	
	WELLTOWER INC	32,600	3,391,704.000	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	40,600	797,790.000	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,700	933,444.000	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	10,200	639,744.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	28,600	578,292.000	
	REALTY INCOME CORP	49,395	2,636,211.150	
	PUBLIC STORAGE	9,100	2,577,575.000	
	REGENCY CENTERS CORP	10,100	623,877.000	
	UDR INC	17,900	721,012.000	
	WP CAREY INC	12,500	701,125.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	17,900	2,683,568.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	12,100	1,894,497.000	
アメリカ・ドル 小計			56,757,060.890 (8,940,939,802)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	39,560	246,063.200	
	SEGRO PLC	71,041	645,762.690	
イギリス・ポンド 小計			891,825.890 (178,249,241)	

	オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	55,930	362,985.700	
		TRANSURBAN GROUP	164,915	2,061,437.500	
		APA GROUP	68,713	573,753.550	
		SCENTRE GROUP	276,990	864,208.800	
		GPT GROUP	99,602	405,380.140	
		MIRVAC GROUP	211,167	398,049.790	
		STOCKLAND	127,778	567,334.320	
		GOODMAN GROUP	91,172	3,261,222.440	
		VICINITY CENTRES	201,203	374,237.580	
	オーストラリア・ドル 小計			8,868,609.820 (923,843,085)	
	カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4,300	187,867.000	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,900	131,930.000	
	カナダ・ドル 小計			319,797.000 (36,677,518)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	226,100	581,077.000	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	325,970	632,381.800	
	シンガポール・ドル 小計			1,213,458.800 (141,331,546)	
	ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,557	475,382.500	
		GECINA SA	2,408	220,452.400	
		KLEPIERRE	11,572	295,548.880	
		COVIVIO	2,737	122,562.860	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	9,789	247,661.700	
	ユーロ 小計			1,361,608.340 (229,621,631)	
	香港・ドル	LINK REIT	154,600	5,039,960.000	
		HKT TRUST AND HKT LTD-SS	230,000	2,007,900.000	
	香港・ドル 小計			7,047,860.000 (142,084,858)	
投資証券 合計				10,592,747,681 [10,592,747,681]	
合計				10,592,747,681 [10,592,747,681]	

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 580銘柄 投資証券 34銘柄	97.9%	2.1%	77.2%
イギリス・ポンド	株式 77銘柄 投資証券 2銘柄	99.2%	0.8%	3.9%
イスラエル・シュケル	株式 8銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 49銘柄 投資証券 9銘柄	91%	9.0%	1.8%
カナダ・ドル	投資証券 2銘柄 株式 85銘柄	99.8%	0.2%	2.9%
シンガポール・ドル	投資証券 2銘柄 株式 12銘柄	92.1%	7.9%	0.3%
スイス・フラン	株式 45銘柄	100%	-%	2.5%
スウェーデン・クローナ	株式 43銘柄	100%	-%	0.9%
デンマーク・クローネ	株式 15銘柄	100%	-%	1.1%
ニュージーランド・ドル	株式 5銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式 11銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式 219銘柄 投資証券 5銘柄	99.5%	0.5%	8.5%
香港・ドル	投資証券 2銘柄 株式 23銘柄	94.9%	5.1%	0.5%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2023年6月16日から2024年6月17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】

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	47,382,942	64,541,484
親投資信託受益証券	3,926,223,778	6,371,161,073
未収入金	1,370,000	2,610,000
流動資産合計	3,974,976,720	6,438,312,557
資産合計	3,974,976,720	6,438,312,557
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,117,485	2,892,089
未払受託者報酬	339,448	626,456
未払委託者報酬	6,705,008	12,373,460
その他未払費用	84,782	156,530
流動負債合計	17,246,723	16,048,535
負債合計	17,246,723	16,048,535
純資産の部		
元本等		
元本	※1 1,603,693,505	※1 1,953,160,126
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,354,036,492	4,469,103,896
（分配準備積立金）	1,152,173,257	2,281,542,828
元本等合計	3,957,729,997	6,422,264,022
純資産合計	3,957,729,997	6,422,264,022
負債純資産合計	3,974,976,720	6,438,312,557

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期 自　2022年6月16日 至　2023年6月15日	第8期 自　2023年6月16日 至　2024年6月17日
営業収益		
受取利息	11	12,465
有価証券売買等損益	606,733,900	1,543,298,456
営業収益合計	606,733,911	1,543,310,921
営業費用		
支払利息	10,862	9,679
受託者報酬	641,859	1,116,041
委託者報酬	12,678,630	22,043,505
その他費用	160,302	278,833
営業費用合計	13,491,653	23,448,058
営業利益又は営業損失（△）	593,242,258	1,519,862,863
経常利益又は経常損失（△）	593,242,258	1,519,862,863
当期純利益又は当期純損失（△）	593,242,258	1,519,862,863
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	26,920,024	134,581,339
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,335,340,057	2,354,036,492
剰余金増加額又は欠損金減少額	674,334,764	1,410,257,530
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	674,334,764	1,410,257,530
剰余金減少額又は欠損金増加額	221,960,563	680,471,650
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	221,960,563	680,471,650
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,354,036,492	4,469,103,896

(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8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日
1．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2024年6月15日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2024年6月17日としております。このため、当計算期間は368日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	第7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
1．　※1 期首元本額	1,270,536,081円	1,603,693,505円
期中追加設定元本額	541,659,096円	802,382,236円
期中一部解約元本額	208,501,672円	452,915,615円
2．　計算期間末日における受益権の総数	1,603,693,505口	1,953,160,126口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第7期 自2022年6月16日 至2023年6月15日	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日

※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（566,328,000円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,201,873,445円）及び分配準備積立金（585,845,257円）より分配対象額は2,354,046,702円（1万口当たり14,678.91円）であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（4,146円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（1,385,269,436円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,187,561,068円）及び分配準備積立金（896,269,246円）より分配対象額は4,469,103,896円（1万口当たり22,881.40円）であり、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	第8期 2024年6月17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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17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	589,998,868	1,424,237,204
合計	589,998,868	1,424,237,204

(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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17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8期 自2023年6月16日 至2024年6月17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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.4679円 (24,679円)	3.2881円 (32,881円)

(4)【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	464,270,984	1,260,635,002	
	外国株式インデックスマザーファンド	769,541,646	5,110,526,071	
親投資信託受益証券 合計			6,371,161,073	
合計			6,371,161,073	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年6月15日現在 金 額（円）	2024年6月17日現在 金 額（円）

資産の部		
流動資産		
預金	1,008,609,100	998,941,026
コール・ローン	377,422,129	631,071,582
株式	24,236,667,098	30,588,982,178
投資証券	2,634,119,995	3,315,393,633
派生商品評価勘定	15,997,440	30,805,727
未収入金	627,921	744,192
未収配当金	205,170,522	252,254,458
差入委託証拠金	431,954,643	642,820,077
流動資産合計	28,910,568,848	36,461,012,873
資産合計	28,910,568,848	36,461,012,873
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	867
未払解約金	30,021,600	4,404,700
流動負債合計	30,021,600	4,405,567
負債合計	30,021,600	4,405,567
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	13,177,740,509	13,426,251,057
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	15,702,806,739	23,030,356,249
元本等合計	28,880,547,248	36,456,607,306
純資産合計	28,880,547,248	36,456,607,306
負債純資産合計	28,910,568,848	36,461,012,873

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2023年6月16日 至2024年6月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	2023年6月15日現在	2024年6月17日現在
1. ※1 期首	2022年6月16日	2023年6月16日
期首元本額	10,444,109,018円	13,177,740,509円
期中追加設定元本額	3,233,436,869円	2,520,427,957円
期中一部解約元本額	499,805,378円	2,271,917,409円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
新興国株式インデックスファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	83,378,541円	107,596,249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）	365,321,398円	464,270,984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）	338,256,197円	341,221,546円
Ｄ－Ｉ's 新興国株式インデックス	130,542,447円	119,821,542円
ｉＦｒｅｅ 新興国株式インデックス	5,333,834,168円	6,790,934,858円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	3,255,515,135円	3,523,421,415円
ダイワ新興国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	6,173,106円	8,941,641円

新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド（為替ヘッジなし／適格機関投資家専用）	1,730,598,349円	656,216円
ＤＣダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド	1,466,253,967円	1,650,579,883円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式	356,091,790円	312,454,350円
ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド	111,775,411円	106,352,373円
計	13,177,740,509円	13,426,251,057円
2. 期末日における受益権の総数	13,177,740,509口	13,426,251,057口

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年6月16日 至2024年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年6月17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	2023年6月15日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2024年6月17日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	1,097,334,213	2,547,934,570
投資証券	163,000,679	153,746,579
合計	1,260,334,892	2,701,681,149

（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	2023年6月15日現在				2024年6月17日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								

株価指数先物取引								
買建	1,535,150,611	-	1,551,148,051	15,997,440	1,909,596,775	-	1,939,538,502	29,941,727
合計	1,535,150,611	-	1,551,148,051	15,997,440	1,909,596,775	-	1,939,538,502	29,941,727

（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6月15日現在				2024年6月17日現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	-	-	-	-	479,067	-	479,751	△684
サウジアラビア･リアル	-	-	-	-	479,067	-	479,751	△684
買建	-	-	-	-	200,692,827	-	201,556,644	863,817
アメリカ･ドル	-	-	-	-	200,692,827	-	201,556,644	863,817
合計	-	-	-	-	201,171,894	-	202,036,395	863,133

（注）　1．時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2023年6月15日現在	2024年6月17日現在
1口当たり純資産額	2.1916円	2.7153円
（1万口当たり純資産額）	(21,916円)	(27,153円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF	29,000	0.000	0.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	21,300	15.060	320,778.000	
	CANADIAN SOLAR INC	7,400	17.040	126,096.000	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	12,900	14.800	190,920.000	
	PINDUODUO INC-ADR	2,500	148.980	372,450.000	
	KE HOLDINGS INC-ADR	16,600	15.710	260,786.000	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	63,875	2.200	140,525.000	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	9,100	18.920	172,172.000	
	SBERBANK ROSSII	698,708	0.000	0.000	
	JINKOSOLAR HOLDING ADR REP LTD	7,600	23.610	179,436.000	
	BANK VTB	382,434,000	0.000	0.000	

	NK LUKOIL	23,088	0.000	0.000	
	MOBILNYE TELESISTEMY	70,700	0.000	0.000	
	NK ROSNEFT	97,499	0.000	0.000	
	MAGNIT	4,678	0.000	0.000	
	SURGUTNEFTEGAZ	360,750	0.000	0.000	
	TATNEFT	57,648	0.000	0.000	
	GAZPROM	853,478	0.000	0.000	
	GMK NORILSKIY NIKEL	182,900	0.000	0.000	
	NOVATEK	26,980	0.000	0.000	
	360 DIGITECH ADR INC	10,200	20.100	205,020.000	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	7,290	0.000	0.000	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	3	0.000	0.000	
	SEVERSTAL - GDR REG S	13,460	0.000	0.000	
	TATNEFT PJSC - PREF	21,009	0.000	0.000	
	SISTEMA PJSFC	319,200	0.000	0.000	
	INTER RAO UES PJSC	2,726,100	0.000	0.000	
	ALROSA PJSC	180,310	0.000	0.000	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	56,619	0.000	0.000	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	68,700	1.895	130,186.500	
	AEROFLOT PJSC	164,910	0.000	0.000	
アメリカ・ドル 小計				2,098,369.500 (330,556,148)	
インド・ルピー	BHARTI AIRTEL PARTLY PAID LTD	3,860	1,048.700	4,047,982.000	
	JIO FINANCIAL SERVICES LTD	63,151	357.000	22,544,907.000	
	TATA STEEL LTD	538,542	183.150	98,633,967.300	
	AXIS BANK LTD	51,959	1,181.050	61,366,176.950	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,011	12,845.200	25,831,697.200	
	TATA POWER CO LTD	31,825	448.650	14,278,286.250	
	BANK OF BARODA	47,622	286.250	13,631,797.500	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	11,673	2,479.750	28,946,121.750	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	66,516	536.300	35,672,530.800	
	STATE BANK OF INDIA	64,087	839.200	53,781,810.400	
	NTPC LTD	179,999	368.450	66,320,631.550	
	POWER FINANCE CORPORATION	70,773	510.050	36,097,768.650	
	JSW STEEL LTD	28,079	921.150	25,864,970.850	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	139,511	321.500	44,852,786.500	
	INDIAN OIL CORP LTD	329,171	170.360	56,077,571.560	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	86,344	626.650	54,107,467.600	
	PUNJAB NATIONAL BANK	93,272	128.940	12,026,491.680	

	STEEL AUTHORITY OF INDIA	123,461	153.630	18,967,313.430	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	14,180	1,052.450	14,923,741.000	
	CANARA BANK	92,990	120.810	11,234,121.900	
	UNION BANK OF INDIA	71,477	147.550	10,546,431.350	
	ULTRATECH CEMENT LTD	1,601	11,242.800	17,999,722.800	
	PETRONET LNG LTD	42,578	323.900	13,791,014.200	
	SHRIRAM FINANCE LTD	7,246	2,732.150	19,797,158.900	
	TECH MAHINDRA LTD	18,654	1,371.450	25,583,028.300	
	YES BANK LTD	528,287	23.810	12,578,513.470	
	TATA MOTORS LTD-A-DVR	12,210	668.350	8,160,553.500	
	REC LTD	44,116	532.650	23,498,387.400	
	COAL INDIA LTD	91,501	486.950	44,556,411.950	
	BAJAJ FINANCE LTD	2,352	7,341.550	17,267,325.600	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE L	68,058	172.360	11,730,476.880	
	GAIL INDIA LTD	133,139	221.830	29,534,224.370	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	91,796	683.600	62,751,745.600	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	13,748	2,471.200	33,974,057.600	
	WIPRO LTD	25,324	477.500	12,092,210.000	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	18,098	3,832.050	69,352,440.900	
	INFOSYS LTD	63,137	1,488.900	94,004,679.300	
	LARSEN & TOUBRO LTD	12,898	3,687.800	47,565,244.400	
	TATA MOTORS LTD	50,250	993.400	49,918,350.000	
	DR. REDDY'S LABORATORIES	1,724	6,085.250	10,490,971.000	
	HDFC BANK LIMITED	86,136	1,596.900	137,550,578.400	
	ICICI BANK LTD	25,326	1,105.650	28,001,691.900	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	64,232	2,955.100	189,811,983.200	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	307,605	275.400	84,714,417.000	
	ITC LTD	68,764	431.150	29,647,598.600	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	21,603	2,928.600	63,266,545.800	
	HERO MOTOCORP LTD	3,243	5,804.200	18,823,020.600	
	BHARTI AIRTEL LTD	31,737	1,427.400	45,301,393.800	
	UPL LTD	36,465	551.700	20,117,740.500	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	10,776	1,516.000	16,336,416.000	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	23,212	1,431.050	33,217,532.600	
	VEDANTA LTD	176,303	447.600	78,913,222.800	
インド・ルピー 小計				2,060,103,230.590 (3,914,196,139)	
インドネシア・ルピア	GOTO GOJEK TOKOPEDIA	25,467,000	52.000	1,324,284,000.000	

	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	821,800	4,420.000	3,632,356,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,330,400	2,720.000	3,618,688,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	608,500	4,310.000	2,622,635,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	848,700	9,200.000	7,808,040,000.000	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	1,211,100	5,750.000	6,963,825,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,832,600	4,180.000	7,660,268,000.000	
インドネシア・ルピア 小計				33,630,096,000.000 (322,848,922)	
オフショア・人民元	CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	281,200	2.120	596,144.000	
	INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	195,200	17.460	3,408,192.000	
	BANK OF BEIJING CO LTD -A	216,300	5.640	1,219,932.000	
	PING AN INSURANCE GROUP CO-A	97,400	41.870	4,078,138.000	
	IND & COMM BK OF CHINA-A	634,700	5.500	3,490,850.000	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	23,800	18.480	439,824.000	
	KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	1,100	1,555.000	1,710,500.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	39,200	23.820	933,744.000	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	117,100	10.000	1,171,000.000	
	SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	398,300	8.140	3,242,162.000	
	CITIC SECURITIES CO-A	35,000	18.630	652,050.000	
	CHINA MERCHANTS BANK-A	119,100	33.810	4,026,771.000	
	PING AN BANK CO LTD-A	184,100	10.180	1,874,138.000	
	CHINA STATE CONSTRUCTION -A	717,300	5.560	3,988,188.000	
	HAIER SMART HOME CO LTD-A	22,200	30.650	680,430.000	
	SAIC MOTOR CORP LTD-A	94,200	14.300	1,347,060.000	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	35,600	27.380	974,728.000	
	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	43,900	4.930	216,427.000	
	POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	200,400	5.150	1,032,060.000	
	CHINA COAL ENERGY CO-A	23,600	12.980	306,328.000	
	COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	128,860	15.210	1,959,960.600	
	METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	201,300	3.100	624,030.000	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	62,200	7.730	480,806.000	
	JIANGXI COPPER CO LTD-A	23,000	24.350	560,050.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP LTD A	7,500	23.820	178,650.000	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-A	46,600	7.130	332,258.000	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	731,900	4.250	3,110,575.000	
	BANK OF CHINA LTD-A	313,400	4.480	1,404,032.000	
	PETROCHINA CO LTD-A	164,200	9.830	1,614,086.000	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	371,100	6.150	2,282,265.000	

	CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	46,800	27.900	1,305,720.000	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	398,800	6.800	2,711,840.000	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	31,100	44.350	1,379,285.000	
	CHINA VANKE CO LTD -A	171,500	7.940	1,361,710.000	
	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	43,400	28.630	1,242,542.000	
	CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	93,200	6.480	603,936.000	
	CHINA MINSHENG BANKING-A	581,200	3.770	2,191,124.000	
	PICC HOLDING CO-A	67,700	5.180	350,686.000	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	545,500	3.140	1,712,870.000	
	CRRC CORP LTD-A	128,300	6.910	886,553.000	
	CHINA UNITED NETWORK-A	260,900	4.510	1,176,659.000	
	CGN POWER CO LTD-A	18,900	4.370	82,593.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD-A	30,500	13.170	401,685.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD-A	62,800	8.870	557,036.000	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	291,300	6.450	1,878,885.000	
	BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	155,300	7.470	1,160,091.000	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	168,200	6.800	1,143,760.000	
	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	18,600	31.680	589,248.000	
	HUAXIA BANK CO LTD-A	215,000	6.640	1,427,600.000	
	BYD CO LTD -A	2,000	253.050	506,100.000	
	WEICHAI POWER CO LTD-A	33,500	15.960	534,660.000	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	54,700	17.090	934,823.000	
	HUANENG POWER INTL INC-A	38,900	9.250	359,825.000	
	POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	180,200	4.750	855,950.000	
オフショア・人民元 小計				73,290,559.600 (1,587,326,940)	
サウジアラビア・リアル	SAUDI ARABIAN MINING	19,964	44.400	886,401.600	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS	7,367	110.000	810,370.000	
	SAUDI AWWAL BANK	15,850	37.850	599,922.500	
	ARAB NATIONAL BANK	30,158	19.920	600,747.360	
	BANQUE SAUDI FRANSI	12,001	34.850	418,234.850	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL	20,617	29.200	602,016.400	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	18,697	73.500	1,374,229.500	
	SAUDI TELECOM CO	55,672	36.600	2,037,595.200	
	AL RAJHI BANK	33,004	79.000	2,607,316.000	
	RIYAD BANK	33,095	24.660	816,122.700	
	ETIHAD ETISALAT CO	11,098	49.200	546,021.600	

	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	14,300	36.350	519,805.000	
	ALINMA BANK	21,816	31.300	682,840.800	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	83,905	35.150	2,949,260.750	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	93,289	27.700	2,584,105.300	
サウジアラビア・リアル 小計				18,034,989.560 (758,912,361)	
タイ・バーツ	SCB X PUBLIC COMPANY LIMITED NON-V	162,000	106.000	17,172,000.000	
	TRUE CORPORATION NON-VOTING DR PCL	776,900	8.650	6,720,185.000	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	53,500	225.000	12,037,500.000	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	38,500	130.000	5,005,000.000	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	152,200	130.000	19,786,000.000	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	2,696,700	1.680	4,530,456.000	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	269,100	19.800	5,328,180.000	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	46,500	211.000	9,811,500.000	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	671,600	17.700	11,887,320.000	
	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	1,516,500	4.860	7,370,190.000	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	236,500	27.250	6,444,625.000	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	86,700	150.500	13,048,350.000	
	BANGCHAK CORP PCL-NVDR	126,300	35.500	4,483,650.000	
	PTT PCL-NVDR	1,367,100	31.750	43,405,425.000	
	THAI OIL PCL-NVDR	128,100	50.750	6,501,075.000	
	CP ALL PCL-NVDR	272,100	56.000	15,237,600.000	
	BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	71,100	135.000	9,598,500.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	409,700	22.000	9,013,400.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	291,000	30.500	8,875,500.000	
タイ・バーツ 小計				216,256,456.000 (927,740,196)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	3,359,721	43.410	145,845,488.610	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	7,571	39,787.000	301,227,377.000	
	BANCO DE CHILE	1,394,988	106.990	149,249,766.120	
チリ・ペソ 小計				596,322,631.730 (100,455,914)	
トルコ・リラ	AKBANK T.A.S.	284,764	61.100	17,399,080.400	
	TURKIYE IS BANKASI-C	665,430	16.180	10,766,657.400	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	84,788	98.600	8,360,096.800	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	52,258	167.000	8,727,086.000	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	261,715	51.600	13,504,494.000	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	163,402	93.850	15,335,277.700	

	YAPI VE KREDI BANKASI	340,490	32.580	11,093,164.200	
	KOC HOLDING AS	77,255	217.500	16,802,962.500	
	TURK HAVA YOLLARI AO	41,697	311.750	12,999,039.750	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	76,021	48.360	3,676,375.560	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	18,614	553.000	10,293,542.000	
トルコ・リラ 小計				128,957,776.310 (623,614,014)	
ブラジル・レアル	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	64,800	8.330	539,784.000	
	ENERGISA SA-UNITS	12,400	45.370	562,588.000	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	23,900	31.900	762,410.000	
	VIBRA ENERGIA SA	136,200	20.720	2,822,064.000	
	NATURA &CO HOLDING SA	54,700	14.800	809,560.000	
	TIM SA	40,926	15.870	649,495.620	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	79,900	11.660	931,634.000	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	253,200	3.750	949,500.000	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	663,600	34.680	23,013,648.000	
	USINAS SIDER MINAS GER-PF A	51,600	7.180	370,488.000	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	502,159	12.830	6,442,699.970	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	258,836	31.140	8,060,153.040	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	59,900	12.030	720,597.000	
	VALE SA	387,790	60.620	23,507,829.800	
	GERDAU SA-PREF	158,092	17.000	2,687,564.000	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	440,900	36.630	16,150,167.000	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	126,974	10.010	1,271,009.740	
	ITAUSA SA	138,409	9.570	1,324,574.130	
	BRASKEM SA-PREF A	48,400	18.410	891,044.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	13,700	39.800	545,260.000	
	BANCO DO BRASIL S.A.	146,800	26.450	3,882,860.000	
	COSAN SA	51,600	12.670	653,772.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	68,600	35.690	2,448,334.000	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	90,500	9.350	846,175.000	
	EMBRAER SA	28,700	37.330	1,071,371.000	
	METALURGICA GERDAU SA-PREF	136,300	9.990	1,361,637.000	
	CCR SA	66,900	11.590	775,371.000	
	BRF SA	70,500	18.630	1,313,415.000	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	11,700	75.000	877,500.000	
	LOJAS RENNER S.A.	52,575	12.790	672,434.250	
	JBS SA	126,000	28.610	3,604,860.000	

	USINAS SIDERURGICAS DE MINAS	17,800	6.710	119,438.000	
	SUZANO SA	33,545	48.970	1,642,698.650	
	LOCALIZA RENT A CAR	17,000	40.420	687,140.000	
	MARFRIG GLOBAL FOODS SA	104,600	10.520	1,100,392.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	159,800	10.370	1,657,126.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	36,900	29.780	1,098,882.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GER	5,109	12.350	63,096.150	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	39,400	27.080	1,066,952.000	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	28,000	44.900	1,257,200.000	
	KLABIN SA - UNIT	44,990	20.360	915,996.400	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	67,300	21.750	1,463,775.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	33,300	27.140	903,762.000	
	BANCO BRADESCO S.A.	147,621	11.380	1,679,926.980	
	AMBEV SA	193,300	11.240	2,172,692.000	
ブラジル・レアル 小計				126,348,876.730 (3,699,735,173)	
マレーシア・リンギット	MALAYAN BANKING BHD	133,800	9.940	1,329,972.000	
	PUBLIC BANK BERHAD	230,800	4.080	941,664.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	720,900	1.170	843,453.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	262,400	6.920	1,815,808.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	58,700	14.080	826,496.000	
マレーシア・リンギット 小計				5,757,393.000 (192,023,450)	
メキシコ・ペソ	AMERICA MOVIL L	1,248,900	15.660	19,557,774.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	16,515	156.680	2,587,570.200	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	281,600	9.800	2,759,680.000	
	CEMEX SAB-CPO	845,619	11.890	10,054,409.910	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	57,600	196.050	11,292,480.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	13,400	178.520	2,392,168.000	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	33,500	67.020	2,245,170.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	94,000	93.190	8,759,860.000	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	146,700	60.600	8,890,020.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	91,300	137.430	12,547,359.000	
メキシコ・ペソ 小計				81,086,491.110 (690,119,017)	
香港・ドル	TRIP.COM GROUP LTD	11,600	396.000	4,593,600.000	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	12,150	269.400	3,273,210.000	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	838,000	4.160	3,486,080.000	
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	428,000	8.890	3,804,920.000	

CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	381,000	3.680	1,402,080.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	40,500	30.500	1,235,250.000	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	202,000	15.640	3,159,280.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	3,843,800	4.700	18,065,860.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	127,600	379.800	48,462,480.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	166,000	23.550	3,909,300.000	
PETROCHINA CO LTD-H	1,846,000	7.610	14,048,060.000	
HUANENG POWER INTL INC-H	386,000	5.600	2,161,600.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	177,500	17.620	3,127,550.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	6,597,000	5.500	36,283,500.000	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	1,251,000	4.710	5,892,210.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	83,400	8.980	748,932.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,053,000	4.310	4,538,430.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	190,500	39.600	7,543,800.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	343,120	6.820	2,340,078.400	
SINOPHARM GROUP CO-H	77,600	22.050	1,711,080.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	152,500	27.000	4,117,500.000	
YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LTD	175,000	18.120	3,171,000.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	504,500	2.760	1,392,420.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	60,400	29.250	1,766,700.000	
BYD CO LTD-H	17,500	229.400	4,014,500.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,312,000	3.210	10,631,520.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	82,800	15.860	1,313,208.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	832,000	2.670	2,221,440.000	
CITIC LTD	168,000	7.540	1,266,720.000	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	322,500	11.900	3,837,750.000	
IND & COMM BK OF CHINA-H	9,009,000	4.340	39,099,060.000	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	91,500	11.740	1,074,210.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	245,000	5.180	1,269,100.000	
CHINA TOWER CORP LTD-H	1,806,000	1.030	1,860,180.000	
XIAOMI CORP-CLASS B	607,800	17.300	10,514,940.000	
MEITUAN-CLASS B	90,490	114.700	10,379,203.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	800,500	72.800	58,276,400.000	
CHINA ENERGY ENGINEERING C-H	708,000	0.860	608,880.000	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	202,000	4.660	941,320.000	
JD.COM INC - CL A	181,395	113.900	20,660,890.500	
NETEASE INC	32,100	144.100	4,625,610.000	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	19,500	59.700	1,164,150.000	

	METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	616,000	1.680	1,034,880.000	
	HAIER SMART HOME CO LTD-H	100,600	28.750	2,892,250.000	
	KUAISHOU TECHNOLOGY	39,200	50.950	1,997,240.000	
	BAIDU INC-CLASS A	105,350	91.600	9,650,060.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	259,000	14.460	3,745,140.000	
	CRRC CORP LTD - H	305,000	4.730	1,442,650.000	
	CGN POWER CO LTD-H	540,000	3.290	1,776,600.000	
	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	809,500	36.450	29,506,275.000	
	CHINA COAL ENERGY CO-H	144,000	9.800	1,411,200.000	
	COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	465,550	13.520	6,294,236.000	
	CHINA MINSHENG BANKING COR-H	1,431,080	2.940	4,207,375.200	
	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	2,784,000	0.485	1,350,240.000	
	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	25,400	81.050	2,058,670.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	606,200	5.300	3,212,860.000	
	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	23,500	83.950	1,972,825.000	
	CHINA MENGNIU DAIRY CO	169,000	12.760	2,156,440.000	
	PICC PROPERTY & CASUALTY-H	432,000	9.720	4,199,040.000	
	LI NING CO LTD	81,500	18.860	1,537,090.000	
	WEICHAI POWER CO LTD-H	127,000	14.300	1,816,100.000	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	506,000	3.830	1,937,980.000	
	SUNNY OPTICAL TECH	29,000	48.700	1,412,300.000	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	336,000	5.530	1,858,080.000	
	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	244,000	19.920	4,860,480.000	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	96,500	11.800	1,138,700.000	
	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	362,000	10.800	3,909,600.000	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	48,300	69.150	3,339,945.000	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	134,000	8.080	1,082,720.000	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	160,000	16.540	2,646,400.000	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	1,011,100	5.860	5,925,046.000	
	CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	385,000	3.530	1,359,050.000	
	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,457,000	1.360	1,981,520.000	
	CHINA MERCHANTS BANK-H	301,500	33.750	10,175,625.000	
	BANK OF CHINA LTD-H	7,868,000	3.740	29,426,320.000	
	CITIC SECURITIES CO LTD-H	103,500	12.180	1,260,630.000	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	576,000	2.470	1,422,720.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	268,000	3.990	1,069,320.000	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	259,500	12.360	3,207,420.000	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	280,000	4.350	1,218,000.000	

香港・ドル 小計				515,487,029.100 (10,392,218,506)	
台湾・ドル	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTUR	196,000	26.700	5,233,200.000	
	WT MICROELECTRONICS LTD	27,000	114.500	3,091,500.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	33,000	179.500	5,923,500.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	10,000	534.000	5,340,000.000	
	SINO-AMERICAN SILICON PRODUC	27,000	210.500	5,683,500.000	
	TAIWAN CEMENT	266,247	34.000	9,052,398.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	218,000	166.000	36,188,000.000	
	WIWYNN CORP	2,000	2,765.000	5,530,000.000	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	102,112	81.700	8,342,550.400	
	FORMOSA PLASTICS CORP	97,600	61.000	5,953,600.000	
	NAN YA PLASTICS CORP	82,140	50.700	4,164,498.000	
	WALSIN LIHWA CORP	159,000	37.250	5,922,750.000	
	CHINA STEEL CORP	370,686	23.250	8,618,449.500	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	87,000	49.350	4,293,450.000	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	88,616	107.500	9,526,220.000	
	DELTA ELECTRONICS INC	64,000	353.500	22,624,000.000	
	YAGEO CORPORATION	18,734	696.000	13,038,864.000	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	167,999	24.650	4,141,175.350	
	QISDA CORP	98,000	37.850	3,709,300.000	
	ACER INC	179,000	49.800	8,914,200.000	
	INVENTEC CORP	175,000	55.400	9,695,000.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	16,000	569.000	9,104,000.000	
	QUANTA COMPUTER INC	106,000	290.500	30,793,000.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	28,000	192.500	5,390,000.000	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	75,000	66.200	4,965,000.000	
	AUO CORP	719,600	18.300	13,168,680.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	117,400	128.000	15,027,200.000	
	MEDIATEK INC	55,003	1,395.000	76,729,185.000	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	30,000	230.500	6,915,000.000	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	199,800	199.000	39,760,200.000	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	403,000	75.400	30,386,200.000	
	CHINA AIRLINES LTD	202,000	23.000	4,646,000.000	
	WAN HAI LINES LTD	126,000	92.800	11,692,800.000	
	EVA AIRWAYS CORP	143,000	36.150	5,169,450.000	
	FUBON FINANCIAL HOLDING CO	177,462	76.900	13,646,827.800	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	232,838	58.200	13,551,171.600	

	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	455,000	15.250	6,938,750.000	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	214,140	28.750	6,156,525.000	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	219,607	32.000	7,027,424.000	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	213,824	39.550	8,456,739.200	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	215,863	24.100	5,202,298.300	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	604,028	37.300	22,530,244.400	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	154,157	27.950	4,308,688.150	
	LARGAN PRECISION CO LTD	4,000	2,520.000	10,080,000.000	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	22,000	614.000	13,508,000.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	37,000	182.500	6,752,500.000	
	TRIPOD TECHNOLOGY CORP	20,000	212.500	4,250,000.000	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	43,000	107.500	4,622,500.000	
	WISTRON CORP	191,110	108.500	20,735,435.000	
	INNOLUX CORP	964,806	13.600	13,121,361.600	
	WPG HOLDINGS LTD	114,000	86.200	9,826,800.000	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	54,000	85.700	4,627,800.000	
	PEGATRON CORP	116,000	115.500	13,398,000.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	53,000	121.000	6,413,000.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	53,713	156.500	8,406,084.500	
	SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	11,000	418.500	4,603,500.000	
	RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	30,000	219.000	6,570,000.000	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	44,000	190.500	8,382,000.000	
	COMPAL ELECTRONICS	673,000	35.750	24,059,750.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	411,000	922.000	378,942,000.000	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	427,902	198.000	84,724,596.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	46,760	493.500	23,076,060.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	623,000	56.300	35,074,900.000	
台湾・ドル 小計				1,207,725,825.800 (5,877,639,276)	
南アフリカ・ランド	AngloGold Ashanti Plc	19,238	420.620	8,091,887.560	
	NEPI ROCKCASTLE NV	21,915	133.660	2,929,158.900	
	NORTHAM PLATINUM HLDGS LTD	24,587	108.000	2,655,396.000	
	GOLD FIELDS LTD	25,547	244.970	6,258,248.590	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,755	2,373.100	4,164,790.500	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	17,376	264.600	4,597,689.600	
	NEDBANK GROUP LTD	17,316	246.600	4,270,125.600	
	BIDVEST GROUP LTD	14,704	257.290	3,783,192.160	
	BID CORP LTD	11,807	404.950	4,781,244.650	

	STANDARD BANK GROUP LTD	42,151	199.360	8,403,223.360	
	SASOL LTD	54,788	115.960	6,353,216.480	
	REMGRO LTD	15,693	132.080	2,072,731.440	
	DISCOVERY LTD	19,008	125.480	2,385,123.840	
	SANLAM LTD	60,281	76.480	4,610,290.880	
	FIRSTRAND LTD	210,673	70.510	14,854,553.230	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	49,725	59.030	2,935,266.750	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	23,921	119.040	2,847,555.840	
	ABSA GROUP LTD	37,792	165.910	6,270,070.720	
	NASPERS LTD-N SHS	4,583	3,736.940	17,126,396.020	
	MTN GROUP LTD	78,402	82.250	6,448,564.500	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	84,711	84.100	7,124,195.100	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	4,857	575.570	2,795,543.490	
	SIBANYE STILLWATER LTD	538,483	20.040	10,791,199.320	
南アフリカ・ランド 小計				136,549,664.530 (1,171,596,122)	
合計				30,588,982,178 [30,588,982,178]	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	1,020,500	20,716,150.000	
	アメリカ・ドル 小計			20,716,150.000 (3,263,415,109)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	113,100	2,541,357.000	
	メキシコ・ペソ 小計			2,541,357.000 (21,629,235)	
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	301,810	3,537,213.200	
	南アフリカ・ランド 小計			3,537,213.200 (30,349,289)	
投資証券 合計				3,315,393,633 [3,315,393,633]	
合計				3,315,393,633 [3,315,393,633]	

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　31銘柄 投資証券　1銘柄	9.2%	90.8%	10.6%
インド・ルピー	株式　52銘柄	100%	-%	11.5%
インドネシア・ルピア	株式　7銘柄	100%	-%	1.0%
オフショア・人民元	株式　54銘柄	100%	-%	4.7%
サウジアラビア・リアル	株式　15銘柄	100%	-%	2.2%
タイ・バーツ	株式　19銘柄	100%	-%	2.7%
チリ・ペソ	株式　3銘柄	100%	-%	0.3%
トルコ・リラ	株式　11銘柄	100%	-%	1.8%
ブラジル・レアル	株式　45銘柄	100%	-%	10.9%
マレーシア・リンギット	株式　5銘柄	100%	-%	0.6%
メキシコ・ペソ	投資証券　1銘柄 株式　10銘柄	97%	3.0%	2.1%
香港・ドル	株式　80銘柄	100%	-%	30.8%
台湾・ドル	株式　63銘柄	100%	-%	17.3%
南アフリカ・ランド	投資証券　1銘柄 株式　23銘柄	97.5%	2.5%	3.5%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

前記「ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）」に記載のとおりであります。

【ダイワファンドラップ 日本債券インデックス】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2023年6月16日から2024年6月17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】

ダイワファンドラップ 日本債券インデックス

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	95,598,155	77,556,664
親投資信託受益証券	36,656,503,295	37,933,054,748
流動資産合計	36,752,101,450	38,010,611,412
資産合計	36,752,101,450	38,010,611,412
負債の部		
流動負債		
未払解約金	31,765,890	10,282,692
未払受託者報酬	1,950,282	2,149,631
未払委託者報酬	24,379,145	27,149,388
その他未払費用	975,081	1,034,950
流動負債合計	59,070,398	40,616,661
負債合計	59,070,398	40,616,661
純資産の部		
元本等		
元本	※1 37,987,526,906	※1 41,077,266,835
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △ 1,294,495,854	※2 △ 3,107,272,084
（分配準備積立金）	260,229,141	198,720,895
元本等合計	36,693,031,052	37,969,994,751
純資産合計	36,693,031,052	37,969,994,751
負債純資産合計	36,752,101,450	38,010,611,412

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期 自　2022年6月16日 至　2023年6月15日	第8期 自　2023年6月16日 至　2024年6月17日
営業収益		
受取利息	36	17,385
有価証券売買等損益	107,832,528	△ 1,584,599,819
営業収益合計	107,832,564	△ 1,584,582,434
営業費用		
支払利息	28,013	15,078
受託者報酬	3,964,295	4,152,067
委託者報酬	49,554,857	52,180,403
その他費用	1,982,023	2,036,103
営業費用合計	55,529,188	58,383,651
営業利益又は営業損失（△）	52,303,376	△ 1,642,966,085
経常利益又は経常損失（△）	52,303,376	△ 1,642,966,085
当期純利益又は当期純損失（△）	52,303,376	△ 1,642,966,085
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（△）	△ 29,115,437	△ 245,753,938
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 1,354,687,620	△ 1,294,495,854
剰余金増加額又は欠損金減少額	255,410,022	389,477,929
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	255,410,022	389,477,929
剰余金減少額又は欠損金増加額	276,637,069	805,042,012
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	276,637,069	805,042,012
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△ 1,294,495,854	△ 3,107,272,084

(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8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日
1．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2024年6月15日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2024年6月17日としております。このため、当計算期間は368日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	第7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
1．　※1 期首元本額	38,196,306,569円	37,987,526,906円
期中追加設定元本額	6,956,197,111円	13,620,058,958円
期中一部解約元本額	7,164,976,774円	10,530,319,029円
2．　計算期間末日における受益権の総数	37,987,526,906口	41,077,266,835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1,294,495,854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3,107,272,084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7期 自2022年6月16日 至2023年6月15日	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日

