

【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】	2026年3月9日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 佐野 径
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	佐竹 優子 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用） ダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用） ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用） ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用） ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用） ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用） ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用） ダイワJ-REITインデックス（ダイワSMA専用） ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用） ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で100兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

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

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

(3) 【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で100兆円を上限とします。

(4) 【発行（売出）価格】

各ファンドについて1万口当たり次のとおりとします。

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

基準価額は、販売会社または下記にお問合せ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(5) 【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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。

(6) 【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

(7)【申込期間】

2026年3月10日から2026年9月8日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8)【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12)【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

<TOPIXインデックス>

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<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
	海 外	債 券	
		不動産投信	
追加型投信	内 外	その他資産 ()	特殊型
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<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	
	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ()	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<外国株式インデックス(為替ヘッジなし)>

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<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
	海 外	債 券	
追加型投信		不動産投信	
	内 外	その他資産 ()	特殊型
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<外国債券インデックス(為替ヘッジなし)>

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<J-REITインデックス>

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

（注1）商品分類の定義

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

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

（注2）属性区分の定義

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

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

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

<信託金の限度額>

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

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

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの目的・特色>

ファンドの目的

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。

※特定の指数、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。

ファンドの特色

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

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

2 各ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて実質的な運用を行ないます。

●各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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



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

●各ファンドの基本情報

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

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

※特定の指数の内容については、後掲の「特定の指数について」をご参照下さい。

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

●各ファンドの運用方針

TOPIXインデックス

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

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

- (a)上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行いません。
- (b)ポートフォリオは、東証株価指数(配当込み)における業種別、銘柄別時価構成比率等を参考に、東証株価指数(配当込み)との連動性を維持するよう構築します。
- (c)株式の組入比率は、高位を保ちます。

◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル^(注1)を用います。

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

日経225インデックス

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

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

◆わが国の株式のうち日経平均トータルリターン・インデックスに採用された銘柄を主要投資対象とします。投資成果を指数の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行いません。

- (a)上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、等株数投資を行いません。
- (b)株式の組入比率は、高位を保ちます。

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

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

外国株式インデックス(為替ヘッジあり)

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

- ◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル^(注1)を用います。

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

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

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

外国株式インデックス(為替ヘッジなし)

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

- ◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル^(注1)を用います。

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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2)を用いるとともに、残存年限別構成比率等をチェックします。

(注1) ポートフォリオ理論に基づき、株価変動に影響を与える複数の要素からポートフォリオのリスクを分析するモデルです。このモデルを用いることにより、さまざまな制約条件下で指数に最も連動すると推定されるポートフォリオを構築することができます。

(注2) マルチファクターモデルは、ポートフォリオのリスク分析、ポートフォリオの構築を主目的としたモデルです。

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

外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)に連動する投資成果をあげることが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3)を用い債券価格変動への連動をめざしてポートフォリオを構築します。また、同インデックスへの連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ないます。なお、保有外貨建資産については、同インデックスに連動させるため為替ヘッジを行ないます。

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

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

外国債券インデックス(為替ヘッジなし)

FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)に連動する投資成果をあげることが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3)を用い債券価格変動への連動をめざしてポートフォリオを構築します。また、同インデックスへの連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ないます。

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

J-REITインデックス

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

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

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

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

外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

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

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

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

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

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

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

外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。

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

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

●特定の指数について

◆東証株価指数(TOPIX)

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。

◆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。

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

※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

●TOPIXインデックス

●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。

●外国株式インデックス(為替ヘッジあり/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。

●日本債券インデックス

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

●外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

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

●外国債券インデックス(為替ヘッジなし)

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

●J-REITインデックス

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

●外国REITインデックス(為替ヘッジあり／なし)

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

*[外国REITインデックス(為替ヘッジなし)]を除きます。

TOPIXインデックス

日経225インデックス

外国株式インデックス(為替ヘッジあり)

外国株式インデックス(為替ヘッジなし)

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

*[TOPIXインデックス]および[日経225インデックス]を除きます。

日本債券インデックス

外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

外国債券インデックス(為替ヘッジなし)

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

*[日本債券インデックス]を除きます。

J-REITインデックス

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

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

外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

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

●各マザーファンドが運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負いません。

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

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

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

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

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

2017年2月16日

2022年3月9日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

<ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>商品
分類の変更

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※3）		
お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。
		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	<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十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 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十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 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。 <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 <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 <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 <日本債券インデックス> わが国の公社債 など <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 <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 <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

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

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

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

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

<委託会社の概況（2025年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
2025年 7月 1日	大和かんぽオルタナティブインベストメンツ株式会社（旧商号：三井物産オルタナティブインベストメンツ株式会社）を子会社化

・大株主の状況

名 称	住 所	所有 株式数	比率
株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
TOPIXインデックス	トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券

日経２２５インデックス	ストックインデックス２２５・マザーファンドの受益証券
外国株式インデックス （為替ヘッジあり）	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの受益証券
外国株式インデックス （為替ヘッジなし）	外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
日本債券インデックス	日本債券インデックスマザーファンドの受益証券
外国債券インデックス （為替ヘッジあり）	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの受益証券
外国債券インデックス （為替ヘッジなし）	外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
J－REITインデックス	ダイワJ－REITマザーファンドの受益証券
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
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および先進国REITマザーファンドの受益証券

※以下、各ファンドにおいて「マザーファンド」といいます。

② 投資態度

＜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、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ハ. 株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- ニ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

＜日経２２５インデックス＞

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

＜外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

- イ. 主として、マザーファンドの受益証券を通じて、外国の株式（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、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
 - ハ. マザーファンドにおいて、保有する外貨建資産については為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。
- ニ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

＜外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

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

＜日本債券インデックス＞

- イ. 主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の公社債に投資し、投資成果をダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
- ロ. マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ハ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

＜外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

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

<外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

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

<J-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、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ハ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

<外国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。

<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、海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。
- ロ. マザーファンドの受益証券の組入比率の合計は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

ハ、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

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

(2)【投資対象】

＜TOPIXインデックス＞

＜日経２２５インデックス＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜日本債券インデックス＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国REITインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国REITインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

イ、有価証券

ロ、デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)

⑧、⑨、⑩、⑪および⑫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、「日経２２５インデックス」は、みずほ信託銀行株式会社、「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。

＜TOPIXインデックス＞

＜日経２２５インデックス＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

<外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

1. 株券または新株引受権証券

<日本債券インデックス>

<外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

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

<TOPIXインデックス>

<日経225インデックス>

<外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

<日本債券インデックス>

<外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

<外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
20. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前19.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

- 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、＜ファンドの目的・特色＞をご参照下さい。

＜外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. コマーシャル・ペーパー
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
9. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
10. 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

11. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
12. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
13. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
14. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
15. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
16. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
17. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前15.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

- 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、＜ファンドの目的・特色＞をご参照下さい。

＜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

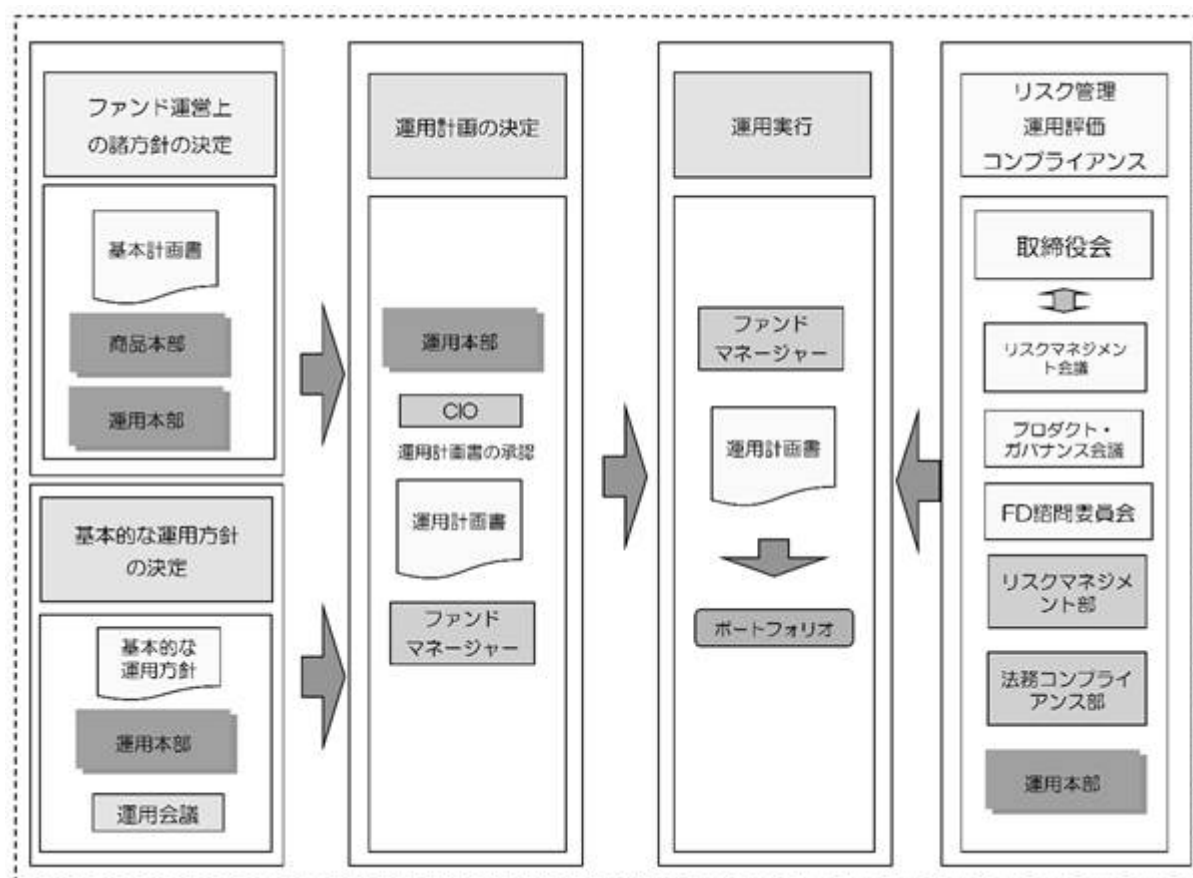
※指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、＜ファンドの目的・特色＞をご参照下さい。

(3)【運用体制】

＜各ファンド共通＞

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本部長の決裁により決定します。

ロ. 基本的な運用方針の承認

運用担当チームは、基本的な運用方針を作成し、運用会議にて承認を受けます。

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承認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、CIOの承認を受けます。

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。

- ・運用チームまたは運用チームの戦略毎の基本的な運用方針の承認
- ・運用チームリーダーまたは運用チームメンバーが策定する各信託財産等の運用計画書および変更運用計画書の承認
- ・その他信託財産等の運用に関する事項の決定

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）

運用チームリーダーまたは運用チームメンバーが策定する運用計画書および変更運用計画書を承認します。

ホ. 運用チームリーダー

次の職務を遂行します。

- ・運用チームまたは運用チームの戦略毎の基本的な運用方針の立案
- ・運用計画書および変更運用計画書の作成または運用チームメンバーへの作成の指示
- ・運用計画に基づく運用プロセス等の実行および運用チームメンバーへの実行の指示

ヘ. ファンドマネージャー

次の職務を遂行します。

- ・運用チームリーダーの指示に基づく運用計画書および変更運用計画書の作成
- ・運用計画に基づく運用プロセス等の実行

④ リスクマネジメント会議、プロダクト・ガバナンス会議およびFD諮問委員会

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

イ. リスクマネジメント会議

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

ロ. プロダクト・ガバナンス会議

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

ハ、FD諮問委員会

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

⑤ 受託会社に対する管理体制

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

※ 上記の運用体制は2025年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、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- 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）

＜TOPIXインデックス＞

＜日経225インデックス＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国REITインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国REITインデックス（為替ヘッジなし）＞