※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（755,179,928円）及び分配準備積立金（260,229,141円）より分配対象額は1,015,409,069円（1万口当たり267.30円）であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（899,273,056円）及び分配準備積立金（198,720,895円）より分配対象額は1,097,993,951円（1万口当たり267.30円）であり、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	第8期 2024年6月17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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17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	124,545,092	△1,412,868,922
合計	124,545,092	△1,412,868,922

(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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17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8期 自2023年6月16日 至2024年6月17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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9659円 (9,659円)	0.9244円 (9,244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	28,754,589,712	37,933,054,748	
親投資信託受益証券 合計			37,933,054,748	
合計			37,933,054,748	

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

	2023年6月15日現在 金 額（円）	2024年6月17日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	518,536,777	551,265,147

国債証券	98,258,745,880	100,536,383,570
地方債証券	5,181,131,600	6,991,689,200
特殊債券	2,638,329,900	3,954,024,200
社債券	5,469,294,700	8,953,662,000
未収利息	234,276,260	273,015,858
前払費用	11,768,485	26,969,752
流動資産合計	112,312,083,602	121,287,009,727
資産合計	112,312,083,602	121,287,009,727
負債の部		
流動負債		
未払金	-	200,000,000
未払解約金	161,642,018	26,075,931
流動負債合計	161,642,018	226,075,931
負債合計	161,642,018	226,075,931
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	81,482,693,217	91,769,046,895
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	30,667,748,367	29,291,886,901
元本等合計	112,150,441,584	121,060,933,796
純資産合計	112,150,441,584	121,060,933,796
負債純資産合計	112,312,083,602	121,287,009,727

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2024年6月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023年6月15日現在	2024年6月17日現在
1.　※1 期首	2022年6月16日	2023年6月16日
期首元本額	73,960,042,577円	81,482,693,217円
期中追加設定元本額	24,175,910,309円	28,834,163,818円
期中一部解約元本額	16,653,259,669円	18,547,810,140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)	45,707,970円	34,251,260円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	257,319,978円	214,018,411円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	38,998,448円	41,043,894円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	508,218,693円	510,580,994円
ＤＣダイワ日本債券インデックス	10,677,575,748円	10,373,209,124円
ダイワ国内債券インデックス（ラップ専用）	4,443,088,033円	16,035,511,576円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	8,403,957,372円	8,266,520,169円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	1,491,821,438円	1,455,649,064円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	189,175,173円	186,728,513円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	230,352,173円	207,601,314円
ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド	64,009,901円	60,843,581円
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	26,632,158,744円	28,754,589,712円
ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用）	18,044,202,761円	15,916,146,639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	2,103,335,471円	1,729,671,691円
スタイル9（4資産分散・保守型）	-円	2,103,275円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	-円	4,723,980円

	スタイル9（4資産分散・積極型）	-円	489,227円
	スタイル9（6資産分散・保守型）	-円	1,426,296円
	スタイル9（6資産分散・バランス型）	-円	9,366,134円
	スタイル9（6資産分散・積極型）	-円	810,659円
	スタイル9（8資産分散・保守型）	-円	1,868,339円
	スタイル9（8資産分散・バランス型）	-円	7,325,726円
	スタイル9（8資産分散・積極型）	-円	1,414,372円
	ダイワ・インデックスセレクト日本債券	836,254,996円	729,326,060円
	ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	6,361,008,900円	5,933,409,590円
	ダイワライフスタイル２５	436,278,657円	458,021,377円
	ダイワライフスタイル５０	565,099,699円	640,423,493円
	ダイワライフスタイル７５	154,129,062円	191,972,425円
計		81,482,693,217円	91,769,046,895円
2.	期末日における受益権の総数	81,482,693,217口	91,769,046,895口

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年6月16日 至2024年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年6月17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	2023年6月15日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2024年6月17日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	908,525,830	△2,362,219,800
地方債証券	7,139,300	△58,396,600
特殊債券	4,607,500	△58,579,600
社債券	△8,003,500	△33,639,200
合計	912,269,130	△2,512,835,200

（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

2023年6月15日現在	2024年6月17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）

	2023年6月15日現在	2024年6月17日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3764円 (13,764円)	1.3192円 (13,192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	450 2年国債	300,000,000	299,565,000	
	452 2年国債	40,000,000	39,925,200	
	453 2年国債	70,000,000	69,850,900	
	455 2年国債	430,000,000	428,783,100	
	456 2年国債	1,050,000,000	1,048,141,500	
	457 2年国債	160,000,000	159,675,200	
	458 2年国債	100,000,000	99,932,000	
	459 2年国債	550,000,000	549,510,500	
	460 2年国債	300,000,000	300,195,000	
	145 5年国債	1,770,000,000	1,768,442,400	
	146 5年国債	1,180,000,000	1,178,218,200	
	147 5年国債	1,430,000,000	1,424,122,700	
	148 5年国債	1,600,000,000	1,591,376,000	
	149 5年国債	1,170,000,000	1,162,512,000	
	150 5年国債	1,300,000,000	1,290,289,000	
	151 5年国債	850,000,000	842,690,000	
	152 5年国債	600,000,000	596,394,000	
	153 5年国債	430,000,000	425,777,400	
	154 5年国債	980,000,000	971,944,400	
	155 5年国債	730,000,000	728,102,000	
	156 5年国債	1,000,000,000	993,940,000	
	157 5年国債	200,000,000	198,484,000	
	158 5年国債	700,000,000	692,104,000	
	161 5年国債	880,000,000	875,494,400	
	162 5年国債	200,000,000	198,704,000	
	163 5年国債	850,000,000	848,045,000	
	164 5年国債	270,000,000	266,606,100	
	165 5年国債	450,000,000	446,328,000	
	166 5年国債	630,000,000	627,776,100	
	167 5年国債	150,000,000	149,268,000	

168 5年国債	400,000,000	401,760,000	
1 40年国債	100,000,000	109,437,000	
2 40年国債	110,000,000	115,652,900	
3 40年国債	150,000,000	156,562,500	
4 40年国債	180,000,000	186,924,600	
5 40年国債	185,000,000	183,525,550	
6 40年国債	285,000,000	275,520,900	
7 40年国債	190,000,000	174,642,300	
8 40年国債	230,000,000	194,642,100	
9 40年国債	220,000,000	133,834,800	
10 40年国債	230,000,000	164,321,200	
11 40年国債	320,000,000	218,019,200	
12 40年国債	380,000,000	227,456,600	
13 40年国債	360,000,000	211,492,800	
14 40年国債	430,000,000	269,115,500	
15 40年国債	410,000,000	283,396,100	
16 40年国債	1,120,000,000	850,427,200	
17 40年国債	300,000,000	294,993,000	
340 10年国債	760,000,000	762,188,800	
341 10年国債	500,000,000	500,750,000	
342 10年国債	710,000,000	708,260,500	
343 10年国債	780,000,000	777,270,000	
344 10年国債	780,000,000	776,669,400	
345 10年国債	950,000,000	945,145,500	
346 10年国債	780,000,000	775,312,200	
347 10年国債	1,100,000,000	1,092,300,000	
348 10年国債	1,050,000,000	1,041,369,000	
349 10年国債	1,250,000,000	1,238,100,000	
350 10年国債	900,000,000	889,848,000	
351 10年国債	600,000,000	592,200,000	
352 10年国債	20,000,000	19,703,400	
353 10年国債	750,000,000	737,257,500	
354 10年国債	730,000,000	716,268,700	
355 10年国債	540,000,000	529,189,200	
356 10年国債	500,000,000	489,375,000	
357 10年国債	700,000,000	684,257,000	
358 10年国債	500,000,000	487,995,000	
359 10年国債	650,000,000	633,178,000	
360 10年国債	1,000,000,000	971,890,000	

361 10年国債	780,000,000	756,280,200	
362 10年国債	850,000,000	822,145,500	
363 10年国債	1,000,000,000	964,440,000	
364 10年国債	1,000,000,000	961,540,000	
365 10年国債	1,130,000,000	1,082,799,900	
366 10年国債	600,000,000	577,512,000	
367 10年国債	900,000,000	863,262,000	
368 10年国債	1,200,000,000	1,147,332,000	
369 10年国債	990,000,000	967,497,300	
370 10年国債	1,350,000,000	1,315,251,000	
371 10年国債	800,000,000	770,200,000	
372 10年国債	900,000,000	895,365,000	
373 10年国債	1,120,000,000	1,090,566,400	
374 10年国債	350,000,000	346,083,500	
1 30年国債	16,000,000	17,898,880	
2 30年国債	184,000,000	203,297,920	
3 30年国債	30,000,000	33,086,100	
4 30年国債	36,000,000	41,288,040	
5 30年国債	28,000,000	31,007,480	
6 30年国債	24,000,000	27,022,560	
7 30年国債	55,000,000	61,719,350	
8 30年国債	27,000,000	29,270,970	
9 30年国債	43,000,000	45,198,590	
10 30年国債	45,000,000	46,123,200	
11 30年国債	40,000,000	43,024,000	
12 30年国債	60,000,000	66,636,600	
13 30年国債	75,000,000	82,586,250	
14 30年国債	82,000,000	93,279,100	
15 30年国債	50,000,000	57,395,500	
16 30年国債	250,000,000	287,157,500	
17 30年国債	130,000,000	148,149,300	
18 30年国債	80,000,000	90,360,800	
19 30年国債	500,000,000	564,720,000	
21 30年国債	60,000,000	67,734,000	
22 30年国債	170,000,000	195,583,300	
24 30年国債	92,000,000	105,911,320	
25 30年国債	150,000,000	169,138,500	
26 30年国債	180,000,000	204,910,200	
27 30年国債	150,000,000	172,500,000	

28 30年国債	270,000,000	310,154,400	
29 30年国債	200,000,000	226,870,000	
30 30年国債	220,000,000	246,015,000	
31 30年国債	300,000,000	330,588,000	
32 30年国債	385,000,000	428,612,800	
33 30年国債	280,000,000	298,883,200	
34 30年国債	270,000,000	295,304,400	
35 30年国債	250,000,000	265,135,000	
36 30年国債	350,000,000	370,380,500	
37 30年国債	450,000,000	467,424,000	
38 30年国債	260,000,000	265,015,400	
39 30年国債	270,000,000	278,958,600	
40 30年国債	240,000,000	243,480,000	
41 30年国債	250,000,000	249,087,500	
42 30年国債	320,000,000	317,881,600	
43 30年国債	260,000,000	257,691,200	
44 30年国債	300,000,000	296,646,000	
45 30年国債	250,000,000	238,052,500	
46 30年国債	250,000,000	237,412,500	
47 30年国債	320,000,000	308,832,000	
48 30年国債	320,000,000	296,896,000	
49 30年国債	220,000,000	203,515,400	
50 30年国債	350,000,000	285,467,000	
51 30年国債	340,000,000	245,670,400	
52 30年国債	350,000,000	264,257,000	
53 30年国債	300,000,000	230,871,000	
54 30年国債	400,000,000	321,172,000	
55 30年国債	300,000,000	239,874,000	
56 30年国債	340,000,000	270,932,400	
57 30年国債	300,000,000	238,059,000	
58 30年国債	430,000,000	339,790,300	
59 30年国債	300,000,000	230,394,000	
60 30年国債	280,000,000	224,915,600	
61 30年国債	300,000,000	228,348,000	
62 30年国債	310,000,000	222,685,400	
63 30年国債	300,000,000	208,353,000	
64 30年国債	290,000,000	200,210,200	
65 30年国債	310,000,000	212,746,800	
66 30年国債	270,000,000	184,199,400	

67 30年国債	350,000,000	251,538,000	
68 30年国債	340,000,000	243,185,000	
69 30年国債	410,000,000	300,243,000	
70 30年国債	330,000,000	240,754,800	
71 30年国債	390,000,000	283,218,000	
72 30年国債	320,000,000	231,504,000	
73 30年国債	360,000,000	259,455,600	
74 30年国債	380,000,000	296,818,000	
75 30年国債	340,000,000	286,477,200	
76 30年国債	310,000,000	267,251,000	
77 30年国債	295,000,000	266,556,100	
78 30年国債	240,000,000	206,184,000	
79 30年国債	320,000,000	260,796,800	
80 30年国債	330,000,000	311,209,800	
81 30年国債	375,000,000	337,155,000	
82 30年国債	200,000,000	188,322,000	
82 20年国債	87,000,000	89,106,270	
83 20年国債	93,000,000	95,654,220	
85 20年国債	58,000,000	59,888,480	
86 20年国債	80,000,000	82,884,000	
87 20年国債	55,000,000	56,887,050	
89 20年国債	53,000,000	55,039,970	
90 20年国債	20,000,000	20,859,000	
92 20年国債	310,000,000	323,881,800	
93 20年国債	100,000,000	104,613,000	
94 20年国債	130,000,000	136,351,800	
95 20年国債	50,000,000	52,939,000	
96 20年国債	55,000,000	57,905,650	
97 20年国債	40,000,000	42,390,000	
98 20年国債	320,000,000	338,089,600	
99 20年国債	100,000,000	106,007,000	
100 20年国債	155,000,000	165,377,250	
101 20年国債	350,000,000	376,022,500	
108 20年国債	300,000,000	319,002,000	
109 20年国債	55,000,000	58,601,950	
110 20年国債	260,000,000	279,442,800	
111 20年国債	250,000,000	270,885,000	
112 20年国債	250,000,000	269,662,500	
113 20年国債	310,000,000	335,581,200	

114 20年国債	70,000,000	76,022,100	
115 20年国債	180,000,000	196,452,000	
116 20年国債	200,000,000	218,952,000	
117 20年国債	200,000,000	217,834,000	
118 20年国債	95,000,000	103,187,100	
119 20年国債	93,000,000	99,932,220	
120 20年国債	317,000,000	336,837,860	
121 20年国債	200,000,000	216,464,000	
122 20年国債	200,000,000	215,252,000	
123 20年国債	200,000,000	219,404,000	
124 20年国債	300,000,000	327,222,000	
125 20年国債	130,000,000	143,780,000	
126 20年国債	110,000,000	120,189,300	
127 20年国債	350,000,000	380,145,500	
128 20年国債	250,000,000	271,940,000	
129 20年国債	200,000,000	216,206,000	
130 20年国債	140,000,000	151,473,000	
131 20年国債	150,000,000	161,250,000	
132 20年国債	100,000,000	107,515,000	
133 20年国債	100,000,000	108,269,000	
134 20年国債	30,000,000	32,498,400	
135 20年国債	92,000,000	98,947,840	
136 20年国債	550,000,000	587,482,500	
138 20年国債	300,000,000	318,072,000	
139 20年国債	370,000,000	395,093,400	
140 20年国債	570,000,000	613,297,200	
141 20年国債	400,000,000	430,384,000	
142 20年国債	240,000,000	260,150,400	
143 20年国債	210,000,000	224,109,900	
144 20年国債	140,000,000	148,198,400	
145 20年国債	340,000,000	365,704,000	
146 20年国債	20,000,000	21,495,800	
147 20年国債	600,000,000	639,018,000	
148 20年国債	400,000,000	421,516,000	
149 20年国債	532,000,000	560,009,800	
150 20年国債	310,000,000	322,886,700	
151 20年国債	420,000,000	428,391,600	
152 20年国債	600,000,000	610,758,000	
153 20年国債	280,000,000	287,187,600	

	154 20年国債	680,000,000	688,880,800	
	155 20年国債	480,000,000	474,609,600	
	156 20年国債	430,000,000	395,582,800	
	157 20年国債	710,000,000	634,491,500	
	158 20年国債	430,000,000	396,984,600	
	159 20年国債	400,000,000	372,280,000	
	160 20年国債	510,000,000	478,614,600	
	161 20年国債	470,000,000	433,640,800	
	162 20年国債	590,000,000	542,068,400	
	163 20年国債	460,000,000	420,587,200	
	164 20年国債	580,000,000	520,695,000	
	165 20年国債	470,000,000	419,728,800	
	166 20年国債	550,000,000	503,041,000	
	167 20年国債	450,000,000	397,804,500	
	168 20年国債	570,000,000	493,659,900	
	169 20年国債	500,000,000	423,910,000	
	170 20年国債	520,000,000	438,438,000	
	171 20年国債	350,000,000	293,286,000	
	172 20年国債	170,000,000	144,059,700	
	173 20年国債	500,000,000	421,395,000	
	174 20年国債	800,000,000	670,520,000	
	175 20年国債	470,000,000	398,583,500	
	176 20年国債	530,000,000	447,357,100	
	177 20年国債	530,000,000	437,377,200	
	178 20年国債	710,000,000	593,148,200	
	179 20年国債	510,000,000	423,998,700	
	180 20年国債	540,000,000	471,787,200	
	181 20年国債	450,000,000	398,448,000	
	182 20年国債	490,000,000	447,477,800	
	183 20年国債	490,000,000	469,302,400	
	184 20年国債	450,000,000	408,123,000	
	185 20年国債	500,000,000	451,715,000	
	186 20年国債	430,000,000	415,113,400	
	187 20年国債	400,000,000	371,928,000	
	188 20年国債	350,000,000	341,789,000	
	27 メキシコ国債	100,000,000	97,311,000	
	11 フィリピン共和国	100,000,000	98,873,600	
国債証券 合計			100,536,383,570	

地方債証券	751 東京都公債	100,000,000	100,165,100	
	796 東京都公債	100,000,000	97,303,100	
	808 東京都公債	100,000,000	96,885,600	
	827 東京都公債	100,000,000	96,489,000	
	4 東京都5年	200,000,000	199,470,800	
	16 東京都20年	100,000,000	106,532,400	
	3-5 北海道公債	100,000,000	96,277,200	
	37-2 宮城県公債	100,000,000	95,848,400	
	222 神奈川県公債	100,000,000	99,442,200	
	262 神奈川県公債	100,000,000	100,079,300	
	27 神奈川県20年	100,000,000	103,567,700	
	31 神奈川県20年	100,000,000	98,106,700	
	420 大阪府公債	200,000,000	198,702,600	
	7 大阪府20年	200,000,000	216,100,800	
	26-2 京都府15年	100,000,000	102,442,000	
	2-1 京都府公債	200,000,000	194,866,000	
	19兵庫県公債20年	100,000,000	105,687,600	
	2-1 静岡県公債	100,000,000	97,439,200	
	8 静岡県20年	200,000,000	217,122,400	
	21-5 愛知県公債	100,000,000	108,479,500	
	26-4 愛知県20年	100,000,000	105,197,800	
	27-12 愛知県15年	100,000,000	100,836,200	
	29-5 広島県公債	100,000,000	99,282,700	
	25-1 広島県20年	100,000,000	107,413,000	
	2-7 埼玉県公債	100,000,000	96,907,500	
	4 埼玉県30年	100,000,000	90,013,600	
	9 埼玉県20年	100,000,000	109,071,800	
	12 埼玉県20年	100,000,000	107,334,800	
	29-1 福岡県公債	100,000,000	99,406,800	
	5-1 福岡県公債	100,000,000	98,259,100	
	22-1 福岡県15年	100,000,000	102,023,500	
	13 千葉県20年	100,000,000	107,107,300	
	16 千葉県20年	100,000,000	105,364,500	
	28-2 新潟県公債	100,000,000	99,516,600	
	153 共同発行地方	200,000,000	200,628,000	
	168 共同発行地方	100,000,000	99,538,600	
	170 共同発行地方	200,000,000	198,782,600	
	195 共同発行地方	100,000,000	97,364,400	

	196 共同発行地方	100,000,000	97,484,500	
	206 共同発行地方	100,000,000	97,309,100	
	244 共同発行地方	200,000,000	194,601,000	
	255 共同発行地方	100,000,000	100,071,300	
	4-3 長崎県公債	100,000,000	96,777,500	
	27-1 滋賀県公債	100,000,000	100,322,800	
	6-1 大阪市5年	100,000,000	100,093,000	
	6-2 大阪市公債	100,000,000	100,023,400	
	11 名古屋市20年	200,000,000	216,864,200	
	10 京都市20年	100,000,000	107,813,100	
	20-1 神戸市20年	100,000,000	107,411,300	
	14 横浜市20年	100,000,000	106,896,300	
	19 横浜市20年	100,000,000	108,404,200	
	26-5 札幌市15年	100,000,000	102,080,300	
	2-4 札幌市公債	100,000,000	96,945,900	
	4 川崎市公債30年	100,000,000	106,388,400	
	1 北九州市15年	100,000,000	101,958,700	
	23-4 福岡市20年	100,000,000	108,364,100	
	1-5 千葉市公債	100,000,000	97,221,300	
	3-2 徳島県公債	100,000,000	95,696,300	
	1-1 山梨県公債	100,000,000	97,279,400	
	2-2 岡山県公債	100,000,000	96,626,700	
地方債証券 合計			6,991,689,200	
特殊債券	47日本政策投資C0	100,000,000	101,907,100	
	174 日本政策投資	300,000,000	290,594,400	
	69 政保政策投資C	100,000,000	96,500,000	
	247 道路機構	200,000,000	164,070,200	
	86 政保道路機構	100,000,000	107,286,600	
	97 政保道路機構	100,000,000	108,340,400	
	160 政保道路機構	200,000,000	215,687,600	
	223 政保道路機構	100,000,000	104,020,800	
	235 政保道路機構	100,000,000	101,723,300	
	261 政保道路機構	200,000,000	200,387,000	
	284 政保道路機構	200,000,000	176,086,200	
	298 政保道路機構	100,000,000	91,875,800	
	321 政保道路機構	200,000,000	198,398,800	
	403 政保道路機構	100,000,000	96,737,100	
	478 政保道路機構	100,000,000	100,042,500	
	F124地方公共団体	100,000,000	102,441,500	

	F143地方公共団体	100,000,000	102,353,200	
	1 地方公共団15年	100,000,000	102,463,800	
	31 地方公共団20	100,000,000	105,564,400	
	F192地方公共団体	100,000,000	101,947,900	
	F221地方公共団体	200,000,000	204,750,600	
	F226地方公共団体	100,000,000	101,580,400	
	97政保地方公共団	100,000,000	99,229,000	
	129 地方公共団体	200,000,000	192,456,400	
	F568地方公共団体	200,000,000	179,646,400	
	4 国際協力銀行CO	100,000,000	100,023,000	
	127 都市再生	100,000,000	99,186,800	
	80 住宅支援機構	100,000,000	102,585,400	
	123 住宅支援機構	100,000,000	107,012,300	
	19 利付商工債	100,000,000	99,125,300	
特殊債券 合計			3,954,024,200	
社債券	33 首都高速道路	100,000,000	99,386,900	
	30 阪神高速道路	100,000,000	99,540,100	
	20 成田国際空港	100,000,000	99,141,000	
	111 東日本高速道	100,000,000	99,623,600	
	63 中日本高速道	100,000,000	100,312,400	
	101 中日本高速道	400,000,000	397,141,200	
	88 西日本高速道	100,000,000	100,318,300	
	32大和ハウス工業	300,000,000	298,779,900	
	22 積水ハウス	100,000,000	98,770,600	
	12 アサヒグループHD	100,000,000	99,180,600	
	11サントリーホールデイング	100,000,000	98,806,500	
	11日本たばこ産業	100,000,000	100,312,900	
	11 ヒユーリツク	100,000,000	99,647,300	
	23 森ビル	100,000,000	87,473,700	
	14 セブンアンドアイ	100,000,000	99,677,900	
	18 セブンアンドアイ	100,000,000	101,014,600	
	35 東レ	300,000,000	300,254,400	
	1 レゾナツクHD	100,000,000	98,819,700	
	4 アステラス製薬	300,000,000	297,391,500	
	20 ZHD	100,000,000	97,061,900	
	18 楽天グループ	100,000,000	71,686,200	
	2 AGC	100,000,000	96,568,300	
	7 日本製鉄	100,000,000	99,481,500	
	32 住友電工	100,000,000	98,440,200	

16 クボタ	100,000,000	99,119,900	
62 日本電気	200,000,000	196,318,400	
17 パナソニツク	100,000,000	99,643,800	
41 ソニーG	100,000,000	98,039,800	
15 デンソー	100,000,000	99,087,600	
31 トヨタ自動車	100,000,000	97,206,400	
6 楽天カード	100,000,000	92,803,500	
3 オリツクス銀行	200,000,000	197,417,400	
1 日生2021基金	100,000,000	99,309,200	
7 凸版印刷	100,000,000	101,413,600	
31 豊田通商	200,000,000	197,186,000	
63 住友商事	100,000,000	96,857,200	
26 りそなホールデイン	100,000,000	98,818,900	
27 りそなホールデイン	200,000,000	198,182,400	
28 三井住友TB	300,000,000	297,048,600	
36 芙蓉総合リース	100,000,000	99,445,000	
16 NTTフアイナンス	100,000,000	99,637,600	
33 NTTフアイナンス	100,000,000	100,097,600	
56 日産フイナンシヤル	100,000,000	99,482,600	
81 ホンダフアイナンス	100,000,000	98,910,800	
78 トヨタフアイナンス	100,000,000	99,098,400	
42 リコーリース	100,000,000	99,171,100	
22 イオンFS	200,000,000	197,997,800	
36 三井住友F&L	200,000,000	198,927,000	
1 SOMPOHD	100,000,000	99,091,100	
7 三井住友海上	100,000,000	99,144,100	
82 三井不動産	100,000,000	98,630,300	
143 三菱地所	100,000,000	97,664,500	
111 住友不動産	100,000,000	99,428,000	
13 NTTフアイナンス	100,000,000	101,468,900	
107東日本旅客鉄	100,000,000	89,886,800	
41 東海旅客鉄道	100,000,000	106,407,200	
67 阪急阪神HLDG	100,000,000	96,398,200	
68 名古屋鉄道	200,000,000	197,194,400	
15 ソフトバンク	100,000,000	97,276,400	
509 関西電力	100,000,000	99,611,500	
538 関西電力	100,000,000	96,302,600	
448 中国電力	100,000,000	97,401,900	
560 東北電力	200,000,000	193,580,400	

	332 北海道電力	100,000,000	92,358,100	
	34 沖縄電力	100,000,000	98,792,000	
	85 電源開発	100,000,000	100,178,400	
	87 電源開発	100,000,000	98,143,000	
	11 東京電力パワー	100,000,000	99,528,600	
	16 JERA	100,000,000	99,330,700	
	65 東京瓦斯	100,000,000	96,431,700	
	50 大阪瓦斯	100,000,000	98,908,700	
	4 フアーストリテイリング	100,000,000	100,452,700	
社債券 合計			8,953,662,000	
合計			120,435,758,970	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2023年6月16日から2024年6月17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】

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	570,911,417	614,509,573
親投資信託受益証券	98,158,543,858	97,900,264,111
未収入金	-	31,914,773
流動資産合計	98,729,455,275	98,546,688,457
資産合計	98,729,455,275	98,546,688,457
負債の部		
流動負債		
未払解約金	72,544,869	153,189,482
未払受託者報酬	10,734,992	10,893,326
未払委託者報酬	193,230,600	196,080,708
その他未払費用	1,118,866	1,131,242
流動負債合計	277,629,327	361,294,758
負債合計	277,629,327	361,294,758
純資産の部		
元本等		
元本	※1 117,510,192,351	※1 120,507,203,109
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △ 19,058,366,403	※2 △ 22,321,809,410
（分配準備積立金）	3,244,816,906	2,529,936,534
元本等合計	98,451,825,948	98,185,393,699
純資産合計	98,451,825,948	98,185,393,699
負債純資産合計	98,729,455,275	98,546,688,457

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期 自　2022年6月16日 至　2023年6月15日	第8期 自　2023年6月16日 至　2024年6月17日
営業収益		
受取利息	172	99,022
有価証券売買等損益	△ 4,258,161,798	△ 2,351,054,208
営業収益合計	△ 4,258,161,626	△ 2,350,955,186
営業費用		
支払利息	175,483	95,259
受託者報酬	21,697,562	21,668,684
委託者報酬	390,557,654	390,038,165
その他費用	2,196,027	2,208,697
営業費用合計	414,626,726	414,010,805
営業利益又は営業損失（△）	△ 4,672,788,352	△ 2,764,965,991
経常利益又は経常損失（△）	△ 4,672,788,352	△ 2,764,965,991
当期純利益又は当期純損失（△）	△ 4,672,788,352	△ 2,764,965,991
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（△）	△ 218,409,466	△ 493,619,925
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 13,467,784,787	△ 19,058,366,403
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,386,120,532	4,871,027,462
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,386,120,532	4,871,027,462
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,522,323,262	5,863,124,403
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,522,323,262	5,863,124,403
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△ 19,058,366,403	△ 22,321,809,410

(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8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日
1．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2024年6月15日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2024年6月17日としております。このため、当計算期間は368日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	第7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
1．　※1 期首元本額	110,985,788,072円	117,510,192,351円
期中追加設定元本額	26,147,697,038円	32,679,578,644円
期中一部解約元本額	19,623,292,759円	29,682,567,886円
2．　計算期間末日における受益権の総数	117,510,192,351口	120,507,203,109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19,058,366,403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22,321,809,410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7期 自2022年6月16日 至2023年6月15日	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日

※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（6,846,133,761円）及び分配準備積立金（3,244,816,906円）より分配対象額は10,090,950,667円（1万口当たり858.73円）であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（7,818,348,912円）及び分配準備積立金（2,529,936,534円）より分配対象額は10,348,285,446円（1万口当たり858.73円）であり、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	第8期 2024年6月17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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	△4,165,831,709	△2,046,035,439
合計	△4,165,831,709	△2,046,035,439

(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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17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8期 自2023年6月16日 至2024年6月17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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.8378円 (8,378円)	0.8148円 (8,148円)

(4)【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	116,437,041,046	97,900,264,111	
親投資信託受益証券 合計			97,900,264,111	
合計			97,900,264,111	

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

	2023年6月15日現在 金 額（円）	2024年6月17日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,177,169,181	1,766,384,203

コール・ローン	2,042,811,022	1,134,496,806
国債証券	120,077,109,021	122,603,987,234
派生商品評価勘定	17,286,979	547,672,494
未収入金	-	256,710
未収利息	820,688,338	870,695,083
前払費用	43,682,720	43,765,372
差入委託証拠金	278,481,888	231,066,642
流動資産合計	124,457,229,149	127,198,324,544
資産合計	124,457,229,149	127,198,324,544
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,820,330,153	297,470,129
未払金	350,335,223	848,406
未払解約金	79,985,053	33,437,142
流動負債合計	2,250,650,429	331,755,677
負債合計	2,250,650,429	331,755,677
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	141,933,741,025	150,884,982,568
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△19,727,162,305	△24,018,413,701
元本等合計	122,206,578,720	126,866,568,867
純資産合計	122,206,578,720	126,866,568,867
負債純資産合計	124,457,229,149	127,198,324,544

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2024年6月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023年6月15日現在	2024年6月17日現在
1. ※1 期首	2022年6月16日	2023年6月16日
期首元本額	133,574,429,591円	141,933,741,025円
期中追加設定元本額	30,925,430,263円	40,419,718,586円

期中一部解約元本額	22,566,118,829円	31,468,477,043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）	2,183,533,217円	2,345,854,351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）	114,005,277,420円	116,437,041,046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）	4,497,197,642円	4,599,899,537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）	6,955,905円	18,119,568円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	3,415,999,261円	3,691,729,083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）	17,824,777,580円	16,856,752,538円
ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	-円	2,338,208,341円
ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	-円	2,268,146,411円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	-円	2,329,231,693円
計	141,933,741,025円	150,884,982,568円
2. 期末日における受益権の総数	141,933,741,025口	150,884,982,568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19,727,162,305円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は24,018,413,701円であります。

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年6月16日 至2024年6月17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。
3．　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II　金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年6月17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	2023年6月15日現在	2024年6月17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	△3,796,459,728	686,388,010
合計	△3,796,459,728	686,388,010

（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	2023年6月15日現在				2024年6月17日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
債券先物取引								
買建	1,922,889,910	-	1,917,135,276	△5,754,634	2,102,527,984	-	2,130,027,159	27,499,175
合計	1,922,889,910	-	1,917,135,276	△5,754,634	2,102,527,984	-	2,130,027,159	27,499,175

（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6月15日現在				2024年6月17日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)

市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	122,068,233,013	-	123,865,521,553	△1,797,288,540	124,144,766,074	-	123,922,062,884	222,703,190
アメリカ・ドル	59,616,908,070	-	60,027,890,271	△410,982,201	56,537,161,105	-	56,787,658,356	△250,497,251
イギリス・ポンド	5,747,494,252	-	5,908,884,052	△161,389,800	6,549,941,192	-	6,555,959,696	△6,018,504
イスラエル・シュケル	451,814,760	-	473,742,205	△21,927,445	501,946,602	-	503,870,427	△1,923,825
オーストラリア・ドル	1,879,774,962	-	1,985,268,862	△105,493,900	1,792,406,775	-	1,789,466,112	2,940,663
オフショア・人民元	6,737,724,061	-	6,725,046,496	12,677,565	12,653,663,385	-	12,688,397,505	△34,734,120
カナダ・ドル	2,536,526,294	-	2,602,603,666	△66,077,372	2,679,675,175	-	2,670,677,220	8,997,955
シンガポール・ドル	568,666,761	-	577,824,951	△9,158,190	632,703,708	-	634,615,800	△1,912,092
スウェーデン・クローナ	266,511,192	-	272,080,655	△5,569,463	316,454,982	-	317,587,554	△1,132,572
デンマーク・クローネ	509,054,462	-	520,227,266	△11,172,804	407,755,647	-	403,512,012	4,243,635
ニュージーランド・ドル	256,425,893	-	266,736,541	△10,310,648	299,709,388	-	300,677,838	△968,450
ノルウェー・クローネ	188,584,175	-	198,291,546	△9,707,371	228,045,706	-	225,459,668	2,586,038
ポーランド・ズロチ	500,400,450	-	521,809,794	△21,409,344	734,895,305	-	710,494,358	24,400,947
マレーシア・リンギット	709,250,808	-	705,800,712	3,450,096	638,502,010	-	637,354,210	1,147,800
メキシコ・ペソ	1,190,138,877	-	1,244,954,256	△54,815,379	1,109,162,182	-	1,027,983,216	81,178,966
ユーロ	40,908,957,996	-	41,834,360,280	△925,402,284	39,062,742,912	-	38,668,348,912	394,394,000
合計	122,068,233,013	-	123,865,521,553	△1,797,288,540	124,144,766,074	-	123,922,062,884	222,703,190

（注）　1.　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2023年6月15日現在	2024年6月17日現在
１口当たり純資産額	0.8610円	0.8408円
（1万口当たり純資産額）	(8,610円)	(8,408円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	7,950,000.000	8,398,221.000	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,848,111.000	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	1,400,000.000	1,547,210.000	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	630,000.000	675,794.700	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	2,000,000.000	2,069,520.000	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	300,000.000	324,501.000	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	430,000.000	395,389.300	

		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,410,000.000	1,425,002.400	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,390,000.000	1,443,264.800	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	770,000.000	807,984.100	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	600,000.000	554,502.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	670,000.000	563,610.700	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	1,500,000.000	1,182,360.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,000,000.000	785,270.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,000,000.000	1,658,420.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,500,000.000	1,988,950.000	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	1,100,000.000	978,527.000	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	1,532,000.000	1,385,908.480	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	1,000,000.000	887,140.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	1,200,000.000	1,023,600.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	940,000.000	769,587.400	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	1,100,000.000	805,189.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	370,000.000	295,030.600	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250815	4,820,000.000	4,658,819.200	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	800,000.000	623,152.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	4,500,000.000	4,339,305.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	3,500,000.000	3,323,600.000	

		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	300,000.000	217,404.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	6,865,000.000	6,482,001.650	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	1,070,000.000	772,989.400	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,750,000.000	5,383,207.500	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	500,000.000	343,300.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20261115	12,850,000.000	12,103,543.500	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	772,380.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	5,000,000.000	4,720,850.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	900,000.000	709,551.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	5,550,000.000	5,236,702.500	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	950,000.000	747,973.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	14,000,000.000	13,112,120.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	1,000,000.000	750,660.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	700,000.000	524,503.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	4,000,000.000	3,783,480.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	1,000,000.000	783,940.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	1,000,000.000	801,600.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	3,300,000.000	3,128,730.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	4,000,000.000	3,782,800.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	1,800,000.000	1,408,428.000	

		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	4,300,000.000	4,100,093.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	1,850,000.000	1,548,931.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,500,000.000	6,052,605.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	1,500,000.000	1,172,625.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	1,000,000.000	957,570.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	2,000,000.000	1,525,540.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	2,300,000.000	2,111,101.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	4,500,000.000	4,259,700.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	5,000,000.000	4,406,600.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	1,500,000.000	1,003,230.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,400,000.000	4,765,878.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	1,300,000.000	893,061.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	4,500,000.000	3,887,730.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,000,000.000	5,558,640.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20500215	2,500,000.000	1,572,550.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	3,000,000.000	2,441,760.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	2,000,000.000	1,030,140.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	500,000.000	316,285.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	2,000,000.000	1,910,560.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	2,856,750.000	

		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	8,000,000.000	7,591,040.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	2,800,000.000	2,259,796.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	1,200,000.000	637,404.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	500,000.000	313,200.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,000,000.000	1,884,140.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	2,000,000.000	1,890,420.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	5,000,000.000	4,075,750.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	800,000.000	454,264.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,000,000.000	649,600.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	4,500,000.000	3,964,455.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	4,000,000.000	3,737,640.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	3,300,000.000	2,904,957.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	2,000,000.000	1,211,000.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	4,900,000.000	4,043,431.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,000,000.000	1,862,680.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	1,000,000.000	890,830.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	2,400,000.000	1,687,680.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	1,000,000.000	930,760.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	5,500,000.000	4,911,940.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	4,600,000.000	3,895,418.000	

		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	3,000,000.000	2,673,690.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	2,400,000.000	1,636,296.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,600,000.000	1,189,088.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	1,000,000.000	889,530.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	1,500,000.000	1,331,160.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	3,500,000.000	3,246,845.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	4,700,000.000	3,849,958.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	2,400,000.000	1,494,504.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	5,750,000.000	3,907,412.500	
		0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	8,000,000.000	7,359,200.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	2,000,000.000	1,752,720.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	1,000,000.000	879,000.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	2,400,000.000	2,208,000.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	3,000,000.000	2,463,750.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	3,100,000.000	1,868,215.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	2,000,000.000	1,410,960.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,697,800.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	4,000,000.000	3,553,960.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	900,000.000	763,803.000	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	2,500,000.000	1,651,250.000	

		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	1,000,000.000	747,260.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	2,500,000.000	2,248,125.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	1,500,000.000	1,401,090.000	
		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	1,500,000.000	1,423,875.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	5,300,000.000	4,827,717.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	2,300,000.000	1,746,321.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,000,000.000	851,990.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	4,000,000.000	3,734,600.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	1,500,000.000	1,450,275.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	2,500,000.000	2,250,025.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	2,000,000.000	1,558,080.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	1,200,000.000	1,179,276.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	3,000,000.000	2,974,860.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	4,000,000.000	3,976,640.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	2,000,000.000	1,883,620.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	2,966,130.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	700,000.000	687,582.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	3,000,000.000	2,891,010.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	4,000,000.000	3,793,200.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	1,000,000.000	924,100.000	

	3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	1,800,000.000	1,583,280.000	
	3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,500,000.000	1,453,815.000	
	3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	4,500,000.000	4,220,640.000	
	3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	1,800,000.000	1,583,460.000	
	3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	2,500,000.000	2,307,300.000	
	4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630	1,000,000.000	988,590.000	
	3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815	2,000,000.000	1,947,840.000	
	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815	1,900,000.000	1,828,750.000	
	4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430815	1,500,000.000	1,480,830.000	
	4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	1,700,000.000	1,679,634.000	
	5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251031	8,000,000.000	8,007,280.000	
	4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20331115	4,500,000.000	4,598,055.000	
	4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20531115	2,100,000.000	2,244,522.000	
	4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251130	5,000,000.000	4,999,900.000	
	4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301130	4,000,000.000	4,034,920.000	
	4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	6,000,000.000	6,025,620.000	
	4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340215	2,000,000.000	1,966,700.000	
	4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540215	1,300,000.000	1,279,473.000	
	4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340515	1,700,000.000	1,722,695.000	
	4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310430	1,700,000.000	1,742,228.000	

アメリカ・ドル 小計			361,530,336.730 (56,951,873,945)	
イギリス・ポンド	2% United Kingdom Gilt 20250907	1,350,000.000	1,308,217.500	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	810,000.000	520,870.500	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,775,000.000	1,679,398.500	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	650,000.000	372,001.500	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	820,000.000	617,353.400	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	900,000.000	484,452.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	650,000.000	597,818.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	800,000.000	727,704.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	517,000.000	242,111.100	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	200,000.000	118,848.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20541022	350,000.000	185,482.500	
	0.875% United Kingdom Gilt 20291022	800,000.000	685,136.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20411022	300,000.000	186,624.000	
	0.375% United Kingdom Gilt 20301022	400,000.000	321,772.000	
	0.5% United Kingdom Gilt 20611022	850,000.000	261,179.500	
	0.125% United Kingdom Gilt 20280131	500,000.000	435,470.000	
	0.625% United Kingdom Gilt 20501022	370,000.000	151,903.500	
	0.625% United Kingdom Gilt 20350731	950,000.000	657,153.000	
	0.25% United Kingdom Gilt 20310731	1,700,000.000	1,317,806.000	

		0.875% United Kingdom Gilt 20460131	500,000.000	252,565.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20261022	1,000,000.000	915,290.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,200,000.000	595,320.000	
		0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	1,000,000.000	856,170.000	
		0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	500,000.000	381,195.000	
		1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	200,000.000	103,468.000	
		1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	500,000.000	404,025.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	400,000.000	149,176.000	
		4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	1,100,000.000	1,094,170.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	800,000.000	757,840.000	
		3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	1,900,000.000	1,798,407.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	700,000.000	603,750.000	
		4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	600,000.000	547,500.000	
		4.5% UNITED KINGDOM GILT 20280607	800,000.000	811,696.000	
		4.75% UNITED KINGDOM GILT 20431022	700,000.000	723,170.000	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	963,000.000	1,043,217.900	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,200,000.000	1,227,180.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	915,000.000	924,058.500	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	550,000.000	577,060.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	850,000.000	813,705.000	

	4.25% United Kingdom Gilt 20461207	770,000.000	742,326.200	
	4.25% United Kingdom Gilt 20271207	300,000.000	301,860.000	
	4.5% United Kingdom Gilt 20421207	911,000.000	917,923.600	
	4.75% United Kingdom Gilt 20301207	907,500.000	950,642.550	
	4.25% United Kingdom Gilt 20491207	543,000.000	521,252.850	
	4.25% United Kingdom Gilt 20390907	330,000.000	326,733.000	
	4.5% United Kingdom Gilt 20340907	600,000.000	621,102.000	
	4% United Kingdom Gilt 20600122	527,000.000	483,965.180	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,000,000.000	984,680.000	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	700,000.000	615,762.000	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	875,000.000	736,050.000	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	338,900.000	281,005.710	
イギリス・ポンド 小計			32,933,567.490 (6,582,432,134)	
イスラエル・シュケル	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,200,000.000	1,241,052.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	500,000.000	484,880.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	4,000,000.000	3,742,800.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	1,200,000.000	947,652.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,000,000.000	909,790.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	1,700,000.000	1,384,718.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,000,000.000	666,110.000	

イスラエル・シュケル 小計			9,377,002.000 (397,122,599)	
オーストラリア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	889,000.000	911,287.230	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	320,000.000	311,555.200	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	359,000.000	369,963.860	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,398,000.000	2,412,364.020	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	725,000.000	691,367.250	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	800,000.000	701,104.000	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	184,000.000	162,475.680	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	658,000.000	620,770.360	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	775,000.000	608,669.500	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,250,000.000	1,195,687.500	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	1,000,000.000	926,270.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	510,000.000	409,371.900	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	1,800,000.000	1,529,406.000	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	850,000.000	690,200.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	900,000.000	512,046.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,800,000.000	1,503,288.000	
	3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,000,000.000	914,170.000	
	3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	1,000,000.000	969,910.000	
オーストラリア・ドル 小計			15,439,906.500 (1,608,375,060)	

オフショア・人民元	3.22% China Government Bond 20251206	3,000,000.000	3,069,990.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	6,500,000.000	6,865,170.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	11,000,000.000	11,693,990.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	15,000,000.000	15,459,300.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	3,000,000.000	3,096,600.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	5,300,000.000	5,593,779.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	8,000,000.000	8,221,600.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	10,000,000.000	10,282,000.000	
	3.02% China Government Bond 20251022	13,000,000.000	13,239,200.000	
	3.28% China Government Bond 20271203	14,000,000.000	14,674,520.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	18,000,000.000	19,280,160.000	
	3.03% China Government Bond 20260311	20,000,000.000	20,450,000.000	
	3.81% China Government Bond 20500914	7,000,000.000	8,652,420.000	
	3.01% China Government Bond 20280513	8,000,000.000	8,315,600.000	
	3.72% China Government Bond 20510412	7,000,000.000	8,556,450.000	
	3.02% China Government Bond 20310527	8,800,000.000	9,273,792.000	
	2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	5,000,000.000	5,091,700.000	
	2.9% CHINA GOVERNMENT BOND 20260505	7,000,000.000	7,151,270.000	
	2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	13,000,000.000	13,256,880.000	
	3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	6,500,000.000	6,876,675.000	

		3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	6,000,000.000	6,440,400.000	
		4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	4,400,000.000	5,619,988.000	
		3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	6,000,000.000	7,438,080.000	
		3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	8,800,000.000	10,156,608.000	
		2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	3,500,000.000	3,626,595.000	
		3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	3,300,000.000	3,919,344.000	
		2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	5,300,000.000	5,542,422.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	12,000,000.000	12,144,840.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	9,800,000.000	10,142,216.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	4,000,000.000	4,131,520.000	
		2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	15,000,000.000	15,245,550.000	
		3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,000,000.000	5,740,950.000	
		2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	9,000,000.000	9,318,510.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	3,000,000.000	3,093,720.000	
		2.5% CHINA GOVERNMENT BOND 20270725	12,000,000.000	12,199,680.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	7,000,000.000	7,212,870.000	
		2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20250825	15,000,000.000	15,087,000.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	2,000,000.000	2,047,620.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	13,000,000.000	13,327,860.000	
		2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	4,000,000.000	4,060,160.000	

		3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	4,000,000.000	4,440,360.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	8,000,000.000	8,316,240.000	
		2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20251125	14,000,000.000	14,113,680.000	
		2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	13,000,000.000	13,438,620.000	
		2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	4,000,000.000	4,187,760.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	8,000,000.000	8,281,520.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	4,000,000.000	4,086,600.000	
		3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	3,000,000.000	3,405,240.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	9,000,000.000	9,265,410.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	6,000,000.000	6,148,080.000	
		2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	20,000,000.000	20,269,600.000	
		2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	11,000,000.000	11,186,560.000	
		2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	15,000,000.000	15,106,950.000	
		2.22% CHINA GOVERNMENT BOND 20250925	18,000,000.000	18,119,880.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	3,000,000.000	3,070,770.000	
		3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	5,000,000.000	5,483,650.000	
		2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	15,000,000.000	15,310,050.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	8,000,000.000	8,240,320.000	
		2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225	8,000,000.000	8,166,240.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20290115	10,000,000.000	10,138,900.000	

	2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225	5,000,000.000	5,019,700.000	
	2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325	4,000,000.000	4,019,840.000	
	2.49% CHINA GOVERNMENT BOND 20440525	2,000,000.000	2,018,420.000	
	2.27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525	10,000,000.000	9,994,600.000	
オフショア・人民元 小計			567,426,019.000 (12,289,312,720)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	460,000.000	417,335.000	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	907,000.000	1,010,969.410	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	300,000.000	353,469.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	620,000.000	675,942.600	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	140,000.000	144,858.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	500,000.000	458,485.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,492,000.000	1,464,383.080	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,920,000.000	1,839,782.400	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	930,000.000	866,518.200	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	600,000.000	571,290.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	1,520,000.000	1,178,364.800	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	300,000.000	287,061.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	1,700,000.000	1,517,301.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	900,000.000	862,632.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	2,000,000.000	1,783,520.000	

	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	1,250,000.000	901,375.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	1,500,000.000	1,411,890.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,000,000.000	884,630.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	500,000.000	456,185.000	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,000,000.000	944,410.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	1,500,000.000	1,505,745.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250801	1,500,000.000	1,488,780.000	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20331201	1,500,000.000	1,497,165.000	
カナダ・ドル 小計			22,522,091.490 (2,583,058,673)	
シンガポール・ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	203,000.000	204,299.200	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	600,000.000	589,800.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	239,000.000	226,691.500	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	420,000.000	426,720.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	500,000.000	493,100.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	400,000.000	395,520.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	300,000.000	281,229.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	200,000.000	195,240.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	660,000.000	599,940.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	350,000.000	274,925.000	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	400,000.000	361,280.000	

	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	170,000.000	131,705.800	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	1,000,000.000	953,130.000	
シンガポール・ドル 小計			5,133,580.500 (597,908,121)	
スウェーデン・クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	2,520,000.000	2,922,645.600	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	4,780,000.000	4,622,021.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	2,550,000.000	2,412,835.500	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	500,000.000	504,170.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	3,000,000.000	2,796,900.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	4,000,000.000	3,494,880.000	
スウェーデン・クローナ 小計			16,753,452.100 (250,799,178)	
デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	4,740,000.000	5,883,667.200	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	2,830,000.000	2,787,634.900	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	3,200,000.000	2,998,624.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	1,700,000.000	1,544,858.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	2,400,000.000	1,316,328.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	2,000,000.000	1,688,260.000	
デンマーク・クローネ 小計			16,219,372.100 (366,557,809)	
ニュージーランド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	1,000,000.000	997,550.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	300,000.000	276,933.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	300,000.000	242,601.000	

	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	500,000.000	468,430.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	500,000.000	411,800.000	
	2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	500,000.000	416,090.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	200,000.000	136,112.000	
ニュージーランド・ドル 小計			2,949,516.000 (285,100,217)	
ノルウェー・クローネ	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	1,430,000.000	1,375,960.300	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,000,000.000	2,862,180.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	2,000,000.000	1,895,420.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	2,000,000.000	1,840,980.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	2,500,000.000	2,216,675.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	2,000,000.000	1,722,160.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	2,000,000.000	1,817,420.000	
ノルウェー・クローネ 小計			13,730,795.300 (202,803,847)	
ポーランド・ズロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	2,640,000.000	2,499,842.400	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	1,815,000.000	1,670,072.250	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	2,300,000.000	2,006,175.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	1,800,000.000	1,390,086.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	900,000.000	803,160.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,000,000.000	756,780.000	
	7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	2,000,000.000	2,145,540.000	

	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	1,000,000.000	1,020,080.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	600,000.000	604,446.000	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	1,800,000.000	1,638,198.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	2,230,000.000	2,191,867.000	
ポーランド・ズロチ 小計			16,726,246.650 (644,286,658)	
マレーシア・リンギット	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,760,000.000	1,829,819.200	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,000,000.000	1,025,750.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	1,950,000.000	1,968,213.000	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,400,000.000	1,397,620.000	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,500,000.000	1,506,075.000	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	700,000.000	771,232.000	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	500,000.000	513,355.000	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	1,420,000.000	1,530,376.600	
	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	500,000.000	505,210.000	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,000,000.000	1,075,680.000	
	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	1,600,000.000	1,749,808.000	
	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	1,500,000.000	1,513,980.000	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,200,000.000	1,212,252.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,295,073.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	400,000.000	385,276.000	

	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	1,400,000.000	1,366,806.000	
マレーシア・リンギット 小計			19,646,525.800 (655,260,752)	
メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	24,200,000.000	22,331,034.000	
	8% Mexican Bonos 20471107	11,450,000.000	9,264,996.500	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	10,000,000.000	7,975,600.000	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	20,800,000.000	19,238,128.000	
	10% Mexican Bonos 20361120	2,750,000.000	2,733,170.000	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	6,500,000.000	6,089,720.000	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	5,000,000.000	4,383,150.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	22,700,000.000	20,045,462.000	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	14,050,000.000	11,252,083.000	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	10,300,000.000	8,741,198.000	
メキシコ・ペソ 小計			112,054,541.500 (953,684,997)	
ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	190,000.000	165,748.400	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	800,000.000	778,056.000	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	180,000.000	172,216.800	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	270,000.000	194,783.400	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	200,000.000	185,842.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	150,000.000	126,741.000	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	454,375.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	300,000.000	266,691.000	
	0.125% Finland Government Bond 20360415	350,000.000	248,976.000	
	0.25% Finland Government Bond 20400915	150,000.000	95,584.500	

		0.125% Finland Government Bond 20520415	200,000.000	92,716.000	
		0.125% Finland Government Bond 20310915	200,000.000	164,712.000	
		FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	400,000.000	374,900.000	
		1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	300,000.000	269,337.000	
		2.95% FINLAND GOVERNMENT BOND 20550415	200,000.000	192,874.000	
		0.75% Austria Government Bond 20261020	490,000.000	467,097.400	
		1.5% Austria Government Bond 20470220	270,000.000	199,405.800	
		1.5% Austria Government Bond 20861102	280,000.000	170,332.400	
		0.5% Austria Government Bond 20270420	1,000,000.000	937,930.000	
		2.1% Austria Government Bond 21170920	200,000.000	151,096.000	
		0.75% Austria Government Bond 20280220	600,000.000	558,030.000	
		0.5% Austria Government Bond 20290220	700,000.000	631,428.000	
		Austria Government Bond 20300220	450,000.000	384,790.500	
		0.75% Austria Government Bond 20510320	600,000.000	348,192.000	
		0.85% Austria Government Bond 21200630	100,000.000	45,968.000	
		Austria Government Bond 20310220	1,000,000.000	828,350.000	
		0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	200,000.000	142,742.000	
		0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	150,000.000	68,007.000	
		1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	200,000.000	156,350.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	800,000.000	797,624.000	

		0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,000,000.000	974,830.000	
		1% Belgium Government Bond 20310622	300,000.000	264,894.000	
		1.9% Belgium Government Bond 20380622	460,000.000	390,632.000	
		1% Belgium Government Bond 20260622	95,000.000	91,342.500	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	500,000.000	356,510.000	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	300,000.000	221,766.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	730,000.000	687,068.700	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	310,000.000	237,252.300	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	400,000.000	325,528.000	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	500,000.000	435,555.000	
		0.9% Belgium Government Bond 20290622	100,000.000	91,282.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	350,000.000	245,889.000	
		0.1% Belgium Government Bond 20300622	900,000.000	766,827.000	
		0.4% Belgium Government Bond 20400622	600,000.000	384,702.000	
		Belgium Government Bond 20271022	300,000.000	273,231.000	
		Belgium Government Bond 20311022	400,000.000	325,120.000	
		1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	400,000.000	250,772.000	
		2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	500,000.000	469,455.000	
		3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	600,000.000	601,734.000	
		3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	400,000.000	384,892.000	

		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	455,000.000	507,256.750	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	800,000.000	885,440.000	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	800,000.000	871,776.000	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,296,000.000	1,555,588.800	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	2,000,000.000	2,377,740.000	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,270,000.000	1,537,970.000	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	1,390,000.000	1,618,905.200	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,020,000.000	1,239,034.800	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,310,000.000	1,691,550.600	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	656,000.000	722,092.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,098,000.000	1,089,765.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	775,000.000	770,388.750	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	3,400,000.000	3,319,896.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	883,000.000	850,117.080	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	1,350,000.000	1,276,060.500	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,000,000.000	941,900.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,100,000.000	2,917,131.000	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	1,160,000.000	896,158.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,050,000.000	980,763.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	1,000,000.000	917,560.000	

		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	1,800,000.000	1,637,208.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	500,000.000	444,605.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,600,000.000	841,984.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	700,000.000	615,874.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	300,000.000	231,660.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	700,000.000	602,784.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	200,000.000	150,238.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	1,500,000.000	1,354,335.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	400,000.000	211,404.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,000,000.000	851,790.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	1,500,000.000	1,261,905.000	
		1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	1,100,000.000	1,051,886.000	
		1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	800,000.000	683,640.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	1,000,000.000	987,810.000	
		2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	2,000,000.000	1,997,700.000	
		1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	400,000.000	342,512.000	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340215	800,000.000	789,464.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20540815	400,000.000	399,048.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	900,000.000	452,682.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	1,000,000.000	952,270.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	1,000,000.000	941,890.000	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	1,000,000.000	991,700.000	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	2,715,000.000	2,811,925.500	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	2,000,000.000	2,224,140.000	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,600,000.000	3,107,208.000	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	1,210,000.000	1,382,594.400	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	732,000.000	793,773.480	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	1,265,000.000	1,360,444.250	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	1,143,000.000	1,302,482.790	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,000,000.000	1,096,620.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	2,410,000.000	2,392,913.100	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	1,340,000.000	1,299,371.200	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	1,600,000.000	1,456,112.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,400,000.000	3,239,724.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	1,650,000.000	1,329,339.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	800,000.000	514,496.000	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	1,370,000.000	1,282,141.900	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	1,000,000.000	815,550.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	2,200,000.000	2,079,748.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	500,000.000	380,590.000	

		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	3,000,000.000	2,759,340.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	1,800,000.000	1,514,808.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	2,750,000.000	2,504,452.500	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	1,350,000.000	897,142.500	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	2,000,000.000	1,780,280.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	2,400,000.000	2,053,248.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	1,100,000.000	570,130.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	2,500,000.000	2,374,950.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	1,000,000.000	649,490.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	3,000,000.000	2,489,880.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	200,000.000	74,326.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	1,600,000.000	1,286,000.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	500,000.000	462,000.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	1,000,000.000	506,360.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	1,100,000.000	869,352.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	1,000,000.000	769,250.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	1,500,000.000	1,386,405.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	1,500,000.000	1,384,845.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	866,970.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	800,000.000	719,688.000	

		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260924	1,000,000.000	988,450.000	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20331125	1,200,000.000	1,236,924.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20490625	100,000.000	92,172.000	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	580,000.000	636,677.600	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	800,000.000	901,000.000	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,180,000.000	1,330,485.400	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	390,000.000	386,010.300	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	910,000.000	907,533.900	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,670,000.000	1,595,050.400	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	900,000.000	836,514.000	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	700,000.000	623,210.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	250,000.000	177,837.500	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	750,000.000	642,307.500	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	400,000.000	193,608.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	700,000.000	584,626.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	300,000.000	266,793.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	500,000.000	478,095.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	1,300,000.000	1,101,412.000	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	400,000.000	339,988.000	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	2,700,000.000	2,938,410.000	

		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	1,135,000.000	1,249,373.950	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	905,000.000	777,042.050	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,500,000.000	1,303,440.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	900,000.000	882,135.000	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	300,000.000	233,592.000	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	450,000.000	375,786.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	500,000.000	363,610.000	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,200,000.000	1,079,700.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,700,000.000	1,646,909.000	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	950,000.000	835,971.500	
		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,050,000.000	1,973,125.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	700,000.000	614,663.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	1,500,000.000	1,432,515.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	900,000.000	879,723.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,300,000.000	1,283,867.000	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	700,000.000	666,260.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	500,000.000	466,585.000	
		2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	1,400,000.000	1,365,280.000	
		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	500,000.000	439,340.000	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	500,000.000	444,690.000	

		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	250,000.000	179,727.500	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	500,000.000	383,775.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	500,000.000	429,765.000	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	600,000.000	534,654.000	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,000,000.000	954,200.000	
		1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	700,000.000	502,250.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,000,000.000	840,970.000	
		1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	400,000.000	242,076.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	200,000.000	139,774.000	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	700,000.000	441,091.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	450,000.000	273,618.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	300,000.000	248,394.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	300,000.000	244,692.000	
		0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	500,000.000	437,385.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	200,000.000	131,816.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	500,000.000	485,915.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	700,000.000	639,849.000	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	400,000.000	365,084.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	1,200,000.000	1,212,156.000	
		4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	600,000.000	629,280.000	

		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	1,500,000.000	1,527,870.000	
		3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,300,000.000	1,302,080.000	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	500,000.000	510,855.000	
		3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260415	1,000,000.000	1,006,820.000	
		3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	500,000.000	504,525.000	
		4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	500,000.000	521,240.000	
		3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,200,000.000	1,193,676.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	1,840,000.000	2,004,882.400	
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	1,488,000.000	1,709,503.680	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,300,000.000	1,489,332.000	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	1,650,000.000	1,807,261.500	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	1,270,000.000	1,275,207.000	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,140,000.000	1,245,461.400	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	1,000,000.000	1,017,760.000	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,080,000.000	2,191,238.400	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	525,000.000	559,188.000	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,370,000.000	1,373,466.100	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,000,000.000	1,095,060.000	

		5% Belgium Government Bond 20350328	750,000.000	879,427.500	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	965,000.000	1,077,229.500	
		4.5% Belgium Government Bond 20260328	700,000.000	717,528.000	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	390,000.000	409,737.900	
		3% Belgium Government Bond 20340622	300,000.000	299,469.000	
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	680,000.000	669,099.600	
		2% IRISH TREASURY 20450218	510,000.000	426,599.700	
		1% IRISH TREASURY 20260515	520,000.000	501,987.200	
		1.7% IRISH TREASURY 20370515	500,000.000	430,985.000	
		1.3% IRISH TREASURY 20330515	150,000.000	132,648.000	
		1.35% IRISH TREASURY 20310318	1,100,000.000	1,008,403.000	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	300,000.000	278,793.000	
		1.5% IRISH TREASURY 20500515	100,000.000	71,713.000	
		IRISH TREASURY 20311018	200,000.000	164,098.000	
		0.55% IRISH TREASURY 20410422	200,000.000	134,172.000	
		6.25% Austria Government Bond 20270715	380,000.000	417,988.600	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	300,000.000	333,810.000	
		4.85% Austria Government Bond 20260315	700,000.000	722,932.000	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	170,000.000	195,107.300	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	500,000.000	501,200.000	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	630,000.000	599,545.800	

		4% Finland Government Bond 20250704	200,000.000	201,640.000	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	120,000.000	119,918.400	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,420,000.000	1,607,056.600	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	910,000.000	858,867.100	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,400,000.000	1,371,818.000	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,100,000.000	961,774.000	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,480,000.000	1,345,956.400	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	1,000,000.000	961,580.000	
		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	2,100,000.000	2,016,105.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	820,000.000	765,584.800	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	1,170,000.000	1,114,799.400	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	650,000.000	614,068.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,050,000.000	873,621.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	800,000.000	747,128.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	400,000.000	344,936.000	
		0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	900,000.000	796,239.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,000,000.000	869,160.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	100,000.000	54,444.000	
		1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	1,800,000.000	1,620,630.000	
		1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	150,000.000	105,294.000	

		0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	800,000.000	657,448.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	200,000.000	98,212.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	2,000,000.000	1,800,020.000	
		0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	900,000.000	652,113.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	500,000.000	326,420.000	
		0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	1,000,000.000	835,020.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	1,400,000.000	1,258,082.000	
		2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	600,000.000	574,182.000	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	600,000.000	576,960.000	
		3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	1,500,000.000	1,495,050.000	
		2.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260531	1,500,000.000	1,491,765.000	
		3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20340430	1,000,000.000	996,980.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	680,000.000	807,472.800	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	900,000.000	969,327.000	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	800,000.000	922,600.000	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	500,000.000	566,965.000	
		4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	500,000.000	507,185.000	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,000,000.000	1,057,330.000	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	490,000.000	589,416.100	
	ユーロ 小計			226,728,003.580 (38,235,410,524)	

国債証券 合計		122,603,987,234 [122,603,987,234]	
合計		122,603,987,234 [122,603,987,234]	

（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	147銘柄	100%	46.5%
イギリス・ポンド	国債証券	51銘柄	100%	5.4%
イスラエル・シュケル	国債証券	7銘柄	100%	0.3%
オーストラリア・ドル	国債証券	18銘柄	100%	1.3%
オフショア・人民元	国債証券	64銘柄	100%	10.0%
カナダ・ドル	国債証券	23銘柄	100%	2.1%
シンガポール・ドル	国債証券	13銘柄	100%	0.5%
スウェーデン・クローナ	国債証券	6銘柄	100%	0.2%
デンマーク・クローネ	国債証券	6銘柄	100%	0.3%
ニュージーランド・ドル	国債証券	7銘柄	100%	0.2%
ノルウェー・クローネ	国債証券	7銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券	11銘柄	100%	0.5%
マレーシア・リンギット	国債証券	16銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	10銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券	268銘柄	100%	31.2%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2023年6月16日から2024年6月17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】

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	64,178,611	91,698,982
親投資信託受益証券	10,236,855,024	18,482,881,094
未収入金	7,938,908	-
流動資産合計	10,308,972,543	18,574,580,076
資産合計	10,308,972,543	18,574,580,076
負債の部		
流動負債		
未払解約金	22,907,366	5,295,506
未払受託者報酬	983,350	1,678,711
未払委託者報酬	17,701,175	30,217,594
その他未払費用	368,695	629,445
流動負債合計	41,960,586	37,821,256
負債合計	41,960,586	37,821,256
純資産の部		
元本等		
元本	※1 8,196,839,818	※1 12,917,741,944
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,070,172,139	5,619,016,876
（分配準備積立金）	624,246,638	2,293,470,531
元本等合計	10,267,011,957	18,536,758,820
純資産合計	10,267,011,957	18,536,758,820
負債純資産合計	10,308,972,543	18,574,580,076

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期 自　2022年6月16日 至　2023年6月15日	第8期 自　2023年6月16日 至　2024年6月17日
営業収益		
受取利息	13	16,297
有価証券売買等損益	412,520,152	1,961,420,603
営業収益合計	412,520,165	1,961,436,900
営業費用		
支払利息	14,655	10,675
受託者報酬	1,891,193	2,952,141
委託者報酬	34,043,038	53,140,220
その他費用	709,066	1,106,917
営業費用合計	36,657,952	57,209,953
営業利益又は営業損失（△）	375,862,213	1,904,226,947
経常利益又は経常損失（△）	375,862,213	1,904,226,947
当期純利益又は当期純損失（△）	375,862,213	1,904,226,947
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（△）	17,014,445	124,034,201
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,283,536,886	2,070,172,139
剰余金増加額又は欠損金減少額	635,483,289	2,274,249,089
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	635,483,289	2,274,249,089
剰余金減少額又は欠損金増加額	207,695,804	505,597,098
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	207,695,804	505,597,098
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,070,172,139	5,619,016,876

(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8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日
1．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2024年6月15日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2024年6月17日としております。このため、当計算期間は368日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	第7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
1．　※1 期首元本額	6,337,300,973円	8,196,839,818円
期中追加設定元本額	2,866,101,938円	6,628,810,445円
期中一部解約元本額	1,006,563,093円	1,907,908,319円
2．　計算期間末日における受益権の総数	8,196,839,818口	12,917,741,944口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第7期 自2022年6月16日 至2023年6月15日	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日

※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（277,543,800円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,445,939,213円）及び分配準備積立金（346,702,838円）より分配対象額は2,070,185,851円（1万口当たり2,525.59円）であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（6,832円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（1,780,174,633円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,325,546,345円）及び分配準備積立金（513,289,066円）より分配対象額は5,619,016,876円（1万口当たり4,349.84円）であり、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	第8期 2024年6月17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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17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	400,895,911	1,906,346,967
合計	400,895,911	1,906,346,967

(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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17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8期 自2023年6月16日 至2024年6月17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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2526円 (12,526円)	1.4350円 (14,350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	4,952,142,404	18,482,881,094	
親投資信託受益証券 合計			18,482,881,094	
合計			18,482,881,094	

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

	2023年6月15日現在 金 額（円）	2024年6月17日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		

預金	2,713,982,921	2,275,059,100
コール・ローン	1,211,121,119	1,934,895,701
国債証券	251,640,652,633	316,701,120,710
派生商品評価勘定	9,786,277	7,054,649
未収入金	798,837	336,112
未収利息	1,628,987,291	2,345,610,298
前払費用	85,322,411	158,918,326
流動資産合計	257,290,651,489	323,422,994,896
資産合計	257,290,651,489	323,422,994,896
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,376,687	12,155,750
未払金	116,907	62,857
未払解約金	236,595,318	50,784,648
流動負債合計	238,088,912	63,003,255
負債合計	238,088,912	63,003,255
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	79,274,139,359	86,637,182,960
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	177,778,423,218	236,722,808,681
元本等合計	257,052,562,577	323,359,991,641
純資産合計	257,052,562,577	323,359,991,641
負債純資産合計	257,290,651,489	323,422,994,896

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2024年6月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023年6月15日現在	2024年6月17日現在
1．　※1 期首	2022年6月16日	2023年6月16日
期首元本額	75,409,227,916円	79,274,139,359円
期中追加設定元本額	10,151,638,189円	14,136,210,121円
期中一部解約元本額	6,286,726,746円	6,773,166,520円
期末元本額の内訳		
ファンド名		

ダイワ外国債券インデックスＶＡ	419,615,070円	353,386,145円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	7,806,699円	4,950,980円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	47,693,634円	32,397,835円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	16,653,868円	14,812,611円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	217,000,520円	185,995,811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）	460,215,414円	731,151,994円
外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	-円	590,336,025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）	754,198,135円	956,757,996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）	3,156,989,769円	4,952,142,404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）	856,969,643円	1,134,690,990円
Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス	1,576,951円	1,759,500円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	17,803,370円	21,281,066円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	2,200,419,902円	2,085,512,930円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	2,096,998,681円	2,512,941,378円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	414,955,962円	596,873,006円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	15,487円	1,954,816円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	50,637,770,780円	51,717,310,895円
ダイワ・ライフ・バランス３０	1,136,510,420円	1,176,149,491円
ダイワ・ライフ・バランス５０	748,096,200円	875,664,748円
ダイワ・ライフ・バランス７０	536,355,138円	712,618,374円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	678,972,136円	712,072,206円

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	528,662,958円	579,249,593円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	207,883,088円	236,172,504円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	35,036,632円	34,551,660円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	17,108,723円	21,468,866円
ダイワつみたてインデックス外国債券	1,616,647,733円	2,292,449,559円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	4,455,883円	4,872,476円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	1,664,065円	2,179,468円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	3,266,544円	3,623,955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）	500,189,943円	1,855,240,936円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	112,079,398円	90,058,800円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	29,164,889円	26,205,450円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	3,120,655,285円	2,623,544,925円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	196,547,666円	169,056,701円
スタイル9（4資産分散・保守型）	-円	85,432円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	-円	1,110,127円
スタイル9（4資産分散・積極型）	-円	989,244円
スタイル9（6資産分散・保守型）	-円	27,564円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	-円	728,074円
スタイル9（6資産分散・積極型）	-円	279,364円
スタイル9（8資産分散・保守型）	-円	36,200円

スタイル9（8資産分散・バランス型）	-円	724,764円
スタイル9（8資産分散・積極型）	-円	789,451円
ダイワ・インデックスセレクト外国債券	157,087,189円	139,355,079円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	59,842,527円	69,704,013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）	2,432,461,646円	3,116,465,492円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,738,328,232円	5,895,512,178円
ダイワライフスタイル２５	28,659,043円	25,294,949円
ダイワライフスタイル５０	61,249,567円	59,367,643円
ダイワライフスタイル７５	16,530,569円	17,277,292円
計	79,274,139,359円	86,637,182,960円
2. 期末日における受益権の総数	79,274,139,359口	86,637,182,960口

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年6月16日 至2024年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年6月17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	2023年6月15日現在	2024年6月17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	△4,615,955,011	3,710,370,172
合計	△4,615,955,011	3,710,370,172

（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	2023年6月15日現在				2024年6月17日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								

為替予約取引								
買建	1,210,552,044	-	1,218,961,634	8,409,590	1,848,810,519	-	1,843,709,418	△5,101,101
アメリカ・ドル	161,165,540	-	161,488,681	323,141	547,073,296	-	551,559,227	4,485,931
イギリス・ポンド	10,810,273	-	10,809,474	△799	17,396,464	-	17,373,673	△22,791
オフショア・人民元	723,623,800	-	722,258,500	△1,365,300	736,173,859	-	738,429,295	2,255,436
カナダ・ドル	-	-	-	-	168,635,030	-	168,197,400	△437,630
シンガポール・ドル	27,108,708	-	27,545,284	436,576	51,914,150	-	52,071,040	156,890
ニュージーランド・ドル	-	-	-	-	15,374,640	-	15,424,320	49,680
ノルウェー・クローネ	-	-	-	-	12,131,042	-	11,993,476	△137,566
メキシコ・ペソ	195,982,580	-	205,009,140	9,026,560	148,292,739	-	137,439,276	△10,853,463
ユーロ	91,861,143	-	91,850,555	△10,588	151,819,299	-	151,221,711	△597,588
合計	1,210,552,044	-	1,218,961,634	8,409,590	1,848,810,519	-	1,843,709,418	△5,101,101

（注）　1．時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2．換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2023年6月15日現在	2024年6月17日現在

１口当たり純資産額	3.2426円	3.7323円
（1万口当たり純資産額）	(32,426円)	(37,323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	873,502.200	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	748,973.420	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	767,542.140	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	789,077.100	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,564,801.790	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,216,877.760	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	916,174.490	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	557,694.120	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	534,424.680	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	964,565.990	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,118,892.520	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,087,242.000	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,222,874.400	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,048,703.200	

		4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	1,692,011.300	
		3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,034,082.530	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,454,471.590	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,315,859.820	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,368,276.000	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,401,965.890	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,223,655.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,365,283.830	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,112,206.590	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	4,123,283.440	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,279,990.100	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,177,505.460	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,828,242.840	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	2,859,077.980	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	1,882,555.840	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	2,933,771.980	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	2,837,931.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,579,291.590	
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,196,937.300	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	1,876,090.370	

		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	1,835,000.000	1,463,192.300	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,550,954.080	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,458,954.620	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	5,631,453.600	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	523,773.200	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,620,753.600	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	2,281,292.640	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,297,799.090	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	2,039,391.660	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,055,534.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	1,908,748.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	4,992,123.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	772,380.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,436,778.800	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	1,848,774.550	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,038,720.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,574,680.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,525,822.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,450,000.000	1,839,117.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,131,060.000	

		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	1,873,225.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	6,006,274.500	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,351,820.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	3,046,080.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	6,162,650.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,476,550.500	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	2,931,330.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,336,190.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,519,521.200	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,442,750.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,506,616.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,440,175.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,437,200.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,527,987.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,528,525.200	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	2,916,540.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,500,000.000	1,451,190.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,145,722.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,415,025.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	3,674,225.000	

		2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,407,225.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,393,925.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	3,546,880.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,579,693.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,683,492.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,858,070.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,650,480.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,361,800.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,142,204.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	2,200,000.000	1,471,404.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,611,420.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,341,400.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,802,630.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	2,850,000.000	2,515,324.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	3,091,365.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,865,460.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,336,125.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,319,700.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	6,021,860.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	3,396,708.000	

		1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	274,569.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,440,496.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,534,656.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,146,968.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	1,000,000.000	515,070.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	3,162,850.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,121,545.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,865,840.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,500,000.000	3,332,875.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,114,020.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,226,192.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,456,560.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,416,200.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	8,200,000.000	4,355,594.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	5,000,000.000	3,132,000.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,095,295.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	4,000,000.000	3,768,280.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,513,320.000	
		0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,308,235.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	7,988,470.000	

0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,755,920.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,517,160.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	3,861,244.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,312,960.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,781,046.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,404,950.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,392,750.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	5,000,000.000	4,672,050.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,162,030.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	3,572,450.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	8,829,533.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,656,700.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,454,150.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,305,040.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,792,280.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,572,320.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,728,960.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	7,367,421.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,184,010.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,347,380.000	

		2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	4,363,456.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	2,824,084.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	6,000,000.000	5,337,180.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	4,079,768.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,437,200.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,638,350.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,437,142.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	6,900,000.000	4,296,699.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	5,700,000.000	3,873,435.000	
		0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,519,400.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,381,800.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,395,000.000	
		0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,600,000.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,408,450.000	
		0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,222,800.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	10,000,000.000	8,212,500.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,600,000.000	3,977,490.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	2,821,920.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,310,300.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	7,000,000.000	6,464,430.000	

		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,697,800.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	4,975,544.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	4,000,000.000	3,527,160.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,691,560.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	5,400,000.000	4,582,818.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,850,736.000	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	6,900,000.000	4,557,450.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	1,868,150.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,496,250.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	5,000,000.000	4,670,300.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,757,630.000	
		2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,746,250.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	9,300,000.000	8,471,277.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	3,796,350.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,277,985.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,819,700.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,863,410.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	6,000,000.000	5,601,900.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,899,920.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250615	4,000,000.000	3,915,360.000	

		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,820,000.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,900,550.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250715	3,000,000.000	2,937,300.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	3,872,686.400	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250815	4,500,000.000	4,405,950.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	9,500,000.000	8,550,095.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	5,200,000.000	4,051,008.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	2,000,000.000	1,729,680.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,112,435.200	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,404,675.000	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,319,120.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250915	2,300,000.000	2,259,474.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,456,825.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	3,500,000.000	3,470,670.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251015	3,400,000.000	3,370,046.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031	3,000,000.000	2,975,070.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	9,700,000.000	9,643,352.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251115	1,500,000.000	1,492,110.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	3,700,000.000	3,484,697.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	2,966,130.000	

		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	2,500,000.000	2,456,150.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	3,000,000.000	2,952,240.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20421115	2,500,000.000	2,355,750.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251215	3,500,000.000	3,456,775.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260115	1,500,000.000	1,478,220.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	5,000,000.000	4,911,300.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271231	1,500,000.000	1,475,970.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	5,000,000.000	4,818,350.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260215	3,500,000.000	3,455,760.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	8,000,000.000	7,586,400.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	2,500,000.000	2,310,250.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	4,500,000.000	3,958,200.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131	3,700,000.000	3,594,476.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300228	4,000,000.000	3,953,880.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280229	3,000,000.000	2,964,060.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260315	2,500,000.000	2,493,825.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,800,000.000	1,744,578.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280331	3,700,000.000	3,608,795.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260415	2,000,000.000	1,965,500.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	3,000,000.000	2,887,140.000	

		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280430	2,000,000.000	1,941,360.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260515	4,000,000.000	3,921,840.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	7,800,000.000	7,315,776.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	5,600,000.000	4,926,320.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	2,500,000.000	2,307,300.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250531	3,600,000.000	3,571,236.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280531	3,700,000.000	3,607,278.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531	1,500,000.000	1,462,755.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260615	3,000,000.000	2,968,800.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250630	2,500,000.000	2,489,500.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	3,000,000.000	2,924,640.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630	3,500,000.000	3,460,065.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260715	5,000,000.000	4,984,350.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250731	4,000,000.000	3,989,040.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	3,500,000.000	3,476,725.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815	11,000,000.000	10,713,120.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260815	6,000,000.000	5,967,840.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815	5,000,000.000	4,812,500.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430815	2,300,000.000	2,270,606.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	3,000,000.000	2,964,060.000	