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

＜日本債券インデックス＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

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

＜外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

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

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

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

< 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）

< TOPIXインデックス >

< 日経225インデックス >

< 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） >

< 日本債券インデックス >

< 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） >

< 外国REITインデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国REITインデックス（為替ヘッジなし） >

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）

< TOPIXインデックス >

< 日経225インデックス >

< 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） >

< 日本債券インデックス >

< 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） >

< 外国REITインデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国REITインデックス（為替ヘッジなし） >

イ。委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（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。

< 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）

< TOPIXインデックス >

< 日経225インデックス >

< 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） >

< 日本債券インデックス >

< 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） >

< 外国REITインデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国REITインデックス（為替ヘッジなし） >

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。

< 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。

< 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）

< TOPIXインデックス >

< 日経225インデックス >

< 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） >

< 日本債券インデックス >

< 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） >

< 外国REITインデックス（為替ヘッジあり） >

< 外国REITインデックス（為替ヘッジなし） >

<外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

<外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

<外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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

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

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

<J-REITインデックス>

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

⑨ スワップ取引（信託約款）

<TOPIXインデックス>

<日経225インデックス>

<日本債券インデックス>

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

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

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

<外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

<外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

<外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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

ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。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。

<J-REITインデックス>

（規定なし）

⑩ 金利先渡取引（信託約款）

<TOPIXインデックス>

<日経225インデックス>

<日本債券インデックス>

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

ロ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。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）

<外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

<外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

<外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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

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

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

<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）

＜TOPIXインデックス＞

＜日経225インデックス＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜日本債券インデックス＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国REITインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国REITインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

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

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

＜J-REITインデックス＞

（規定なし）

⑮ 外貨建資産（信託約款）

＜TOPIXインデックス＞

＜日経225インデックス＞

＜日本債券インデックス＞

外貨建資産への投資は、行ないません。

＜外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国REITインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国REITインデックス（為替ヘッジなし）＞

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

＜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）

＜外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

＜上記以外の各ファンド＞

（規定なし）

⑰ 外国為替予約取引（信託約款）

＜外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

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

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

＜上記以外の各ファンド＞

（規定なし）

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。

⑨ 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、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

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

ハ. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

<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MSC I コクサイ指数（配当込み、円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 ② 保有外貨建資産については、MSC I コクサイ指数（配当込み、円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして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MSC I コクサイ指数（配当込み、円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	外国の株式（預託証券を含みます。）を主要投資対象とします。
投資態度	イ、主として外国の株式（預託証券を含みます。）に投資し、投資成果をMSC I 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。

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します。 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します。 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。

先進国REITマザーファンド

運用の基本方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	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を対象指数とした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 ニ. 国内の債券
投資態度	イ. 主として、先進国のリート、先進国のリート指数を対象指数としたETF、先進国のリートを対象としたリート指数先物取引および残存期間の短いわが国の債券に投資し、先進国のリート市場の中長期的な値動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行ないます。 ※ 一部日本のリートを含む指数を対象とするETFを組入れる場合があります。 ロ. 運用の効率化を図るため、先進国のリートを対象としたリート指数先物取引を利用することがあります。このため、リートおよびETFの組入総額ならびにリート指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 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 株式への投資割合には、制限を設けません。 ② 投資信託証券 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③ 外貨建資産 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ④ 先物取引等 イ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。 ロ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。 ハ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。 ⑤ スワップ取引 イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。 ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。 ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。 ニ. スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。 ホ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。 ⑥ 金利先渡取引および為替先渡取引 イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

- ロ. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。）の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ. 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ホ. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ヘ. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、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。

3【投資リスク】

(1)価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

<TOPIXインデックス>

<日経225インデックス>

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。

<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）

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

ロ. カントリー・リスク

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

③ その他

（TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの②と同内容）

<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）

（TOPIXインデックスおよび日経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

（TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの②と同内容）

＜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

（TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの②と同内容）

＜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）

（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

（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

（TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの②と同内容）

＜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）

（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

（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

（TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの②と同内容）

＜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ます。

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

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

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

（TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの②と同内容）

<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

（J-REIT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

（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

（TOPIXインデックスおよび日経225インデックスの②と同内容）

<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

（J-REIT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

（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

（TOPIXインデックスおよび日経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（「TOPIXインデックス」、「日経225インデックス」、「日本債券インデックス」および「J-REITインデックス」を除きます。）その他やむを得ない事情が発生した場合には、お買付けの申込みの受付けを中止すること、すでに受付けたお買付けの申込みを取消することがあります。
- 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（「TOPIXインデックス」、「日経225インデックス」、「日本債券インデックス」および「J-REITインデックス」を除きます。）その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

(3)その他の留意点

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

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

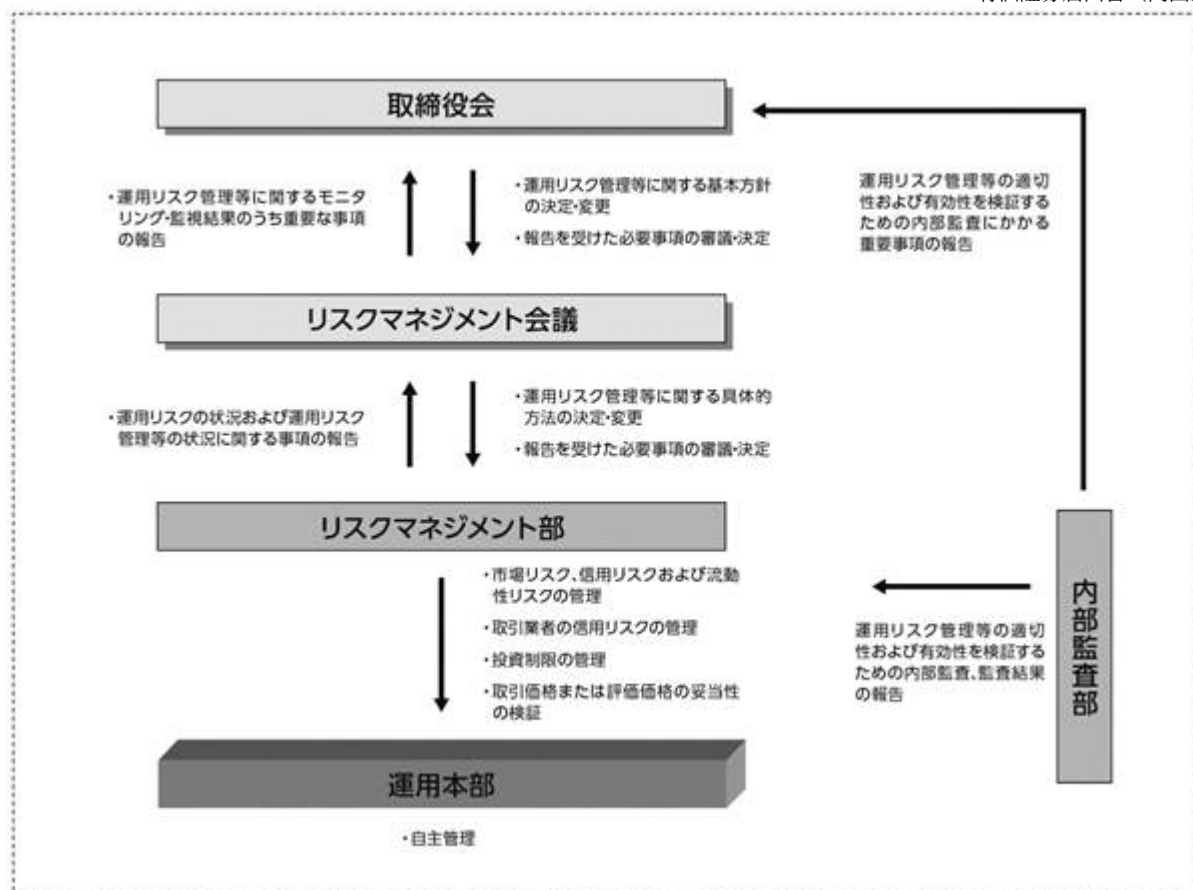
※ 流動性リスクに関する事項

- ・ 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性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

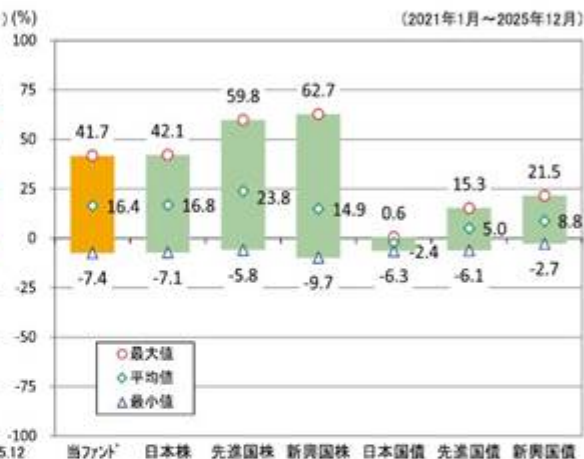
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間に於ける年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間に於ける年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

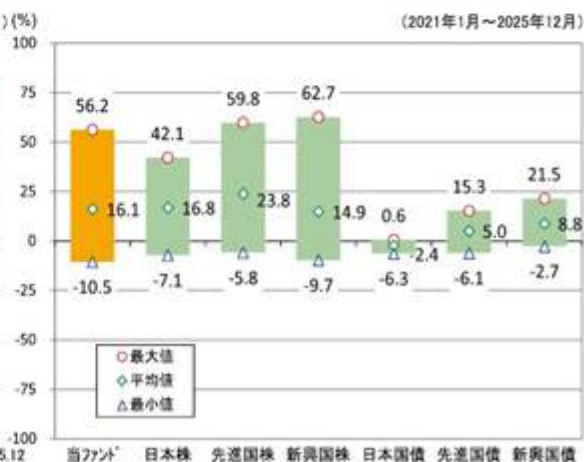
[TOPIXインデックス]



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



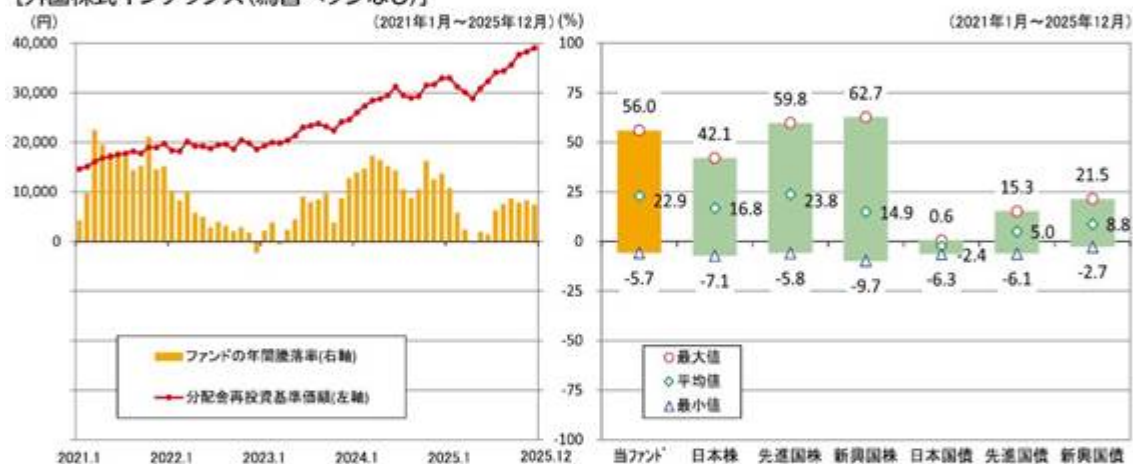
[日経225インデックス]