		5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250831	3,900,000.000	3,899,922.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300831	3,100,000.000	3,083,508.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	3,000,000.000	3,008,610.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260915	3,000,000.000	3,000,570.000	
		5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20250930	1,000,000.000	1,000,480.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930	1,500,000.000	1,532,955.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	4,200,000.000	4,253,382.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261015	1,000,000.000	1,000,800.000	
		5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251031	1,000,000.000	1,000,910.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	6,139,080.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20331115	10,000,000.000	10,217,900.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261115	3,800,000.000	3,805,320.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20431115	2,300,000.000	2,383,375.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301031	3,100,000.000	3,212,127.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20531115	5,300,000.000	5,664,746.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251130	3,500,000.000	3,499,930.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301130	3,000,000.000	3,026,190.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	4,000,000.000	4,017,080.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261215	2,000,000.000	1,992,340.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310131	2,000,000.000	1,975,540.000	

		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301231	4,500,000.000	4,382,010.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20251231	1,000,000.000	991,090.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260131	6,000,000.000	5,946,900.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,800,000.000	4,747,200.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	1,000,000.000	978,690.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270115	1,000,000.000	987,320.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340215	8,200,000.000	8,063,470.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270215	4,000,000.000	3,962,400.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540215	4,400,000.000	4,330,524.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440215	3,000,000.000	3,008,880.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310228	3,600,000.000	3,608,136.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260228	5,000,000.000	4,986,700.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,200,000.000	5,201,092.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270315	5,000,000.000	4,970,600.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	5,000,000.000	4,973,000.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310331	2,000,000.000	1,990,140.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260331	5,200,000.000	5,177,432.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270415	5,000,000.000	5,004,650.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260430	2,500,000.000	2,506,525.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340515	2,200,000.000	2,229,370.000	

	4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270515	4,000,000.000	4,004,520.000	
	4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	2,500,000.000	2,541,000.000	
	4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310430	1,600,000.000	1,639,744.000	
	4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540515	1,300,000.000	1,361,750.000	
	4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440515	1,000,000.000	1,021,710.000	
アメリカ・ドル 小計			955,694,465.400 (150,550,549,134)	
イギリス・ポンド	2% United Kingdom Gilt 20250907	921,000.000	892,495.050	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,282,000.000	824,390.100	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,386,095.100	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	1,007,265.600	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,091,661.500	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	974,286.800	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,410,000.000	1,296,805.200	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,364,445.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,740,000.000	814,842.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	719,030.400	
	1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	450,457.500	
	0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,500,000.000	1,284,630.000	
	0.625% United Kingdom Gilt 20250607	1,900,000.000	1,828,465.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	740,275.200	

		0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,300,000.000	1,045,759.000	
		0.5% United Kingdom Gilt 20611022	1,700,000.000	522,359.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,406,325.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,393,504.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	451,605.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20350731	3,700,000.000	2,559,438.000	
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	1,937,950.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20460131	2,000,000.000	1,010,260.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20261022	3,500,000.000	3,203,515.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,800,000.000	892,980.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	2,100,000.000	1,380,981.000	
		0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	2,700,000.000	2,311,659.000	
		0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	2,300,000.000	1,753,497.000	
		1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	1,300,000.000	672,542.000	
		1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	3,600,000.000	2,908,980.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	820,000.000	305,810.800	
		4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	2,000,000.000	1,989,400.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	1,000,000.000	947,300.000	
		3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	3,600,000.000	3,407,508.000	
		3.5% UNITED KINGDOM GILT 20251022	400,000.000	393,828.000	

		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	2,500,000.000	2,156,250.000	
		4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	1,500,000.000	1,368,750.000	
		4.5% UNITED KINGDOM GILT 20280607	2,200,000.000	2,232,164.000	
		4.625% UNITED KINGDOM GILT 20340131	1,000,000.000	1,045,450.000	
		4.75% UNITED KINGDOM GILT 20431022	1,000,000.000	1,033,100.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20270307	1,900,000.000	1,871,785.000	
		4.375% UNITED KINGDOM GILT 20540731	850,000.000	828,155.000	
		4% UNITED KINGDOM GILT 20311022	500,000.000	500,830.000	
		4.125% UNITED KINGDOM GILT 20290722	1,300,000.000	1,305,460.000	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,028,051.700	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,040,000.000	1,063,556.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,362,000.000	1,375,483.800	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	1,423,764.400	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	1,635,068.400	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,316,905.960	
		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,239,638.400	
		4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	2,132,081.600	
		4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,600,000.000	1,676,064.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,289,212.850	
		4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,846,000.000	1,827,724.600	

	4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,614,865.200	
	4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	1,078,131.160	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,552,840.360	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,365,232.320	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,866,000.000	1,569,679.200	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	1,149,229.620	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,524,000.000	1,321,460.400	
イギリス・ポンド 小計			83,171,279.220 (16,623,443,578)	
イスラエル・シュケル	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	1,871,586.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	2,200,000.000	2,275,262.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,230,448.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,684,260.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	1,895,304.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,091,748.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	1,954,896.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,132,387.000	
	0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	187,172.000	
	1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	2,300,000.000	1,774,542.000	
	2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129	820,000.000	511,458.600	
	3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290228	3,000,000.000	2,886,210.000	

	4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20350330	1,000,000.000	921,250.000	
	3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20270930	2,500,000.000	2,438,950.000	
イスラエル・シュケル 小計			22,855,473.600 (967,945,306)	
オーストラリア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,038,864.230	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,318,267.940	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	2,258,000.000	2,326,959.320	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	1,748,000.000	1,758,470.520	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,061,367.930	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,145,428.660	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	699,351.840	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,615,536.560	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,111,348.760	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	983,295.760	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,434,825.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,795,975.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,658,394.900	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,115,739.100	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,413,062.800	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	2,700,000.000	2,192,400.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,664,800.000	

	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	796,516.000	
	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,600,000.000	1,516,000.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,020,800.000	
	0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,113,816.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,600,000.000	1,336,256.000	
	3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,700,000.000	1,554,089.000	
	3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	1,200,000.000	1,163,892.000	
	3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221	1,100,000.000	1,040,358.000	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20540621	900,000.000	936,846.000	
オーストラリア・ドル 小計			38,812,661.320 (4,043,114,930)	
オフショア・人民元	3.22% China Government Bond 20251206	5,200,000.000	5,321,316.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,280,900.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,315,450.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,153,100.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,386,400.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	8,000,000.000	8,443,440.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,360,100.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	11,500,000.000	11,824,300.000	
	3.02% China Government Bond 20251022	18,000,000.000	18,331,200.000	
	3.28% China Government Bond 20271203	9,000,000.000	9,433,620.000	

		3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	13,389,000.000	
		3.03% China Government Bond 20260311	7,000,000.000	7,157,500.000	
		3.81% China Government Bond 20500914	7,300,000.000	9,023,238.000	
		3.01% China Government Bond 20280513	7,000,000.000	7,276,150.000	
		3.72% China Government Bond 20510412	14,000,000.000	17,112,900.000	
		3.02% China Government Bond 20310527	15,800,000.000	16,650,672.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,582,530.000	
		2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,098,800.000	
		3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,818,725.000	
		3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,367,000.000	
		3.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20250607	17,000,000.000	17,374,850.000	
		3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,811,445.000	
		4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	4,500,000.000	5,747,715.000	
		3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	6,300,000.000	7,809,984.000	
		3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	12,000,000.000	13,849,920.000	
		2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,698,935.000	
		3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	11,500,000.000	13,658,320.000	
		2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	16,000,000.000	16,731,840.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	17,000,000.000	17,205,190.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	7,200,000.000	7,451,424.000	

		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	15,493,200.000	
		2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	15,000,000.000	15,245,550.000	
		3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	6,315,045.000	
		2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	5,176,950.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	4,000,000.000	4,124,960.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	19,000,000.000	19,577,790.000	
		2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20250825	25,000,000.000	25,145,000.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	32,000,000.000	32,761,920.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	9,739,590.000	
		2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	17,200,000.000	17,458,688.000	
		3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	14,000,000.000	15,541,260.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	5,500,000.000	5,717,415.000	
		2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20251125	18,000,000.000	18,146,160.000	
		2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	19,000,000.000	19,641,060.000	
		2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	20,000,000.000	20,442,400.000	
		2.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20260215	38,000,000.000	38,444,600.000	
		2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	15,000,000.000	15,704,100.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	15,000,000.000	15,527,850.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	25,000,000.000	25,541,250.000	
		3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	23,000,000.000	26,106,840.000	

		2.3% CHINA GOVERNMENT BOND 20260515	7,000,000.000	7,069,580.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	40,000,000.000	41,179,600.000	
		2% CHINA GOVERNMENT BOND 20250615	9,000,000.000	9,028,350.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	33,000,000.000	33,814,440.000	
		2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	35,000,000.000	35,471,800.000	
		2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	40,000,000.000	40,678,400.000	
		2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	30,000,000.000	30,213,900.000	
		2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925	25,000,000.000	25,422,250.000	
		2.22% CHINA GOVERNMENT BOND 20250925	30,000,000.000	30,199,800.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	20,000,000.000	20,471,800.000	
		3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	24,000,000.000	26,321,520.000	
		2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	20,000,000.000	20,413,400.000	
		2.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20261115	60,000,000.000	60,744,000.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	36,000,000.000	37,081,440.000	
		2.33% CHINA GOVERNMENT BOND 20251215	18,000,000.000	18,171,540.000	
		2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225	50,000,000.000	51,039,000.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20290115	58,000,000.000	58,805,620.000	
		2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20270225	35,000,000.000	35,146,300.000	
		2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225	8,000,000.000	8,031,520.000	
		1.99% CHINA GOVERNMENT BOND 20260315	26,000,000.000	26,111,020.000	

	2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325	9,000,000.000	9,044,640.000	
	2.05% CHINA GOVERNMENT BOND 20290415	73,000,000.000	73,011,680.000	
	1.85% CHINA GOVERNMENT BOND 20270515	40,000,000.000	39,956,400.000	
	2.49% CHINA GOVERNMENT BOND 20440525	25,000,000.000	25,230,250.000	
	2.27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525	5,000,000.000	4,997,300.000	
オフショア・人民元 小計			1,416,173,142.000 (30,671,477,909)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	605,000.000	548,886.250	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,095,681.290	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,330,425.190	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,192,368.760	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	995,379.990	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	994,346.700	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,225,988.890	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,134,602.440	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	928,515.180	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,155,357.600	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	618,897.500	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,876,140.400	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,167,381.400	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,079,228.500	

		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,770,007.200	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,683,300.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	1,977,024.000	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	283,068.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	3,031,984.000	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	2,650,000.000	1,910,915.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	2,200,000.000	2,070,772.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,100,000.000	1,857,723.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,368,555.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	95,404.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	400,000.000	391,728.000	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20251001	1,000,000.000	986,470.000	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	2,270,000.000	2,143,810.700	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	1,300,000.000	1,304,979.000	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260401	600,000.000	591,402.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,700,000.000	1,632,493.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201	900,000.000	818,523.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280901	1,200,000.000	1,195,632.000	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250801	500,000.000	496,260.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20331201	1,000,000.000	998,110.000	

	4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20251101	2,000,000.000	2,011,280.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290301	300,000.000	308,982.000	
	4.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260201	2,000,000.000	2,017,180.000	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340601	1,700,000.000	1,660,373.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260501	1,000,000.000	1,003,000.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340301	400,000.000	408,180.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290901	800,000.000	807,984.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260801	700,000.000	703,857.000	
カナダ・ドル 小計			54,872,195.990 (6,293,292,159)	
シンガポール・ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	776,940.800	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	795,247.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	379,400.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	577,088.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	616,375.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	518,131.200	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	644,951.840	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	439,290.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	681,750.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	538,615.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	316,239.000	

	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	424,170.000	
	0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	750,000.000	720,150.000	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	541,920.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	500,000.000	387,370.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	190,626.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	230,520.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	620,000.000	609,460.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	100,000.000	98,940.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20280801	400,000.000	395,360.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20290401	600,000.000	595,548.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20340501	300,000.000	305,040.000	
シンガポール・ドル 小計			10,783,131.840 (1,255,911,366)	
スウェーデン・クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	3,655,000.000	4,238,995.900	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	6,942,701.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,778,360.500	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,327,522.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	5,966,720.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,368,600.000	
	1.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20331111	2,000,000.000	1,939,500.000	
スウェーデン・クローナ 小計			31,562,399.400 (472,489,119)	

デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	16,958,367.360	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	5,922,985.390	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,779,057.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	4,090,000.000	3,716,746.600	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	1,919,645.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	422,065.000	
	2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20331115	2,000,000.000	1,974,400.000	
デンマーク・クローネ 小計			35,693,266.350 (806,667,819)	
ニュージーランド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	600,000.000	598,530.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	1,500,000.000	1,384,665.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	396,248.300	
	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	600,000.000	562,116.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	530,000.000	436,508.000	
	1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	224,427.000	
	0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	1,100,000.000	934,593.000	
	0.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20260515	500,000.000	461,470.000	
	2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	440,000.000	366,159.200	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	258,612.800	
	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20340515	200,000.000	194,438.000	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20300515	500,000.000	500,770.000	

	5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20540515	700,000.000	708,323.000	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20350515	500,000.000	493,400.000	
ニュージーランド・ドル 小計			7,520,260.300 (726,908,361)	
ノルウェー・クローネ	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,175,991.400	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,245,567.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,316,985.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,543,886.500	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,256,016.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	3,013,780.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	1,700,000.000	1,544,807.000	
	3.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20421006	3,500,000.000	3,563,770.000	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20330815	1,500,000.000	1,444,875.000	
	3.625% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20340413	3,500,000.000	3,544,975.000	
ノルウェー・クローネ 小計			32,650,652.900 (482,250,143)	
ポーランド・ズロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,144,625.070	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	2,916,875.500	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,221,690.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,316,810.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	1,963,280.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,800,000.000	1,362,204.000	

	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	500,000.000	479,110.000	
	7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	5,000,000.000	5,363,850.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20251025	1,500,000.000	1,404,840.000	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	5,000,000.000	5,100,400.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20260425	2,000,000.000	1,826,500.000	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725	2,000,000.000	1,927,600.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	833,128.070	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,321,901.500	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	4,512,493.900	
ポーランド・ズロチ 小計			41,695,308.040 (1,606,082,418)	
マレーシア・リンギット	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,370,104.940	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	3,378,000.000	3,512,005.260	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,539,541.180	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,333,475.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	737,827.540	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,424,574.100	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,893,638.300	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,432,288.000	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,750,461.750	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,252,586.200	

	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,002,288.900	
	3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,566,368.000	
	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,202,399.800	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,097,576.000	
	4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,272,276.000	
	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	2,000,000.000	2,187,260.000	
	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	656,058.000	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,333,585.100	
	4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,328,520.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	2,000,000.000	1,992,420.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,685,582.500	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,587,168.500	
	2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,674,594.000	
	3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	1,400,000.000	1,374,296.000	
	4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	1,900,000.000	2,038,928.000	
	4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	518,720.000	
	4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	1,400,000.000	1,452,528.000	
	3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	1,000,000.000	997,160.000	
	4.054% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390418	1,200,000.000	1,205,136.000	
	4.18% MALAYSIAN GOVERNMENT 20440516	800,000.000	804,288.000	

マレーシア・リンギット 小計			47,223,655.070 (1,575,026,956)	
メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	37,290,000.000	34,410,093.300	
	8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	17,235,321.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	6,208,510.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	14,000,000.000	11,165,840.000	
	7.5% MEXICAN BONOS 20330526	30,000,000.000	25,512,600.000	
	7% MEXICAN BONOS 20260903	3,000,000.000	2,786,280.000	
	8% MEXICAN BONOS 20350524	5,000,000.000	4,337,850.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20290301	10,000,000.000	9,351,700.000	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	25,867,882.880	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	8,819,691.120	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	27,679,182.720	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	16,563,047.220	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	44,515,000.000	39,309,415.900	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	29,654,000.000	23,748,702.440	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	6,741,755.040	
メキシコ・ペソ 小計			259,737,871.620 (2,210,603,052)	
ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	317,539.040	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	271,347.030	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	775,932.360	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	259,711.200	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	743,368.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	397,121.800	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	454,375.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	444,485.000	

		0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	220,521.600	
		0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	254,892.000	
		Finland Government Bond 20300915	500,000.000	420,180.000	
		0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	185,432.000	
		0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	494,136.000	
		FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	187,450.000	
		0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	283,284.000	
		1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	800,000.000	718,232.000	
		1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	259,119.000	
		2.75% FINLAND GOVERNMENT BOND 20380415	400,000.000	382,828.000	
		3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20330915	300,000.000	300,879.000	
		2.875% FINLAND GOVERNMENT BOND 20290415	1,000,000.000	1,002,240.000	
		2.95% FINLAND GOVERNMENT BOND 20550415	400,000.000	385,748.000	
		3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20340915	100,000.000	100,007.000	
		1.2% Austria Government Bond 20251020	500,000.000	487,830.000	
		0.75% Austria Government Bond 20261020	2,126,000.000	2,026,630.760	
		1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	579,015.360	
		1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	145,999.200	
		0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,200,550.400	
		2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	407,959.200	

		0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,116,060.000	
		0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,154,611.200	
		Austria Government Bond 20300220	980,000.000	837,988.200	
		0.75% Austria Government Bond 20510320	1,200,000.000	696,384.000	
		Austria Government Bond 20401020	400,000.000	242,172.000	
		0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	160,888.000	
		Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	994,020.000	
		0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	428,226.000	
		0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	136,014.000	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	1,800,000.000	1,599,246.000	
		0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	1,500,000.000	1,297,320.000	
		1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	300,000.000	234,525.000	
		2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	300,000.000	294,735.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	800,000.000	797,624.000	
		3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20531020	300,000.000	299,541.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20290523	1,000,000.000	1,007,220.000	
		3.45% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20301020	800,000.000	828,936.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20340220	500,000.000	497,240.000	
		3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20390715	500,000.000	504,305.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,656,236.170	

		1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,566,406.520	
		1.9% Belgium Government Bond 20380622	758,000.000	643,693.600	
		1% Belgium Government Bond 20260622	1,463,000.000	1,406,674.500	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	886,996.880	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	547,022.800	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,035,309.000	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	443,891.400	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	488,292.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,379,203.600	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	566,221.500	
		0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,369,230.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	491,778.000	
		0.1% Belgium Government Bond 20300622	220,000.000	187,446.600	
		0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	551,406.200	
		Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,092,924.000	
		Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,300,480.000	
		0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	222,160.100	
		0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	1,400,000.000	1,146,040.000	
		1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	501,544.000	
		2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	400,000.000	375,564.000	

3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	1,500,000.000	1,504,335.000	
3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	600,000.000	577,338.000	
3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20430622	700,000.000	705,180.000	
2.85% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20341022	300,000.000	294,582.000	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20550622	1,000,000.000	994,200.000	
2.7% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20291022	100,000.000	99,454.000	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,301,029.950	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,392,901.600	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,035,234.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,341,785.300	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,623,675.760	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	2,791,355.000	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,271,000.000	3,809,668.280	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	1,609,530.500	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,245,501.140	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,974,000.000	2,172,880.500	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,608,000.000	1,595,940.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	2,663,059.950	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,083,722.960	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	4,168,000.000	4,012,783.680	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,287,456.600	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	2,200,000.000	2,072,180.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,105,333.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	3,470,000.000	2,680,748.500	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,774,714.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,761,996.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	4,700,000.000	4,274,932.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,667,630.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,850,000.000	1,499,784.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,539,685.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,100,000.000	1,621,620.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,841,540.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,567,764.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,045,896.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	900,000.000	775,008.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	1,400,000.000	1,051,666.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,805,780.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	581,361.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	3,600,000.000	3,066,444.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	596,638.000	

		GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	3,800,000.000	3,196,826.000	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	1,600,000.000	1,321,376.000	
		1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,581,902.000	
		1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	2,350,000.000	2,008,192.500	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	3,200,000.000	3,160,992.000	
		2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	2,400,000.000	2,397,240.000	
		2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,700,000.000	1,698,589.000	
		1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,000,000.000	856,280.000	
		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330815	2,400,000.000	2,452,440.000	
		2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,506,390.000	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340215	1,600,000.000	1,578,928.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20540815	1,100,000.000	1,097,382.000	
		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20410515	1,000,000.000	1,006,660.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	2,100,000.000	1,056,258.000	
		2.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250612	1,000,000.000	996,310.000	
		3.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250918	100,000.000	100,028.000	
		3.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20251212	300,000.000	300,624.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260319	800,000.000	795,464.000	
		2.9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260618	800,000.000	802,232.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,213,014.000	

		GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	96,229.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,094,994.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	2,800,000.000	2,637,292.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	3,100,000.000	2,888,363.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,890,890.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	414,511.400	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	100,000.000	99,170.000	
		2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20281019	100,000.000	100,013.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	100,000.000	98,792.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	100,000.000	98,823.000	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,132,992.500	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,695,408.610	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	3,227,000.000	3,856,523.160	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,038,279.760	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	1,912,863.960	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,553,118.300	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,605,472.920	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	1,882,896.540	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	3,673,417.920	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	1,899,000.000	1,885,536.090	

		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	3,088,000.000	2,994,371.840	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	4,971,219.880	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	3,101,000.000	3,006,295.460	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,659,558.400	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	4,387,000.000	4,180,196.820	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	3,358,796.540	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	892,007.440	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	3,790,273.500	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	2,095,963.500	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,214,156.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	1,941,009.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	4,966,812.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	5,150,000.000	4,334,034.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,508,014.500	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,850,000.000	1,893,967.500	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	5,350,000.000	4,762,249.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,593,184.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,435,691.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	2,849,940.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,428,878.000	

FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	5,000,000.000	4,149,800.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	1,480,000.000	550,012.400	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	1,900,000.000	1,104,698.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,697,250.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	3,100,000.000	2,864,400.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,600,000.000	1,316,536.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	3,600,000.000	2,845,152.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	2,200,000.000	1,692,350.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	4,300,000.000	3,974,361.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	4,800,000.000	4,431,504.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	866,970.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	2,100,000.000	1,889,181.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260924	3,200,000.000	3,163,040.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20330525	3,900,000.000	3,875,391.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290225	4,300,000.000	4,264,009.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20331125	2,700,000.000	2,783,079.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20490625	700,000.000	645,204.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270924	3,100,000.000	3,055,608.000	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550525	700,000.000	657,972.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300225	1,000,000.000	989,510.000	

		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,250,303.080	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	1,976,568.750	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	1,949,499.370	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,452,982.360	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	1,923,772.410	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,736,750.610	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,938,000.000	1,851,022.560	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,077,922.000	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,254,771.000	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,068,360.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	640,215.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,198,974.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	2,300,000.000	2,147,786.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,250,000.000	605,025.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,085,734.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	616,095.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	800,379.000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260115	100,000.000	95,619.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	600,000.000	508,344.000	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	1,200,000.000	1,019,964.000	

		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715	900,000.000	887,382.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300115	1,300,000.000	1,292,564.000	
		3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20440115	600,000.000	638,532.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20340715	500,000.000	490,520.000	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,208,013.000	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,633,041.840	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,295,642.490	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,440,443.360	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,794,402.400	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	2,891,000.000	2,833,613.650	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,253,610.400	
		1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,306,498.480	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	1,940,725.920	
		1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,016,469.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	703,948.960	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,349,625.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,462,842.700	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,650,000.000	1,451,950.500	
		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,598,750.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,141,517.000	

		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,005,521.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,492,548.500	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,530,764.500	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,208,786.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,450,000.000	1,353,096.500	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	2,900,000.000	2,844,465.000	
		2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,047,920.000	
		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,098,350.000	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,689,822.000	
		0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,208,201.000	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,114,310.500	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,151,325.000	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	1,500,000.000	1,474,950.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,719,060.000	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,871,289.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	2,041,270.000	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,622,140.000	
		1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,076,250.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,900,000.000	1,597,843.000	
		1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	726,228.000	

		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	489,209.000	
		0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,695,389.000	
		0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,465,470.000	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	2,200,000.000	1,386,286.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	1,035,914.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	279,698.400	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	714,288.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,573,162.000	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	3,100,000.000	2,888,425.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,000,000.000	815,640.000	
		0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	900,000.000	787,293.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	527,264.000	
		1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	282,363.000	
		1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,000,000.000	1,947,260.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	777,464.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,600,000.000	1,462,512.000	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	2,300,000.000	2,099,233.000	
		2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	200,000.000	195,616.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	500,000.000	505,065.000	
		3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260115	3,300,000.000	3,302,871.000	

		4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	2,800,000.000	2,936,640.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	300,000.000	305,574.000	
		3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,500,000.000	1,502,400.000	
		4.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20430901	100,000.000	102,220.000	
		4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	800,000.000	817,368.000	
		3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260415	500,000.000	503,410.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311030	900,000.000	923,553.000	
		3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	1,200,000.000	1,210,860.000	
		4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	2,100,000.000	2,189,208.000	
		3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280801	700,000.000	711,228.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260915	900,000.000	909,288.000	
		3.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250929	300,000.000	300,276.000	
		4.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340301	2,100,000.000	2,161,005.000	
		4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,537,155.000	
		4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290201	600,000.000	617,730.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270215	200,000.000	197,940.000	
		3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,000,000.000	994,730.000	
		4.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20391001	2,000,000.000	1,992,880.000	
		3.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260128	100,000.000	99,591.000	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290701	400,000.000	398,296.000	

		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340701	200,000.000	199,592.000	
		4.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20371030	50,000.000	50,076.000	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310715	1,000,000.000	989,010.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	3,254,000.000	3,545,590.940	
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,273,102.140	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,067,880.200	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,517,022.380	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,751,234.000	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	2,233,090.440	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,449,804.600	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,106,763.200	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,538,886.800	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	1,931,062.560	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,323,864.540	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	3,206,000.000	3,510,762.360	
		5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,232,573.280	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	1,790,545.200	
		4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,026,065.040	

		4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	838,991.400	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	675,542.230	
		3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	745,677.810	
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	945,595.170	
		2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	778,753.570	
		1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,035,831.280	
		1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	474,083.500	
		0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	747,720.000	
		1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	663,240.000	
		1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	687,547.500	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	882,844.500	
		1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	430,278.000	
		0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	269,055.500	
		0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	464,955.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	685,664.000	
		IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	656,392.000	
		0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	268,344.000	
		0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	82,186.000	
		3% IRISH TREASURY 20431018	200,000.000	197,078.000	
		2.6% IRISH TREASURY 20341018	300,000.000	292,824.000	
		6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	907,475.250	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,527,737.100	

		4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	903,665.000	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	387,919.220	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	724,735.200	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	733,729.860	
		4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	672,469.400	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	388,735.480	
		2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	378,176.260	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,001,347.960	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	1,936,698.120	
		2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,161,991.520	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	2,677,984.710	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,706,711.680	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	1,409,616.500	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,528,955.400	
		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,824,095.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,633,870.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	1,953,281.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,267,328.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	2,200,000.000	1,830,444.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,730,756.000	

		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,494,256.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	2,250,000.000	1,940,265.000	
		0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,477,188.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	2,560,000.000	2,225,049.600	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	762,216.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,246,928.000	
		1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,160,840.000	
		1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	912,548.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	475,765.000	
		0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,807,982.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	319,189.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	2,500,000.000	2,250,025.000	
		0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	700,000.000	507,199.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,584,581.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	391,704.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	900,000.000	832,509.000	
		0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,753,542.000	
		1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	1,600,000.000	1,075,360.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20250531	1,100,000.000	1,065,559.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	1,100,000.000	988,493.000	

		2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,700,000.000	1,626,849.000	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,000,000.000	961,600.000	
		3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	2,600,000.000	2,591,420.000	
		2.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260531	2,300,000.000	2,287,373.000	
		3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730	800,000.000	827,096.000	
		3.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20331031	1,500,000.000	1,536,990.000	
		3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290531	600,000.000	614,634.000	
		3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20340430	2,600,000.000	2,592,148.000	
		2.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270531	200,000.000	197,178.000	
		4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20541031	1,000,000.000	1,017,800.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,587,475.340	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,889,110.620	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,858,000.000	2,142,738.500	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,237,243.890	
		4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,789,000.000	2,829,077.930	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,077,653.450	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	1,928,963.700	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	1,562,554.110	
	ユーロ 小計			583,582,533.560 (98,415,358,460)	
国債証券 合計				316,701,120,710 [316,701,120,710]	

合計		316,701,120,710 [316,701,120,710]	

（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	279銘柄	100%	47.5%
イギリス・ポンド	国債証券	61銘柄	100%	5.2%
イスラエル・シュケル	国債証券	14銘柄	100%	0.3%
オーストラリア・ドル	国債証券	26銘柄	100%	1.3%
オフショア・人民元	国債証券	75銘柄	100%	9.7%
カナダ・ドル	国債証券	42銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券	22銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券	7銘柄	100%	0.1%
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	14銘柄	100%	0.2%
ノルウェー・クローネ	国債証券	10銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券	15銘柄	100%	0.5%
マレーシア・リンギット	国債証券	30銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	100%	0.7%
ユーロ	国債証券	386銘柄	100%	31.1%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2023年6月16日から2024年6月17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】

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	15,093,946	21,442,163
親投資信託受益証券	3,061,824,182	4,451,186,900
未収入金	-	1,715,010
流動資産合計	3,076,918,128	4,474,344,073
資産合計	3,076,918,128	4,474,344,073
負債の部		
流動負債		
未払解約金	589,368	1,682,146
未払受託者報酬	275,538	426,769
未払委託者報酬	5,098,281	7,896,049
その他未払費用	103,251	159,964
流動負債合計	6,066,438	10,164,928
負債合計	6,066,438	10,164,928
純資産の部		
元本等		
元本	※1 2,408,871,747	※1 3,064,897,601
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	661,979,943	1,399,281,544
（分配準備積立金）	264,802,149	665,131,531
元本等合計	3,070,851,690	4,464,179,145
純資産合計	3,070,851,690	4,464,179,145
負債純資産合計	3,076,918,128	4,474,344,073

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期 自　2022年6月16日 至　2023年6月15日	第8期 自　2023年6月16日 至　2024年6月17日
営業収益		
受取利息	2	3,773
有価証券売買等損益	175,980,100	500,025,405
営業収益合計	175,980,102	500,029,178
営業費用		
支払利息	3,893	2,877
受託者報酬	534,221	792,746
委託者報酬	9,885,041	14,667,471
その他費用	200,197	297,127
営業費用合計	10,623,352	15,760,221
営業利益又は営業損失（△）	165,356,750	484,268,957
経常利益又は経常損失（△）	165,356,750	484,268,957
当期純利益又は当期純損失（△）	165,356,750	484,268,957
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（△）	6,061,471	30,949,214
期首剰余金又は期首欠損金（△）	381,281,515	661,979,943
剰余金増加額又は欠損金減少額	168,287,883	446,193,928
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	168,287,883	446,193,928
剰余金減少額又は欠損金増加額	46,884,734	162,212,070
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	46,884,734	162,212,070
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	661,979,943	1,399,281,544

(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8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日
1．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2024年6月15日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2024年6月17日としております。このため、当計算期間は368日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	第7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
1．　※1 期首元本額	1,913,328,634円	2,408,871,747円
期中追加設定元本額	728,642,263円	1,231,686,050円
期中一部解約元本額	233,099,150円	575,660,196円
2．　計算期間末日における受益権の総数	2,408,871,747口	3,064,897,601口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第7期 自2022年6月16日 至2023年6月15日	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日

※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（129,205,780円）、投資信託約款に規定される収益調整金（397,181,519円）及び分配準備積立金（135,596,369円）より分配対象額は661,983,668円（1万口当たり2,748.11円）であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,317円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（453,315,443円）、投資信託約款に規定される収益調整金（734,150,013円）及び分配準備積立金（211,814,771円）より分配対象額は1,399,281,544円（1万口当たり4,565.51円）であり、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	第8期 2024年6月17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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17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	170,022,618	475,666,605
合計	170,022,618	475,666,605

(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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17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8期 自2023年6月16日 至2024年6月17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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2748円 (12,748円)	1.4566円 (14,566円)

(4)【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	468,407,935	880,279,032	
	外国債券インデックスマザーファンド	956,757,996	3,570,907,868	
親投資信託受益証券 合計			4,451,186,900	
合計			4,451,186,900	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2023年6月15日現在 金 額（円）	2024年6月17日現在 金 額（円）

資産の部		
流動資産		
預金	190,310,784	159,745,222
コール・ローン	327,843,728	655,242,007
国債証券	33,928,192,104	46,204,219,780
派生商品評価勘定	980,588	1,585,232
未収利息	537,068,210	815,086,743
前払費用	65,211,312	75,992,260
流動資産合計	35,049,606,726	47,911,871,244
資産合計	35,049,606,726	47,911,871,244
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	3,614,873
未払金	-	54,209,972
未払解約金	7,248,944	57,101
流動負債合計	7,248,944	57,881,946
負債合計	7,248,944	57,881,946
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	21,168,871,625	25,463,772,957
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	13,873,486,157	22,390,216,341
元本等合計	35,042,357,782	47,853,989,298
純資産合計	35,042,357,782	47,853,989,298
負債純資産合計	35,049,606,726	47,911,871,244

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2024年6月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023年6月15日現在	2024年6月17日現在
1．　※1 期首	2022年6月16日	2023年6月16日
期首元本額	17,421,108,690円	21,168,871,625円
期中追加設定元本額	4,429,105,539円	5,141,491,854円
期中一部解約元本額	681,342,604円	846,590,522円
期末元本額の内訳		
ファンド名		

新興国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	365,087,963円	557,526,488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）	372,273,354円	468,407,935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）	426,231,978円	553,737,479円
Ｄ－Ｉ's 新興国債券インデックス	60,255,051円	66,352,663円
ｉＦｒｅｅ 新興国債券インデックス	6,665,918,287円	9,083,935,978円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	4,213,508,237円	4,878,463,525円
ダイワ新興国債券インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	2,314,763円	5,516,935円
ＤＣダイワ新興国債券インデックスファンド	8,887,151,762円	9,686,537,756円
スタイル9（8資産分散・保守型）	-円	30,139円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	-円	650,543円
スタイル9（8資産分散・積極型）	-円	758,049円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券	139,412,115円	122,832,052円
ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド	36,718,115円	39,023,415円
計	21,168,871,625円	25,463,772,957円
2. 期末日における受益権の総数	21,168,871,625口	25,463,772,957口

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年6月16日 至2024年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年6月17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	2023年6月15日現在	2024年6月17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	1,167,385,646	△161,323,128
合計	1,167,385,646	△161,323,128

（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	2023年6月15日現在				2024年6月17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	70,920,008	-	71,900,596	980,588	557,154,321	-	555,124,680	△2,029,641
オフショア・人民元	-	-	-	-	56,006,090	-	56,213,300	207,210
チェコ・コルナ	23,684,691	-	23,904,288	219,597	68,076,560	-	67,925,000	△151,560
トルコ・リラ	-	-	-	-	36,829,200	-	37,496,800	667,600
ハンガリー・フォリント	26,962,547	-	27,239,488	276,941	55,664,161	-	54,790,320	△873,841
ポーランド・ズロチ	-	-	-	-	62,266,492	-	61,386,560	△879,932
メキシコ・ペソ	20,272,770	-	20,756,820	484,050	42,903,840	-	42,353,300	△550,540
ルーマニア・レイ	-	-	-	-	203,589,200	-	202,515,000	△1,074,200
南アフリカ・ランド	-	-	-	-	31,818,778	-	32,444,400	625,622
合計	70,920,008	-	71,900,596	980,588	557,154,321	-	555,124,680	△2,029,641

（注）　1.　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2023年6月15日現在	2024年6月17日現在
1口当たり純資産額	1.6554円	1.8793円
（1万口当たり純資産額）	(16,554円)	(18,793円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	インドネシア・ルピア	8.25% Indonesia Treasury Bond 20360515	15,250,000,000.000	16,628,295,000.000	
		8.75% Indonesia Treasury Bond 20310515	10,000,000,000.000	10,905,700,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20320815	7,000,000,000.000	7,164,500,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20380515	10,800,000,000.000	11,192,688,000.000	
		8.375% Indonesia Treasury Bond 20390415	7,700,000,000.000	8,611,911,000.000	
		8.25% Indonesia Treasury Bond 20290515	17,000,000,000.000	17,820,420,000.000	
		7% Indonesia Treasury Bond 20300915	24,300,000,000.000	24,187,977,000.000	

6.5% Indonesia Treasury Bond 20250615	19,700,000,000.000	19,659,812,000.000	
7.5% Indonesia Treasury Bond 20350615	22,000,000,000.000	22,657,580,000.000	
7.5% Indonesia Treasury Bond 20400415	20,500,000,000.000	21,229,800,000.000	
5.5% Indonesia Treasury Bond 20260415	18,100,000,000.000	17,746,507,000.000	
6.5% Indonesia Treasury Bond 20310215	26,300,000,000.000	25,520,994,000.000	
6.25% Indonesia Treasury Bond 20360615	7,300,000,000.000	6,820,244,000.000	
6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20320415	36,300,000,000.000	34,752,168,000.000	
5.125% INDONESIA TREASURY BOND 20270415	15,700,000,000.000	15,026,313,000.000	
7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20420615	14,200,000,000.000	14,294,714,000.000	
6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20370715	2,700,000,000.000	2,591,163,000.000	
7% INDONESIA TREASURY BOND 20330215	19,800,000,000.000	19,654,866,000.000	
6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20280815	16,100,000,000.000	15,754,011,000.000	
7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20430615	10,300,000,000.000	10,263,229,000.000	
7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20380615	10,500,000,000.000	10,499,055,000.000	
6.625% INDONESIA TREASURY BOND 20340215	14,300,000,000.000	13,763,607,000.000	
6.875% INDONESIA TREASURY BOND 20290415	15,500,000,000.000	15,380,805,000.000	
11% Indonesia Treasury Bond 20250915	6,400,000,000.000	6,731,776,000.000	
10.5% Indonesia Treasury Bond 20300815	3,480,000,000.000	4,112,246,400.000	
9.5% Indonesia Treasury Bond 20310715	2,970,000,000.000	3,374,484,300.000	
8.375% Indonesia Treasury Bond 20260915	16,324,000,000.000	16,832,002,880.000	

	8.25% Indonesia Treasury Bond 20320615	4,750,000,000.000	5,136,840,000.000	
	7% Indonesia Treasury Bond 20270515	16,030,000,000.000	16,100,532,000.000	
	6.125% Indonesia Treasury Bond 20280515	16,450,000,000.000	15,994,828,500.000	
	6.625% Indonesia Treasury Bond 20330515	14,075,000,000.000	13,597,998,250.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20340315	26,920,000,000.000	29,500,551,200.000	
	9% Indonesia Treasury Bond 20290315	12,220,000,000.000	13,150,186,400.000	
インドネシア・ルピア 小計			486,657,804,930.000 (4,671,914,928)	
ウルグアイ・ペソ	8.5% Uruguay Government International Bond 20280315	2,800,000.000	2,743,300.000	
	8.25% Uruguay Government International Bond 20310521	12,000,000.000	11,436,600.000	
	9.75% URUGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 20330720	11,000,000.000	11,357,500.000	
ウルグアイ・ペソ 小計			25,537,400.000 (102,435,619)	
オフショア・人民元	3.22% China Government Bond 20251206	3,700,000.000	3,786,321.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	4,800,000.000	5,069,664.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,900,000.000	6,272,231.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	4,800,000.000	4,946,976.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	4,200,000.000	4,335,240.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	5,700,000.000	6,015,951.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	4,800,000.000	4,932,960.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	4,000,000.000	4,112,800.000	
	1.99% China Government Bond 20250409	6,500,000.000	6,519,045.000	

		3.02% China Government Bond 20251022	7,000,000.000	7,128,800.000	
		3.28% China Government Bond 20271203	5,000,000.000	5,240,900.000	
		3.27% China Government Bond 20301119	6,300,000.000	6,748,056.000	
		3.03% China Government Bond 20260311	3,900,000.000	3,987,750.000	
		3.81% China Government Bond 20500914	5,800,000.000	7,169,148.000	
		3.01% China Government Bond 20280513	5,000,000.000	5,197,250.000	
		3.72% China Government Bond 20510412	2,000,000.000	2,444,700.000	
		3.02% China Government Bond 20310527	7,000,000.000	7,376,880.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,582,530.000	
		2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	1,800,000.000	1,865,106.000	
		3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	2,000,000.000	2,375,360.000	
		2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	3,500,000.000	3,660,090.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	2,800,000.000	2,833,796.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	3,000,000.000	3,104,760.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	3,500,000.000	3,615,080.000	
		2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	2,200,000.000	2,236,014.000	
		3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	2,000,000.000	2,296,380.000	
		2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	2,500,000.000	2,588,475.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	3,600,000.000	3,712,464.000	
		2.5% CHINA GOVERNMENT BOND 20270725	3,700,000.000	3,761,568.000	

		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	3,000,000.000	3,091,230.000	
		2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20250825	3,900,000.000	3,922,620.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	1,600,000.000	1,638,096.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	3,300,000.000	3,383,226.000	
		2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	3,200,000.000	3,248,128.000	
		3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	1,200,000.000	1,332,108.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	3,700,000.000	3,846,261.000	
		2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20251125	3,000,000.000	3,024,360.000	
		2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	3,000,000.000	3,101,220.000	
		2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	3,200,000.000	3,270,784.000	
		2.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20260215	2,600,000.000	2,630,420.000	
		2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	2,500,000.000	2,617,350.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	3,700,000.000	3,830,203.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	3,300,000.000	3,371,445.000	
		3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	2,200,000.000	2,497,176.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	3,200,000.000	3,294,368.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	3,000,000.000	3,074,040.000	
		2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	3,000,000.000	3,040,440.000	
		2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	1,000,000.000	1,016,960.000	
		2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	4,500,000.000	4,532,085.000	

	2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	4,700,000.000	4,810,873.000	
	3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	2,000,000.000	2,193,460.000	
	2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	4,000,000.000	4,082,680.000	
	2.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20261115	3,000,000.000	3,037,200.000	
	2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	2,400,000.000	2,472,096.000	
	2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225	4,300,000.000	4,389,354.000	
	2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20270225	4,000,000.000	4,016,720.000	
	2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225	5,500,000.000	5,521,670.000	
	1.85% CHINA GOVERNMENT BOND 20270515	1,500,000.000	1,498,365.000	
オフショア・人民元 小計			219,701,233.000 (4,758,289,304)	
コロンビア・ペソ	6% Colombian TES 20280428	6,320,000,000.000	5,514,073,600.000	
	7.5% Colombian TES 20260826	5,410,000,000.000	5,182,563,600.000	
	7.75% Colombian TES 20300918	4,900,000,000.000	4,325,524,000.000	
	7% Colombian TES 20320630	5,300,000,000.000	4,259,875,000.000	
	6.25% Colombian TES 20251126	3,700,000,000.000	3,561,768,000.000	
	7.25% Colombian TES 20341018	5,900,000,000.000	4,592,560,000.000	
	5.75% Colombian TES 20271103	4,400,000,000.000	3,870,856,000.000	
	7.25% Colombian TES 20501026	5,810,000,000.000	3,716,540,800.000	
	6.25% Colombian TES 20360709	2,600,000,000.000	1,772,966,000.000	
	7% COLOMBIAN TES 20310326	5,400,000,000.000	4,503,438,000.000	
	9.25% COLOMBIAN TES 20420528	8,400,000,000.000	6,866,748,000.000	
	13.25% COLOMBIAN TES 20330209	4,800,000,000.000	5,402,880,000.000	

コロンビア・ペソ 小計			53,569,793,000.000 (2,038,598,473)	
タイ・バーツ	4.875% Thailand Government Bond 20290622	48,050,000.000	53,353,759.000	
	3.85% Thailand Government Bond 20251212	37,610,000.000	38,417,862.800	
	3.65% Thailand Government Bond 20310620	39,200,000.000	41,743,688.000	
	3.4% Thailand Government Bond 20360617	34,600,000.000	36,233,466.000	
	2.125% Thailand Government Bond 20261217	52,400,000.000	52,088,744.000	
	3.775% Thailand Government Bond 20320625	48,500,000.000	52,269,905.000	
	2.875% Thailand Government Bond 20460617	34,900,000.000	31,953,742.000	
	2.875% Thailand Government Bond 20281217	44,500,000.000	45,304,560.000	
	3.3% Thailand Government Bond 20380617	56,500,000.000	58,537,955.000	
	1.6% Thailand Government Bond 20291217	36,500,000.000	34,784,865.000	
	1.6% Thailand Government Bond 20350617	20,500,000.000	18,148,445.000	
	0.95% Thailand Government Bond 20250617	43,000,000.000	42,409,180.000	
	1.585% Thailand Government Bond 20351217	40,900,000.000	35,883,206.000	
	2% Thailand Government Bond 20311217	66,500,000.000	63,685,720.000	
	2% Thailand Government Bond 20420617	29,000,000.000	24,427,570.000	
	1% THAILAND GOVERNMENT BOND 20270617	61,000,000.000	58,581,350.000	
	2.65% THAILAND GOVERNMENT BOND 20280617	56,000,000.000	56,462,000.000	
	3.39% THAILAND GOVERNMENT BOND 20370617	48,500,000.000	50,768,830.000	
	2.35% THAILAND GOVERNMENT BOND 20260617	43,500,000.000	43,488,690.000	

	3.45% THAILAND GOVERNMENT BOND 20430617	39,000,000.000	40,044,810.000	
	3.35% THAILAND GOVERNMENT BOND 20330617	49,000,000.000	51,341,220.000	
	2.25% THAILAND GOVERNMENT BOND 20270317	50,000,000.000	49,824,500.000	
	2.4% THAILAND GOVERNMENT BOND 20290317	37,000,000.000	36,856,810.000	
	2.8% THAILAND GOVERNMENT BOND 20340617	18,000,000.000	18,073,260.000	
タイ・バーツ 小計			1,034,684,137.800 (4,438,794,951)	
チェコ・コルナ	2.5% Czech Republic Government Bond 20280825	26,600,000.000	24,948,406.000	
	2.4% Czech Republic Government Bond 20250917	24,100,000.000	23,557,027.000	
	1% Czech Republic Government Bond 20260626	27,400,000.000	25,734,080.000	
	0.95% Czech Republic Government Bond 20300515	27,500,000.000	22,975,975.000	
	0.25% Czech Republic Government Bond 20270210	31,500,000.000	28,468,125.000	
	2.75% Czech Republic Government Bond 20290723	29,500,000.000	27,651,825.000	
	2% Czech Republic Government Bond 20331013	29,500,000.000	24,589,135.000	
	1.2% Czech Republic Government Bond 20310313	28,700,000.000	23,812,390.000	
	0.05% Czech Republic Government Bond 20291129	15,500,000.000	12,480,445.000	
	4.2% Czech Republic Government Bond 20361204	15,300,000.000	15,249,510.000	
	1.75% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20320623	29,500,000.000	24,735,160.000	
	1.25% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20250214	17,500,000.000	17,165,925.000	
	1.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20400424	16,500,000.000	11,254,320.000	
	3.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20350530	15,700,000.000	14,673,063.000	

	6% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20260226	19,500,000.000	20,092,410.000	
	5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20300930	26,000,000.000	27,218,360.000	
	5.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20281212	20,500,000.000	21,655,380.000	
	1.95% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20370730	14,000,000.000	10,761,800.000	
	4.9% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20340414	16,000,000.000	16,824,800.000	
	5.75% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20290329	14,000,000.000	14,973,700.000	
	6.2% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20310616	8,000,000.000	8,988,160.000	
	4.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20321111	14,300,000.000	14,582,568.000	
チェコ・コルナ 小計			432,392,564.000 (2,947,360,673)	
チリ・ペソ	4.5% BONOS TESORERIA PESOS 20260301	500,000,000.000	498,880,000.000	
	5% BONOS TESORERIA PESOS 20350301	970,000,000.000	901,954,500.000	
	6% BONOS TESORERIA PESOS 20430101	630,000,000.000	635,292,000.000	
	4.7% BONOS TESORERIA PESOS 20300901	765,000,000.000	724,393,800.000	
	2.5% BONOS TESORERIA PESOS 20250301	1,000,000,000.000	985,770,000.000	
	2.3% BONOS TESORERIA PESOS 20281001	80,000,000.000	70,665,600.000	
	5% BONOS TESORERIA PESOS 20281001	200,000,000.000	196,210,000.000	
	7% BONOS TESORERIA PESOS 20340501	220,000,000.000	237,879,400.000	
	6% BONOS TESORERIA PESOS 20330401	500,000,000.000	503,670,000.000	
チリ・ペソ 小計			4,754,715,300.000 (800,974,585)	
ドミニカ・ペソ	13.625% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20330203	11,400,000.000	13,604,988.000	

	11.25% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20350915	12,500,000.000	13,292,875.000	
ドミニカ・ペソ 小計			26,897,863.000 (71,577,903)	
トルコ・リラ	8% Turkey Government Bond 20250312	2,690,000.000	2,158,402.200	
	10.6% Turkey Government Bond 20260211	5,570,000.000	3,887,915.700	
	11% Turkey Government Bond 20270224	2,970,000.000	1,929,133.800	
	10.5% Turkey Government Bond 20270811	9,000,000.000	5,632,290.000	
	12.4% Turkey Government Bond 20280308	20,500,000.000	12,985,110.000	
	12.6% Turkey Government Bond 20251001	9,100,000.000	6,754,293.000	
	11.7% Turkey Government Bond 20301113	13,900,000.000	8,062,000.000	
	16.9% TURKEY GOVERNMENT BOND 20260902	8,500,000.000	6,338,790.000	
	17.8% TURKEY GOVERNMENT BOND 20330713	11,500,000.000	8,260,680.000	
	17.3% TURKEY GOVERNMENT BOND 20280719	18,000,000.000	13,184,100.000	
	26.2% TURKEY GOVERNMENT BOND 20331005	35,000,000.000	34,240,500.000	
	31.08% TURKEY GOVERNMENT BOND 20281108	31,000,000.000	31,358,050.000	
トルコ・リラ 小計			134,791,264.700 (651,823,599)	
ハンガリー・フォリント	3% Hungary Government Bond 20271027	270,000,000.000	240,534,900.000	
	2.75% Hungary Government Bond 20261222	130,000,000.000	118,375,400.000	
	6.75% Hungary Government Bond 20281022	443,000,000.000	442,393,090.000	
	3% Hungary Government Bond 20300821	225,000,000.000	182,729,250.000	
	3.25% Hungary Government Bond 20311022	272,000,000.000	217,020,640.000	

		1% Hungary Government Bond 20251126	270,000,000.000	249,534,000.000	
		3% Hungary Government Bond 20381027	202,000,000.000	131,213,140.000	
		1.5% Hungary Government Bond 20260422	224,000,000.000	204,424,640.000	
		2% Hungary Government Bond 20290523	135,000,000.000	108,587,250.000	
		2.25% Hungary Government Bond 20330420	315,000,000.000	220,739,400.000	
		1.5% Hungary Government Bond 20260826	100,000,000.000	89,752,000.000	
		3% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20410425	240,000,000.000	147,547,200.000	
		2.25% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20340622	75,000,000.000	50,379,750.000	
		4.5% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20280323	100,000,000.000	92,699,000.000	
		4.75% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20321124	235,000,000.000	203,322,000.000	
		9.5% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20261021	110,000,000.000	116,318,400.000	
		7% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20351024	90,000,000.000	90,395,100.000	
		5.5% Hungary Government Bond 20250624	282,500,000.000	279,304,925.000	
	ハンガリー・フォリント 小計			3,185,270,085.000 (1,348,694,319)	
	ブラジル・レアル	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20250101	16,490,000.000	16,422,885.700	
		10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20270101	19,650,000.000	19,054,015.500	
		10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20290101	20,800,000.000	19,565,936.000	
		10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20310101	10,000,000.000	9,153,600.000	
		10% BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F 20330101	10,000,000.000	9,003,400.000	
		10% BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F 20350101	2,500,000.000	2,227,100.000	

	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20250701	16,300,000.000	14,638,704.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20260101	29,700,000.000	25,187,976.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20260701	32,000,000.000	25,676,480.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20270701	14,700,000.000	10,519,467.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20300101	5,000,000.000	2,661,450.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20280101	6,000,000.000	4,041,000.000	
ブラジル・レアル 小計			158,152,014.200 (4,630,991,464)	
ペルー・ソル	6.35% Peru Government Bond 20280812	2,270,000.000	2,325,728.500	
	6.15% Peru Government Bond 20320812	3,350,000.000	3,223,169.000	
	5.94% Peru Government Bond 20290212	3,400,000.000	3,405,134.000	
	5.4% Peru Government Bond 20340812	2,850,000.000	2,510,964.000	
	5.35% Peru Government Bond 20400812	1,500,000.000	1,231,815.000	
	7.3% PERU GOVERNMENT BOND 20330812	3,900,000.000	4,001,361.000	
	8.2% Peru Government Bond 20260812	725,000.000	764,701.000	
	6.9% Peru Government Bond 20370812	4,465,000.000	4,324,173.900	
	6.95% Peru Government Bond 20310812	4,070,000.000	4,158,929.500	
ペルー・ソル 小計			25,945,975.900 (1,079,443,408)	
ポーランド・ズロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	9,190,000.000	8,702,102.900	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	6,540,000.000	6,017,781.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	10,850,000.000	9,463,912.500	

		0.75% Poland Government Bond 20250425	5,550,000.000	5,368,570.500	
		1.25% Poland Government Bond 20301025	9,400,000.000	7,259,338.000	
		0.25% Poland Government Bond 20261025	6,300,000.000	5,622,120.000	
		1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	7,650,000.000	5,789,367.000	
		3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	6,150,000.000	5,893,053.000	
		7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	9,400,000.000	10,084,038.000	
		POLAND GOVERNMENT BOND 20251025	4,350,000.000	4,074,036.000	
		6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	9,900,000.000	10,098,792.000	
		4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725	3,200,000.000	3,084,160.000	
		5% POLAND GOVERNMENT BOND 20341025	1,100,000.000	1,038,565.000	
		2.75% Poland Government Bond 20280425	6,950,000.000	6,325,264.500	
		3.25% Poland Government Bond 20250725	6,550,000.000	6,437,995.000	
	ポーランド・ズロチ 小計			95,259,095.400 (3,669,332,726)	
	マレーシア・リンギット	4.07% Malaysia Government Investment Issue 20260930	4,650,000.000	4,710,124.500	
		4.258% Malaysia Government Investment Issue 20270726	1,800,000.000	1,836,756.000	
		4.369% Malaysia Government Investment Issue 20281031	4,400,000.000	4,526,764.000	
		4.128% Malaysia Government Investment Issue 20250815	1,900,000.000	1,916,815.000	
		4.13% Malaysia Government Investment Issue 20290709	3,700,000.000	3,779,772.000	
		3.726% Malaysia Government Investment Issue 20260331	4,200,000.000	4,218,144.000	
		3.465% Malaysia Government Investment Issue 20301015	5,100,000.000	5,016,105.000	

		3.422% Malaysia Government Investment Issue 20270930	4,850,000.000	4,830,309.000	
		3.447% Malaysia Government Investment Issue 20360715	4,200,000.000	3,998,358.000	
		4.417% MALAYSIA T-BILL 20410930	3,300,000.000	3,440,415.000	
		3.99% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20251015	3,800,000.000	3,831,578.000	
		3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	3,150,000.000	3,146,157.000	
		3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	3,850,000.000	3,865,592.500	
		3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	4,350,000.000	4,383,712.500	
		4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	3,100,000.000	3,182,801.000	
		3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	4,300,000.000	4,345,408.000	
		3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	3,820,000.000	3,859,804.400	
		4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	4,300,000.000	4,625,424.000	
		3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	2,800,000.000	2,812,124.000	
		4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	4,200,000.000	4,452,966.000	
		4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	4,450,000.000	4,866,653.500	
		3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	3,900,000.000	3,936,348.000	
		3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	4,350,000.000	4,394,413.500	
		4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	2,750,000.000	3,044,525.000	
		3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	3,000,000.000	2,988,630.000	
		3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	4,400,000.000	4,238,036.000	
		4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	4,300,000.000	4,198,047.000	

	2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	3,700,000.000	3,442,221.000	
	3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	3,100,000.000	3,043,084.000	
	4.193% MALAYSIAN GOVERNMENT 20321007	3,400,000.000	3,481,600.000	
	4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	4,100,000.000	4,399,792.000	
	4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	1,000,000.000	1,037,440.000	
	3.599% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280731	3,900,000.000	3,895,359.000	
	4.291% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430814	3,500,000.000	3,579,275.000	
	4.662% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380331	1,400,000.000	1,501,360.000	
	4.245% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300930	3,600,000.000	3,697,272.000	
	4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	3,150,000.000	3,268,188.000	
	3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	2,300,000.000	2,293,468.000	
	4.467% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390915	4,400,000.000	4,630,604.000	
	4.18% MALAYSIAN GOVERNMENT 20440516	700,000.000	703,752.000	
マレーシア・リンギット 小計			143,419,197.900 (4,783,388,798)	
メキシコ・ペソ	5.75% Mexican Bonos 20260305	54,400,000.000	50,198,688.000	
	8% Mexican Bonos 20471107	35,400,000.000	28,644,618.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	53,000,000.000	47,007,290.000	
	5% MEXICAN BONOS 20250306	20,200,000.000	19,468,962.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	42,500,000.000	33,896,300.000	
	7.5% MEXICAN BONOS 20330526	45,400,000.000	38,609,068.000	
	7% MEXICAN BONOS 20260903	33,500,000.000	31,113,460.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20290301	24,000,000.000	22,444,080.000	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	48,030,000.000	44,423,427.300	
	10% Mexican Bonos 20361120	11,390,000.000	11,320,293.200	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	40,230,000.000	37,690,682.400	

	8.5% Mexican Bonos 20381118	31,100,000.000	27,263,193.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	55,350,000.000	48,877,371.000	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	46,620,000.000	37,336,093.200	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	24,830,000.000	21,072,227.800	
メキシコ・ペソ 小計			499,365,753.900 (4,250,051,994)	
ルーマニア・レイ	4.75% Romania Government Bond 20250224	2,450,000.000	2,429,101.500	
	5.8% Romania Government Bond 20270726	2,800,000.000	2,770,964.000	
	5% Romania Government Bond 20290212	2,600,000.000	2,447,458.000	
	4.85% Romania Government Bond 20260422	2,500,000.000	2,448,900.000	
	3.65% Romania Government Bond 20310924	2,900,000.000	2,399,605.000	
	3.65% Romania Government Bond 20250728	2,300,000.000	2,244,639.000	
	4.15% Romania Government Bond 20280126	2,600,000.000	2,434,120.000	
	3.25% Romania Government Bond 20260624	2,750,000.000	2,607,467.500	
	4.15% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20301024	2,500,000.000	2,187,925.000	
	4.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20341011	2,700,000.000	2,289,492.000	
	2.5% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20271025	2,300,000.000	2,049,208.000	
	4.85% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20290725	2,300,000.000	2,141,576.000	
	6.7% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20320225	3,000,000.000	2,984,310.000	
	4.25% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20360428	2,300,000.000	1,819,806.000	
	3.5% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20251125	2,000,000.000	1,934,520.000	

	8.25% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20320929	3,100,000.000	3,370,475.000	
	8.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20281030	2,700,000.000	2,925,045.000	
	8% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20300429	2,700,000.000	2,876,877.000	
	7.9% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20380224	2,600,000.000	2,821,806.000	
	7.2% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20261028	1,400,000.000	1,430,562.000	
	7.2% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20331030	2,300,000.000	2,370,288.000	
	7.35% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20310428	2,500,000.000	2,598,825.000	
	7.2% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20270531	1,800,000.000	1,847,754.000	
ルーマニア・レイ 小計			55,430,724.000 (1,878,380,944)	
南アフリカ・ランド	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	66,150,000.000	68,478,480.000	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	17,720,000.000	11,543,694.000	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	16,280,000.000	9,736,254.000	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	35,040,000.000	29,034,844.800	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	85,520,000.000	62,091,796.000	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	58,800,000.000	45,261,888.000	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	67,200,000.000	61,267,584.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	47,700,000.000	34,927,848.000	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	64,200,000.000	55,199,160.000	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	61,700,000.000	51,207,915.000	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	49,400,000.000	38,052,820.000	

		11.625% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20530331	9,500,000.000	8,974,650.000	
	南アフリカ・ランド 小計			475,776,933.800 (4,082,166,092)	
国債証券 合計				46,204,219,780 [46,204,219,780]	
合計				46,204,219,780 [46,204,219,780]	

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
インドネシア・ルピア	国債証券	33銘柄	100%	10.1%
ウルグアイ・ペソ	国債証券	3銘柄	100%	0.2%
オフショア・人民元	国債証券	58銘柄	100%	10.3%
コロンビア・ペソ	国債証券	12銘柄	100%	4.4%
タイ・バーツ	国債証券	24銘柄	100%	9.6%
チェコ・コルナ	国債証券	22銘柄	100%	6.4%
チリ・ペソ	国債証券	9銘柄	100%	1.7%
ドミニカ・ペソ	国債証券	2銘柄	100%	0.2%
トルコ・リラ	国債証券	12銘柄	100%	1.4%
ハンガリー・フォリント	国債証券	18銘柄	100%	2.9%
ブラジル・レアル	国債証券	12銘柄	100%	10.0%
ペルー・ソル	国債証券	9銘柄	100%	2.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券	15銘柄	100%	7.9%
マレーシア・リンギット	国債証券	40銘柄	100%	10.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	100%	9.2%
ルーマニア・レイ	国債証券	23銘柄	100%	4.1%
南アフリカ・ランド	国債証券	12銘柄	100%	8.8%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）」に記載のとおりであります。

【ダイワファンドラップ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2023年6月16日から2024年6月17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】

ダイワファンドラップ Ｊ－ＲＥＩＴインデックス

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	27,759,808	28,724,049
親投資信託受益証券	8,359,898,563	11,708,209,024
流動資産合計	8,387,658,371	11,736,933,073
資産合計	8,387,658,371	11,736,933,073
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,591,876	4,326,925
未払受託者報酬	826,817	1,174,838
未払委託者報酬	11,989,453	17,035,805
その他未払費用	206,621	293,640
流動負債合計	23,614,767	22,831,208
負債合計	23,614,767	22,831,208
純資産の部		
元本等		
元本	※1 6,389,175,673	※1 9,360,680,454
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,974,867,931	2,353,421,411
（分配準備積立金）	855,646,964	711,028,109
元本等合計	8,364,043,604	11,714,101,865
純資産合計	8,364,043,604	11,714,101,865
負債純資産合計	8,387,658,371	11,736,933,073

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期 自　2022年6月16日 至　2023年6月15日	第8期 自　2023年6月16日 至　2024年6月17日
営業収益		
受取利息	6	6,445
有価証券売買等損益	256,278,092	△ 451,809,539
営業収益合計	256,278,098	△ 451,803,094
営業費用		
支払利息	6,988	4,097
受託者報酬	1,653,498	2,172,249
委託者報酬	23,977,015	31,498,919
その他費用	413,213	542,918
営業費用合計	26,050,714	34,218,183
営業利益又は営業損失（△）	230,227,384	△ 486,021,277
経常利益又は経常損失（△）	230,227,384	△ 486,021,277
当期純利益又は当期純損失（△）	230,227,384	△ 486,021,277
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（△）	49,338,907	△ 20,462,159
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,480,003,163	1,974,867,931
剰余金増加額又は欠損金減少額	592,852,845	1,270,028,249
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	592,852,845	1,270,028,249
剰余金減少額又は欠損金増加額	278,876,554	425,915,651
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	278,876,554	425,915,651
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,974,867,931	2,353,421,411

(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8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日
1．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2024年6月15日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2024年6月17日としております。このため、当計算期間は368日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	第7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
1．　※1 期首元本額	5,463,295,501円	6,389,175,673円
期中追加設定元本額	1,930,903,164円	4,354,491,040円
期中一部解約元本額	1,005,022,992円	1,382,986,259円
2．　計算期間末日における受益権の総数	6,389,175,673口	9,360,680,454口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第7期 自2022年6月16日 至2023年6月15日	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日

※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,658,250,976円）及び分配準備積立金（855,646,964円）より分配対象額は2,513,897,940円（1万口当たり3,934.62円）であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,972,046,627円）及び分配準備積立金（711,028,109円）より分配対象額は3,683,074,736円（1万口当たり3,934.62円）であり、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	第8期 2024年6月17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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17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	220,526,545	△442,792,390
合計	220,526,545	△442,792,390

(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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17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8期 自2023年6月16日 至2024年6月17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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3091円 (13,091円)	1.2514円 (12,514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	3,723,274,510	11,708,209,024	
親投資信託受益証券 合計			11,708,209,024	
合計			11,708,209,024	

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

	2023年6月15日現在 金 額（円）	2024年6月17日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,356,129,716	6,840,179,349

投資証券	※2	457,635,466,600	314,436,883,200
未収入金		2,906,211,667	3,450,506,931
未収配当金		3,035,932,269	2,533,455,970
前払金		96,320,000	-
差入委託証拠金		-	508,426,997
流動資産合計		472,030,060,252	327,769,452,447
資産合計		472,030,060,252	327,769,452,447
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		10,136,000	28,616,000
前受金		-	8,400,000
未払解約金		2,067,518,000	1,747,066,000
流動負債合計		2,077,654,000	1,784,082,000
負債合計		2,077,654,000	1,784,082,000
純資産の部			
元本等			
元本	※1	143,357,852,675	103,664,583,904
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）		326,594,553,577	222,320,786,543
元本等合計		469,952,406,252	325,985,370,447
純資産合計		469,952,406,252	325,985,370,447
負債純資産合計		472,030,060,252	327,769,452,447

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2024年6月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3.　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2023年6月15日現在	2024年6月17日現在
1.　※1 期首	2022年6月16日	2023年6月16日
期首元本額	139,303,981,506円	143,357,852,675円
期中追加設定元本額	31,595,153,336円	8,638,388,918円
期中一部解約元本額	27,541,282,167円	48,331,657,689円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン	4,382,210,878円	3,732,059,711円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（毎月分配型）	125,900,106,201円	84,518,908,283円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（年1回決算型）	390,067,503円	561,312,597円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	17,523,105円	24,574,738円
ｉＦｒｅｅ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	650,961,876円	676,165,505円
ｉＦｒｅｅ　８資産バランス	2,051,017,920円	2,865,827,270円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（奇数月決算型）	-円	97,468,809円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	2,397円	320,562円
ＤＣ・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン	5,515,708,487円	5,277,909,415円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	7,494,804円	9,135,460円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	7,382,097円	10,258,995円
ダイワ国内ＲＥＩＴインデックス（投資一任専用）	1,606,303円	5,532,494円

	ダイワ・ノーロード Ｊ－ＲＥＩＴファンド	102,421,379円	89,714,633円
	ダイワファンドラップ Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	2,550,149,034円	3,723,274,510円
	ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	406,375,098円	728,631,453円
	ダイワファンドラップオンライン Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	459,885,005円	594,563,162円
	スタイル9（6資産分散・保守型）	-円	39,631円
	スタイル9（6資産分散・バランス型）	-円	1,163,872円
	スタイル9（6資産分散・積極型）	-円	687,709円
	スタイル9（8資産分散・保守型）	-円	46,263円
	スタイル9（8資産分散・バランス型）	-円	871,592円
	スタイル9（8資産分散・積極型）	-円	452,507円
	ダイワ・インデックスセレクト Ｊ－ＲＥＩＴ	914,940,588円	745,664,733円
計		143,357,852,675円	103,664,583,904円
2.	期末日における受益権の総数	143,357,852,675口	103,664,583,904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　4,699,050,000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　1,483,150,000円

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年6月16日 至2024年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年6月17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	2023年6月15日現在	2024年6月17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	15,950,869,975	△1,535,913,516
合計	15,950,869,975	△1,535,913,516

（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	2023年6月15日現在				2024年6月17日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
不動産投信指数先物取引								
買建	10,338,720,000	-	10,329,200,000	△9,520,000	9,520,000,000	-	9,492,000,000	△28,000,000
合計	10,338,720,000	-	10,329,200,000	△9,520,000	9,520,000,000	-	9,492,000,000	△28,000,000

（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6月15日現在	2024年6月17日現在
1口当たり純資産額	3.2782円	3.1446円
（1万口当たり純資産額）	(32,782円)	(31,446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	6,503	770,605,500	
	サンケイリアルエステート	10,249	852,716,800	
	SOSILA物流リート投	15,963	1,835,745,000	
	東海道リート投資法	5,466	665,212,200	
	日本アコモデーションファンド投資法人	11,047	7,070,080,000	
	森ヒルズリート	37,622	4,887,097,800	
	産業ファンド	58,274	7,115,255,400	
	アドバンス・レジデンス	31,390	10,044,800,000	
	ＡＰＩ投資法人	16,784	6,151,336,000	
	ＧＬＰ投資法人	107,466	13,959,833,400	
	コンフォリア・レジデンシャル	15,732	4,947,714,000	
	日本プロロジスリート	55,734	13,939,073,400	
	星野リゾート・リート	6,724	3,422,516,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	5,581	1,423,155,000	
	イオンリート投資	39,245	5,168,566,500	
	ヒューリックリート投資法	29,933	4,301,372,100	
	日本リート投資法人	10,392	3,450,144,000	
	積水ハウス・リート投資	96,138	7,441,081,200	
	トーセイ・リート投資法人	6,737	925,663,800	
	ヘルスケア&メディカル投資	7,888	997,043,200	
	サムティ・レジデンシャル	8,717	905,696,300	
	野村不動産マスターＦ	103,460	14,515,438,000	※
	いちごホテルリート投資	5,300	577,700,000	
	ラサールロジポート投資	40,897	6,003,679,600	
	スターアジア不動産投	49,307	2,923,905,100	
	マリモ地方創生リート	4,931	643,988,600	
	三井不ロジパーク	13,307	5,735,317,000	
	日本ホテル＆レジデンシャル投資法人	4,892	362,986,400	
	投資法人みらい	43,906	1,951,621,700	
	三菱地所物流REIT	11,047	4,148,148,500	
	CREロジスティクスファンド	13,773	1,957,143,300	
	ザイマックス・リート	5,189	608,669,700	
	タカラレーベン不動産投	17,043	1,680,439,800	

	アドバンス・ロジスティクス投資法人	14,019	1,668,261,000	
	日本ビルファンド	37,323	21,610,017,000	※
	ジャパンリアルエステイト	32,864	16,662,048,000	
	日本都市ファンド投資法人	153,354	13,771,189,200	
	オリックス不動産投資	63,747	10,046,527,200	
	日本プライムリアルティ	21,880	7,154,760,000	
	NTT都市開発リート投資法人	32,437	3,756,204,600	
	東急リアル・エステート	21,450	3,318,315,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	23,624	2,352,950,400	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	71,567	10,176,827,400	
	森トラストリート投資法人	61,668	4,236,591,600	
	インヴィンシブル投資法人	154,905	10,518,049,500	
	フロンティア不動産投資	11,871	5,282,595,000	
	平和不動産リート	24,793	3,247,883,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	20,421	5,419,733,400	
	福岡リート投資法人	16,547	2,614,426,000	
	KDX不動産投資法人	90,657	13,825,192,500	
	いちごオフィスリート投資法人	26,217	2,131,442,100	
	大和証券オフィス投資法人	13,255	3,706,098,000	
	阪急阪神リート投資法人	15,254	2,001,324,800	
	スターツプロシード投資法人	5,546	1,111,418,400	
	大和ハウスリート投資法人	48,226	11,800,902,200	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	107,100	8,450,190,000	
	大和証券リビング投資法人	47,114	4,848,030,600	
	ジャパンエクセレント投資法人	27,805	3,342,161,000	
投資証券 合計			314,436,883,200	
合計			314,436,883,200	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

野村不動産マスターF	5,000口
日本ビルファンド	1,350口

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2023年6月16日から2024年6月17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】

ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	53,848,388	55,733,279
親投資信託受益証券	18,253,086,308	20,783,620,019
流動資産合計	18,306,934,696	20,839,353,298
資産合計	18,306,934,696	20,839,353,298
負債の部		
流動負債		
未払解約金	15,666,831	12,049,981
未払受託者報酬	1,958,556	2,259,984
未払委託者報酬	36,723,609	42,375,491
その他未払費用	489,552	564,917
流動負債合計	54,838,548	57,250,373
負債合計	54,838,548	57,250,373
純資産の部		
元本等		
元本	※1 18,214,604,055	※1 20,883,336,459
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 37,492,093	※2 △ 101,233,534
（分配準備積立金）	2,167,517,921	1,773,357,939
元本等合計	18,252,096,148	20,782,102,925
純資産合計	18,252,096,148	20,782,102,925
負債純資産合計	18,306,934,696	20,839,353,298

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期 自　2022年6月16日 至　2023年6月15日	第8期 自　2023年6月16日 至　2024年6月17日
営業収益		
受取利息	6	8,853
有価証券売買等損益	△ 692,465,928	2,329,711
営業収益合計	△ 692,465,922	2,338,564
営業費用		
支払利息	12,716	5,969
受託者報酬	3,862,957	4,286,925
委託者報酬	72,432,103	80,381,409
その他費用	971,510	1,077,524
営業費用合計	77,279,286	85,751,827
営業利益又は営業損失（△）	△ 769,745,208	△ 83,413,263
経常利益又は経常損失（△）	△ 769,745,208	△ 83,413,263
当期純利益又は当期純損失（△）	△ 769,745,208	△ 83,413,263
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（△）	△ 37,410,743	△ 45,196,985
期首剰余金又は期首欠損金（△）	747,117,015	37,492,093
剰余金増加額又は欠損金減少額	150,113,153	6,620,999
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	6,620,999
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	150,113,153	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	127,403,610	107,130,348
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	127,403,610	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	107,130,348
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	37,492,093	△ 101,233,534

(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8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2024年6月15日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2024年6月17日としております。このため、当計算期間は368日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	第7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
1．※1 期首元本額	15,522,412,035円	18,214,604,055円
期中追加設定元本額	5,389,055,347円	6,627,669,356円
期中一部解約元本額	2,696,863,327円	3,958,936,952円
2．計算期間末日における受益権の総数	18,214,604,055口	20,883,336,459口
3．※2 元本の欠損	――――――	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は101,233,534円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第7期 自2022年6月16日 至2023年6月15日	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日

※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,539,154,470円）及び分配準備積立金（2,167,517,921円）より分配対象額は5,706,672,391円（1万口当たり3,133.02円）であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（4,769,436,900円）及び分配準備積立金（1,773,357,939円）より分配対象額は6,542,794,839円（1万口当たり3,133.02円）であり、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17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。 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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	第8期 2024年6月17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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17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	△676,672,043	29,297,483
合計	△676,672,043	29,297,483

(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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17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8期 自2023年6月16日 至2024年6月17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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0021円 (10,021円)	0.9952円 (9,952円)

(4)【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	24,721,803,282	20,783,620,019	
親投資信託受益証券 合計			20,783,620,019	
合計			20,783,620,019	

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

	2023年6月15日現在 金 額（円）	2024年6月17日現在 金 額（円）
資産の部		

流動資産		
預金	48,891,025	203,072,547
コール・ローン	296,161,395	162,870,581
投資信託受益証券	519,089,273	382,552,153
投資証券	22,162,714,557	24,226,719,052
派生商品評価勘定	8,958,295	28,810,416
未収入金	75,093,306	26,004,087
未収配当金	60,079,306	68,941,817
差入委託証拠金	360,775,820	367,357,284
流動資産合計	23,531,762,977	25,466,327,937
資産合計	23,531,762,977	25,466,327,937
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	350,559,490	111,207,805
未払解約金	17,610,000	-
流動負債合計	368,169,490	111,207,805
負債合計	368,169,490	111,207,805
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	27,483,964,976	30,158,213,460
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△4,320,371,489	△4,803,093,328
元本等合計	23,163,593,487	25,355,120,132
純資産合計	23,163,593,487	25,355,120,132
負債純資産合計	23,531,762,977	25,466,327,937

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2024年6月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券

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

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	2023年6月15日現在	2024年6月17日現在
1. ※1 期首	2022年6月16日	2023年6月16日
期首元本額	23,434,151,916円	27,483,964,976円
期中追加設定元本額	7,967,013,569円	10,991,030,606円
期中一部解約元本額	3,917,200,509円	8,316,782,122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）	21,657,672,412円	24,721,803,282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）	1,000,051,316円	1,115,161,590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）	1,124,792円	1,517,667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	508,448,807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）	3,397,474,305円	3,811,282,114円

計	27,483,964,976円	30,158,213,460円
2. 期末日における受益権の総数	27,483,964,976口	30,158,213,460口
3. ※2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は4,320,371,489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4,803,093,328円であります。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年6月16日 至2024年6月17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。 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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年6月17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	2023年6月15日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2024年6月17日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	7,639,774	4,834,167
投資証券	△3,231,043,402	691,987,897
合計	△3,223,403,628	696,822,064

（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	2023年6月15日現在				2024年6月17日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
不動産投信								
指数先物取引								
買建	761,498,997	-	770,457,292	8,958,295	864,506,730	-	847,236,722	△17,270,008
合計	761,498,997	-	770,457,292	8,958,295	864,506,730	-	847,236,722	△17,270,008

（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6月15日現在				2024年6月17日現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	21,937,027,320	-	22,287,586,810	△350,559,490	24,598,604,673	-	24,663,732,054	△65,127,381
アメリカ・ドル	16,926,952,180	-	17,109,014,074	△182,061,894	18,738,965,171	-	18,821,412,448	△82,447,277
イギリス・ポンド	1,107,378,942	-	1,138,948,476	△31,569,534	1,353,097,721	-	1,352,156,720	941,001
イスラエル・シュケル	25,772,179	-	27,082,447	△1,310,268	31,962,707	-	31,904,330	58,377
オーストラリア・ドル	1,511,405,493	-	1,595,676,763	△84,271,270	1,931,862,032	-	1,925,279,283	6,582,749
カナダ・ドル	422,483,567	-	434,743,176	△12,259,609	375,751,000	-	373,855,908	1,895,092
シンガポール・ドル	812,340,658	-	826,862,126	△14,521,468	789,317,071	-	790,828,920	△1,511,849
ニュージーランド・ドル	88,059,712	-	91,718,423	△3,658,711	78,224,046	-	78,316,984	△92,938
ユーロ	710,885,874	-	728,276,331	△17,390,457	1,049,195,211	-	1,038,536,662	10,658,549
香港・ドル	331,748,715	-	335,264,994	△3,516,279	250,229,714	-	251,440,799	△1,211,085
合計	21,937,027,320	-	22,287,586,810	△350,559,490	24,598,604,673	-	24,663,732,054	△65,127,381