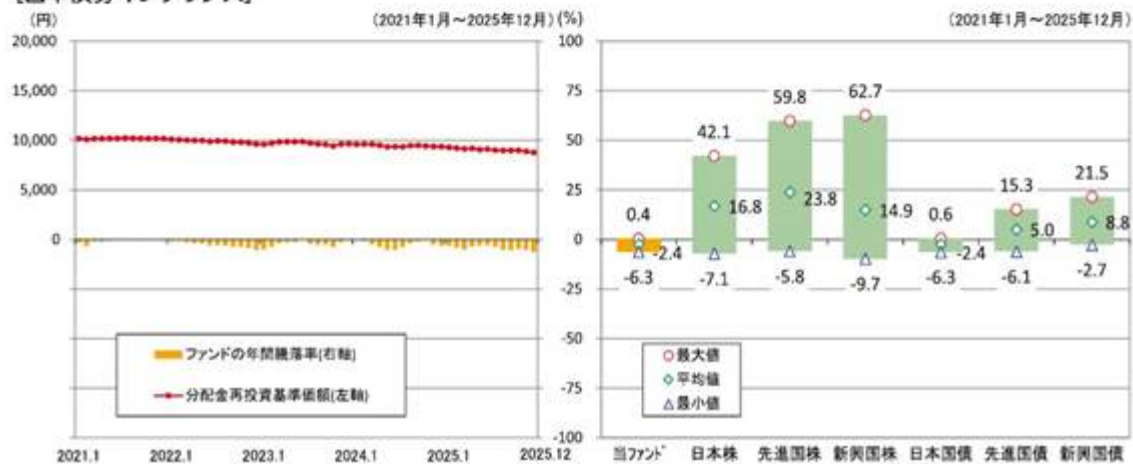
[外国株式インデックス(為替ヘッジあり)]



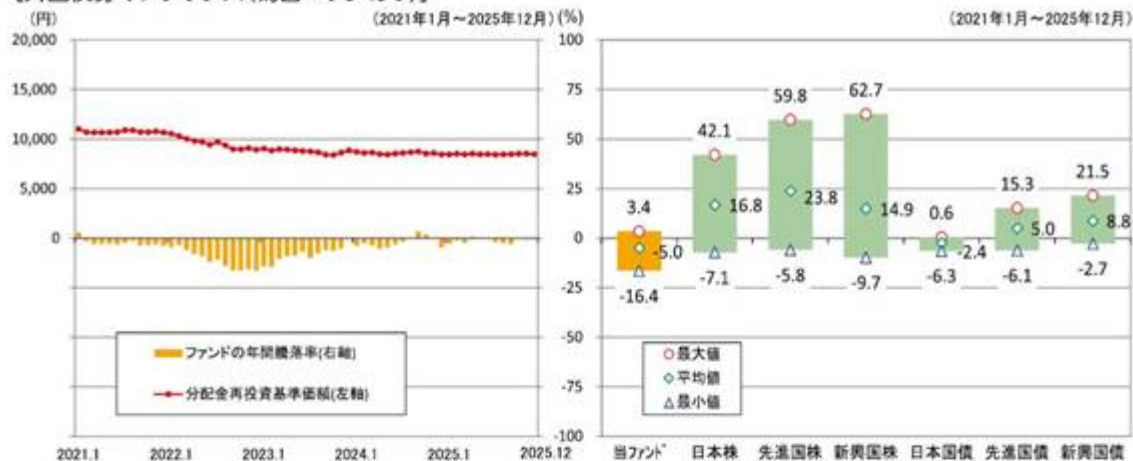
[外国株式インデックス(為替ヘッジなし)]



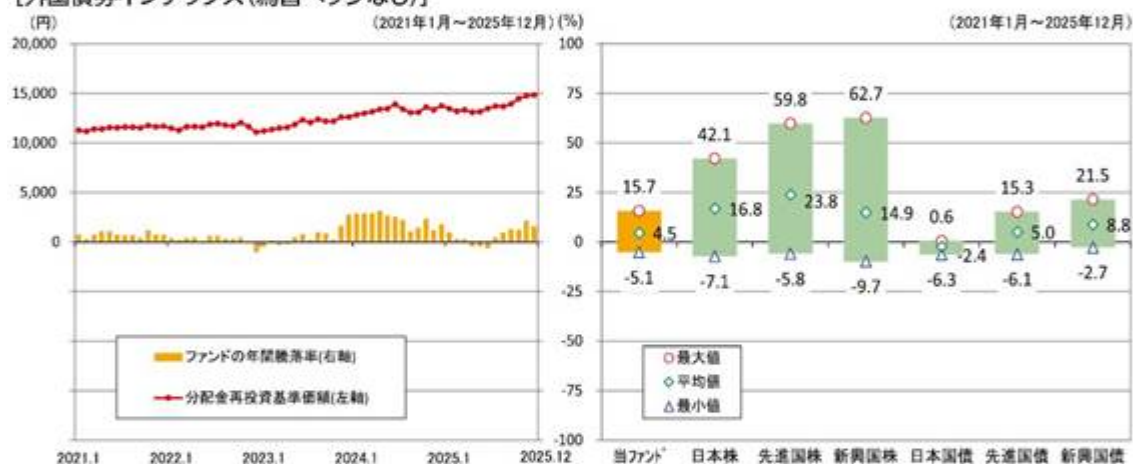
[日本債券インデックス]



〔外国債券インデックス(為替ヘッジあり)〕



〔外国債券インデックス(為替ヘッジなし)〕



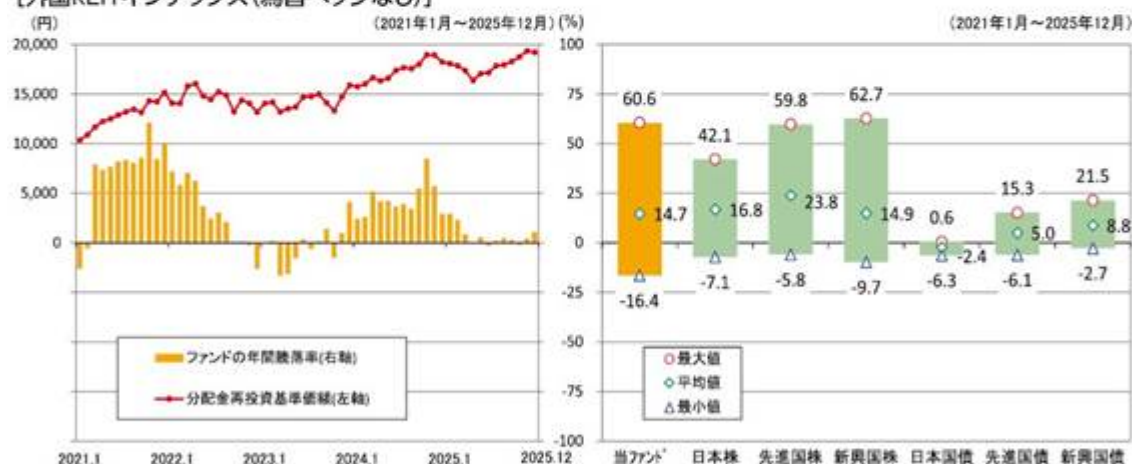
〔J-REITインデックス〕



【外国REITインデックス（為替ヘッジあり）】



【外国REITインデックス（為替ヘッジなし）】



※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・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

※指数について

●配当込みTOPIXの指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.（「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・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

(2)【換金（解約）手数料】

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

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

（新発10年国債利回りが）

イ. 1%未満の場合 …………… 年率0.1485%（税抜0.135%）

ロ. 1%以上の場合 …………… 年率0.3355%（税抜0.305%）

- 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。

<TOPIXインデックス>

<日経225インデックス>

委託会社	販売会社	受託会社

年率0.19% (税抜)	年率0.10% (税抜)	年率0.02% (税抜)

＜外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

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

＜日本債券インデックス＞

	委託会社	販売会社	受託会社
前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)

＜外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

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

＜Ｊ－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)

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

- 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（「TOPIXインデックス」および「日経225インデックス」のみ。））を選択することもできます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ロ. 解約金および償還金に対する課税

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

ハ. 損益通算について

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

間、上場株式等の譲渡益・償還差益および配当等・利子から繰越控除することができます。一部解約時および償還時の差益については、他の上場株式等の譲渡損および償還差損との相殺が可能となります。

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

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」について

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

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

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

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

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。

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

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。

<注2>収益分配金の課税について

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

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

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

（※）上記は、2025年12月末日現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

【ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）】

(1)【投資状況】（2025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		53,263,857,887	99.99
	内 日本	53,263,857,887	99.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,699,030	0.01
純資産総額		53,267,556,917	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

(2)【投資資産】（2025年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	20,728,462,752	2.1584 44,741,910,787	2.5696 53,263,857,887	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)	4,156,052	4,168,187	1.0274	1.0304
第2計算期間末 (2018年6月15日)	99,679,256	100,618,182	1.1678	1.1788
第3計算期間末 (2019年6月17日)	1,892,823,205	1,898,380,433	1.0218	1.0248
第4計算期間末 (2020年6月15日)	5,083,506,949	5,183,291,476	1.0189	1.0389
第5計算期間末 (2021年6月15日)	2,958,666,170	3,001,224,765	1.3209	1.3399
第6計算期間末 (2022年6月15日)	2,264,818,646	2,314,133,579	1.2400	1.2670
第7計算期間末 (2023年6月15日)	5,633,831,264	5,710,268,303	1.5478	1.5688
第8計算期間末 (2024年6月17日)	17,564,723,732	17,794,662,178	1.8333	1.8573
2024年12月末日	30,800,720,964	—	1.9117	—
2025年1月末日	29,612,130,231	—	1.9138	—
2月末日	29,378,987,248	—	1.8407	—
3月末日	30,196,023,898	—	1.8439	—
4月末日	32,266,859,488	—	1.8499	—
5月末日	29,848,551,511	—	1.9436	—
第9計算期間末 (2025年6月16日)	30,727,751,543	31,312,869,876	1.8906	1.9266
6月末日	31,316,482,685	—	1.9443	—
7月末日	38,874,372,299	—	2.0053	—
8月末日	42,699,514,491	—	2.0953	—
9月末日	46,380,167,466	—	2.1571	—
10月末日	50,275,658,073	—	2.2905	—
11月末日	50,811,123,890	—	2.3222	—
12月末日	53,267,556,917	—	2.3455	—

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0030
第2計算期間	0.0110
第3計算期間	0.0030
第4計算期間	0.0200
第5計算期間	0.0190
第6計算期間	0.0270
第7計算期間	0.0210
第8計算期間	0.0240
第9計算期間	0.0360
2025年6月17日～ 2025年12月16日	—

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	3.0
第2計算期間	14.7
第3計算期間	△12.2
第4計算期間	1.7
第5計算期間	31.5
第6計算期間	△4.1
第7計算期間	26.5
第8計算期間	20.0
第9計算期間	5.1
2025年6月17日～ 2025年12月16日	22.5

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量 (口)	解約数量 (口)
第1計算期間	3,045,067	0
第2計算期間	81,311,932	0
第3計算期間	2,042,744,740	275,692,237
第4計算期間	20,581,650,630	17,444,833,751
第5計算期間	8,768,488,999	11,517,789,316
第6計算期間	1,305,791,488	1,719,238,551
第7計算期間	2,192,695,557	379,315,522
第8計算期間	9,114,805,565	3,173,896,010

第9計算期間	14,304,105,605	7,631,587,166
2025年6月17日～ 2025年12月16日	11,097,355,937	4,276,533,529

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（2025年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		569,635,341,660	97.83
	内 日本	569,635,341,660	97.83
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		12,658,743,679	2.17
純資産総額		582,294,085,339	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）		12,561,680,000	2.16
	内 日本	12,561,680,000	2.16

(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) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

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

(2) 投資資産（2025年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	6,278,300	2,931.05 18,402,028,857	3,356.00 21,069,974,800	3.62
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	7,337,900	2,343.42 17,195,852,157	2,493.00 18,293,384,700	3.14
3	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	4,074,100	3,476.12 14,162,082,513	4,024.00 16,394,178,400	2.82

4	日立	日本	株式	電気機器	3,035,200	3,912.65 11,875,691,361	4,902.00 14,878,550,400	2.56
5	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	2,555,400	4,161.62 10,634,615,360	5,041.00 12,881,771,400	2.21
6	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	2,270,400	4,623.15 10,496,421,774	4,400.00 9,989,760,000	1.72
7	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,649,500	4,875.38 8,041,951,305	5,700.00 9,402,150,000	1.61
8	三菱商事	日本	株式	卸売業	2,491,100	3,582.89 8,925,344,333	3,586.00 8,933,084,600	1.53
9	三菱重工業	日本	株式	機械	2,235,000	3,769.38 8,424,566,020	3,840.00 8,582,400,000	1.47
10	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	250,000	25,976.16 6,494,041,577	34,320.00 8,580,000,000	1.47
11	三井物産	日本	株式	卸売業	1,796,700	3,739.95 6,719,578,475	4,643.00 8,342,078,100	1.43
12	伊藤忠	日本	株式	卸売業	4,200,000	1,744.12 7,325,324,720	1,975.00 8,295,000,000	1.42
13	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	897,900	7,944.21 7,133,112,250	8,847.00 7,943,721,300	1.36
14	任天堂	日本	株式	その他製品	745,600	12,803.82 9,546,528,799	10,595.00 7,899,632,000	1.36
15	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	372,200	15,257.45 5,678,826,188	19,635.00 7,308,147,000	1.26
16	東京海上HD	日本	株式	保険業	1,195,800	6,266.07 7,492,977,606	5,817.00 6,955,968,600	1.19
17	キーエンス	日本	株式	電気機器	118,200	55,751.05 6,589,775,228	56,680.00 6,699,576,000	1.15
18	三菱電機	日本	株式	電気機器	1,306,600	3,843.02 5,021,290,542	4,585.00 5,990,761,000	1.03
19	HOYA	日本	株式	精密機器	227,300	20,668.29 4,697,903,948	23,685.00 5,383,600,500	0.92
20	NTT	日本	株式	情報・通信業	32,523,200	157.78 5,131,691,535	157.70 5,128,908,640	0.88
21	信越化学	日本	株式	化学	1,052,000	4,641.52 4,882,881,630	4,873.00 5,126,396,000	0.88
22	武田薬品	日本	株式	医薬品	1,054,000	4,472.08 4,713,573,586	4,835.00 5,096,090,000	0.88
23	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	84,300	46,173.96 3,892,465,230	56,940.00 4,800,042,000	0.82

24	富士通	日本	株式	電気機器	1,097,600	3,684.65 4,044,273,006	4,329.00 4,751,510,400	0.82
25	KDDI	日本	株式	情報・通信業	1,664,600	2,475.49 4,120,715,840	2,708.50 4,508,569,100	0.77
26	日本電気	日本	株式	電気機器	783,300	4,726.25 3,702,075,593	5,310.00 4,159,323,000	0.71
27	丸紅	日本	株式	卸売業	953,500	3,637.02 3,467,902,834	4,353.00 4,150,585,500	0.71
28	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	19,049,800	228.34 4,349,947,222	214.80 4,091,897,040	0.70
29	住友商事	日本	株式	卸売業	749,000	4,384.11 3,283,703,723	5,412.00 4,053,588,000	0.70
30	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	706,600	4,804.43 3,394,811,977	5,640.00 3,985,224,000	0.68

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.83%
合計	97.83%

(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	0.34%
建設業	2.44%
食料品	2.70%
繊維製品	0.33%
パルプ・紙	0.14%
化学	4.40%
医薬品	3.66%
石油・石炭製品	0.48%
ゴム製品	0.63%
ガラス・土石製品	0.66%
鉄鋼	0.78%
非鉄金属	1.62%
金属製品	0.44%
機械	5.77%

電気機器	18.00%
輸送用機器	6.82%
精密機器	1.90%
その他製品	2.44%
電気・ガス業	1.37%
陸運業	2.19%
海運業	0.52%
空運業	0.30%
倉庫・運輸関連業	0.14%
情報・通信業	7.01%
卸売業	7.56%
小売業	4.37%
銀行業	9.92%
証券、商品先物取引業	0.99%
保険業	3.11%
その他金融業	1.16%
不動産業	1.93%
サービス業	3.63%
合計	97.83%

(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 0803月	買建	368	12,509,319,000	12,561,680,000	2.16%

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

(参考情報) 運用実績

●TOPIXインデックス

2025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	23,455円
純資産総額	532億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.0%
3カ月間	8.7%
6カ月間	20.6%
1年間	25.0%
3年間	91.8%
5年間	109.6%
設定来	163.4%



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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：360円										設定来分配金合計額：1,640円			
決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期				
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月	22年6月	23年6月	24年6月	25年6月				
分配金	30円	110円	30円	200円	190円	270円	210円	240円	360円				

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額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			株式東証33業種別構成			組入上位10銘柄			業種名		
銘柄数	比率		銘柄数	比率		銘柄数	比率		銘柄数	比率	
国内株式	1,658	97.8%	電気機器	18.0%		トヨタ自動車	3.6%		輸送用機器	3.6%	
国内株式先物	1	2.2%	銀行業	9.9%		三菱UFJフィナンシャルG	3.1%		銀行業	3.1%	
不動産投資信託等	-	-	卸売業	7.6%		ソニーグループ	2.8%		電気機器	2.8%	
コール・ローン、その他	-	2.2%	情報・通信業	7.0%		日立	2.6%		電気機器	2.6%	
合計	1,659	-	輸送用機器	6.8%		三井住友フィナンシャルG	2.2%		銀行業	2.2%	
株式 市場・上場別構成	比率		機械	5.8%		TOPIX 先物 0803月	2.2%		-		
東証プライム市場	97.5%		化学	4.4%		ソフトバンクグループ	1.7%		情報・通信業	1.7%	
東証スタンダード市場	0.3%		小売業	4.4%		みずほフィナンシャルG	1.6%		銀行業	1.6%	
東証グロース市場	0.0%		医薬品	3.7%		三菱商事	1.5%		卸売業	1.5%	
地方市場・その他	-		その他	30.3%		三菱重工業	1.5%		機械	1.5%	
合計	97.8%		合計	97.8%		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。
・2017年※は設定日（2月16日）から年末、2025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。

【ダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）】

(1) 【投資状況】（2025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	6,361,836,201	99.98
内 日本	6,361,836,201	99.98
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,027,366	0.02
純資産総額	6,362,863,567	100.00

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

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

（2）【投資資産】（2025年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	891,487,935	6.1490 5,481,797,691	7.1362 6,361,836,201	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)	1,020,073	1,027,073	1.0201	1.0271
第2計算期間末 (2018年6月15日)	27,240,569	27,447,452	1.1850	1.1940
第3計算期間末 (2019年6月17日)	33,941,230	34,498,119	1.0971	1.1151
第4計算期間末 (2020年6月15日)	376,011,783	380,018,315	1.1262	1.1382
第5計算期間末 (2021年6月15日)	439,385,720	445,667,627	1.5388	1.5608
第6計算期間末 (2022年6月15日)	1,748,247,666	1,768,500,080	1.3812	1.3972
第7計算期間末 (2023年6月15日)	2,895,857,145	2,943,548,075	1.7609	1.7899
第8計算期間末 (2024年6月17日)	3,408,353,873	3,454,232,309	2.0059	2.0329
2024年12月末日	5,957,779,049	—	2.1152	—
2025年1月末日	5,609,566,486	—	2.0975	—
2月末日	4,549,601,001	—	1.9698	—
3月末日	4,623,459,369	—	1.9034	—
4月末日	5,170,929,894	—	1.9262	—
5月末日	5,141,094,636	—	2.0286	—
第9計算期間末 (2025年6月16日)	4,743,630,228	4,811,803,287	2.0179	2.0469
6月末日	5,546,992,527	—	2.1350	—
7月末日	4,694,453,180	—	2.1654	—
8月末日	4,884,467,773	—	2.2530	—
9月末日	5,139,686,971	—	2.3851	—
10月末日	6,539,656,481	—	2.7817	—
11月末日	6,390,732,303	—	2.6658	—
12月末日	6,362,863,567	—	2.6722	—

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0070
第2計算期間	0.0090
第3計算期間	0.0180
第4計算期間	0.0120
第5計算期間	0.0220

第6計算期間	0.0160
第7計算期間	0.0290
第8計算期間	0.0270
第9計算期間	0.0290
2025年6月17日～ 2025年12月16日	—

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.7
第2計算期間	17.0
第3計算期間	△5.9
第4計算期間	3.7
第5計算期間	38.6
第6計算期間	△9.2
第7計算期間	29.6
第8計算期間	15.4
第9計算期間	2.0
2025年6月17日～ 2025年12月16日	29.8

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量 (口)	解約数量 (口)
第1計算期間	0	0
第2計算期間	21,987,038	0
第3計算期間	816,750,378	808,799,125
第4計算期間	1,970,995,928	1,668,056,539
第5計算期間	762,009,014	810,345,465
第6計算期間	1,043,814,417	63,579,745
第7計算期間	6,874,274,786	6,495,535,854
第8計算期間	6,758,588,320	6,703,901,813
第9計算期間	4,921,775,792	4,270,181,978
2025年6月17日～ 2025年12月16日	2,293,539,102	2,439,601,709

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

ストックインデックス２２５・マザーファンド

(1) 投資状況（2025年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		468,370,963,560	98.07
	内 日本	468,370,963,560	98.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		9,225,028,032	1.93
純資産総額		477,595,991,592	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）		9,223,200,000	1.93
	内 日本	9,223,200,000	1.93

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

(2) 投資資産（2025年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	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	2,488,000	15,159.80 37,717,600,000	19,635.00 48,851,880,000	10.23
2	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	746,400	46,005.01 34,338,144,000	56,940.00 42,500,016,000	8.90
3	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信 業	7,464,000	4,584.58 34,219,350,000	4,400.00 32,841,600,000	6.88
4	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	933,000	25,765.36 24,039,090,000	34,320.00 32,020,560,000	6.70
5	T D K	日本	株式	電気機器	4,665,000	2,100.97 9,801,045,000	2,211.00 10,314,315,000	2.16
6	KDDI	日本	株式	情報・通信 業	3,732,000	2,475.55 9,238,782,000	2,708.50 10,108,122,000	2.12
7	ファナック	日本	株式	電気機器	1,555,000	4,191.19 6,517,310,000	6,084.00 9,460,620,000	1.98

8	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	933,000	7,932.23 7,400,778,000	8,847.00 8,254,251,000	1.73
9	中外製薬	日本	株式	医薬品	933,000	6,864.81 6,404,874,000	8,243.00 7,690,719,000	1.61
10	信越化学	日本	株式	化学	1,555,000	4,632.97 7,204,280,000	4,873.00 7,577,515,000	1.59
11	コナミグループ	日本	株式	情報・通信業	311,000	21,464.45 6,675,445,000	21,330.00 6,633,630,000	1.39
12	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	1,555,000	3,460.38 5,380,894,230	4,024.00 6,257,320,000	1.31
13	ダイキン工業	日本	株式	機械	311,000	17,455.62 5,428,700,000	20,080.00 6,244,880,000	1.31
14	日東電工	日本	株式	化学	1,555,000	3,426.13 5,327,645,000	3,715.00 5,776,825,000	1.21
15	テルモ	日本	株式	精密機器	2,488,000	2,457.75 6,114,892,000	2,270.00 5,647,760,000	1.18
16	京セラ	日本	株式	電気機器	2,488,000	2,022.70 5,032,480,000	2,196.50 5,464,892,000	1.14
17	フジクラ	日本	株式	非鉄金属	311,000	14,079.43 4,378,705,000	17,440.00 5,423,840,000	1.14
18	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	1,555,000	2,928.45 4,553,745,000	3,356.00 5,218,580,000	1.09
19	豊田通商	日本	株式	卸売業	933,000	4,139.04 3,861,732,000	5,274.00 4,920,642,000	1.03
20	イビデン	日本	株式	電気機器	622,000	7,142.66 4,442,740,030	6,731.00 4,186,682,000	0.88
21	バンダイナムコHLDGS	日本	株式	その他製品	933,000	4,835.56 4,511,586,000	4,172.00 3,892,476,000	0.82
22	レーザーテック	日本	株式	電気機器	124,400	19,407.63 2,414,310,000	29,645.00 3,687,838,000	0.77
23	HOYA	日本	株式	精密機器	155,500	20,574.46 3,199,330,000	23,685.00 3,683,017,500	0.77
24	セコム	日本	株式	サービス業	622,000	5,572.36 3,466,010,000	5,573.00 3,466,406,000	0.73
25	三菱商事	日本	株式	卸売業	933,000	3,573.54 3,334,119,000	3,586.00 3,345,738,000	0.70
26	任天堂	日本	株式	その他製品	311,000	12,814.91 3,985,440,000	10,595.00 3,295,045,000	0.69
27	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	1,555,000	1,665.07 2,589,192,500	2,093.00 3,254,615,000	0.68