（注）　1．時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2023年6月15日現在	2024年6月17日現在
1口当たり純資産額	0.8428円	0.8407円
（1万口当たり純資産額）	(8,428円)	(8,407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	28,910	2,428,440.000	
	アメリカ・ドル 小計			2,428,440.000 (382,552,153)	
投資信託受益証券 合計				382,552,153 [382,552,153]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	13,726	190,654.140	
		URBAN EDGE PROPERTIES	13,400	240,262.000	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	11,983	170,637.920	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	16,157	3,261,936.730	

		SIMON PROPERTY GROUP INC	37,123	5,525,016.090	
		BOSTON PROPERTIES INC	16,446	1,013,731.440	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	15,763	127,207.410	
		VORNADO REALTY TRUST	18,210	463,080.300	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	11,191	136,194.470	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	8,798	359,398.300	
		UNITI GROUP INC	27,186	74,761.500	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	2,686	99,596.880	
		EQUITY RESIDENTIAL	39,315	2,622,703.650	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	24,238	349,996.720	
		EPR PROPERTIES	8,580	346,031.400	
		CITY OFFICE REIT INC	4,603	22,600.730	
		GLOBAL NET LEASE INC	22,246	160,393.660	
		EQUINIX INC	10,694	8,194,384.440	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	10,316	251,504.080	
		CHATHAM LODGING TRUST	5,858	48,504.240	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	6,801	672,142.830	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	14,352	176,673.120	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,761	64,524.570	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	6,929	20,301.970	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	80,352	1,431,872.640	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	36,227	1,283,884.880	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	14,429	71,423.550	
		RLJ LODGING TRUST	18,046	172,700.220	
		FARMLAND PARTNERS INC	5,044	57,501.600	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	7,677	84,754.080	
		KIMCO REALTY CORP	75,877	1,422,693.750	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	7,392	66,675.840	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	43,383	715,819.500	
		WHITESTONE REIT	5,635	75,396.300	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	30,414	1,320,271.740	

		PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	14,810	105,002.900	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	23,918	351,116.240	
		INVITATION HOMES INC	65,522	2,326,031.000	
		JBG SMITH PROPERTIES	9,920	145,824.000	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	8,527	140,780.770	
		CLIPPER REALTY INC	1,647	6,044.490	
		GLADSTONE LAND CORP	3,874	51,834.120	
		AMERICOLD REALTY TRUST	30,357	773,799.930	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	7,310	27,558.700	
		VICI PROPERTIES INC	117,838	3,333,637.020	
		BRT APARTMENTS CORP	1,402	24,268.620	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,194	340,544.280	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	17,772	490,507.200	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,309	90,273.550	
		BROADSTONE NET LEASE INC	21,329	325,907.120	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	12,254	71,195.740	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	5,727	123,989.550	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	25,563	458,344.590	
		PARAMOUNT GROUP INC	19,418	90,099.520	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	15,377	143,313.640	
		NETSTREIT CORP	8,076	138,503.400	
		APARTMENT INCOME REIT CO	16,457	640,506.440	
		CTO REALTY GROWTH INC	2,544	44,316.480	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	24,005	1,076,144.150	
		STAG INDUSTRIAL INC	20,682	723,042.720	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	1,311	19,782.990	
		POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2,551	33,647.690	
		PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	13,899	447,964.770	
		ORION OFFICE REIT INC	6,028	20,676.040	
		DIGITAL CORE REIT UNITS	90,400	48,816.000	
		VENTAS INC	45,833	2,296,233.300	

		CARETRUST REIT INC	14,865	374,152.050	
		INVENTRUST PROPERTIES CORP	7,938	196,227.360	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	34,239	762,844.920	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	6,148	13,771.520	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	26,337	376,355.730	
		UMH PROPERTIES INC	7,337	113,136.540	
		CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	2,807	61,389.090	
		NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C	4,276	20,695.840	
		PEAKSTONE REALTY TRUST CLASS E	4,102	47,049.940	
		NET LEASE OFFICE PROPERTIES	1,634	40,604.900	
		IRON MOUNTAIN INC	33,259	2,927,457.180	
		TERRENO REALTY CORP	10,650	617,593.500	
		SUN COMMUNITIES INC	14,175	1,653,372.000	
		ACADIA REALTY TRUST	12,022	207,980.600	
		ALEXANDER'S INC	272	58,004.000	
		PROLOGIS INC	105,244	11,817,848.760	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	17,937	2,086,431.840	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	20,230	92,653.400	
		SAUL CENTERS INC	1,633	59,996.420	
		VERIS RESIDENTIAL INC	9,426	142,426.860	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	12,162	1,313,982.480	
		COUSINS PROPERTIES INC	17,288	399,179.920	
		SITE CENTERS CORP	20,504	298,538.240	
		EASTGROUP PROPERTIES INC	5,433	901,117.380	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,313	2,036,670.500	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	15,067	715,531.830	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	8,367	846,656.730	
		GETTY REALTY CORP	5,592	149,697.840	
		WELLTOWER INC	63,043	6,558,993.720	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	80,634	1,584,458.100	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	12,041	309,212.880	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	19,486	96,065.980	
		EQUITY COMMONWEALTH	12,155	233,619.100	
		KILROY REALTY CORP	12,161	386,963.020	

		LTC PROPERTIES INC	4,717	158,774.220	
		LXP INDUSTRIAL TRUST	33,332	293,321.600	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	13,294	1,852,120.080	
		MACERICH CO/THE	24,601	356,222.480	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	21,235	1,331,859.200	
		NATL HEALTH INVESTORS INC	4,945	328,545.800	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	20,785	875,464.200	
		REALTY INCOME CORP	94,728	5,055,633.360	
		COPT DEFENSE PROPERTIES TRUST	12,781	311,600.780	
		PUBLIC STORAGE	18,026	5,105,864.500	
		REGENCY CENTERS CORP	18,712	1,155,840.240	
		SAFEHOLD INC	5,263	98,681.250	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	12,266	331,795.300	
		SL GREEN REALTY CORP	7,373	419,744.890	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	27,338	77,093.160	
		UDR INC	34,469	1,388,411.320	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,440	55,742.400	
		WP CAREY INC	24,908	1,397,089.720	
		ELME	10,325	161,276.500	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4,132	4,129.930	
		AGREE REALTY CORP	11,427	700,132.290	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	27,939	904,385.430	
		CUBESMART	25,613	1,132,862.990	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	23,401	233,073.960	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	36,783	5,514,507.360	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	24,065	3,767,857.050	
		CENTERSPACE	1,788	120,940.320	
		KITE REALTY GROUP TRUST	24,989	548,758.440	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,965	46,374.000	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4,550	64,109.500	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	24,642	202,310.820	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	68,229	330,910.650	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES C	11,605	19,148.250	

	DOUGLAS EMMETT INC	18,992	252,593.600	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	203,400	13,831.200	
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	82,300	11,522.000	
	PRIME US REIT	75,240	8,803.080	
アメリカ・ドル 小計			118,336,951.690 (18,641,620,000)	
イギリス・ポンド	WAREHOUSE REIT PLC	48,892	38,918.030	
	HELICAL PLC	13,564	29,569.520	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	44,442	15,243.600	
	ASSURA PLC	363,873	144,530.350	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	74,712	69,855.720	
	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITE	51,354	26,087.830	
	CLS HOLDINGS PLC	20,382	17,569.280	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	64,471	41,390.380	
	REGIONAL REIT LTD	54,681	11,701.730	
	NEWRIVER REIT PLC	39,166	28,356.180	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	231,528	316,961.830	
	CUSTODIAN REIT PLC	51,902	37,369.440	
	PRS REIT PLC/THE	64,664	49,467.960	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	53,298	45,356.590	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	46,825	26,549.770	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	73,523	58,450.780	
	AEW UK REIT PLC	20,041	17,175.130	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	83,162	62,787.310	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	151,928	109,540.080	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	58,444	69,899.020	
	HOME REIT PLC	84,338	16,049.520	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	89,103	554,220.660	
	SEGRO PLC	158,629	1,441,937.610	
	HAMMERSON PLC	469,562	131,571.270	
	UNITE GROUP PLC/THE	47,016	427,845.600	
	BRITISH LAND CO PLC	111,269	474,673.550	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	48,649	165,163.350	
	DERWENT LONDON PLC	13,311	309,081.420	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	162,931	148,593.070	
	WORKSPACE GROUP PLC	16,611	93,686.040	

	SAFESTORE HOLDINGS PLC	25,894	206,634.120	
	BIG YELLOW GROUP PLC	23,257	272,572.040	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	241,409	469,540.500	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	55,879	24,866.150	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	280,932	432,073.410	
イギリス・ポンド 小計			6,385,288.840 (1,276,227,681)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	82,303	128,063.460	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	26,700	173,309.700	
	REIT 1 LTD	23,250	320,385.000	
イスラエル・シュケル 小計			621,758.160 (26,331,893)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	129,126	838,027.740	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	62,441	70,870.530	
	HMC CAPITAL LTD	29,287	216,430.930	
	ABACUS STORAGE KING STAPLED UNITS	71,161	86,816.420	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	40,594	97,831.540	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	184,360	77,431.200	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	64,030	199,133.300	
	RURAL FUNDS GROUP	50,015	100,530.150	
	WAYPOINT REIT	80,654	187,117.280	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	82,086	281,554.980	
	CENTURIA OFFICE REIT	52,359	62,307.210	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	99,358	171,889.340	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	220,528	270,146.800	
	REGION GROUP	143,388	315,453.600	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	32,517	74,463.930	
	NATIONAL STORAGE REIT	156,226	360,882.060	
	DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	26,925	79,698.000	
	GDI PROPERTY GROUP	64,299	38,900.890	
	SCENTRE GROUP	623,125	1,944,150.000	

	ARENA REIT	43,831	163,051.320	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	23,412	75,620.760	
	BWP TRUST	64,841	233,427.600	
	GPT GROUP	229,973	935,990.110	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	62,103	203,697.840	
	MIRVAC GROUP	473,716	892,954.660	
	STOCKLAND	285,956	1,269,644.640	
	ABACUS GROUP UNIT	52,859	59,730.670	
	GOODMAN GROUP	207,484	7,421,702.680	
	VICINITY CENTRES	464,533	864,031.380	
	CHARTER HALL GROUP	56,785	697,887.650	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	45,017	219,232.790	
オーストラリア・ドル 小計			18,510,608.000 (1,928,250,035)	
カナダ・ドル	BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	4,600	14,490.000	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	3,600	25,128.000	
	PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	5,725	77,058.500	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	3,500	17,640.000	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST U	2,026	30,896.500	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	7,100	45,937.000	
	SLATE GROCERY REIT	3,600	40,068.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	7,200	123,480.000	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,500	37,425.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	15,700	76,302.000	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL ESTATE	956	8,202.480	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,800	253,574.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	16,100	201,894.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	8,900	104,664.000	

		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	12,500	183,875.000	
		CHOICE PROPERTIES REIT	19,800	251,658.000	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	2,400	36,192.000	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	6,400	86,336.000	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	8,700	191,313.000	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	9,900	432,531.000	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	15,800	142,200.000	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	17,600	293,920.000	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	1,000	19,060.000	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2,900	199,288.000	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6,300	78,813.000	
		ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	7,700	121,198.000	
カナダ・ドル 小計				3,093,143.480 (354,752,626)	
シンガポール・ドル		KEPPEL DC REIT	165,800	296,782.000	
		AIMS APAC REIT	85,000	107,950.000	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	351,200	335,396.000	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	66,400	44,156.000	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	214,900	119,269.500	
		EC WORLD REIT	32,900	9,212.000	
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	427,300	1,098,161.000	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	607,500	1,178,550.000	
		SUNTEC REIT	276,500	293,090.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	400,700	528,924.000	
		KEPPEL REIT	277,100	232,764.000	

	CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	306,500	272,785.000	
	ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T	720,000	201,600.000	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	80,900	77,259.500	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	140,400	301,860.000	
	STARHILL GLOBAL REIT	168,100	80,688.000	
	CAPITALAND CHINA TRUST	139,900	91,634.500	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	46,500	169,260.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	248,400	536,544.000	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	277,300	338,306.000	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	127,600	78,474.000	
	PARAGON REIT	153,900	128,506.500	
シンガポール・ドル 小計			6,521,172.000 (759,520,903)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	108,963	117,680.040	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	202,139	162,721.890	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	126,102	265,444.710	
	PRECINCT PROPERTIES GROUP	190,460	223,790.500	
ニュージーランド・ドル 小計			769,637.140 (74,393,126)	
ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	5,052	109,375.800	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	3,638	140,790.600	
	HAMBORNER REIT AG	8,268	53,576.640	
	WERELDHAVE NV	4,001	53,453.360	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	11,580	839,550.000	
	NSI NV	1,842	36,213.720	
	VASTNED RETAIL NV	1,879	43,968.600	
	ICADE	3,652	93,491.200	
	CARMILA	6,491	103,985.820	
	ALTAREA	505	42,723.000	
	GECINA SA	5,857	536,208.350	
	KLEPIERRE	22,255	568,392.700	
	COVIVIO	5,531	247,678.180	
	MERCIALYS	10,969	118,684.580	
	AEDIFICA	5,425	305,427.500	
	COFINIMMO	4,194	240,735.600	

		RETAIL ESTATES	1,428	89,392.800	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	19,778	500,383.400	
		CARE PROPERTY INVEST	4,054	56,593.840	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	3,886	111,528.200	
		MONTEA NV	2,092	166,314.000	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,703	12,226.270	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	5,518	38,074.200	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	33,414	200,818.140	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	38,053	403,361.800	
		CROMWELL REIT EUR	36,800	52,256.000	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	44,558	40,681.450	
	ユーロ 小計			5,205,885.750 (877,920,573)	
	韓国・ウォン	SK REITS LTD	13,417	65,273,705.000	
		D&D PLATFORM REIT LTD	6,865	24,096,150.000	
		NH ALL ONE REIT LTD	3,459	12,763,710.000	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	9,443	57,696,730.000	
		LOTTE REIT CO LTD	15,417	51,338,610.000	
		JR REIT XXVII	21,637	89,468,995.000	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	5,393	24,915,660.000	
		ESR KENDALL SQUARE REIT COL	21,147	97,381,935.000	
	韓国・ウォン 小計			422,935,495.000 (48,341,527)	
	香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	291,000	299,730.000	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	128,000	221,440.000	
		FORTUNE REIT	184,000	717,600.000	
		PROSPERITY REIT	156,000	210,600.000	
		LINK REIT	308,800	10,066,880.000	
		CHAMPION REIT	223,000	356,800.000	
	香港・ドル 小計			11,873,050.000 (239,360,688)	
投資証券 合計				24,226,719,052 [24,226,719,052]	

合計		24,609,271,205 [24,609,271,205]	

投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資信託受益証券時価比率	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄 投資証券 137銘柄	2.0%	98%	77.3%
イギリス・ポンド	投資証券 35銘柄	-%	100%	5.2%
イスラエル・シュケル	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%	7.8%
カナダ・ドル	投資証券 26銘柄	-%	100%	1.4%
シンガポール・ドル	投資証券 22銘柄	-%	100%	3.1%
ニュージーランド・ドル	投資証券 4銘柄	-%	100%	0.3%
ユーロ	投資証券 27銘柄	-%	100%	3.6%
韓国・ウォン	投資証券 8銘柄	-%	100%	0.2%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	-%	100%	1.0%

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2023年6月16日から2024年6月17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】

ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	14,893,229	17,405,102
親投資信託受益証券	4,650,518,068	7,453,264,693
流動資産合計	4,665,411,297	7,470,669,795
資産合計	4,665,411,297	7,470,669,795
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,626,218	2,492,533
未払受託者報酬	441,815	727,036
未払委託者報酬	8,284,923	13,632,481
その他未払費用	110,379	181,673
流動負債合計	14,463,335	17,033,723
負債合計	14,463,335	17,033,723
純資産の部		
元本等		
元本	※1 3,020,170,856	※1 4,068,540,757
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,630,777,106	3,385,095,315
（分配準備積立金）	705,262,707	1,539,571,039
元本等合計	4,650,947,962	7,453,636,072
純資産合計	4,650,947,962	7,453,636,072
負債純資産合計	4,665,411,297	7,470,669,795

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期 自　2022年6月16日 至　2023年6月15日	第8期 自　2023年6月16日 至　2024年6月17日
営業収益		
受取利息	1	3,086
有価証券売買等損益	207,555,455	1,089,971,625
営業収益合計	207,555,456	1,089,974,711
営業費用		
支払利息	2,702	1,662
受託者報酬	859,202	1,292,227
委託者報酬	16,111,738	24,230,508
その他費用	214,647	322,883
営業費用合計	17,188,289	25,847,280
営業利益又は営業損失（△）	190,367,167	1,064,127,431
経常利益又は経常損失（△）	190,367,167	1,064,127,431
当期純利益又は当期純損失（△）	190,367,167	1,064,127,431
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（△）	12,534,900	82,726,329
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,110,390,892	1,630,777,106
剰余金増加額又は欠損金減少額	523,444,961	1,228,932,092
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	523,444,961	1,228,932,092
剰余金減少額又は欠損金増加額	180,891,014	456,014,985
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	180,891,014	456,014,985
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,630,777,106	3,385,095,315

(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8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日
1．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2024年6月15日及びその翌日が休日のため、当計算期間末日を2024年6月17日としております。このため、当計算期間は368日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	第7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
1．　※1 期首元本額	2,343,884,195円	3,020,170,856円
期中追加設定元本額	1,053,030,359円	1,871,437,793円
期中一部解約元本額	376,743,698円	823,067,892円
2．　計算期間末日における受益権の総数	3,020,170,856口	4,068,540,757口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区分	第7期 自2022年6月16日 至2023年6月15日	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日

※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（177,833,824円）、投資信託約款に規定される収益調整金（925,516,946円）及び分配準備積立金（527,428,883円）より分配対象額は1,630,779,653円（1万口当たり5,399.63円）であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（1,649円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（981,397,436円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,845,524,276円）及び分配準備積立金（558,171,954円）より分配対象額は3,385,095,315円（1万口当たり8,320.17円）であり、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	第8期 自2023年6月16日 至2024年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	第8期 2024年6月17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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17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	200,071,724	1,043,761,787
合計	200,071,724	1,043,761,787

(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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17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8期 自2023年6月16日 至2024年6月17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7期 2023年6月15日現在	第8期 2024年6月17日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.5400円 (15,400円)	1.8320円 (18,320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	1,955,980,762	7,453,264,693	
親投資信託受益証券 合計			7,453,264,693	
合計			7,453,264,693	

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

	2023年6月15日現在 金 額（円）	2024年6月17日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		

預金	154,307,636	354,676,827
コール・ローン	484,818,531	317,329,086
投資信託受益証券	1,754,535,818	1,763,894,916
投資証券	28,791,803,997	38,951,062,271
派生商品評価勘定	15,800,902	7,265,592
未収入金	1,131,204	942,018
未収配当金	77,136,732	109,471,581
差入委託証拠金	167,487,490	418,509,770
流動資産合計	31,447,022,310	41,923,152,061
資産合計	31,447,022,310	41,923,152,061
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	44,675,540
未払金	-	33,085,238
未払解約金	55,171,000	831,000
流動負債合計	55,171,000	78,591,778
負債合計	55,171,000	78,591,778
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	9,843,782,869	10,981,310,353
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	21,548,068,441	30,863,249,930
元本等合計	31,391,851,310	41,844,560,283
純資産合計	31,391,851,310	41,844,560,283
負債純資産合計	31,447,022,310	41,923,152,061

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2024年6月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券

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

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	2023年6月15日現在	2024年6月17日現在
1. ※1 期首	2022年6月16日	2023年6月16日
期首元本額	8,345,562,785円	9,843,782,869円
期中追加設定元本額	2,162,995,640円	2,203,448,196円
期中一部解約元本額	664,775,556円	1,065,920,712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）	94,248,022円	87,906,063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）	1,458,299,802円	1,955,980,762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）	274,543,609円	351,688,573円
Ｄ－Ｉ's グローバルＲＥＩＴインデックス	1,640,299円	1,440,421円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	15,709,152円	21,117,268円
ｉＦｒｅｅ 外国ＲＥＩＴインデックス	744,870,116円	651,464,417円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	2,197,414,066円	2,475,793,628円

グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成型）	371,513,203円	365,994,567円
グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）	225,034,809円	234,273,674円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	30,065円	3,565,459円
ＤＣダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックスファンド	3,973,004,517円	4,119,965,423円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	7,781,902円	7,703,940円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	7,881,175円	8,750,218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）	1,403,715円	4,537,854円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	145,182,962円	138,343,907円
スタイル9（6資産分散・保守型）	-円	21,229円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	-円	815,174円
スタイル9（6資産分散・積極型）	-円	749,411円
スタイル9（8資産分散・保守型）	-円	22,560円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	-円	543,086円
スタイル9（8資産分散・積極型）	-円	543,573円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルＲＥＩＴ	254,276,260円	204,302,936円
ダイワ・ノーロード グローバルＲＥＩＴファンド	67,019,874円	64,844,404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）	3,929,321円	29,208,816円
ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	-円	87,624,943円
ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	-円	83,814,309円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	-円	80,293,738円

計	9,843,782,869円	10,981,310,353円
2. 期末日における受益権の総数	9,843,782,869口	10,981,310,353口

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	自2023年6月16日 至2024年6月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	2024年6月17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	2023年6月15日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2024年6月17日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	21,270,363	25,600,657
投資証券	△429,776,574	2,157,697,371
合計	△408,506,211	2,183,298,028

（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	2023年6月15日現在				2024年6月17日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
不動産投信指数先物取引								
買建	840,481,969	-	850,296,032	9,814,063	1,171,910,880	-	1,134,681,168	△37,229,712
合計	840,481,969	-	850,296,032	9,814,063	1,171,910,880	-	1,134,681,168	△37,229,712

（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6月15日現在				2024年6月17日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	465,522,474	-	471,509,313	5,986,839	311,890,156	-	311,709,920	△180,236
アメリカ・ドル	395,878,626	-	400,161,762	4,283,136	206,470,440	-	207,361,440	891,000
ユーロ	69,643,848	-	71,347,551	1,703,703	105,419,716	-	104,348,480	△1,071,236
合計	465,522,474	-	471,509,313	5,986,839	311,890,156	-	311,709,920	△180,236

（注）　1．　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2．　換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2023年6月15日現在	2024年6月17日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.1890円 (31,890円)	3.8105円 (38,105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	133,300	11,197,200.000	
	アメリカ・ドル 小計			11,197,200.000 (1,763,894,916)	
投資信託受益証券 合計				1,763,894,916 [1,763,894,916]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	22,085	306,760.650	
		URBAN EDGE PROPERTIES	21,560	386,570.800	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	19,280	274,547.200	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	26,097	5,268,723.330	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	59,930	8,919,381.900	
		BOSTON PROPERTIES INC	26,562	1,637,281.680	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	24,000	193,680.000	
		VORNADO REALTY TRUST	29,300	745,099.000	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	17,448	212,342.160	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	14,156	578,272.600	
		UNITI GROUP INC	43,742	120,290.500	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	4,188	155,291.040	
		EQUITY RESIDENTIAL	63,457	4,233,216.470	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	38,998	563,131.120	
		EPR PROPERTIES	13,806	556,795.980	
		CITY OFFICE REIT INC	6,000	29,460.000	
		GLOBAL NET LEASE INC	35,794	258,074.740	
		EQUINIX INC	17,206	13,184,269.560	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	16,598	404,659.240	
		CHATHAM LODGING TRUST	8,953	74,130.840	

		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	10,943	1,081,496.690	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	23,093	284,274.830	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	4,348	101,612.760	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	7,800	22,854.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	129,786	2,312,786.520	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	58,489	2,072,850.160	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	23,216	114,919.200	
		RLJ LODGING TRUST	28,135	269,251.950	
		FARMLAND PARTNERS INC	7,936	90,470.400	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	12,353	136,377.120	
		KIMCO REALTY CORP	122,585	2,298,468.750	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	11,295	101,880.900	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	69,803	1,151,749.500	
		WHITESTONE REIT	8,217	109,943.460	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	49,136	2,132,993.760	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	22,673	160,751.570	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	38,484	564,945.120	
		INVITATION HOMES INC	105,825	3,756,787.500	
		JBG SMITH PROPERTIES	15,961	234,626.700	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	13,294	219,483.940	
		CLIPPER REALTY INC	1,890	6,936.300	
		GLADSTONE LAND CORP	6,132	82,046.160	
		AMERICOLD REALTY TRUST	48,843	1,245,008.070	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	11,179	42,144.830	
		VICI PROPERTIES INC	190,400	5,386,416.000	
		BRT APARTMENTS CORP	2,049	35,468.190	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	5,139	547,920.180	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	28,595	789,222.000	

PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	6,717	140,721.150	
BROADSTONE NET LEASE INC	34,319	524,394.320	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	19,716	114,549.960	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,928	193,291.200	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	41,131	737,478.830	
PARAMOUNT GROUP INC	30,339	140,772.960	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	23,974	223,437.680	
NETSTREIT CORP	12,591	215,935.650	
APARTMENT INCOME REIT CO	26,480	1,030,601.600	
CTO REALTY GROWTH INC	3,700	64,454.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	38,724	1,735,996.920	
STAG INDUSTRIAL INC	33,277	1,163,363.920	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	2,066	31,175.940	
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	3,325	43,856.750	
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	22,363	720,759.490	
ORION OFFICE REIT INC	9,048	31,034.640	
DIGITAL CORE REIT UNITS	126,600	68,364.000	
VENTAS INC	74,045	3,709,654.500	
CARETRUST REIT INC	23,917	601,990.890	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	12,376	305,934.720	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	55,091	1,227,427.480	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,759	17,380.160	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	42,376	605,553.040	
UMH PROPERTIES INC	11,439	176,389.380	
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	4,316	94,390.920	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C	5,785	27,999.400	
PEAKSTONE REALTY TRUST CLASS E	6,300	72,261.000	
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	2,529	62,845.650	
IRON MOUNTAIN INC	53,713	4,727,818.260	
TERRENO REALTY CORP	17,127	993,194.730	

		SUN COMMUNITIES INC	22,907	2,671,872.480	
		ACADIA REALTY TRUST	18,744	324,271.200	
		ALEXANDER'S INC	393	83,807.250	
		PROLOGIS INC	170,037	19,093,454.730	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	28,960	3,368,627.200	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	31,541	144,457.780	
		SAUL CENTERS INC	2,261	83,069.140	
		VERIS RESIDENTIAL INC	14,696	222,056.560	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	19,568	2,114,126.720	
		COUSINS PROPERTIES INC	27,816	642,271.440	
		SITE CENTERS CORP	32,991	480,348.960	
		EASTGROUP PROPERTIES INC	8,742	1,449,948.120	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,767	3,277,109.500	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	24,242	1,151,252.580	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	13,463	1,362,320.970	
		GETTY REALTY CORP	8,998	240,876.460	
		WELLTOWER INC	101,835	10,594,913.400	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	130,240	2,559,216.000	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	19,374	497,524.320	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	30,381	149,778.330	
		EQUITY COMMONWEALTH	19,557	375,885.540	
		KILROY REALTY CORP	19,567	622,621.940	
		LTC PROPERTIES INC	7,590	255,479.400	
		LXP INDUSTRIAL TRUST	53,632	471,961.600	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	21,391	2,980,194.120	
		MACERICH CO/THE	39,582	573,147.360	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	34,266	2,149,163.520	
		NATL HEALTH INVESTORS INC	7,956	528,596.640	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	33,442	1,408,577.040	
		REALTY INCOME CORP	153,016	8,166,463.920	
		COPT DEFENSE PROPERTIES TRUST	20,564	501,350.320	
		PUBLIC STORAGE	29,103	8,243,424.750	
		REGENCY CENTERS CORP	30,207	1,865,886.390	
		SAFEHOLD INC	8,205	153,843.750	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	19,735	533,831.750	
		SL GREEN REALTY CORP	11,862	675,303.660	

		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	37,967	107,066.940	
		UDR INC	55,660	2,241,984.800	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,229	86,284.590	
		WP CAREY INC	40,176	2,253,471.840	
		ELME	16,097	251,435.140	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4,700	4,697.650	
		AGREE REALTY CORP	18,386	1,126,510.220	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	44,953	1,455,128.610	
		CUBESMART	41,311	1,827,185.530	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	37,652	375,013.920	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	59,404	8,905,847.680	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	38,821	6,078,203.970	
		CENTERSPACE	2,759	186,618.760	
		KITE REALTY GROUP TRUST	40,207	882,945.720	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,892	68,251.200	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6,928	97,615.520	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	38,419	315,419.990	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	109,779	532,428.150	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES C	16,005	26,408.250	
		DOUGLAS EMMETT INC	30,558	406,421.400	
		MANULIFE US REAL ESTATE INV	265,962	18,085.410	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	135,300	18,942.000	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	0.000	
		PRIME US REIT	101,420	11,866.140	
	アメリカ・ドル 小計			190,553,562.780 (30,017,902,745)	
	イギリス・ポンド	WAREHOUSE REIT PLC	77,771	61,905.710	
		HELICAL PLC	20,666	45,051.880	
		LIFE SCIENCE REIT PLC	61,021	20,930.200	
		ASSURA PLC	568,072	225,638.190	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	116,204	108,650.740	
		ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITE	67,467	34,273.230	

	CLS HOLDINGS PLC	22,950	19,782.900	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	104,221	66,909.880	
	REGIONAL REIT LTD	71,837	15,373.110	
	NEWRIVER REIT PLC	59,545	43,110.580	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	376,124	514,913.750	
	CUSTODIAN REIT PLC	83,903	60,410.160	
	PRS REIT PLC/THE	95,537	73,085.800	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	78,863	67,112.410	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	62,933	35,683.010	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	118,044	93,844.980	
	AEW UK REIT PLC	27,617	23,667.760	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	133,520	100,807.600	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	237,187	171,011.820	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	90,888	108,702.040	
	HOME REIT PLC	117,587	22,376.800	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	144,750	900,345.000	
	SEGRO PLC	257,696	2,342,456.640	
	HAMMERSON PLC	733,072	205,406.770	
	UNITE GROUP PLC/THE	76,379	695,048.900	
	BRITISH LAND CO PLC	180,759	771,117.890	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	78,316	265,882.820	
	DERWENT LONDON PLC	21,624	502,109.280	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	254,364	231,979.960	
	WORKSPACE GROUP PLC	25,932	146,256.480	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	41,573	331,752.540	
	BIG YELLOW GROUP PLC	37,781	442,793.320	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	392,175	762,780.370	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	93,799	41,740.550	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	439,490	675,935.620	
イギリス・ポンド 小計			10,228,848.690 (2,044,439,988)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	125,212	194,829.870	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	40,780	264,702.980	
	REIT 1 LTD	35,212	485,221.360	
イスラエル・シュケル 小計			944,754.210 (40,011,002)	

オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	212,807	1,381,117.430	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	88,653	100,621.150	
	HMC CAPITAL LTD	47,711	352,584.290	
	ABACUS STORAGE KING STAPLED UNITS	106,601	130,053.220	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	66,132	159,378.120	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	274,625	115,342.500	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	105,525	328,182.750	
	RURAL FUNDS GROUP	72,888	146,504.880	
	WAYPOINT REIT	131,393	304,831.760	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	130,083	446,184.690	
	CENTURIA OFFICE REIT	77,754	92,527.260	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	157,455	272,397.150	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	349,474	428,105.650	
	REGION GROUP	227,229	499,903.800	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	50,422	115,466.380	
	NATIONAL STORAGE REIT	247,573	571,893.630	
	DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	39,338	116,440.480	
	GDI PROPERTY GROUP	104,909	63,469.940	
	SCENTRE GROUP	1,026,952	3,204,090.240	
	ARENA REIT	70,268	261,396.960	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	38,140	123,192.200	
	BWP TRUST	105,500	379,800.000	
	GPT GROUP	379,010	1,542,570.700	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	101,171	331,840.880	
	MIRVAC GROUP	780,715	1,471,647.770	
	STOCKLAND	471,274	2,092,456.560	
	ABACUS GROUP UNIT	79,969	90,364.970	
	GOODMAN GROUP	341,947	12,231,444.190	
	VICINITY CENTRES	765,581	1,423,980.660	
	CHARTER HALL GROUP	93,585	1,150,159.650	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	73,337	357,151.190	
オーストラリア・ドル 小計			30,285,101.050 (3,154,798,976)	

カナダ・ドル	BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	8,400	26,460.000	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	5,600	39,088.000	
	PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	9,341	125,729.860	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	4,400	22,176.000	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST U	3,358	51,209.500	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,800	63,406.000	
	SLATE GROCERY REIT	5,500	61,215.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	11,000	188,650.000	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	3,400	50,898.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	23,500	114,210.000	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL ESTATE	1,060	9,094.800	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6,100	407,053.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	26,400	331,056.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	14,000	164,640.000	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	20,500	301,555.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	31,700	402,907.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	3,300	49,764.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	10,500	141,645.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	14,000	307,860.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	16,200	707,778.000	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	25,366	228,294.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	29,000	484,300.000	

	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	1,650	31,449.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,700	322,984.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	10,300	128,853.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	12,400	195,176.000	
カナダ・ドル 小計			4,957,451.160 (568,570,074)	
シンガポール・ドル	KEPPEL DC REIT	262,783	470,381.570	
	AIMS APAC REIT	134,700	171,069.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	572,090	546,345.950	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	101,600	67,564.000	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	344,440	191,164.200	
	EC WORLD REIT	36,500	10,220.000	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	704,077	1,809,477.890	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,001,122	1,942,176.680	
	SUNTEC REIT	438,100	464,386.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	660,400	871,728.000	
	KEPPEL REIT	439,100	368,844.000	
	CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	485,756	432,322.840	
	ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T	1,172,902	328,412.560	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	131,700	125,773.500	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	222,376	478,108.400	
	STARHILL GLOBAL REIT	273,900	131,472.000	
	CAPITALAND CHINA TRUST	227,842	149,236.510	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	75,700	275,548.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	409,369	884,237.040	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	451,684	551,054.480	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	200,000	123,000.000	
	PARAGON REIT	237,100	197,978.500	

シンガポール・ドル 小計			10,590,501.120 (1,233,475,666)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	157,936	170,570.880	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	314,982	253,560.510	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	208,239	438,343.090	
	PRECINCT PROPERTIES GROUP	313,870	368,797.250	
ニュージーランド・ドル 小計			1,231,271.730 (119,014,726)	
ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	7,366	159,473.900	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	5,305	205,303.500	
	HAMBORNER REIT AG	12,056	78,122.880	
	WERELDHAVE NV	6,098	81,469.280	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	17,291	1,253,597.500	
	NSI NV	3,090	60,749.400	
	VASTNED RETAIL NV	3,081	72,095.400	
	ICADE	5,324	136,294.400	
	CARMILA	9,464	151,613.280	
	ALTAREA	777	65,734.200	
	GECINA SA	8,745	800,604.750	
	KLEPIERRE	33,231	848,719.740	
	COVIVIO	8,259	369,838.020	
	MERCIALYS	15,994	173,055.080	
	AEDIFICA	8,100	456,030.000	
	COFINIMMO	6,263	359,496.200	
	RETAIL ESTATES	2,081	130,270.600	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	29,532	747,159.600	
	CARE PROPERTY INVEST	6,301	87,961.960	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	5,665	162,585.500	
	MONTEA NV	3,050	242,475.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,930	12,640.320	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	8,412	58,042.800	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	48,722	292,819.220	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	56,822	602,313.200	
	CROMWELL REIT EUR	52,920	75,146.400	

		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	73,078	66,720.210	
	ユーロ 小計			7,750,332.340 (1,307,016,045)	
	韓国・ウォン	SK REITS LTD	22,834	111,087,410.000	
		D&D PLATFORM REIT LTD	10,703	37,567,530.000	
		NH ALL ONE REIT LTD	6,454	23,815,260.000	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	13,632	83,291,520.000	
		LOTTE REIT CO LTD	24,036	80,039,880.000	
		JR REIT XXVII	32,413	134,027,755.000	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	9,157	42,305,340.000	
		ESR KENDALL SQUARE REIT COL	31,620	145,610,100.000	
	韓国・ウォン 小計			657,744,795.000 (75,180,230)	
	香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	395,000	406,850.000	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	181,000	313,130.000	
		FORTUNE REIT	294,000	1,146,600.000	
		PROSPERITY REIT	246,000	332,100.000	
		LINK REIT	508,900	16,590,140.000	
		CHAMPION REIT	368,000	588,800.000	
	香港・ドル 小計			19,377,620.000 (390,652,819)	
投資証券 合計				38,951,062,271 [38,951,062,271]	
合計				40,714,957,187 [40,714,957,187]	

投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資信託受益証券時価比率	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率

アメリカ・ドル	投資信託受益証券　1銘柄 投資証券　138銘柄	5.6%	94.4%	78.1%
イギリス・ポンド	投資証券　35銘柄	-%	100%	5.0%
イスラエル・シュケル	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%	7.7%
カナダ・ドル	投資証券　26銘柄	-%	100%	1.4%
シンガポール・ドル	投資証券　22銘柄	-%	100%	3.0%
ニュージーランド・ドル	投資証券　4銘柄	-%	100%	0.3%
ユーロ	投資証券　27銘柄	-%	100%	3.2%
韓国・ウォン	投資証券　8銘柄	-%	100%	0.2%
香港・ドル	投資証券　6銘柄	-%	100%	1.0%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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284条及び第307条の規定により、「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(2024年6月18日から2024年12月17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】

ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

	当中間計算期間末 2024年12月17日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	60,470,078
親投資信託受益証券	31,432,286,513
流動資産合計	31,492,756,591
資産合計	31,492,756,591
負債の部	
流動負債	
未払解約金	9,162,494
未払受託者報酬	3,118,770
未払委託者報酬	45,222,775
その他未払費用	779,620
流動負債合計	58,283,659
負債合計	58,283,659
純資産の部	
元本等	
元本	※1 13,138,106,765
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	18,296,366,167
（分配準備積立金）	6,530,202,239
元本等合計	31,434,472,932
純資産合計	31,434,472,932
負債純資産合計	31,492,756,591

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	当中間計算期間 自　2024年6月18日 至　2024年12月17日
営業収益	
受取利息	52,325
有価証券売買等損益	694,718,580
営業収益合計	694,770,905
営業費用	
受託者報酬	3,118,770
委託者報酬	45,222,775
その他費用	779,620
営業費用合計	49,121,165
営業利益又は営業損失（△）	645,649,740
経常利益又は経常損失（△）	645,649,740
中間純利益又は中間純損失（△）	645,649,740
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（△）	48,652,050
期首剰余金又は期首欠損金（△）	14,565,462,154
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,731,944,182
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,731,944,182
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,598,037,859
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,598,037,859
中間剰余金又は中間欠損金（△）	18,296,366,167

(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2024年6月18日 至2024年12月17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 2024年12月17日現在
1．　※1 期首元本額	10,829,538,359円
期中追加設定元本額	3,494,882,184円
期中一部解約元本額	1,186,313,778円
2．　中間計算期間末日における受益権の総数	13,138,106,765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2024年6月18日 至2024年12月17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 2024年12月17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 2024年12月17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 2024年12月17日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.3926円 (23,926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

		2024年12月17日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		18,093,540,359
株式	※2※3	401,326,827,680
派生商品評価勘定		455,050
未収入金		23,166,500
未収配当金		42,918,686
前払金		2,945,000

その他未収収益	※4	7,190,995
流動資産合計		419,497,044,270
資産合計		419,497,044,270
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		20,943,450
未払解約金		98,530,240
未払利息		1,096,239
受入担保金		12,934,917,302
流動負債合計		13,055,487,231
負債合計		13,055,487,231
純資産の部		
元本等		
元本	※1	202,834,890,976
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）		203,606,666,063
元本等合計		406,441,557,039
純資産合計		406,441,557,039
負債純資産合計		419,497,044,270