28	第一三共	日本	株式	医薬品	933,000	3,550.45 3,312,579,000	3,348.00 3,123,684,000	0.65
29	富士フイルムHLDGS	日本	株式	化学	933,000	3,548.95 3,311,178,000	3,344.00 3,119,952,000	0.65
30	伊 藤 忠	日本	株式	卸売業	1,555,000	1,742.82 2,710,100,000	1,975.00 3,071,125,000	0.64

(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	98.07%
合計	98.07%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.07%
鉱業	0.08%
建設業	1.80%
食料品	2.40%
繊維製品	0.08%
パルプ・紙	0.06%
化学	4.88%
医薬品	5.01%
石油・石炭製品	0.23%
ゴム製品	0.65%
ガラス・土石製品	0.64%
鉄鋼	0.05%
非鉄金属	2.06%
金属製品	0.01%
機械	4.26%
電気機器	30.72%
輸送用機器	3.53%
精密機器	2.58%
その他製品	2.05%
電気・ガス業	0.19%
陸運業	0.80%
海運業	0.32%
空運業	0.21%

情報・通信業	12.32%
卸売業	3.65%
小売業	11.42%
銀行業	0.81%
証券、商品先物取引業	0.17%
保険業	1.07%
その他金融業	0.79%
不動産業	1.32%
サービス業	3.86%
合計	98.07%

(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 0803月	買建	183	9,153,840,650	9,223,200,000	1.93%

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

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

(参考情報) 運用実績

●日経225インデックス

2025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	26,722円
純資産総額	63億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.2%
3カ月間	12.0%
6カ月間	25.2%
1年間	28.1%
3年間	102.0%
5年間	97.9%
設定来	198.6%



※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: 290円										設定来分配金合計額: 1,690円		
決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期			
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月	22年6月	23年6月	24年6月	25年6月			
分配金	70円	90円	180円	120円	220円	160円	290円	270円	290円			

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	225	98.1%	電気機器	30.7%	アドバンテスト	電気機器	10.2%
国内株式先物	1	1.9%	情報・通信業	12.3%	ファーストリテイリング	小売業	8.9%
不動産投資信託等	-	-	小売業	11.4%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	6.9%
コール・ローン、その他	-	1.9%	医薬品	5.0%	東京エレクトロン	電気機器	6.7%
合計	226	-	化学	4.9%	T D K	電気機器	2.2%
株式 市場・上場別構成			機械	4.3%	KDDI	情報・通信業	2.1%
東証プライム市場		98.1%	サービス業	3.9%	ファナック	電気機器	2.0%
東証スタンダード市場		-	卸売業	3.6%	NK225 先物 0803月	-	1.9%
東証グロース市場		-	輸送用機器	3.5%	リクルートホールディングス	サービス業	1.7%
地方市場・その他		-	その他	18.4%	中外製薬	医薬品	1.6%
合計		98.1%	合計	98.1%	合計		44.2%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは日経平均トータルリターン・インデックスです。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2017年※は設定日(2月16日)から年末、2025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。

【ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）】

(1) 【投資状況】（2025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		39,000,846,774	99.98
	内 日本	39,000,846,774	99.98
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,874,826	0.02
純資産総額		39,006,721,600	100.00

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

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

（2）【投資資産】（2025年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	10,300,516,804	3.4254 35,283,878,063	3.7863 39,000,846,774	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)	3,609,633	3,630,431	1.0413	1.0473
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,333,520,140	1,345,180,653	1.1436	1.1536
第3計算期間末 (2019年6月17日)	3,003,717,900	3,053,452,707	1.1475	1.1665
第4計算期間末 (2020年6月15日)	7,959,510,896	8,070,496,281	1.1475	1.1635
第5計算期間末 (2021年6月15日)	11,208,379,177	11,357,996,884	1.5732	1.5942
第6計算期間末 (2022年6月15日)	9,983,749,975	10,101,554,505	1.3560	1.3720
第7計算期間末 (2023年6月15日)	12,818,618,455	12,972,128,839	1.5031	1.5211
第8計算期間末 (2024年6月17日)	22,623,395,977	22,942,383,909	1.7021	1.7261
2024年12月末日	33,030,668,642	—	1.8020	—
2025年1月末日	34,833,463,239	—	1.8423	—
2月末日	34,385,637,648	—	1.7941	—
3月末日	33,651,249,792	—	1.7121	—
4月末日	33,884,342,484	—	1.6968	—
5月末日	28,865,793,139	—	1.7963	—
第9計算期間末 (2025年6月16日)	30,115,718,324	30,520,356,449	1.7862	1.8102
6月末日	30,255,109,971	—	1.8300	—
7月末日	30,770,912,410	—	1.8769	—
8月末日	32,563,064,491	—	1.9102	—
9月末日	34,374,741,941	—	1.9480	—
10月末日	35,584,917,374	—	1.9913	—
11月末日	37,238,911,748	—	1.9847	—
12月末日	39,006,721,600	—	2.0109	—

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0060
第2計算期間	0.0100
第3計算期間	0.0190
第4計算期間	0.0160
第5計算期間	0.0210

第6計算期間	0.0160
第7計算期間	0.0180
第8計算期間	0.0240
第9計算期間	0.0240
2025年6月17日～ 2025年12月16日	—

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	4.7
第2計算期間	10.8
第3計算期間	2.0
第4計算期間	1.4
第5計算期間	38.9
第6計算期間	△12.8
第7計算期間	12.2
第8計算期間	14.8
第9計算期間	6.4
2025年6月17日～ 2025年12月16日	11.3

(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	2,466,456	0
第2計算期間	1,162,584,923	0
第3計算期間	3,354,512,466	1,902,942,421
第4計算期間	12,869,207,903	8,550,242,735
第5計算期間	5,926,265,855	5,738,199,717
第6計算期間	3,696,975,613	3,458,845,184
第7計算期間	5,497,831,929	4,332,260,406
第8計算期間	12,945,394,819	8,182,585,638
第9計算期間	16,814,410,901	13,245,652,853
2025年6月17日～ 2025年12月16日	6,380,673,681	3,697,059,446

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

(1) 投資状況（2025年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		160,238,316,739	92.59
	内 香港	879,940,436	0.51
	内 シンガポール	726,932,907	0.42
	内 イスラエル	489,846,870	0.28
	内 ノルウェー	263,758,560	0.15
	内 スウェーデン	1,675,816,654	0.97
	内 デンマーク	876,381,120	0.51
	内 イギリス	6,375,078,052	3.68
	内 アイルランド	201,914,208	0.12
	内 オランダ	2,077,448,886	1.20
	内 ベルギー	462,742,415	0.27
	内 フランス	4,384,243,717	2.53
	内 ドイツ	4,057,280,494	2.34
	内 スイス	4,092,925,555	2.37
	内 ポルトガル	84,041,256	0.05
	内 スペイン	1,634,521,271	0.94
	内 イタリア	1,371,891,195	0.79
	内 フィンランド	490,023,978	0.28
	内 オーストリア	115,167,577	0.07
	内 カナダ	5,445,237,777	3.15
	内 アメリカ	121,948,390,108	70.47
	内 オーストラリア	2,504,310,870	1.45
	内 ニュージーランド	80,422,833	0.05
投資証券		2,581,484,646	1.49
	内 香港	37,533,351	0.02
	内 シンガポール	41,992,011	0.02
	内 イギリス	39,976,431	0.02
	内 フランス	60,520,748	0.03
	内 アメリカ	2,170,796,987	1.25
	内 オーストラリア	230,665,118	0.13
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		10,239,024,355	5.92
純資産総額		173,058,825,740	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)	11,842,844,348	6.84
内 イギリス	292,627,577	0.17
内 ドイツ	1,496,320,041	0.86
内 カナダ	856,335,600	0.49
内 アメリカ	9,037,660,840	5.22
内 オーストラリア	159,900,290	0.09
為替予約取引 (売建)	168,216,589,924	△97.20
内 日本	168,216,589,924	△97.20

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

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

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

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

(2) 投資資産（2025年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	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	319,810	21,669.31 6,930,066,261	29,467.72 9,424,072,557	5.45
2	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	195,363	37,704.50 7,366,064,945	42,859.86 8,373,231,923	4.84
3	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	92,966	66,556.00 6,187,452,405	76,260.37 7,089,622,115	4.10
4	AMAZON COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービス	126,385	34,464.64 4,355,817,087	36,332.87 4,591,930,938	2.65
5	ALPHABET INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	76,568	30,109.14 2,305,409,422	49,090.95 3,758,796,135	2.17
6	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	59,060	35,858.03 2,117,780,814	54,700.49 3,230,611,436	1.87

7	ALPHABET INC CLASS C	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	64,340	30,343.98 1,952,336,328	49,220.89 3,166,872,603	1.83
8	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	28,567	96,181.38 2,747,615,466	103,124.50 2,945,957,774	1.70
9	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	37,226	59,922.40 2,230,674,921	71,961.23 2,678,829,061	1.55
10	JPMORGAN CHASE	アメリカ	株式	金融	36,189	38,308.19 1,386,335,921	50,686.30 1,834,286,511	1.06
11	ELI LILLY	アメリカ	株式	ヘルスケア	10,605	123,877.16 1,313,718,522	168,885.96 1,791,035,699	1.03
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC CLASS B	アメリカ	株式	金融	18,159	71,920.37 1,306,004,626	78,444.38 1,424,471,642	0.82
13	VISA INC CLASS A	アメリカ	株式	金融	22,360	49,779.66 1,113,073,246	55,517.74 1,241,376,702	0.72
14	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	56,129	16,755.20 940,456,088	18,870.17 1,059,164,154	0.61
15	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	31,694	22,694.62 719,287,284	32,495.59 1,029,915,344	0.60
16	MASTERCARD INC CLASS A	アメリカ	株式	金融	11,258	82,135.13 924,678,843	90,476.02 1,018,579,078	0.59
17	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需品	57,667	14,451.58 833,387,135	17,617.69 1,015,959,721	0.59
18	PALANTIR TECHNOLOGIES INC CLASS A	アメリカ	株式	情報技術	30,048	12,420.37 373,211,147	28,835.22 866,440,715	0.50
19	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	5,060	133,830.21 677,180,948	167,150.44 845,781,247	0.49
20	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	23,259	28,396.53 660,478,623	36,140.31 840,587,480	0.49
21	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	55,950	14,004.60 783,557,694	14,740.12 824,709,938	0.48
22	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	92,749	7,181.56 666,085,740	8,665.59 803,725,363	0.46

23	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	5,820	146,622.19 853,342,038	135,869.03 790,757,757	0.46
24	ADVANCED MICRO DEVICES INC	アメリカ	株式	情報技術	21,427	18,882.70 404,600,995	33,755.90 723,287,704	0.42
25	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	13,114	60,532.67 793,826,853	54,396.77 713,359,268	0.41
26	PROCTER & GAMBLE	アメリカ	株式	生活必需品	30,848	25,458.84 785,357,909	22,633.87 698,209,906	0.40
27	ORACLE CORP	アメリカ	株式	情報技術	22,520	25,755.68 580,018,087	30,588.69 688,857,362	0.40
28	MICRON TECHNOLOGY INC	アメリカ	株式	情報技術	14,826	15,663.51 232,227,947	46,086.56 683,279,445	0.39
29	GE AEROSPACE	アメリカ	株式	資本財・サービス	13,952	27,818.36 388,121,975	48,780.96 680,592,021	0.39
30	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	52,080	9,334.57 486,148,844	12,178.80 634,272,029	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	92.59%
投資証券	1.49%
合計	94.08%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	3.21%
素材	3.01%
資本財・サービス	9.65%
一般消費財・サービス	9.07%
生活必需品	4.98%
ヘルスケア	9.39%
金融	16.02%
情報技術	26.26%
コミュニケーション・サービス	8.26%
公益事業	2.48%
不動産	0.26%

合計	92.59%

(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 26	買建	166	8,946,607,673	9,037,660,840	5.22%
	イギリス	FTSE 100 INDEX MAR 26	買建	14	289,846,956	292,627,577	0.17%
	オーストラリア	SPI 200 MAR 26	買建	7	157,301,435	159,900,290	0.09%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX MAR 26	買建	20	846,647,075	856,335,600	0.49%
	ドイツ	SWISS MKT IX MAR 26	買建	10	258,610,928	260,638,080	0.15%
		EURO STOXX 50 MAR 26	買建	116	1,234,969,710	1,235,681,961	0.71%
為替予約取引	日本	イスラエル・シケル 売/円買 2026年1月	売建	5,951,400	284,090,079	292,140,537	△0.17%
		デンマーク・クローネ 売/円買 2026年1月	売建	33,855,600	818,710,677	835,011,132	△0.48%
		香港ドル売/円買 2026 年1月	売建	44,189,600	881,940,013	888,825,195	△0.51%
		ニュージーランド・ドル 売/円買 2026年1月	売建	902,300	80,395,290	81,915,756	△0.05%
		米ドル売/円買 2026年 1月	売建	826,355,800	128,285,127,103	129,225,024,190	△74.67%
		ユーロ売/円買 2026年 1月	売建	82,299,300	14,857,904,125	15,160,140,074	△8.76%
		豪ドル売/円買 2026年 1月	売建	27,310,100	2,773,996,097	2,859,473,979	△1.65%
		スウェーデン・クロー ネ売/円買 2026年1月	売建	84,415,000	1,389,733,852	1,439,301,074	△0.83%
		ノルウェー・クローネ 売/円買 2026年1月	売建	17,069,700	261,794,574	266,012,497	△0.15%

	シンガポール・ドル 売/円買 2026年1月	売建	5,240,300	629,583,790	637,808,965	△0.37%
	英ポンド売/円買 2026 年1月	売建	31,369,800	6,449,662,249	6,624,624,172	△3.83%
	スイス・フラン売/円 買 2026年1月	売建	20,888,500	4,055,836,491	4,143,942,095	△2.39%
	カナダ・ドル売/円買 2026年1月	売建	50,448,600	5,615,812,030	5,762,370,258	△3.33%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

（注4）為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●外国株式インデックス(為替ヘッジあり)

2025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	20,109円
純資産総額	390億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.3%
3カ月間	3.2%
6カ月間	9.9%
1年間	13.1%
3年間	51.6%
5年間	53.2%
設定来	124.2%



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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 240円										設定来分配金合計額: 1,540円		
決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期			
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月	22年6月	23年6月	24年6月	25年6月			
分配金	60円	100円	190円	160円	210円	160円	180円	240円	240円			

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	株式業種別構成	比率	組入上位10銘柄	国・地域名	比率
外国株式・先物	1,097	99.4%	日本円	98.2%	情報技術	26.3%	NVIDIA CORP	アメリカ	5.4%
外国リート	45	1.4%	米ドル	1.3%	金融	16.0%	S&P500 EMINI MAR 26	アメリカ	5.2%
外国投資証券	3	0.1%	ユーロ	0.2%	資本財・サービス	9.7%	APPLE INC	アメリカ	4.8%
外国ワラント	1	0.0%	カナダ・ドル	0.1%	ヘルスケア	9.4%	MICROSOFT CORP	アメリカ	4.1%
コール・ローン、その他		5.9%	英ポンド	0.1%	一般消費財・サービス	9.1%	AMAZON COM INC	アメリカ	2.7%
合計	1,146	—	スイス・フラン	0.1%	コミュニケーション・サービス	8.3%	ALPHABET INC CLASS A	アメリカ	2.2%
国・地域別構成		比率	豪ドル	0.0%	生活必需品	5.0%	BROADCOM INC	アメリカ	1.9%
アメリカ		76.9%	デンマーク・クローネ	0.0%	エネルギー	3.2%	ALPHABET INC CLASS C	アメリカ	1.8%
イギリス		3.9%	スウェーデン・クローネ	0.0%	素材	3.0%	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	1.7%
その他		20.1%	その他	0.0%	公益事業、他	2.7%	TESLA INC	アメリカ	1.5%
合計		100.9%	合計	100.0%	合計	92.6%	合計		31.4%

※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額を表示していません。

年間収益率の推移

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



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。 ・2017年※は設定日(2月16日)から年末、2025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。

【ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)】

(1) 【投資状況】 (2025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		55,719,405,160	99.99
	内 日本	55,719,405,160	99.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,586,668	0.01
純資産総額		55,724,991,828	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（2）【投資資産】（2025年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	6,464,343,078	7.2522 46,880,966,438	8.6195 55,719,405,160	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)	1,009,377	1,019,377	1.0094	1.0194
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,127,308	1,149,308	1.1273	1.1493
第3計算期間末 (2019年6月17日)	16,536,717	16,580,596	1.1306	1.1336
第4計算期間末 (2020年6月15日)	223,479,606	223,479,606	1.1489	1.1489
第5計算期間末 (2021年6月15日)	10,845,036,190	10,935,990,992	1.6693	1.6833
第6計算期間末 (2022年6月15日)	6,056,649,872	6,123,398,054	1.7240	1.7430
第7計算期間末 (2023年6月15日)	7,477,554,139	7,556,218,515	2.0912	2.1132
第8計算期間末 (2024年6月17日)	25,879,101,999	26,108,408,509	2.8215	2.8465
2024年12月末日	38,575,816,198	—	3.0676	—
2025年1月末日	39,988,431,601	—	3.0733	—
2月末日	38,719,462,130	—	2.9107	—
3月末日	38,261,765,972	—	2.8050	—
4月末日	33,195,640,775	—	2.6854	—
5月末日	27,781,906,356	—	2.8778	—
第9計算期間末 (2025年6月16日)	28,930,503,249	29,220,385,896	2.8942	2.9232
6月末日	28,115,111,872	—	2.9836	—
7月末日	45,603,594,335	—	3.1479	—
8月末日	47,699,225,025	—	3.1726	—
9月末日	51,840,954,833	—	3.2874	—
10月末日	56,000,677,462	—	3.4764	—
11月末日	53,178,465,462	—	3.5307	—
12月末日	55,724,991,828	—	3.6006	—

② 【分配の推移】

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

第6計算期間	0.0190
第7計算期間	0.0220
第8計算期間	0.0250
第9計算期間	0.0290
2025年6月17日～ 2025年12月16日	—

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.9
第2計算期間	13.9
第3計算期間	0.6
第4計算期間	1.6
第5計算期間	46.5
第6計算期間	4.4
第7計算期間	22.6
第8計算期間	36.1
第9計算期間	3.6
2025年6月17日～ 2025年12月16日	21.6

(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	0	0
第2計算期間	0	0
第3計算期間	13,626,454	0
第4計算期間	15,442,007,002	15,262,119,439
第5計算期間	9,570,631,213	3,268,373,640
第6計算期間	2,411,536,407	5,395,245,779
第7計算期間	3,888,370,778	3,825,779,521
第8計算期間	7,956,911,859	2,360,304,910
第9計算期間	11,344,974,483	10,521,281,556
2025年6月17日～ 2025年12月16日	9,358,663,499	3,771,157,026

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2025年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		863,612,760,447	93.80
	内 香港	4,589,563,284	0.50
	内 シンガポール	3,813,271,005	0.41
	内 イスラエル	2,602,551,016	0.28
	内 ノルウェー	1,354,844,596	0.15
	内 スウェーデン	8,759,023,316	0.95
	内 デンマーク	4,583,417,918	0.50
	内 イギリス	32,846,254,841	3.57
	内 アイルランド	1,077,514,538	0.12
	内 オランダ	11,094,475,209	1.20
	内 ベルギー	2,485,151,752	0.27
	内 フランス	23,476,818,184	2.55
	内 ドイツ	21,676,262,988	2.35
	内 スイス	20,843,742,150	2.26
	内 ポルトガル	438,097,171	0.05
	内 スペイン	8,737,536,908	0.95
	内 イタリア	7,305,030,147	0.79
	内 フィンランド	2,600,218,350	0.28
	内 オーストリア	610,040,484	0.07
	内 カナダ	29,297,374,499	3.18
	内 アメリカ	662,427,253,143	71.95
	内 オーストラリア	12,582,908,534	1.37
	内 ニュージーランド	411,410,414	0.04
投資証券		13,888,422,385	1.51
	内 香港	200,225,219	0.02
	内 シンガポール	228,313,713	0.02
	内 イギリス	199,174,532	0.02
	内 フランス	322,889,149	0.04
	内 アメリカ	11,765,228,376	1.28
	内 オーストラリア	1,172,591,396	0.13
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		43,217,262,781	4.69
純資産総額		920,718,445,613	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)	44,902,896,365	4.88
内 イギリス	2,487,334,406	0.27
内 ドイツ	7,844,666,036	0.85
内 カナダ	4,067,594,100	0.44
内 アメリカ	29,018,513,420	3.15
内 オーストラリア	1,484,788,403	0.16
為替予約取引 (買建)	26,750,093,020	2.91
内 日本	26,750,093,020	2.91

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

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

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

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

(2) 投資資産（2025年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	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	1,739,700	27,711.12 48,209,035,464	29,467.72 51,264,998,051	5.57
2	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	1,062,400	43,656.75 46,380,937,574	42,859.86 45,534,321,213	4.95
3	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	505,660	77,029.08 38,950,527,424	76,260.37 38,561,821,728	4.19
4	AMAZON COM INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービス	687,400	36,512.92 25,098,983,408	36,332.87 24,975,221,162	2.71
5	ALPHABET INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サービ ス	416,500	50,127.38 20,878,054,103	49,090.95 20,446,382,174	2.22
6	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	321,300	63,087.41 20,269,987,275	54,700.49 17,575,270,136	1.91