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2024年6月18日 至2024年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引

	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3.　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年12月17日現在
1.　※1 期首	2024年6月18日
期首元本額	179,077,569,301円
期中追加設定元本額	33,670,194,787円
期中一部解約元本額	9,912,873,112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	2,759,672,127円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	3,722,777,467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	904,682円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	8,959,470円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	127,893,647円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	11,283,120円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	308,334,441円
国内株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,171,311,234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）	862,207,445円
アセット・アロケーションファンド（リスク判断付き）2023-07（適格機関投資家専用）	963,731,047円
Ｄ－Ｉ's　ＴＯＰＩＸインデックス	11,679,404円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	246,736,288円
ｉＦｒｅｅ　ＴＯＰＩＸインデックス	9,954,712,574円
ｉＦｒｅｅ　８資産バランス	5,200,333,681円
ｉＦｒｅｅ　年金バランス	1,221,314,409円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	4,364,951円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	72,972,237,753円

ダイワ・ライフ・バランス３０	2,973,734,629円
ダイワ・ライフ・バランス５０	5,197,844,995円
ダイワ・ライフ・バランス７０	6,247,921,235円
年金ダイワ日本株式インデックス	10,599,292,617円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	48,865,163円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	76,595,831円
ダイワつみたてインデックス日本株式	6,605,468,917円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	12,474,384円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	14,025,228円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	83,268,985円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	24,107,021,293円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	47,149,049円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	19,954,146円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	2,954,340,687円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	278,988,473円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	39,319,630円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	55,931,105円
ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	234,424,340円
ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	15,686,339,212円
ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	14,857,226,487円
ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	3,541,095,263円
スタイル9（4資産分散・保守型）	875,285円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	6,126,062円
スタイル9（4資産分散・積極型）	8,948,813円
スタイル9（6資産分散・保守型）	365,916円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	11,271,872円
スタイル9（6資産分散・積極型）	12,992,897円
スタイル9（8資産分散・保守型）	577,437円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	9,136,776円
スタイル9（8資産分散・積極型）	27,547,418円
ダイワ国内株式インデックス（投資一任専用）	4,999,558円
ダイワ・インデックスセレクト ＴＯＰＩＸ	977,008,824円
ダイワライフスタイル２５	92,382,825円
ダイワライフスタイル５０	431,876,444円
ダイワライフスタイル７５	379,438,749円
ＤＣ・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）	7,641,606,691円

計	202,834,890,976円
2. 期末日における受益権の総数	202,834,890,976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　12,221,366,550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　1,027,730,000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	2024年12月17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	2024年12月17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				

株価指数 先物取引				
買建	5,156,545,000	-	5,136,160,000	△20,385,000
合計	5,156,545,000	-	5,136,160,000	△20,385,000

（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）

	2024年12月17日現在
１口当たり純資産額	2.0038円
（1万口当たり純資産額）	(20,038円)

【ダイワファンドラップ 日経２２５インデックス】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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284条及び第307条の規定により、「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(2024年6月18日から2024年12月17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】

ダイワファンドラップ 日経２２５インデックス

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

	当中間計算期間末 2024年12月17日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	49,988,336
親投資信託受益証券	25,018,668,842
流動資産合計	25,068,657,178
資産合計	25,068,657,178
負債の部	
流動負債	
未払解約金	3,509,944
未払受託者報酬	2,677,995
未払委託者報酬	38,831,551
その他未払費用	669,414
流動負債合計	45,688,904
負債合計	45,688,904
純資産の部	
元本等	
元本	※1 9,299,903,823
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	15,723,064,451
（分配準備積立金）	6,084,562,446
元本等合計	25,022,968,274
純資産合計	25,022,968,274
負債純資産合計	25,068,657,178

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	当中間計算期間 自　2024年6月18日 至　2024年12月17日
営業収益	
受取利息	34,495
有価証券売買等損益	990,016,285
営業収益合計	990,050,780
営業費用	
受託者報酬	2,677,995
委託者報酬	38,831,551
その他費用	669,414
営業費用合計	42,178,960
営業利益又は営業損失（△）	947,871,820
経常利益又は経常損失（△）	947,871,820
中間純利益又は中間純損失（△）	947,871,820
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（△）	49,043,592
期首剰余金又は期首欠損金（△）	14,756,864,993
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,588,746,566
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,588,746,566
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,521,375,336
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,521,375,336
中間剰余金又は中間欠損金（△）	15,723,064,451

(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2024年6月18日 至2024年12月17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 2024年12月17日現在
1．　※1 期首元本額	9,290,599,405円
期中追加設定元本額	965,277,055円
期中一部解約元本額	955,972,637円
2．　中間計算期間末日における受益権の総数	9,299,903,823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2024年6月18日 至2024年12月17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 2024年12月17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 2024年12月17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 2024年12月17日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.6907円 (26,907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

		2024年12月17日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		13,039,306,864
株式	※2※3	353,166,194,300
派生商品評価勘定		35,237,700
その他未収収益		245,746
流動資産合計		366,240,984,610
資産合計		366,240,984,610

負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		5,794,300
前受金		45,000,000
未払解約金		89,371,000
未払利息		477,861
受入担保金		4,590,642,378
流動負債合計		4,731,285,539
負債合計		4,731,285,539
純資産の部		
元本等		
元本	※1	66,094,834,872
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）		295,414,864,199
元本等合計		361,509,699,071
純資産合計		361,509,699,071
負債純資産合計		366,240,984,610

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2024年6月18日 至2024年12月17日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引

	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3.　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年12月17日現在
1.　※1 期首	2024年6月18日
期首元本額	62,582,339,693円
期中追加設定元本額	12,961,422,074円
期中一部解約元本額	9,448,926,895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２２５	23,890,047,047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２２５ＶＡ	173,347,098円
大和 ストック インデックス ２２５ ファンド	7,525,343,666円
Ｄ－Ｉ's 日経２２５インデックス	43,373,490円
ｉＦｒｅｅ 日経２２５インデックス	17,723,342,038円
ＤＣ・ダイワ・ストックインデックス２２５（確定拠出年金専用ファンド）	5,526,125,652円
ダイワ・ノーロード 日経２２５ファンド	404,339,772円
ダイワファンドラップ 日経２２５インデックス	4,574,131,352円
ダイワ日経２２５インデックス（ダイワＳＭＡ専用）	1,071,424,983円
ダイワ・インデックスセレクト 日経２２５	5,163,359,774円
計	66,094,834,872円
2.　期末日における受益権の総数	66,094,834,872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　4,344,712,360円
4.　※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式　5,663,002,000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	2024年12月17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	2024年12月17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				
株価指数先物取引				
買建	8,323,240,000	-	8,352,800,000	29,560,000
合計	8,323,240,000	-	8,352,800,000	29,560,000

（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）

	2024年12月17日現在
１口当たり純資産額	5.4696円
（1万口当たり純資産額）	(54,696円)

【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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284条及び第307条の規定により、「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(2024年6月18日から2024年12月17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】

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

	当中間計算期間末 2024年12月17日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	366,982,890
親投資信託受益証券	94,645,629,907
未収入金	18,350,000
流動資産合計	95,030,962,797
資産合計	95,030,962,797
負債の部	
流動負債	
未払解約金	168,605,917
未払受託者報酬	9,947,011
未払委託者報酬	191,480,967
その他未払費用	1,091,445
流動負債合計	371,125,340
負債合計	371,125,340
純資産の部	
元本等	
元本	※1 43,779,727,706
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	50,880,109,751
（分配準備積立金）	15,929,622,458
元本等合計	94,659,837,457
純資産合計	94,659,837,457
負債純資産合計	95,030,962,797

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	当中間計算期間 自　2024年6月18日 至　2024年12月17日
営業収益	
受取利息	196,432
有価証券売買等損益	7,238,673,635
営業収益合計	7,238,870,067
営業費用	
受託者報酬	9,947,011
委託者報酬	191,480,967
その他費用	1,091,445
営業費用合計	202,519,423
営業利益又は営業損失（△）	7,036,350,644
経常利益又は経常損失（△）	7,036,350,644
中間純利益又は中間純損失（△）	7,036,350,644
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（△）	391,584,700
期首剰余金又は期首欠損金（△）	42,126,733,891
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,205,084,517
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,205,084,517
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,096,474,601
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,096,474,601
中間剰余金又は中間欠損金（△）	50,880,109,751

(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2024年6月18日 至2024年12月17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 2024年12月17日現在
1．　※1 期首元本額	42,039,157,358円
期中追加設定元本額	6,809,606,401円
期中一部解約元本額	5,069,036,053円
2．　中間計算期間末日における受益権の総数	43,779,727,706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2024年6月18日 至2024年12月17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 2024年12月17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 2024年12月17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 2024年12月17日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.1622円 (21,622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

	2024年12月17日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	421,802,469
コール・ローン	5,840,994,269
株式	138,430,433,864
投資証券	2,638,837,378
派生商品評価勘定	185,278,894
未収入金	965,233

未収配当金		129,012,247
差入委託証拠金		1,670,335,840
流動資産合計		149,317,660,194
資産合計		149,317,660,194
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		3,800,390,192
未払解約金		256,300,110
流動負債合計		4,056,690,302
負債合計		4,056,690,302
純資産の部		
元本等		
元本	※1	42,730,197,401
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）		102,530,772,491
元本等合計		145,260,969,892
純資産合計		145,260,969,892
負債純資産合計		149,317,660,194

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2024年6月18日 至2024年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)新株予約権証券

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

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年12月17日現在
1.　※1 期首	2024年6月18日
期首元本額	38,512,369,700円
期中追加設定元本額	9,321,702,597円
期中一部解約元本額	5,103,874,896円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	27,841,044,244円
ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	992,320,469円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	3,790,927,265円
ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用）	919,904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）	9,873,828,630円
外国株式インデックス為替ヘッジ型ファンドVA（適格機関投資家専用）	231,156,889円
計	42,730,197,401円
2.　期末日における受益権の総数	42,730,197,401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	2024年12月17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

1．株式関連

種類	2024年12月17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				
株価指数先物取引				
買建	7,980,557,405	-	8,157,142,592	176,585,187
合計	7,980,557,405	-	8,157,142,592	176,585,187

（注）　1．　時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．　株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4．　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2．通貨関連

種類	2024年12月17日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	136,213,295,039	-	140,004,991,524	△3,791,696,485
アメリカ・ドル	106,797,819,672	-	109,903,550,205	△3,105,730,533
イギリス・ポンド	5,002,948,726	-	5,149,739,718	△146,790,992
イスラエル・シュケル	158,231,223	-	164,949,413	△6,718,190
オーストラリア・ドル	2,649,843,812	-	2,674,539,079	△24,695,267
カナダ・ドル	4,250,809,973	-	4,310,112,765	△59,302,792
シンガポール・ドル	485,381,735	-	496,774,371	△11,392,636
スイス・フラン	3,244,567,510	-	3,294,630,468	△50,062,958
スウェーデン・クローナ	1,102,547,746	-	1,140,139,813	△37,592,067
デンマーク・クローネ	1,120,675,359	-	1,152,328,034	△31,652,675
ニュージーランド・ドル	73,933,465	-	74,625,145	△691,680
ノルウェー・クローネ	220,856,457	-	226,007,466	△5,151,009
ユーロ	10,447,147,209	-	10,739,163,997	△292,016,788
香港・ドル	658,532,152	-	678,431,050	△19,898,898
合計	136,213,295,039	-	140,004,991,524	△3,791,696,485

（注）　1.　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2024年12月17日現在
１口当たり純資産額	3.3995円
（1万口当たり純資産額）	(33,995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）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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284条及び第307条の規定により、「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(2024年6月18日から2024年12月17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】

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

	当中間計算期間末 2024年12月17日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	136,493,878
親投資信託受益証券	43,536,465,905
未収入金	7,931,800
流動資産合計	43,680,891,583
資産合計	43,680,891,583
負債の部	
流動負債	
未払解約金	54,760,791
未払受託者報酬	4,161,338
未払委託者報酬	80,106,566
その他未払費用	1,040,258
流動負債合計	140,068,953
負債合計	140,068,953
純資産の部	
元本等	
元本	※1 11,078,038,559
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	32,462,784,071
（分配準備積立金）	9,640,128,996
元本等合計	43,540,822,630
純資産合計	43,540,822,630
負債純資産合計	43,680,891,583

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	当中間計算期間 自　2024年6月18日 至　2024年12月17日
営業収益	
受取利息	85,567
有価証券売買等損益	3,380,507,568
営業収益合計	3,380,593,135
営業費用	
受託者報酬	4,161,338
委託者報酬	80,106,566
その他費用	1,040,258
営業費用合計	85,308,162
営業利益又は営業損失（△）	3,295,284,973
経常利益又は経常損失（△）	3,295,284,973
中間純利益又は中間純損失（△）	3,295,284,973
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（△）	101,465,542
期首剰余金又は期首欠損金（△）	25,319,867,012
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,406,208,156
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,406,208,156
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,457,110,528
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,457,110,528
中間剰余金又は中間欠損金（△）	32,462,784,071

(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2024年6月18日 至2024年12月17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 2024年12月17日現在
1．　※1 期首元本額	9,619,339,885円
期中追加設定元本額	2,772,061,876円
期中一部解約元本額	1,313,363,202円
2．　中間計算期間末日における受益権の総数	11,078,038,559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2024年6月18日 至2024年12月17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 2024年12月17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 2024年12月17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 2024年12月17日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.9304円 (39,304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

	2024年12月17日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,573,212,463
コール・ローン	16,190,432,031
株式	661,758,675,367
投資証券	12,593,917,988
派生商品評価勘定	969,058,346
未収入金	4,612,841

未収配当金		607,376,457
差入委託証拠金		8,652,033,485
流動資産合計		702,349,318,978
資産合計		702,349,318,978
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		89,385,802
未払解約金		383,578,600
流動負債合計		472,964,402
負債合計		472,964,402
純資産の部		
元本等		
元本	※1	97,448,519,109
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）		604,427,835,467
元本等合計		701,876,354,576
純資産合計		701,876,354,576
負債純資産合計		702,349,318,978

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2024年6月18日 至2024年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)投資証券

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

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	2024年12月17日現在
1. ※1 期首	2024年6月18日
期首元本額	87,815,492,483円
期中追加設定元本額	14,208,096,512円
期中一部解約元本額	4,575,069,886円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国株式インデックスＶＡ	216,840,522円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	1,350,771円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	15,640,386円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	3,401,571円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	86,708,993円
外国株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	114,827,724円
ダイワバランスファンド2023-01（適格機関投資家専用）	77,052,001円
外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	8,670,767,363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）	762,586,077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）	6,044,632,545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）	570,811,387円

Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	15,961,593円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	45,797,205円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	9,752,822,739円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,523,216,776円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	347,557,704円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	18,710,984円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	51,384,001,054円
ダイワ・ライフ・バランス３０	433,707,038円
ダイワ・ライフ・バランス５０	1,018,865,470円
ダイワ・ライフ・バランス７０	997,600,353円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,099,399,883円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	9,588,199円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	11,192,828円
ダイワつみたてインデックス外国株式	2,864,428,386円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	1,774,665円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	2,615,264円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	13,195,933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）	16,125,093円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	40,010,033円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	28,225,334円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	630,707,347円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	33,701,276円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	122,278,441円
スタイル9（4資産分散・保守型）	330,023円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	2,318,891円
スタイル9（4資産分散・積極型）	3,442,873円
スタイル9（6資産分散・保守型）	136,724円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	4,249,834円
スタイル9（6資産分散・積極型）	4,975,198円
スタイル9（8資産分散・保守型）	192,325円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	3,048,629円
スタイル9（8資産分散・積極型）	9,637,198円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,195,895,570円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	426,585,133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）	5,263,829,280円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,267,330,867円
ダイワライフスタイル２５	6,633,135円

ダイワライフスタイル５０	31,382,448円
ダイワライフスタイル７５	27,178,582円
ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	76,831,150円
ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	74,807,979円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	73,610,332円
計	97,448,519,109円
2. 期末日における受益権の総数	97,448,519,109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	2024年12月17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

1．株式関連

種類	2024年12月17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				
株価指数先物取引				

買建	26,963,903,767	-	27,447,978,081	484,074,314
合計	26,963,903,767	-	27,447,978,081	484,074,314

（注）　1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2．通貨関連

種類	2024年12月17日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	15,762,598,220	-	16,158,196,450	395,598,230
アメリカ・ドル	9,734,075,170	-	10,011,227,730	277,152,560
イギリス・ポンド	1,175,821,140	-	1,210,623,780	34,802,640
オーストラリア・ドル	659,684,120	-	666,439,440	6,755,320
カナダ・ドル	1,716,631,230	-	1,741,215,000	24,583,770
スイス・フラン	1,308,759,250	-	1,329,064,660	20,305,410
ユーロ	1,167,627,310	-	1,199,625,840	31,998,530
合計	15,762,598,220	-	16,158,196,450	395,598,230

（注）　1．時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2024年12月17日現在
１口当たり純資産額	7.2025円
（1万口当たり純資産額）	(72,025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）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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284条及び第307条の規定により、「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(2024年6月18日から2024年12月17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】

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

	当中間計算期間末 2024年12月17日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	71,298,503
親投資信託受益証券	6,886,895,329
未収入金	4,520,000
流動資産合計	6,962,713,832
資産合計	6,962,713,832
負債の部	
流動負債	
未払解約金	5,712,340
未払受託者報酬	713,292
未払委託者報酬	14,088,397
その他未払費用	178,250
流動負債合計	20,692,279
負債合計	20,692,279
純資産の部	
元本等	
元本	※1 1,966,247,842
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	4,975,773,711
（分配準備積立金）	2,085,486,564
元本等合計	6,942,021,553
純資産合計	6,942,021,553
負債純資産合計	6,962,713,832

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	当中間計算期間 自　2024年6月18日 至　2024年12月17日
営業収益	
受取利息	66,193
有価証券売買等損益	494,227,256
営業収益合計	494,293,449
営業費用	
受託者報酬	713,292
委託者報酬	14,088,397
その他費用	178,250
営業費用合計	14,979,939
営業利益又は営業損失（△）	479,313,510
経常利益又は経常損失（△）	479,313,510
中間純利益又は中間純損失（△）	479,313,510
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（△）	9,292,738
期首剰余金又は期首欠損金（△）	4,469,103,896
剰余金増加額又は欠損金減少額	439,041,164
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	439,041,164
剰余金減少額又は欠損金増加額	402,392,121
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	402,392,121
中間剰余金又は中間欠損金（△）	4,975,773,711

(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2024年6月18日 至2024年12月17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 2024年12月17日現在
1．　※1 期首元本額	1,953,160,126円
期中追加設定元本額	188,991,323円
期中一部解約元本額	175,903,607円
2．　中間計算期間末日における受益権の総数	1,966,247,842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2024年6月18日 至2024年12月17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 2024年12月17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 2024年12月17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 2024年12月17日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.5306円 (35,306円)

（参考）

当ファンドは、「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」受益証券、「外国株式インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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。

「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年12月17日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,437,334,909
コール・ローン	418,850,373
株式	36,916,025,582
投資証券	2,950,882,434
派生商品評価勘定	8,944,834
未収配当金	131,620,777

差入委託証拠金		771,424,398
流動資産合計		42,635,083,307
資産合計		42,635,083,307
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		32,149,097
未払金		984,500,347
未払解約金		27,457,000
流動負債合計		1,044,106,444
負債合計		1,044,106,444
純資産の部		
元本等		
元本	※1	14,694,169,998
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）		26,896,806,865
元本等合計		41,590,976,863
純資産合計		41,590,976,863
負債純資産合計		42,635,083,307

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2024年6月18日 至2024年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)投資証券

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

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	2024年12月17日現在
1.　※1 期首	2024年6月18日
期首元本額	13,426,251,057円
期中追加設定元本額	1,611,436,205円
期中一部解約元本額	343,517,264円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
新興国株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	124,779,458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）	492,640,302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）	353,347,186円
Ｄ－Ｉ's 新興国株式インデックス	116,390,140円
ｉＦｒｅｅ 新興国株式インデックス	7,722,228,715円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	3,771,877,090円
ダイワ新興国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	9,298,087円
新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド（為替ヘッジなし／適格機関投資家専用）	653,837円
ＤＣダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド	1,712,046,055円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式	289,437,558円
ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド	101,471,570円
計	14,694,169,998円
2.　期末日における受益権の総数	14,694,169,998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	2024年12月17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

1．株式関連

種類	2024年12月17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				
株価指数先物取引				
買建	1,596,213,177	-	1,572,551,244	△23,661,933
合計	1,596,213,177	-	1,572,551,244	△23,661,933

（注）　1．　時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．　株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2．通貨関連

種類	2024年12月17日現在			
	契約額等 (円)	うち１年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	14,920,560	-	15,378,230	457,670
アメリカ・ドル	14,920,560	-	15,378,230	457,670
合計	14,920,560	-	15,378,230	457,670

（注） 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2024年12月17日現在
１口当たり純資産額	2.8304円
（1万口当たり純資産額）	(28,304円)

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

前記「ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）」に記載のとおりであります。

【ダイワファンドラップ 日本債券インデックス】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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284条及び第307条の規定により、「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(2024年6月18日から2024年12月17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】

ダイワファンドラップ 日本債券インデックス

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

	当中間計算期間末 2024年12月17日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	94,722,962
親投資信託受益証券	39,390,131,778
流動資産合計	39,484,854,740
資産合計	39,484,854,740
負債の部	
流動負債	
未払解約金	13,236,102
未払受託者報酬	2,870,321
未払委託者報酬	38,454,369
その他未払費用	1,067,252
流動負債合計	55,628,044
負債合計	55,628,044
純資産の部	
元本等	
元本	※1 43,008,863,107
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	※2 △ 3,579,636,411
（分配準備積立金）	177,470,119
元本等合計	39,429,226,696
純資産合計	39,429,226,696
負債純資産合計	39,484,854,740

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	当中間計算期間 自　2024年6月18日 至　2024年12月17日
営業収益	
受取利息	88,479
有価証券売買等損益	△ 283,055,662
営業収益合計	△ 282,967,183
営業費用	
受託者報酬	2,870,321
委託者報酬	38,454,369
その他費用	1,067,252
営業費用合計	42,391,942
営業利益又は営業損失（△）	△ 325,359,125
経常利益又は経常損失（△）	△ 325,359,125
中間純利益又は中間純損失（△）	△ 325,359,125
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（△）	△ 14,240,544
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 3,107,272,084
剰余金増加額又は欠損金減少額	358,700,971
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	358,700,971
剰余金減少額又は欠損金増加額	519,946,717
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	519,946,717
中間剰余金又は中間欠損金（△）	△ 3,579,636,411

(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2024年6月18日 至2024年12月17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 2024年12月17日現在
1．　※1 期首元本額	41,077,266,835円
期中追加設定元本額	6,663,603,258円
期中一部解約元本額	4,732,006,986円
2．　中間計算期間末日における受益権の総数	43,008,863,107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3,579,636,411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2024年6月18日 至2024年12月17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 2024年12月17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 2024年12月17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 2024年12月17日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9168円 (9,168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

	2024年12月17日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,868,722,625
国債証券	106,604,439,160
地方債証券	6,318,079,500
特殊債券	3,919,196,900

社債券		8,909,922,400
未収入金		657,167,600
未収利息		311,681,596
前払費用		23,793,715
流動資産合計		129,613,003,496
資産合計		129,613,003,496
負債の部		
流動負債		
未払金		100,000,000
未払解約金		3,067,906,224
流動負債合計		3,167,906,224
負債合計		3,167,906,224
純資産の部		
元本等		
元本	※1	96,541,327,705
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）		29,903,769,567
元本等合計		126,445,097,272
純資産合計		126,445,097,272
負債純資産合計		129,613,003,496

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2024年6月18日 至2024年12月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	2024年12月17日現在
1. ※1 期首	2024年6月18日
期首元本額	91,769,046,895円
期中追加設定元本額	15,714,839,180円
期中一部解約元本額	10,942,558,370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)	32,289,249円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	196,363,086円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	37,897,876円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	464,480,192円
ＤＣダイワ日本債券インデックス	10,551,368,387円
ダイワ国内債券インデックス（ラップ専用）	21,716,170,920円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	7,858,915,467円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	1,395,708,195円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	177,725,433円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	194,573,887円
ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド	45,310,610円
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	30,073,394,242円
ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用）	14,127,086,943円
ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス	1,727,799,206円
スタイル9（4資産分散・保守型）	5,773,217円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	11,101,398円
スタイル9（4資産分散・積極型）	1,212,425円
スタイル9（6資産分散・保守型）	2,660,019円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	22,980,821円
スタイル9（6資産分散・積極型）	1,842,715円
スタイル9（8資産分散・保守型）	4,143,544円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	17,455,390円
スタイル9（8資産分散・積極型）	3,521,115円
ダイワ国内債券インデックス（投資一任専用）	7,573,847円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	679,578,002円

ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	5,889,783,806円
ダイワライフスタイル２５	452,354,415円
ダイワライフスタイル５０	649,502,671円
ダイワライフスタイル７５	192,760,627円
計	96,541,327,705円
2. 期末日における受益権の総数	96,541,327,705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	2024年12月17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

2024年12月17日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2024年12月17日現在
１口当たり純資産額	1.3098円
（1万口当たり純資産額）	(13,098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）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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284条及び第307条の規定により、「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(2024年6月18日から2024年12月17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】

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

	当中間計算期間末 2024年12月17日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	603,644,545
親投資信託受益証券	98,074,669,283
流動資産合計	98,678,313,828
資産合計	98,678,313,828
負債の部	
流動負債	
未払解約金	102,019,866
未払受託者報酬	10,986,539
未払委託者報酬	197,758,628
その他未払費用	1,079,772
流動負債合計	311,844,805
負債合計	311,844,805
純資産の部	
元本等	
元本	※1 121,112,511,237
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	※2 △ 22,746,042,214
（分配準備積立金）	2,282,379,956
元本等合計	98,366,469,023
純資産合計	98,366,469,023
負債純資産合計	98,678,313,828

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	当中間計算期間 自　2024年6月18日 至　2024年12月17日
営業収益	
受取利息	477,952
有価証券売買等損益	△ 104,353,111
営業収益合計	△ 103,875,159
営業費用	
受託者報酬	10,986,539
委託者報酬	197,758,628
その他費用	1,079,772
営業費用合計	209,824,939
営業利益又は営業損失（△）	△ 313,700,098
経常利益又は経常損失（△）	△ 313,700,098
中間純利益又は中間純損失（△）	△ 313,700,098
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（△）	43,648,790
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 22,321,809,410
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,315,632,887
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,315,632,887
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,382,516,803
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,382,516,803
中間剰余金又は中間欠損金（△）	△ 22,746,042,214

(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2024年6月18日 至2024年12月17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 2024年12月17日現在
1．　※1 期首元本額	120,507,203,109円
期中追加設定元本額	13,120,570,749円
期中一部解約元本額	12,515,262,621円
2．　中間計算期間末日における受益権の総数	121,112,511,237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22,746,042,214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2024年6月18日 至2024年12月17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 2024年12月17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 2024年12月17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 2024年12月17日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.8122円 (8,122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

	2024年12月17日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	1,978,259,541
コール・ローン	863,295,907
国債証券	123,589,136,870
未収利息	905,172,208

前払費用		109,929,557
差入委託証拠金		243,589,470
流動資産合計		127,689,383,553
資産合計		127,689,383,553
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		3,347,017,362
未払解約金		217,545,187
流動負債合計		3,564,562,549
負債合計		3,564,562,549
純資産の部		
元本等		
元本	※1	147,789,520,799
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2	△23,664,699,795
元本等合計		124,124,821,004
純資産合計		124,124,821,004
負債純資産合計		127,689,383,553

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2024年6月18日 至2024年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(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.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年12月17日現在
1.　※1 期首	2024年6月18日
期首元本額	150,884,982,568円
期中追加設定元本額	19,856,746,443円
期中一部解約元本額	22,952,208,212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）	2,350,310,554円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）	116,769,459,797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）	4,640,642,701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）	21,520,509円

ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	3,730,026,733円
ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用）	11,715,977円
ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）	13,387,347,367円
ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	2,343,579,432円
ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	2,281,705,423円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	2,253,212,306円
計	147,789,520,799円
2. 期末日における受益権の総数	147,789,520,799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23,664,699,795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	2024年12月17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

1．債券関連

種類	2024年12月17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				
債券先物取引				
買建	2,086,122,865	-	2,077,742,063	△8,380,802
合計	2,086,122,865	-	2,077,742,063	△8,380,802

（注）　1．時価の算定方法
債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
2．債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2．通貨関連

種類	2024年12月17日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	125,496,756,758	-	128,835,393,318	△3,338,636,560
アメリカ・ドル	57,584,382,549	-	59,268,447,120	△1,684,064,571
イギリス・ポンド	6,809,585,174	-	7,001,906,146	△192,320,972
イスラエル・シュケル	391,560,646	-	408,272,857	△16,712,211
オーストラリア・ドル	1,674,062,404	-	1,685,127,175	△11,064,771

オフショア・人民元	14,239,064,957	-	14,559,134,451	△320,069,494
カナダ・ドル	2,437,302,922	-	2,466,480,640	△29,177,718
シンガポール・ドル	561,447,618	-	573,972,845	△12,525,227
スウェーデン・クローナ	302,543,596	-	312,525,294	△9,981,698
デンマーク・クローネ	392,817,067	-	402,787,222	△9,970,155
ニュージーランド・ドル	378,865,821	-	381,362,965	△2,497,144
ノルウェー・クローネ	212,461,777	-	216,994,849	△4,533,072
ポーランド・ズロチ	699,470,528	-	724,464,148	△24,993,620
マレーシア・リンギット	653,675,926	-	662,110,343	△8,434,417
メキシコ・ペソ	968,494,781	-	1,004,735,521	△36,240,740
ユーロ	38,191,020,992	-	39,167,071,742	△976,050,750
合計	125,496,756,758	-	128,835,393,318	△3,338,636,560

（注）　1．時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2．換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2024年12月17日現在

１口当たり純資産額	**0.8399円**
（1万口当たり純資産額）	**(8,399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）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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284条及び第307条の規定により、「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(2024年6月18日から2024年12月17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】

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

	当中間計算期間末 2024年12月17日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	140,002,359
親投資信託受益証券	23,216,149,253
未収入金	1,514,221
流動資産合計	23,357,665,833
資産合計	23,357,665,833
負債の部	
流動負債	
未払解約金	29,125,684
未払受託者報酬	2,289,136
未払委託者報酬	41,205,147
その他未払費用	858,349
流動負債合計	73,478,316
負債合計	73,478,316
純資産の部	
元本等	
元本	※1 16,331,688,081
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	6,952,499,436
（分配準備積立金）	2,133,735,945
元本等合計	23,284,187,517
純資産合計	23,284,187,517
負債純資産合計	23,357,665,833

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	当中間計算期間 自　2024年6月18日 至　2024年12月17日
営業収益	
受取利息	102,555
有価証券売買等損益	△ 25,936,802
営業収益合計	△ 25,834,247
営業費用	
受託者報酬	2,289,136
委託者報酬	41,205,147
その他費用	858,349
営業費用合計	44,352,632
営業利益又は営業損失（△）	△ 70,186,879
経常利益又は経常損失（△）	△ 70,186,879
中間純利益又は中間純損失（△）	△ 70,186,879
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（△）	△ 21,210,403
期首剰余金又は期首欠損金（△）	5,619,016,876
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,843,762,218
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,843,762,218
剰余金減少額又は欠損金増加額	461,303,182
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	461,303,182
中間剰余金又は中間欠損金（△）	6,952,499,436

(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2024年6月18日 至2024年12月17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 2024年12月17日現在
1．　※1 期首元本額	12,917,741,944円
期中追加設定元本額	4,481,358,207円
期中一部解約元本額	1,067,412,070円
2．　中間計算期間末日における受益権の総数	16,331,688,081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2024年6月18日 至2024年12月17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 2024年12月17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 2024年12月17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 2024年12月17日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4257円 (14,257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

	2024年12月17日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	3,188,361,585
コール・ローン	1,353,401,863
国債証券	325,893,099,833
派生商品評価勘定	24,068,962
未収入金	3,462,085
未収利息	2,469,592,500

前払費用		154,610,470
流動資産合計		333,086,597,298
資産合計		333,086,597,298
負債の部		
流動負債		
未払金		14,265
未払解約金		372,954,987
流動負債合計		372,969,252
負債合計		372,969,252
純資産の部		
元本等		
元本	※1	89,534,821,573
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）		243,178,806,473
元本等合計		332,713,628,046
純資産合計		332,713,628,046
負債純資産合計		333,086,597,298

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2024年6月18日 至2024年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年12月17日現在
1．　※1 期首	2024年6月18日
期首元本額	86,637,182,960円
期中追加設定元本額	8,487,686,356円
期中一部解約元本額	5,590,047,743円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国債券インデックスＶＡ	324,211,441円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	4,781,204円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	30,065,328円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	14,033,041円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	166,107,769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）	853,763,375円
外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	626,597,140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）	980,218,809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）	6,247,618,206円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	1,141,672,928円
Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス	1,854,652円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	21,998,427円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	1,365,101,611円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	2,801,887,717円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	670,229,493円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	2,389,602円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	51,496,316,739円
ダイワ・ライフ・バランス３０	1,196,257,378円
ダイワ・ライフ・バランス５０	932,590,704円
ダイワ・ライフ・バランス７０	748,628,053円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	742,728,245円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	609,541,348円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	292,204,263円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	36,746,467円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	22,755,567円
ダイワつみたてインデックス外国債券	2,478,042,791円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	5,041,201円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	2,514,030円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	10,205,784円
ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ラップ専用）	2,578,601,135円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	89,069,708円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	26,929,432円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	2,416,447,708円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	150,818,032円
スタイル9（4資産分散・保守型）	235,549円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	2,635,203円
スタイル9（4資産分散・積極型）	2,443,135円
スタイル9（6資産分散・保守型）	51,885円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	1,791,954円
スタイル9（6資産分散・積極型）	634,024円

スタイル9（8資産分散・保守型）	81,076円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	1,747,960円
スタイル9（8資産分散・積極型）	1,986,117円
ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	2,705,214円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	128,267,002円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	68,138,716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）	4,106,107,034円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	6,029,576,453円
ダイワライフスタイル２５	24,997,512円
ダイワライフスタイル５０	58,275,113円
ダイワライフスタイル７５	17,178,298円
計	89,534,821,573円
2. 期末日における受益権の総数	89,534,821,573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	2024年12月17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

通貨関連

種類	2024年12月17日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	1,020,069,428	-	1,044,138,390	24,068,962
アメリカ・ドル	146,012,984	-	149,188,520	3,175,536
イギリス・ポンド	23,424,418	-	24,215,885	791,467
オフショア・人民元	479,311,829	-	490,425,790	11,113,961
カナダ・ドル	49,991,058	-	50,618,880	627,822
スウェーデン・クローナ	11,630,489	-	12,014,209	383,720
ニュージーランド・ドル	52,620,253	-	52,967,078	346,825
ノルウェー・クローネ	25,831,178	-	26,382,310	551,132
メキシコ・ペソ	108,926,260	-	113,002,243	4,075,983
ユーロ	122,320,959	-	125,323,475	3,002,516
合計	1,020,069,428	-	1,044,138,390	24,068,962

（注）　1.　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2．　換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2024年12月17日現在
1口当たり純資産額	3.7160円
（1万口当たり純資産額）	(37,160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）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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284条及び第307条の規定により、「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(2024年6月18日から2024年12月17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】

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

	当中間計算期間末 2024年12月17日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	23,160,266
親投資信託受益証券	4,557,777,500
流動資産合計	4,580,937,766
資産合計	4,580,937,766
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	493,258
未払委託者報酬	9,126,073
その他未払費用	184,893
流動負債合計	9,804,224
負債合計	9,804,224
純資産の部	
元本等	
元本	※1 3,146,366,788
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,424,766,754
（分配準備積立金）	633,000,276
元本等合計	4,571,133,542
純資産合計	4,571,133,542
負債純資産合計	4,580,937,766

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	当中間計算期間 自　2024年6月18日 至　2024年12月17日
営業収益	
受取利息	19,313
有価証券売買等損益	△ 2,731,183
営業収益合計	△ 2,711,870
営業費用	
受託者報酬	493,258
委託者報酬	9,126,073
その他費用	184,893
営業費用合計	9,804,224
営業利益又は営業損失（△）	△ 12,516,094
経常利益又は経常損失（△）	△ 12,516,094
中間純利益又は中間純損失（△）	△ 12,516,094
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（△）	△ 4,446,567
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,399,281,544
剰余金増加額又は欠損金減少額	103,930,344
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	103,930,344
剰余金減少額又は欠損金増加額	70,375,607
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	70,375,607
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,424,766,754

(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2024年6月18日 至2024年12月17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 2024年12月17日現在
1．　※1 期首元本額	3,064,897,601円
期中追加設定元本額	235,723,747円
期中一部解約元本額	154,254,560円
2．　中間計算期間末日における受益権の総数	3,146,366,788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2024年6月18日 至2024年12月17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 2024年12月17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 2024年12月17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 2024年12月17日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4528円 (14,528円)

（参考）

当ファンドは、「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」受益証券、「外国債券インデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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。

「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年12月17日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	95,060,646
コール・ローン	109,572,664
国債証券	50,200,451,604
派生商品評価勘定	1,978,865
未収利息	775,349,565
前払費用	53,985,125

流動資産合計		51,236,398,469
資産合計		51,236,398,469
負債の部		
流動負債		
未払金		10,981,162
未払解約金		19,346,215
流動負債合計		30,327,377
負債合計		30,327,377
純資産の部		
元本等		
元本	※1	26,836,042,787
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）		24,370,028,305
元本等合計		51,206,071,092
純資産合計		51,206,071,092
負債純資産合計		51,236,398,469

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2024年6月18日 至2024年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年12月17日現在
1.　※1 期首	2024年6月18日
期首元本額	25,463,772,957円
期中追加設定元本額	1,995,209,095円
期中一部解約元本額	622,939,265円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
新興国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	637,522,226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）	479,683,668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）	558,094,759円
Ｄ－Ｉ's 新興国債券インデックス	69,549,808円
ｉＦｒｅｅ 新興国債券インデックス	9,678,415,420円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	5,455,976,689円
ダイワ新興国債券インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	5,846,487円
ＤＣダイワ新興国債券インデックスファンド	9,794,110,390円
スタイル9（8資産分散・保守型）	67,032円

スタイル9（8資産分散・バランス型）	1,575,517円
スタイル9（8資産分散・積極型）	1,906,617円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券	115,372,597円
ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド	37,921,577円
計	26,836,042,787円
2. 期末日における受益権の総数	26,836,042,787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	2024年12月17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

通貨関連

種類	2024年12月17日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	75,124,985	-	77,103,850	1,978,865
インド・ルピー	36,310,000	-	36,600,000	290,000

ポーランド・ズロチ	18,274,410	-	18,995,100	720,690
南アフリカ・ランド	20,540,575	-	21,508,750	968,175
合計	75,124,985	-	77,103,850	1,978,865

（注）　1．時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2．換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2024年12月17日現在
1口当たり純資産額	1.9081円
（1万口当たり純資産額）	(19,081円)

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）」に記載のとおりであります。

【ダイワファンドラップ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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284条及び第307条の規定により、「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(2024年6月18日から2024年12月17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】