7	ALPHABET INC CLASS C	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	349,940	50,117.98 17,538,288,441	49,220.89 17,224,361,186	1.87
8	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	155,360	101,443.05 15,760,192,559	103,124.50 16,021,423,314	1.74
9	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	202,190	67,347.41 13,616,973,879	71,961.23 14,549,842,792	1.58
10	JPMORGAN CHASE	アメリカ	株式	金融	196,830	49,015.80 9,647,780,859	50,686.30 9,976,584,429	1.08
11	ELI LILLY	アメリカ	株式	ヘルスケア	57,605	168,375.58 9,699,275,470	168,885.96 9,728,676,233	1.06
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC CLASS B	アメリカ	株式	金融	98,770	80,442.09 7,945,265,585	78,444.38 7,747,952,203	0.84
13	VISA INC CLASS A	アメリカ	株式	金融	121,590	52,359.92 6,366,443,451	55,517.74 6,750,402,201	0.73
14	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	305,209	18,148.43 5,539,065,759	18,870.17 5,759,347,791	0.63
15	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	172,500	32,395.39 5,588,205,672	32,495.59 5,605,489,896	0.61
16	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需品	314,000	17,301.44 5,432,653,918	17,617.69 5,531,956,795	0.60
17	MASTERCARD INC CLASS A	アメリカ	株式	金融	61,060	86,190.97 5,262,821,043	90,476.02 5,524,466,025	0.60
18	PALANTIR TECHNOLOGIES INC CLASS A	アメリカ	株式	情報技術	163,000	26,372.53 4,298,722,716	28,835.22 4,700,140,990	0.51
19	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	126,472	35,648.71 4,508,563,904	36,140.31 4,570,737,337	0.50
20	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	27,068	166,523.72 4,507,464,107	167,150.44 4,524,428,218	0.49
21	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	304,710	16,842.72 5,132,146,674	14,740.12 4,491,463,184	0.49
22	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	503,601	8,399.44 4,229,968,398	8,665.59 4,364,002,811	0.47

23	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	31,720	143,031.65 4,536,963,951	135,869.03 4,309,765,644	0.47
24	ADVANCED MICRO DEVICES INC	アメリカ	株式	情報技術	116,227	34,056.49 3,958,284,454	33,755.90 3,923,347,175	0.43
25	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	71,290	55,879.39 3,983,642,084	54,396.77 3,877,945,876	0.42
26	PROCTER & GAMBLE	アメリカ	株式	生活必需品	167,567	23,195.92 3,886,872,335	22,633.87 3,792,691,236	0.41
27	ORACLE CORP	アメリカ	株式	情報技術	122,533	31,617.29 3,874,161,641	30,588.69 3,748,124,295	0.41
28	MICRON TECHNOLOGY INC	アメリカ	株式	情報技術	80,400	37,023.30 2,976,674,028	46,086.56 3,705,360,003	0.40
29	GE AEROSPACE	アメリカ	株式	資本財・サービス	75,906	46,725.33 3,546,733,051	48,780.96 3,702,767,914	0.40
30	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	283,050	12,045.72 3,409,542,858	12,178.80 3,447,210,019	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	93.80%
投資証券	1.51%
合計	95.31%

(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	3.25%
素材	3.01%
資本財・サービス	9.73%
一般消費財・サービス	9.21%
生活必需品	5.02%
ヘルスケア	9.48%
金融	16.13%
情報技術	26.80%
コミュニケーション・サービス	8.42%
公益事業	2.50%
不動産	0.25%

合計	93.80%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 EMINI MAR 26	買建	533	28,742,890,996	29,018,513,420	3.15%
	イギリス	FTSE 100 INDEX MAR 26	買建	119	2,463,484,521	2,487,334,406	0.27%
	オーストラリア	SPI 200 MAR 26	買建	65	1,458,928,522	1,484,788,403	0.16%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX MAR 26	買建	95	4,021,251,108	4,067,594,100	0.44%
	ドイツ	SWISS MKT IX MAR 26	買建	86	2,223,649,642	2,241,487,488	0.24%
		EURO STOXX 50 MAR 26	買建	526	5,598,457,120	5,603,178,548	0.61%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2026年1月	買建	116,000,000	18,019,037,960	18,140,010,400	1.97%
		豪ドル買/円売 2026年1月	買建	8,000,000	815,830,820	837,631,200	0.09%
		カナダ・ドル買/円売 2026年1月	買建	20,600,000	2,297,960,910	2,352,985,560	0.26%
		英ポンド買/円売 2026年1月	買建	6,600,000	1,361,730,650	1,393,777,440	0.15%
		ユーロ買/円売 2026年1月	買建	14,100,000	2,557,414,980	2,597,324,340	0.28%
		スイス・フラン買/円売 2026年1月	買建	7,200,000	1,400,109,010	1,428,364,080	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) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

●外国株式インデックス(為替ヘッジなし)

2025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	36,006円
純資産総額	557億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	2.0%
3カ月間	9.5%
6カ月間	20.7%
1年間	18.6%
3年間	109.9%
5年間	172.9%
設定来	290.2%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 290円 設定来分配金合計額: 1,440円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期			
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月	22年6月	23年6月	24年6月	25年6月			
分配金	100円	220円	30円	0円	140円	190円	220円	250円	290円			

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	株式業種別構成	比率	組入上位10銘柄	国・地域名	比率
外国株式・先物	1,097	98.7%	米ドル	76.8%	情報技術	26.8%	NVIDIA CORP	アメリカ	5.6%
外国リート	45	1.5%	ユーロ	9.2%	金融	16.1%	APPLE INC	アメリカ	4.9%
外国投資証券	3	0.1%	英ポンド	3.9%	資本財・サービス	9.7%	MICROSOFT CORP	アメリカ	4.2%
			カナダドル	3.6%	ヘルスケア	9.5%	S&P500 EMINI MAR 26	アメリカ	3.2%
コール・ローン、その他		4.7%	スイス・フラン	2.5%	一般消費財・サービス	9.2%	AMAZON COM INC	アメリカ	2.7%
合計	1,145	-	豪ドル	1.7%	コミュニケーション・サービス	8.4%	ALPHABET INC CLASS A	アメリカ	2.2%
国・地域別構成			スウェーデン・クローネ	0.8%	生活必需品	5.0%	BROADCOM INC	アメリカ	1.9%
アメリカ		76.4%	デンマーク・クローネ	0.5%	エネルギー	3.2%	ALPHABET INC CLASS C	アメリカ	1.9%
イギリス		3.9%	香港ドル	0.5%	素材	3.0%	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	1.7%
その他		19.9%	その他	0.6%	公益事業、他	2.8%	TESLA INC	アメリカ	1.6%
合計		100.2%	合計	100.0%	合計	93.8%	合計		29.9%

※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。・2017年※は設定日(2月16日)から年末、2025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。

【ダイワ日本債券インデックス(ダイワSMA専用)】

(1) 【投資状況】 (2025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	19,167,056,255	99.90
内 日本	19,167,056,255	99.90
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	19,005,753	0.10
純資産総額	19,186,062,008	100.00

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

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

（2）【投資資産】（2025年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	15,558,938,433	1.2706 19,770,494,969	1.2319 19,167,056,255	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)	24,087,488	24,087,488	1.0065	1.0065
第2計算期間末 (2018年6月15日)	279,326,560	279,326,560	1.0124	1.0124
第3計算期間末 (2019年6月17日)	5,116,892,737	5,116,892,737	1.0363	1.0363
第4計算期間末 (2020年6月15日)	18,594,655,554	18,594,655,554	1.0235	1.0235
第5計算期間末 (2021年6月15日)	5,774,922,588	5,774,922,588	1.0197	1.0197
第6計算期間末 (2022年6月15日)	18,663,790,166	18,663,790,166	0.9848	0.9848
第7計算期間末 (2023年6月15日)	24,860,789,334	24,873,399,848	0.9857	0.9862
第8計算期間末 (2024年6月17日)	21,017,022,340	21,151,561,247	0.9373	0.9433
2024年12月末日	18,515,917,330	—	0.9295	—
2025年1月末日	15,385,424,218	—	0.9225	—
2月末日	16,171,481,768	—	0.9161	—
3月末日	16,630,545,450	—	0.9069	—
4月末日	18,868,180,528	—	0.9116	—
5月末日	19,462,317,193	—	0.8998	—
第9計算期間末 (2025年6月16日)	19,522,069,074	19,740,795,423	0.8925	0.9025
6月末日	21,036,811,490	—	0.8944	—
7月末日	18,737,875,174	—	0.8851	—
8月末日	18,789,921,517	—	0.8822	—
9月末日	19,417,343,252	—	0.8813	—
10月末日	19,646,145,024	—	0.8827	—
11月末日	19,254,986,308	—	0.8724	—
12月末日	19,186,062,008	—	0.8616	—

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	0.0005
第8計算期間	0.0060
第9計算期間	0.0100
2025年6月17日～ 2025年12月16日	—

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.7
第2計算期間	0.6
第3計算期間	2.4
第4計算期間	△1.2
第5計算期間	△0.4
第6計算期間	△3.4
第7計算期間	0.1
第8計算期間	△4.3
第9計算期間	△3.7
2025年6月17日～ 2025年12月16日	△2.9

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量 (口)	解約数量 (口)
第1計算期間	22,931,206	0
第2計算期間	251,969,341	0
第3計算期間	8,652,065,532	3,990,278,317
第4計算期間	32,014,941,813	18,784,692,054
第5計算期間	8,663,614,937	21,168,152,589
第6計算期間	14,231,839,472	943,254,247
第7計算期間	20,573,676,151	14,304,632,814
第8計算期間	11,346,984,854	14,144,862,056
第9計算期間	13,807,969,263	14,358,485,578
2025年6月17日～ 2025年12月16日	6,291,478,468	5,163,677,387

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2025年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		132,395,859,450	86.97
	内 日本	132,395,859,450	86.97
地方債証券		6,245,743,700	4.10
	内 日本	6,245,743,700	4.10
特殊債券		4,125,540,900	2.71
	内 日本	4,125,540,900	2.71
社債券		8,197,492,100	5.38
	内 日本	8,197,492,100	5.38
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,272,685,527	0.84
純資産総額		152,237,321,677	100.00

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

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

(2) 投資資産（2025年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	158 5年国債	日本	国債証券	2,050,000,000	97.90 2,007,039,500	97.69 2,002,665,500	0.100000 2028/03/20	1.32
2	365 10年国債	日本	国債証券	1,960,000,000	91.92 1,801,820,800	91.22 1,787,970,800	0.100000 2031/12/20	1.17
3	370 10年国債	日本	国債証券	1,900,000,000	92.24 1,752,703,000	91.33 1,735,308,000	0.500000 2033/03/20	1.14
4	161 5年国債	日本	国債証券	1,650,000,000	98.10 1,618,711,000	97.84 1,614,393,000	0.300000 2028/06/20	1.06
5	181 5年国債	日本	国債証券	1,630,000,000	99.63 1,624,086,000	98.90 1,612,118,900	1.300000 2030/09/20	1.06
6	163 5年国債	日本	国債証券	1,600,000,000	98.11 1,569,776,000	97.81 1,564,992,000	0.400000 2028/09/20	1.03
7	369 10年国債	日本	国債証券	1,700,000,000	92.63 1,574,851,800	91.79 1,560,481,000	0.500000 2032/12/20	1.03
8	154 5年国債	日本	国債証券	1,570,000,000	98.45 1,545,696,400	98.31 1,543,561,200	0.100000 2027/09/20	1.01