ダイワファンドラップ Ｊ－ＲＥＩＴインデックス

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

	当中間計算期間末 2024年12月17日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	44,523,014
親投資信託受益証券	13,432,656,451
流動資産合計	13,477,179,465
資産合計	13,477,179,465
負債の部	
流動負債	
未払解約金	15,532,492
未払受託者報酬	1,412,334
未払委託者報酬	20,479,551
その他未払費用	353,017
流動負債合計	37,777,394
負債合計	37,777,394
純資産の部	
元本等	
元本	※1 11,098,384,757
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	2,341,017,314
（分配準備積立金）	650,102,592
元本等合計	13,439,402,071
純資産合計	13,439,402,071
負債純資産合計	13,477,179,465

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	当中間計算期間 自　2024年6月18日 至　2024年12月17日
営業収益	
受取利息	32,115
有価証券売買等損益	△ 436,052,573
営業収益合計	△ 436,020,458
営業費用	
受託者報酬	1,412,334
委託者報酬	20,479,551
その他費用	353,017
営業費用合計	22,244,902
営業利益又は営業損失（△）	△ 458,265,360
経常利益又は経常損失（△）	△ 458,265,360
中間純利益又は中間純損失（△）	△ 458,265,360
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（△）	7,660,118
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,353,421,411
剰余金増加額又は欠損金減少額	679,087,674
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	679,087,674
剰余金減少額又は欠損金増加額	225,566,293
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	225,566,293
中間剰余金又は中間欠損金（△）	2,341,017,314

(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2024年6月18日 至2024年12月17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 2024年12月17日現在
1．　※1 期首元本額	9,360,680,454円
期中追加設定元本額	2,630,409,857円
期中一部解約元本額	892,705,554円
2．　中間計算期間末日における受益権の総数	11,098,384,757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2024年6月18日 至2024年12月17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 2024年12月17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 2024年12月17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 2024年12月17日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2109円 (12,109円)

（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、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Ｊ－ＲＥＩＴマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

		2024年12月17日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		5,060,596,123
投資証券	※2	254,728,573,539
未収入金		1,716,861,901
未収配当金		1,774,501,406
前払金		38,640,000
差入委託証拠金		477,833,866

流動資産合計		263,797,006,835
資産合計		263,797,006,835
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		58,856,000
未払解約金		44,920,000
流動負債合計		103,776,000
負債合計		103,776,000
純資産の部		
元本等		
元本	※1	86,510,257,032
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）		177,182,973,803
元本等合計		263,693,230,835
純資産合計		263,693,230,835
負債純資産合計		263,797,006,835

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2024年6月18日 至2024年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金

	原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	2024年12月17日現在
1. ※1 期首	2024年6月18日
期首元本額	103,664,583,904円
期中追加設定元本額	3,036,698,951円
期中一部解約元本額	20,191,025,823円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン	3,431,923,535円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（毎月分配型）	65,921,844,591円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（年1回決算型）	740,218,395円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	26,039,587円
ｉＦｒｅｅ Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	602,450,265円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	3,304,433,265円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（奇数月決算型）	106,851,698円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	402,452円
ＤＣ・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン	5,228,009,632円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	9,854,023円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	10,974,561円
ダイワ国内ＲＥＩＴインデックス（投資一任専用）	5,833,615円
ダイワ・ノーロード Ｊ－ＲＥＩＴファンド	80,914,847円
ダイワファンドラップ Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	4,406,894,935円
ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	1,311,752,668円
ダイワファンドラップオンライン Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	635,773,500円
スタイル9（6資産分散・保守型）	76,840円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	2,956,752円
スタイル9（6資産分散・積極型）	1,604,349円
スタイル9（8資産分散・保守型）	106,132円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	2,135,185円
スタイル9（8資産分散・積極型）	1,155,874円
ダイワ・インデックスセレクト Ｊ－ＲＥＩＴ	678,050,331円
計	86,510,257,032円
2. 期末日における受益権の総数	86,510,257,032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　679,000,000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	2024年12月17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

不動産投信関連

種類	2024年12月17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	9,004,240,000	-	8,946,000,000	△58,240,000
合計	9,004,240,000	-	8,946,000,000	△58,240,000

（注）　1．時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2024年12月17日現在
1口当たり純資産額	3.0481円
（1万口当たり純資産額）	(30,481円)

【ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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284条及び第307条の規定により、「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(2024年6月18日から2024年12月17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】

ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

	当中間計算期間末 2024年12月17日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	69,020,775
親投資信託受益証券	21,878,077,008
流動資産合計	21,947,097,783
資産合計	21,947,097,783
負債の部	
流動負債	
未払解約金	19,099,010
未払受託者報酬	2,485,019
未払委託者報酬	46,594,877
その他未払費用	621,174
流動負債合計	68,800,080
負債合計	68,800,080
純資産の部	
元本等	
元本	※1 20,526,681,799
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,351,615,904
（分配準備積立金）	1,537,925,316
元本等合計	21,878,297,703
純資産合計	21,878,297,703
負債純資産合計	21,947,097,783

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	当中間計算期間 自　2024年6月18日 至　2024年12月17日
営業収益	
受取利息	41,519
有価証券売買等損益	1,564,114,989
営業収益合計	1,564,156,508
営業費用	
受託者報酬	2,485,019
委託者報酬	46,594,877
その他費用	627,114
営業費用合計	49,707,010
営業利益又は営業損失（△）	1,514,449,498
経常利益又は経常損失（△）	1,514,449,498
中間純利益又は中間純損失（△）	1,514,449,498
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（△）	248,519,596
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 101,233,534
剰余金増加額又は欠損金減少額	186,919,536
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,809,797
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	184,109,739
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,351,615,904

(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2024年6月18日 至2024年12月17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 2024年12月17日現在
1．　※1 期首元本額	20,883,336,459円
期中追加設定元本額	2,613,606,027円
期中一部解約元本額	2,970,260,687円
2．　中間計算期間末日における受益権の総数	20,526,681,799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2024年6月18日 至2024年12月17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 2024年12月17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 2024年12月17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 2024年12月17日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0658円 (10,658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

	2024年12月17日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	368,092,133
コール・ローン	293,291,565
投資信託受益証券	389,682,194
投資証券	26,703,307,967
未収入金	1,322,481
未収配当金	86,254,003

差入委託証拠金		506,446,768
流動資産合計		28,348,397,111
資産合計		28,348,397,111
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		836,795,112
未払解約金		15,660,000
流動負債合計		852,455,112
負債合計		852,455,112
純資産の部		
元本等		
元本	※1	30,469,018,909
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2	△2,973,076,910
元本等合計		27,495,941,999
純資産合計		27,495,941,999
負債純資産合計		28,348,397,111

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2024年6月18日 至2024年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のない有価証券については投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。また、市場価格のある有価証券については、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)投資証券

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

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	2024年12月17日現在
1.　※1 期首	2024年6月18日
期首元本額	30,158,213,460円
期中追加設定元本額	4,080,198,424円
期中一部解約元本額	3,769,392,975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）	24,244,322,926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）	1,118,552,241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）	1,568,651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）	454,835,253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）	4,649,739,838円
計	30,469,018,909円
2.　期末日における受益権の総数	30,469,018,909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2,973,076,910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	2024年12月17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

1．不動産投信関連

種類	2024年12月17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	1,309,126,869	-	1,243,291,626	△65,835,243
合計	1,309,126,869	-	1,243,291,626	△65,835,243

（注）　1．　時価の算定方法
不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
2．　不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4．　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2．通貨関連

種類	2024年12月17日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	28,257,596,915	-	29,028,556,784	△770,959,869
アメリカ・ドル	22,544,756,971	-	23,201,258,626	△656,501,655
イギリス・ポンド	1,243,049,054	-	1,279,551,230	△36,502,176
イスラエル・シュケル	40,052,394	-	41,752,940	△1,700,546
オーストラリア・ドル	2,104,600,780	-	2,124,834,347	△20,233,567
カナダ・ドル	373,094,744	-	378,341,145	△5,246,401
シンガポール・ドル	858,121,267	-	878,342,281	△20,221,014
ニュージーランド・ドル	32,118,178	-	32,417,077	△298,899
ユーロ	819,147,343	-	842,056,283	△22,908,940
香港・ドル	242,656,184	-	250,002,855	△7,346,671
合計	28,257,596,915	-	29,028,556,784	△770,959,869

（注）　1．　時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2024年12月17日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9024円 (9,024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) 当ファンドの中間財務諸表は、「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284条及び第307条の規定により、「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(2024年6月18日から2024年12月17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】

ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

	当中間計算期間末 2024年12月17日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	33,006,130
親投資信託受益証券	9,156,163,816
未収入金	777,000
流動資産合計	9,189,946,946
資産合計	9,189,946,946
負債の部	
流動負債	
未払解約金	14,646,843
未払受託者報酬	934,601
未払委託者報酬	17,524,571
その他未払費用	233,573
流動負債合計	33,339,588
負債合計	33,339,588
純資産の部	
元本等	
元本	※1 4,623,656,099
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	4,532,951,259
（分配準備積立金）	1,388,991,108
元本等合計	9,156,607,358
純資産合計	9,156,607,358
負債純資産合計	9,189,946,946

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	当中間計算期間 自　2024年6月18日 至　2024年12月17日
営業収益	
受取利息	16,647
有価証券売買等損益	651,488,123
営業収益合計	651,504,770
営業費用	
受託者報酬	934,601
委託者報酬	17,524,571
その他費用	233,573
営業費用合計	18,692,745
営業利益又は営業損失（△）	632,812,025
経常利益又は経常損失（△）	632,812,025
中間純利益又は中間純損失（△）	632,812,025
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（△）	46,498,030
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,385,095,315
剰余金増加額又は欠損金減少額	940,368,215
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	940,368,215
剰余金減少額又は欠損金増加額	378,826,266
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	378,826,266
中間剰余金又は中間欠損金（△）	4,532,951,259

(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2024年6月18日 至2024年12月17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 2024年12月17日現在
1．　※1 期首元本額	4,068,540,757円
期中追加設定元本額	1,005,482,549円
期中一部解約元本額	450,367,207円
2．　中間計算期間末日における受益権の総数	4,623,656,099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2024年6月18日 至2024年12月17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 2024年12月17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 2024年12月17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 2024年12月17日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.9804円 (19,804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

	2024年12月17日現在 金　額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	426,148,324
コール・ローン	465,855,505
投資信託受益証券	2,386,280,448
投資証券	44,886,964,402
派生商品評価勘定	12,980,742
未収入金	2,137,310

未収配当金		144,446,910
差入委託証拠金		460,092,716
流動資産合計		48,784,906,357
資産合計		48,784,906,357
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		4,520,368
未払金		121,202,534
未払解約金		12,159,000
流動負債合計		137,881,902
負債合計		137,881,902
純資産の部		
元本等		
元本	※1	11,783,963,659
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）		36,863,060,796
元本等合計		48,647,024,455
純資産合計		48,647,024,455
負債純資産合計		48,784,906,357

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2024年6月18日 至2024年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のない有価証券については投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。また、市場価格のある有価証券については、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

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

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	2024年12月17日現在
1. ※1 期首	2024年6月18日
期首元本額	10,981,310,353円
期中追加設定元本額	1,160,283,639円
期中一部解約元本額	357,630,333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）	81,228,434円
ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）	2,217,955,481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）	348,424,656円
Ｄ－Ｉ's グローバルＲＥＩＴインデックス	1,417,770円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	19,354,919円
ｉＦｒｅｅ 外国ＲＥＩＴインデックス	640,867,611円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	2,485,241,049円
グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成型）	399,362,027円
グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）	233,708,475円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	3,988,687円
ＤＣダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックスファンド	4,466,830,635円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	7,266,352円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	8,113,100円
ダイワ海外ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	4,512,190円

	ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	128,911,402円
	スタイル9（6資産分散・保守型）	36,317円
	スタイル9（6資産分散・バランス型）	1,840,907円
	スタイル9（6資産分散・積極型）	1,556,201円
	スタイル9（8資産分散・保守型）	45,990円
	スタイル9（8資産分散・バランス型）	1,197,702円
	スタイル9（8資産分散・積極型）	1,240,325円
	ダイワ・インデックスセレクト グローバルＲＥＩＴ	189,357,942円
	ダイワ・ノーロード グローバルＲＥＩＴファンド	62,222,856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）	241,590,593円
	ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	80,995,964円
	ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	78,847,818円
	ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	77,848,256円
計		11,783,963,659円
2.	期末日における受益権の総数	11,783,963,659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	2024年12月17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

1．不動産投信関連

種類	2024年12月17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	1,460,894,486	-	1,456,374,412	△4,520,074
合計	1,460,894,486	-	1,456,374,412	△4,520,074

（注）　1．時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2．通貨関連

種類	2024年12月17日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	527,914,515	-	540,894,963	12,980,448
アメリカ・ドル	365,482,279	-	373,920,015	8,437,736
ユーロ	162,432,236	-	166,974,948	4,542,712

合計	527,914,515	-	540,894,963	12,980,448

（注）　1．時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

2．換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2024年12月17日現在
1口当たり純資産額	4.1282円
（1万口当たり純資産額）	(41,282円)

２【ファンドの現況】

ダイワファンドラップ　ＴＯＰＩＸインデックス

【純資産額計算書】

2024年12月30日

Ⅰ	資産総額	32,530,067,677円
Ⅱ	負債総額	70,743,002円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	32,459,324,675円
Ⅳ	発行済数量	13,274,659,795口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.4452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

2024年12月30日

Ⅰ	資産総額	431,783,605,199円
Ⅱ	負債総額	14,239,153,946円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	417,544,451,253円
Ⅳ	発行済数量	203,873,244,351口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.0481円

ダイワファンドラップ 日経２２５インデックス

純資産額計算書

2024年12月30日

Ⅰ	資産総額	25,507,480,796円
Ⅱ	負債総額	63,960,331円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	25,443,520,465円
Ⅳ	発行済数量	9,321,899,318口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.7294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

2024年12月30日

Ⅰ	資産総額	371,235,162,206円

Ⅱ　負債総額	6,342,786,798円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	364,892,375,408円
Ⅳ　発行済数量	65,756,752,362口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	5.5491円

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

2024年12月30日

Ⅰ　資産総額	93,551,109,366円
Ⅱ　負債総額	14,887,012円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	93,536,222,354円
Ⅳ　発行済数量	44,131,396,107口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.1195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

2024年12月30日

Ⅰ　資産総額	150,656,036,651円
Ⅱ　負債総額	7,401,290,328円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	143,254,746,323円
Ⅳ　発行済数量	42,981,632,554口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.3329円

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）

純資産額計算書

2024年12月30日

Ⅰ　資産総額	44,286,045,884円
Ⅱ　負債総額	7,024,549円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	44,279,021,335円
Ⅳ　発行済数量	11,212,406,031口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.9491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

2024年12月30日

Ⅰ	資産総額	708,622,749,220円
Ⅱ	負債総額	625,196,470円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	707,997,552,750円
Ⅳ	発行済数量	97,816,242,760口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	7.2380円

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）

純資産額計算書

2024年12月30日

Ⅰ	資産総額	7,024,927,373円
Ⅱ	負債総額	1,145,445円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	7,023,781,928円
Ⅳ	発行済数量	1,975,865,158口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.5548円

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

前記「ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2024年12月30日

Ⅰ	資産総額	42,453,348,262円
Ⅱ	負債総額	27,970,621円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	42,425,377,641円
Ⅳ	発行済数量	14,760,253,850口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.8743円

ダイワファンドラップ 日本債券インデックス

純資産額計算書

2024年12月30日

Ⅰ	資産総額	39,723,721,521円

Ⅱ　負債総額	66,776,531円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	39,656,944,990円
Ⅳ　発行済数量	43,262,503,426口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9167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

2024年12月30日

Ⅰ　資産総額	127,422,852,267円
Ⅱ　負債総額	202,257,530円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	127,220,594,737円
Ⅳ　発行済数量	97,130,194,657口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3098円

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

2024年12月30日

Ⅰ　資産総額	97,856,837,405円
Ⅱ　負債総額	14,669,280円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	97,842,168,125円
Ⅳ　発行済数量	121,756,875,520口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8036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

2024年12月30日

Ⅰ　資産総額	129,496,718,516円
Ⅱ　負債総額	6,193,304,027円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	123,303,414,489円
Ⅳ　発行済数量	148,361,970,231口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8311円

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）

純資産額計算書

2024年12月30日

Ⅰ	資産総額	23,793,073,805円
Ⅱ	負債総額	3,578,880円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	23,789,494,925円
Ⅳ	発行済数量	16,484,744,256口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4431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

2024年12月30日

Ⅰ	資産総額	337,607,885,211円
Ⅱ	負債総額	45,678,812円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	337,562,206,399円
Ⅳ	発行済数量	89,726,141,857口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.7621円

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）

純資産額計算書

2024年12月30日

Ⅰ	資産総額	4,651,506,750円
Ⅱ	負債総額	719,316円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	4,650,787,434円
Ⅳ	発行済数量	3,163,253,682口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4703円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

前記「ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2024年12月30日

Ⅰ	資産総額	51,951,373,006円
Ⅱ	負債総額	192,381,856円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	51,758,991,150円
Ⅳ	発行済数量	26,822,126,026口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.9297円

ダイワファンドラップ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス

純資産額計算書

2024年12月30日

Ⅰ	資産総額	13,923,764,029円
Ⅱ	負債総額	27,171,889円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	13,896,592,140円
Ⅳ	発行済数量	11,214,778,349口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2391円

(参考) ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

純資産額計算書

2024年12月30日

Ⅰ	資産総額	266,271,638,575円
Ⅱ	負債総額	847,027,900円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	265,424,610,675円
Ⅳ	発行済数量	85,086,675,514口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.1195円

ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

2024年12月30日

Ⅰ	資産総額	21,257,586,256円
Ⅱ	負債総額	3,332,696円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	21,254,253,560円
Ⅳ	発行済数量	20,660,931,460口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0287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

2024年12月30日

Ⅰ	資産総額	28,192,951,254円
Ⅱ	負債総額	1,522,726,576円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	26,670,224,678円
Ⅳ	発行済数量	30,615,992,553口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8711円

ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）

純資産額計算書

2024年12月30日

Ⅰ	資産総額	9,177,372,025円
Ⅱ	負債総額	1,423,857円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	9,175,948,168円
Ⅳ	発行済数量	4,673,883,130口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.9632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

2024年12月30日

Ⅰ	資産総額	48,651,638,081円
Ⅱ	負債総額	115,882,518円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	48,535,755,563円
Ⅳ	発行済数量	11,857,973,304口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.0931円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

2024年12月末日現在

資本金の額　　414億2,454万1,896円

発行可能株式総数　799万9,980株

発行済株式総数　　326万657株

過去5年間における資本金の額の増減：2024年10月1日262億5,026万9,396円増加しました。

ｂ．委託会社の機構

①　会社の意思決定機構

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

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

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

②　投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ．商品会議

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

ロ．商品担当役員

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

ハ．運用会議

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

ニ．運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ．リスクマネジメント会議

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2024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	91	340,875
追加型株式投資信託	791	30,692,916
株式投資信託　　合計	882	31,033,791
単位型公社債投資信託	77	144,018
追加型公社債投資信託	14	1,440,104
公社債投資信託　合計	91	1,584,122
総合計	973	32,617,913

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、「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282条及び第306条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年８月６日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第65期事業年度（2023年４月１日から2024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66期事業年度に係る中間会計期間（2024年４月１日から2024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る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 （2023年３月31日）		当事業年度 （2024年３月31日）	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		1,982		4,813
有価証券		346		503
前払費用		393		481
未収委託者報酬		12,525		16,513
未収収益		47		78
関係会社短期貸付金		22,100		23,400
その他		59		88
流動資産計		37,455		45,878
固定資産				
有形固定資産	※1	196	※1	176
建物		3		2
器具備品		193		174
無形固定資産		1,482		1,342
ソフトウェア		1,351		1,063
ソフトウェア仮勘定		131		279
投資その他の資産		13,824		13,660

投資有価証券	8,260	8,448
関係会社株式	3,475	3,475
出資金	177	177
長期差入保証金	1,066	1,021
繰延税金資産	824	524
その他	20	12
固定資産計	15,503	15,180
資産合計	52,959	61,058

（単位:百万円）

	前事業年度 （2023年３月31日）		当事業年度 （2024年３月31日）	
負債の部				
流動負債				
預り金		101		158
未払金		5,874		6,187
未払収益分配金		38		39
未払償還金		12		12
未払手数料		4,525		5,849
その他未払金	※2	1,297	※2	285
未払費用		3,987		5,035
未払法人税等		560		3,842
未払消費税等		327		872
賞与引当金		692		1,048
その他		2		1
流動負債計		11,545		17,146
固定負債				
退職給付引当金		2,276		2,227
役員退職慰労引当金		51		62
その他		0		-
固定負債計		2,329		2,289
負債合計		13,874		19,435
純資産の部				
株主資本				
資本金		15,174		15,174
資本剰余金				
資本準備金		11,495		11,495
資本剰余金合計		11,495		11,495

利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	11,505	13,048
利益剰余金合計	11,879	13,422
株主資本合計	38,549	40,092
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	534	1,530
評価・換算差額等合計	534	1,530
純資産合計	39,084	41,623
負債・純資産合計	52,959	61,058

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）	当事業年度 （自　2023年４月１日 至　2024年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	69,845	76,221
その他営業収益	559	717
営業収益計	70,405	76,939
営業費用		
支払手数料	29,405	31,497
広告宣伝費	662	947
調査費	9,638	10,709
調査費	1,469	1,700
委託調査費	8,169	9,009
委託計算費	1,783	1,783
営業雑経費	1,658	2,285
通信費	181	163
印刷費	468	514
協会費	51	51
諸会費	17	18
その他営業雑経費	939	1,538
営業費用計	43,147	47,224
一般管理費		
給料	5,788	6,601
役員報酬	317	483
給料・手当	4,369	4,543
賞与	409	527
賞与引当金繰入額	692	1,048

福利厚生費	874	969
交際費	66	96
旅費交通費	95	192
租税公課	476	508
不動産賃借料	1,300	1,269
退職給付費用	488	334
役員退職慰労引当金繰入額	38	6
固定資産減価償却費	625	478
諸経費	2,193	1,888
一般管理費計	11,946	12,346
営業利益	15,310	17,368

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）	当事業年度 （自　2023年４月１日 至　2024年３月31日）
営業外収益		
投資有価証券売却益	286	220
受取配当金	25	40
有価証券償還益	150	32
その他	146	93
営業外収益計	608	388
営業外費用		
有価証券償還損	2	196
投資有価証券売却損	244	1
その他	31	18
営業外費用計	277	215
経常利益	15,642	17,540
特別損失		
システム刷新関連費用	-	153
投資有価証券評価損	257	132
関係会社整理損失	229	-
特別損失計	486	286
税引前当期純利益	15,155	17,253
法人税、住民税及び事業税	4,589	5,533
法人税等調整額	248	△139
法人税等合計	4,838	5,394
当期純利益	10,317	11,859

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（自　2023年４月１日 至　2024年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	11,505	11,879	38,549
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 10,316	△ 10,316	△ 10,316
当期純利益	-	-	-	11,859	11,859	11,859
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,543	1,543	1,543
当期末残高	15,174	11,495	374	13,048	13,422	40,092

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	534	534	39,084
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 10,316
当期純利益	-	-	11,859
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	995	995	995
当期変動額合計	995	995	2,538
当期末残高	1,530	1,530	41,623

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物　　10～18年

器具備品　　４～20年

（２）無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

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

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

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

４．収益及び費用の計上基準

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

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

（重要な会計上の見積り）

該当事項はありません。

（表示方法の変更）

（損益計算書関係）

前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「受取配当金」は、営業外収益の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。

この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」のその他に表示していた171百万円は、「受取配当金」25百万円、「その他」146百万円として組替えております。

（貸借対照表関係）

※１　有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 （2023年３月31日）	当事業年度 （2024年３月31日）
建物	38百万円	39百万円
器具備品	296百万円	308百万円

※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 （2023年３月31日）	当事業年度 （2024年３月31日）
未払金	1,178百万円	236百万円

３　保証債務

前事業年度（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。

当事業年度（2024年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,354百万円に対して保証を行っております。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

２．配当に関する事項

（１）　配当金支払額

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

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

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

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

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

２．配当に関する事項

（１） 配当金支払額

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

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

2024年６月19日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

①剰余金の配当の総額	11,858百万円
②配当の原資	利益剰余金
③１株当たり配当額	4,546円
④基準日	2024年３月31日
⑤効力発生日	2024年６月20日

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

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

（２）金融商品の内容及びそのリスク

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

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。その他未払金は主にグループ通算制度における通算親法人へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に関係する業務を委託したことにより発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

（３） 金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

（ⅰ）為替変動リスクの管理

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

（ⅱ）価格変動リスクの管理

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

②信用リスクの管理

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

２．金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

前事業年度（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

当事業年度（2024年３月31日）

（１）時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額			
	レベル１	レベル２	レベル３	合計
有価証券及び投資有価証券	144	8,141	―	8,285
資産合計	144	8,141	―	8,285

（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	666	666
子会社株式	1,448	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（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。

当事業年度（2024年３月31日）

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

２．その他有価証券

前事業年度（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。

当事業年度（2024年３月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	144	55	89
（２）その他	6,597	4,268	2,329
小計	6,742	4,323	2,419
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,543	1,756	△213
小計	1,543	1,756	△213
合計	8,285	6,079	2,205

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

３．売却したその他有価証券

前事業年度（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

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）

種類	売却額 （百万円）	売却益の合計額 （百万円）	売却損の合計額 （百万円）
（１）株式	-	-	-
（２）その他			
証券投資信託	1,455	220	1
合計	1,455	220	1

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。

当事業年度において、証券投資信託について132百万円の減損処理を行っております。

（退職給付関係）

１．採用している退職給付制度の概要

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

２．確定給付制度

(１)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）	当事業年度 （自　2023年４月１日 至　2024年３月31日）
退職給付債務の期首残高	2,399百万円	2,276百万円
勤務費用	150	138
退職給付の支払額	△ 322	△ 266
その他	48	78
退職給付債務の期末残高	2,276	2,227

(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　2022年４月１日 至　2023年３月31日）	当事業年度 （自　2023年４月１日 至　2024年３月31日）
非積立型制度の退職給付債務	2,276百万円	2,227百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,276	2,227
退職給付引当金	2,276	2,227
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,276	2,227

(３)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）	当事業年度 （自　2023年４月１日 至　2024年３月31日）
勤務費用	150百万円	138百万円
その他	153	9
確定給付制度に係る退職給付費用	303	147

（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184百万円、当事業年度187百万円であります。

（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 （2023年３月31日）	当事業年度 （2024年３月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金	697	681
賞与引当金	182	262

投資有価証券評価損	177	204
未払事業税	114	197
関係会社株式評価損	155	155
出資金評価損	94	94
システム関連費用	68	25
その他	309	289
繰延税金資産小計	1,799	1,910
評価性引当額	△ 459	△ 486
繰延税金資産合計	1,339	1,424
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	△ 356	△ 740
連結法人間取引（譲渡益）	△ 159	△ 159
繰延税金負債合計	△ 515	△ 899
繰延税金資産の純額	824	524

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（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。

当事業年度（2024年３月31日）

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

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76,221百万円、その他717百万円であります。

（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　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）

該当事項はありません。

[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　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

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

親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取（注）	17,100 0	関係会社短期貸付金 -	22,100 -

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　2023年４月１日　至　2024年３月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関係内容		取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取（注）	11,100 0	関係会社短期貸付金 -	23,400 -

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（イ）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（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。

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024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）	2,354	―	―

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（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　2022年４月１日　至　2023年３月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度（自　2023年４月１日　至　2024年３月31日）

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)

同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料（注2） 不動産の賃借料（注3）	13,749 1,030	未払手数料 長期差入保証金	3,491 1,010
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守（注4）	902	未払費用	87

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

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　2022年４月１日 至　2023年３月31日）		当事業年度 （自　2023年４月１日 至　2024年３月31日）	
１株当たり純資産額	14,983.42円	１株当たり純資産額	15,956.63円
１株当たり当期純利益	3,955.35円	１株当たり当期純利益	4,546.57円

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

（注２）１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 （自　2022年４月１日 至　2023年３月31日）	当事業年度 （自　2023年４月１日 至　2024年３月31日）
当期純利益（百万円）	10,317	11,859
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）

（株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行）

2024年5月15日開催の株主総会において、株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行を決議いたしました。条件等は次のとおりであります。

募集等の方法	第三者割当
発行する株式の種類及び数	普通株式　652,132株
払込金額	1株につき80,506円
払込金額の総額	52,500,538,792円
増加する資本金の金額	26,250,269,396円
払込期日	2024年7月1日（予定）
資金の使途	投融資及び運転資金に充当する予定であります。
新株式発行前の発行済株式総数に対する議決権比率	株式会社大和証券グループ本社：100%
新株式発行後の発行済株式総数に対する議決権比率	株式会社大和証券グループ本社：80% 株式会社かんぽ生命保険：20%

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 （2024年９月30日）
資産の部		
流動資産		
現金・預金		4,555
有価証券		1,271
未収委託者報酬		18,273
関係会社短期貸付金		16,900
その他		916
流動資産合計		41,916
固定資産		
有形固定資産	※１	60
無形固定資産		
ソフトウエア		878
その他		346
無形固定資産合計		1,225
投資その他の資産		
投資有価証券		9,666
関係会社株式		3,414
繰延税金資産		748

その他	1,095
投資その他の資産合計	14,924
固定資産合計	16,211
資産合計	58,128

（単位:百万円）

		当中間会計期間 （2024年９月30日）
負債の部		
流動負債		
未払金		6,580
未払費用		5,540
未払法人税等		4,405
賞与引当金		910
その他	※２	1,107
流動負債合計		18,545
固定負債		
退職給付引当金		2,270
役員退職慰労引当金		55
固定負債合計		2,325
負債合計		20,870
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		8,774
利益剰余金合計		9,148
株主資本合計		35,818
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		1,438
評価・換算差額等合計		1,438
純資産合計		37,257
負債・純資産合計		58,128

(２)中間損益計算書

（単位:百万円）

		当中間会計期間 （自　2024年４月１日 至　2024年９月30日）
営業収益		
委託者報酬		44,508
その他営業収益		483
営業収益合計		44,992
営業費用		
支払手数料		18,092
その他営業費用		9,300
営業費用合計		27,392
一般管理費	※１	6,708
営業利益		10,890
営業外収益	※２	281
営業外費用	※３	21
経常利益		11,150
特別利益	※４	491
特別損失	※５	154
税引前中間純利益		11,487
法人税、住民税及び事業税		4,086
法人税等調整額		△183
中間純利益		7,584

(３)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自　2024年４月１日 至　2024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	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		

当期首残高	15,174	11,495	374	13,048	13,422	40,092
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△11,858	△11,858	△11,858
中間純利益	-	-	-	7,584	7,584	7,584
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	△4,274	△4,274	△4,274
当中間期末残高	15,174	11,495	374	8,774	9,148	35,818

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,530	1,530	41,623
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△11,858
中間純利益	-	-	7,584
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△91	△91	△91
当中間期変動額合計	△91	△91	△4,365
当中間期末残高	1,438	1,438	37,257

注記事項
（重要な会計方針）

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

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

市場価格のない株式等
移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法
（１）有形固定資産

定額法によっております。
なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。
建物　　10～18年
器具備品　　４～20年

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

３．引当金の計上基準
（１）賞与引当金
役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

（２）退職給付引当金
従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員及び参与についても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．その他中間財務諸表の作成のための基本となる重要な事項
当社は株式会社大和証券グループ本社を通算親法人とするグループ通算制度を適用しておりましたが、2024年10月1日の第三者割当増資により、株式会社大和証券グループ本社の100%子会社ではなくなったため、株式会社大和証券グループ本社を通算親法人とするグループ通算制度から離脱しています。

（中間貸借対照表関係）

※１　減価償却累計額

	当中間会計期間 （2024年９月30日現在）
有形固定資産	358百万円

※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（2024年９月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,340百万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　2024年４月　１日 至　2024年９月30日）
有形固定資産	9百万円
無形固定資産	211百万円

※２　営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 （自　2024年４月　１日 至　2024年９月30日）
投資有価証券売却益	184百万円
有価証券償還益	45百万円
受取配当金	27百万円

※３　営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 （自　2024年４月　１日 至　2024年９月30日）
為替差損	17百万円

※４　特別利益の項目

	当中間会計期間 （自　2024年４月　１日 至　2024年９月30日）
投資有価証券売却益	380百万円
固定資産売却益	
美術品	83百万円
ゴルフ会員権	26百万円

※５　特別損失の項目

	当中間会計期間 （自　2024年４月１日 至　2024年９月30日）
固定資産売却損	
美術品	85百万円
ゴルフ会員権	15百万円
投資有価証券評価損	53百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自　2024年４月１日　至　2024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
2024年６月19日 定時株主総会	普通株式	11,858	4,546	2024年 ３月31日	2024年 ６月20日

（金融商品関係）

当中間会計期間（2024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	1,602	8,991	－	10,594
資産合計	1,602	8,991	－	10,594

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

（注１）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

市場で取得した株式及び上場投資信託は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル１に分類しております。当社が保有している証券投資信託のうちレベル１の時価を採用しているもの以外は基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル２に分類しております。

（注２）市場価格のない株式等の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	342
子会社株式	1,386
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2024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　1,386百万円）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	123	55	67

（２）その他	6,715	4,477	2,238
小計	6,838	4,532	2,306
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	3,756	3,988	△232
小計	3,756	3,988	△232
合計	10,594	8,520	2,073

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額　342百万円）については、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（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44,508百万円、その他483百万円であります。

（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　2024年４月１日　至　2024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　2024年４月１日　至　2024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　2024年４月１日　至　2024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　2024年４月１日　至　2024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　2024年４月１日　至　2024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　2024年４月１日 至　2024年９月30日）	
１株当たり純資産額	14,283.03円
１株当たり中間純利益	2,907.52円

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

（注２）　１株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 （自　2024年４月１日 至　2024年９月30日）	
中間純利益(百万円)	7,584
普通株式に係る中間純利益(百万円)	7,584
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）

（株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行）

2024年5月15日開催の株主総会及び2024年6月27日開催の臨時株主総会において、株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行について決議し、2024年10月1日付で払込手続きが完了いたしました。

募集等の方法	第三者割当
発行する株式の種類及び数	普通株式　652,132株

払込金額	1株につき80,506円
払込金額の総額	52,500,538,792円
増加する資本金の金額	26,250,269,396円
払込日	2024年10月1日
資金の使途	投融資及び運転資金に充当する予定であります。
新株式発行前の発行済株式総数に対する議決権比率	株式会社大和証券グループ本社：100%
新株式発行後の発行済株式総数に対する議決権比率	株式会社大和証券グループ本社：80% 株式会社かんぽ生命保険：20%

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

ａ．定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2024年5月15日、株式会社かんぽ生命保険と資本業務提携を締結し、本提携に基づき2024年10月1日、かんぽ生命保険を引き受け先とする第三者割当増資を実施いたしました。

ｂ．訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

	①　名　称	②　資本金の額 (2024年03月末日現在)	③　事業の内容	④　備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	（注6）	
	みずほ信託銀行株式会社	247,369百万円	（注6）	
再信託受託会社	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円	（注6）	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	（注1）	

（注1）金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
（注2）主として中小企業向け融資業を営んでいます。
（注3）銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
（注4）全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
（注5）協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。
（注6）銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
（注7）信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。
（注8）保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。
（注9）保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
（注10）全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。
（注11）労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。
（注12）農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでいます。
（注13）資産運用業務を行なっています。
（注14）資産運用業務、投資助言業務および情報提供業務を行なっています。

２【関係業務の概要】

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

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

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

３【資本関係】

該当事項はありません。

第３【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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

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

・委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

・詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

①委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等

②請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨

・使用開始日を記載することがあります。

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

①届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

②届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日

・次の事項を記載することがあります。

①投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨

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

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

・委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。

・ファンドの形態等を記載することがあります。

・図案を採用することがあります。

・ファンドの管理番号等を記載することがあります。

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

・UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

2024年５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

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2024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。

強調事項

注記事項（重要な後発事象）に記載されているとおり、会社は2024年５月15日開催の株主総会において、株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行を決議している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表

を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注) 1．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年8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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）の2023年6月16日から2024年6月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）の2024年6月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年8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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2023年6月16日から2024年6月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2024年6月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年8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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の2023年6月16日から2024年6月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の2024年6月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年8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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）の2023年6月16日から2024年6月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）の2024年6月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年8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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2023年6月16日から2024年6月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2024年6月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年8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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）の2023年6月16日から2024年6月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）の2024年6月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年8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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）の2023年6月16日から2024年6月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）の2024年6月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年8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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）の2023年6月16日から2024年6月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）の2024年6月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年8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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスの2023年6月16日から2024年6月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスの2024年6月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- **不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。**
- **財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。**

・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年8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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ　ＴＯＰＩＸインデックスの2023年6月16日から2024年6月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ　ＴＯＰＩＸインデックスの2024年6月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどう

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- **不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。**
- **財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。**

・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年8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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 日経２２５インデックスの2023年6月16日から2024年6月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 日経２２５インデックスの2024年6月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどう

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- **不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。**
- **財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。**

・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年8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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 日本債券インデックスの2023年6月16日から2024年6月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 日本債券インデックスの2024年6月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどう

か検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- **不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。**
- **財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。**

・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

大和アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2024年11月25日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	渡部　啓太
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	松田　好弘

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2024年４月１日から2025年３月31日までの第66期事業年度の中間会計期間（2024年４月１日から2024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2024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（2024年４月１日から2024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。

強調事項

注記事項（重要な後発事象）に記載されているとおり、会社は2024年10月１日付で株式会社かんぽ生命保険を割当先とする新株式発行を実施している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成

基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- **不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。**
- **中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。**
- **中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。**

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

**　会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。**

以　上

(注)１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2025年2月14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ファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）の2024年6月18日から2024年12月17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、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）の2024年12月17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（2024年6月18日から2024年12月17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、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

2025年2月14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ファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2024年6月18日から2024年12月17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、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2024年12月17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（2024年6月18日から2024年12月17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、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

2025年2月14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ファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の2024年6月18日から2024年12月17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、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の2024年12月17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（2024年6月18日から2024年12月17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、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

2025年2月14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ファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）の2024年6月18日から2024年12月17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、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）の2024年12月17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（2024年6月18日から2024年12月17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、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

2025年2月14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ファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2024年6月18日から2024年12月17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、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2024年12月17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（2024年6月18日から2024年12月17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、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

2025年2月14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ファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）の2024年6月18日から2024年12月17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、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）の2024年12月17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（2024年6月18日から2024年12月17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、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

2025年2月14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ファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）の2024年6月18日から2024年12月17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、ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）の2024年12月17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（2024年6月18日から2024年12月17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、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

2025年2月14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ファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）の2024年6月18日から2024年12月17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、ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）の2024年12月17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（2024年6月18日から2024年12月17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、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

2025年2月14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ファンドラップ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスの2024年6月18日から2024年12月17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、ダイワファンドラップ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスの2024年12月17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（2024年6月18日から2024年12月17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、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

2025年2月14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ファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックスの2024年6月18日から2024年12月17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、ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックスの2024年12月17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（2024年6月18日から2024年12月17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、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

2025年2月14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ファンドラップ 日経２２５インデックスの2024年6月18日から2024年12月17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、ダイワファンドラップ 日経２２５インデックスの2024年12月17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（2024年6月18日から2024年12月17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、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

2025年2月14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ファンドラップ 日本債券インデックスの2024年6月18日から2024年12月17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、ダイワファンドラップ 日本債券インデックスの2024年12月17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（2024年6月18日から2024年12月17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、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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。