9	178 5年国債	日本	国債証券	1,535,000,000	98.63 1,514,043,300	98.06 1,505,251,700	1.000000 2030/03/20	0.99
10	360 10年国債	日本	国債証券	1,600,000,000	94.08 1,505,421,300	93.51 1,496,256,000	0.100000 2030/09/20	0.98
11	364 10年国債	日本	国債証券	1,600,000,000	92.40 1,478,496,000	91.72 1,467,584,000	0.100000 2031/09/20	0.96
12	363 10年国債	日本	国債証券	1,590,000,000	92.86 1,476,486,300	92.19 1,465,932,300	0.100000 2031/06/20	0.96
13	362 10年国債	日本	国債証券	1,550,000,000	93.27 1,445,686,500	92.66 1,436,261,000	0.100000 2031/03/20	0.94
14	166 5年国債	日本	国債証券	1,400,000,000	97.81 1,369,394,500	97.46 1,364,510,000	0.400000 2028/12/20	0.90
15	367 10年国債	日本	国債証券	1,500,000,000	91.63 1,374,518,000	90.79 1,361,985,000	0.200000 2032/06/20	0.89
16	156 5年国債	日本	国債証券	1,380,000,000	98.38 1,357,685,400	98.20 1,355,173,800	0.200000 2027/12/20	0.89
17	371 10年国債	日本	国債証券	1,500,000,000	91.11 1,366,693,800	90.17 1,352,625,000	0.400000 2033/06/20	0.89
18	377 10年国債	日本	国債証券	1,400,000,000	95.01 1,330,183,000	93.70 1,311,926,000	1.200000 2034/12/20	0.86
19	174 5年国債	日本	国債証券	1,330,000,000	97.93 1,302,577,300	97.43 1,295,819,000	0.700000 2029/09/20	0.85
20	372 10年国債	日本	国債証券	1,350,000,000	93.60 1,263,708,000	92.54 1,249,330,500	0.800000 2033/09/20	0.82
21	378 10年国債	日本	国債証券	1,300,000,000	96.39 1,253,096,000	95.00 1,235,052,000	1.400000 2035/03/20	0.81
22	366 10年国債	日本	国債証券	1,350,000,000	92.06 1,242,849,500	91.30 1,232,563,500	0.200000 2032/03/20	0.81
23	349 10年国債	日本	国債証券	1,250,000,000	98.18 1,227,275,000	98.00 1,225,112,500	0.100000 2027/12/20	0.80
24	368 10年国債	日本	国債証券	1,350,000,000	91.13 1,230,292,000	90.31 1,219,266,000	0.200000 2032/09/20	0.80
25	375 10年国債	日本	国債証券	1,300,000,000	94.82 1,232,782,000	93.62 1,217,138,000	1.100000 2034/06/20	0.80
26	473 2年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	99.81 1,197,784,000	99.68 1,196,172,000	0.800000 2027/06/01	0.79
27	361 10年国債	日本	国債証券	1,210,000,000	93.75 1,134,456,200	93.11 1,126,643,100	0.100000 2030/12/20	0.74
28	18 40年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	90.05 1,080,704,000	91.79 1,101,552,000	3.100000 2065/03/20	0.72

29	373 10年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	91.71 1,100,634,000	90.63 1,087,668,000	0.600000 2033/12/20	0.71
30	358 10年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	94.90 1,043,955,000	94.40 1,038,499,000	0.100000 2030/03/20	0.68

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	86.97%
地方債証券	4.10%
特殊債券	2.71%
社債券	5.38%
合計	99.16%

(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

●日本債券インデックス

2025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	8,616円
純資産総額	191億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-1.2%
3カ月間	-2.2%
6カ月間	-3.7%
1年間	-6.3%
3年間	-8.9%
5年間	-14.0%
設定来	-12.3%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 100円

設定来分配金合計額: 165円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期			
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月	22年6月	23年6月	24年6月	25年6月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	5円	60円	100円			

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

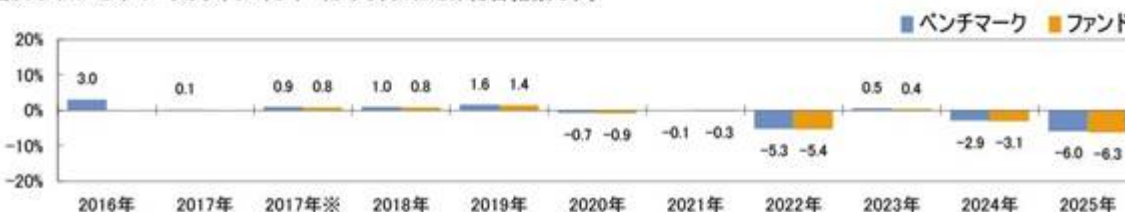
資産別構成	銘柄数	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	利率(%)	償還日	比率	
国内債券	435	99.1%	直接利回り(%)	1.0	158 5年国債	0.100	2028/03/20	1.3%
国内債券先物	-	-	最終利回り(%)	1.9	365 10年国債	0.100	2031/12/20	1.2%
コール・ローン、その他		0.9%	修正デュレーション	8.1	370 10年国債	0.500	2033/03/20	1.1%
合計	435	100.0%	残存年数	9.2	161 5年国債	0.300	2028/06/20	1.1%
債券種別構成		比率	格付別構成	比率	181 5年国債	1.300	2030/09/20	1.1%
国債		86.8%	AAA	90.0%	163 5年国債	0.400	2028/09/20	1.0%
事業債		5.9%	AA	6.0%	369 10年国債	0.500	2032/12/20	1.0%
地方債		5.0%	A	2.1%	154 5年国債	0.100	2027/09/20	1.0%
政府保証債		1.1%	BBB	-	178 5年国債	1.000	2030/03/20	1.0%
円建外債		0.3%	BB以下・無格付	1.9%	360 10年国債	0.100	2030/09/20	1.0%
合計		99.1%	合計	100.0%	合計			10.8%

※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1.9%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。

・2017年※は設定日(2月16日)から年末、2025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。

【ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)】

(1) 【投資状況】(2025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		15,575,476,153	99.72
	内 日本	15,575,476,153	99.72
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		44,085,498	0.28
純資産総額		15,619,561,651	100.00

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

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

（2）【投資資産】（2025年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	18,608,693,135	0.8353 15,544,583,377	0.8370 15,575,476,153	99.72

（注） 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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)	20,274,657	20,274,657	1.0212	1.0212
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,398,757,675	1,398,757,675	0.9966	0.9966
第3計算期間末 (2019年6月17日)	12,750,079,921	12,750,079,921	1.0418	1.0418
第4計算期間末 (2020年6月15日)	22,300,327,697	22,300,327,697	1.0992	1.0992
第5計算期間末 (2021年6月15日)	8,180,398,456	8,180,398,456	1.0724	1.0724
第6計算期間末 (2022年6月15日)	16,292,732,543	16,507,053,334	0.9122	0.9242
第7計算期間末 (2023年6月15日)	15,393,229,356	15,393,229,356	0.8698	0.8698
第8計算期間末 (2024年6月17日)	14,214,274,477	14,214,274,477	0.8458	0.8458
2024年12月末日	11,126,714,781	—	0.8342	—
2025年1月末日	11,413,484,080	—	0.8352	—
2月末日	11,557,507,895	—	0.8409	—
3月末日	11,596,810,595	—	0.8350	—
4月末日	16,871,621,883	—	0.8423	—
5月末日	24,453,785,166	—	0.8350	—
第9計算期間末 (2025年6月16日)	25,482,070,540	25,482,070,540	0.8354	0.8354
6月末日	26,089,626,772	—	0.8378	—
7月末日	12,265,820,753	—	0.8332	—
8月末日	12,415,366,633	—	0.8350	—
9月末日	12,677,858,312	—	0.8366	—
10月末日	12,723,100,027	—	0.8411	—
11月末日	15,412,489,749	—	0.8416	—
12月末日	15,619,561,651	—	0.8365	—

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	0.0120
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
2025年6月17日～ 2025年12月16日	—

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.1
第2計算期間	△2.4
第3計算期間	4.5
第4計算期間	5.5
第5計算期間	△2.4
第6計算期間	△13.8
第7計算期間	△4.6
第8計算期間	△2.8
第9計算期間	△1.2
2025年6月17日～ 2025年12月16日	△0.1

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量 (口)	解約数量 (口)
第1計算期間	18,852,947	0
第2計算期間	1,383,614,307	0
第3計算期間	14,932,722,296	4,098,050,663
第4計算期間	31,728,087,266	23,677,730,208
第5計算期間	7,679,681,362	20,339,945,076
第6計算期間	11,384,539,682	1,152,705,931
第7計算期間	11,600,215,353	11,762,616,828
第8計算期間	11,562,078,814	12,454,062,311
第9計算期間	29,874,378,732	16,175,701,743
2025年6月17日～ 2025年12月16日	8,021,059,188	19,447,472,043

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

(1) 投資状況（2025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		132,000,422,533	97.83
	内 ユーロ	39,682,266,482	29.41
	内 中国	15,816,366,512	11.72
	内 シンガポール	508,231,378	0.38
	内 マレーシア	713,238,085	0.53
	内 イスラエル	542,041,303	0.40
	内 ノルウェー	194,418,276	0.14
	内 スウェーデン	238,379,664	0.18
	内 デンマーク	326,641,804	0.24
	内 イギリス	7,864,562,643	5.83
	内 ポーランド	942,337,213	0.70
	内 カナダ	2,739,906,736	2.03
	内 アメリカ	59,204,494,533	43.88
	内 メキシコ	1,198,896,326	0.89
	内 オーストラリア	1,664,104,953	1.23
	内 ニュージーランド	364,536,625	0.27
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,921,444,768	2.17
純資産総額		134,921,867,301	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
債券先物取引（買建）		1,981,648,431	1.47
	内 アメリカ	1,981,648,431	1.47
為替予約取引（売建）		135,516,963,011	△100.44
	内 日本	135,516,963,011	△100.44

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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

(2) 投資資産（2025年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	9,000,000	96.51 1,359,934,956	98.08 1,381,986,432	2.250000 2027/08/15	1.02
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,950,000	105.08 1,307,905,214	104.83 1,304,830,924	6.125000 2027/11/15	0.97
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	94.33 1,181,575,444	94.76 1,186,937,721	0.500000 2027/10/31	0.88
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	101.35 1,110,729,109	102.27 1,120,874,098	4.250000 2029/06/30	0.83
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	97.45 1,068,068,954	98.52 1,079,755,180	2.375000 2027/05/15	0.80
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	95.50 971,876,729	97.33 990,540,246	2.625000 2029/02/15	0.73
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,000,000	92.77 871,528,814	95.04 892,842,892	1.250000 2028/04/30	0.66
8	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	92.61 870,025,838	94.84 890,898,417	1.750000 2029/01/31	0.66
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	92.97 800,546,076	95.22 819,954,819	1.250000 2028/03/31	0.61
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	5,000,000	100.91 789,993,932	101.26 792,733,732	4.500000 2027/04/15	0.59
11	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	5,000,000	100.80 789,092,960	100.88 789,735,608	4.250000 2027/03/15	0.59
12	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	5,000,000	99.61 779,770,564	100.35 785,563,284	3.750000 2027/04/30	0.58
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,000,000	97.20 760,905,084	98.63 772,122,608	2.250000 2027/02/15	0.57
14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,700,000	100.16 737,024,047	102.73 755,964,363	4.375000 2034/05/15	0.56
15	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,500,000	101.74 716,792,738	104.35 735,173,665	4.625000 2035/02/15	0.54
16	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	5,000,000	91.46 715,948,880	93.89 734,986,576	1.000000 2028/07/31	0.54
17	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,500,000	100.73 709,678,226	101.28 713,544,901	4.250000 2035/08/15	0.53
18	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,800,000	92.09 692,097,903	94.64 711,238,302	2.875000 2032/05/15	0.53

19	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,000,000	92.90 684,985,026	93.48 689,268,855	0.500000 2029/05/25	0.51
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,000,000	85.00 665,403,484	87.96 688,550,880	0.625000 2030/05/15	0.51
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,000,000	84.64 662,561,920	87.65 686,186,824	0.875000 2030/11/15	0.51
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,900,000	85.37 654,972,204	88.31 677,464,866	1.125000 2031/02/15	0.50
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,500,000	92.33 650,532,632	94.77 667,737,010	0.625000 2027/11/30	0.49
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,300,000	97.39 655,637,271	98.96 666,220,100	3.125000 2028/11/15	0.49
25	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,650,000	97.98 659,234,033	98.24 660,969,868	1.400000 2028/04/30	0.49
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,500,000	89.51 630,679,258	92.05 648,524,750	1.500000 2030/02/15	0.48
27	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,000,000	102.33 640,850,179	103.39 647,469,536	4.625000 2029/04/30	0.48
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,600,000	87.05 626,970,822	89.89 647,423,820	1.625000 2031/05/15	0.48
29	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,000,000	99.40 622,482,560	101.57 636,109,542	4.125000 2032/11/15	0.47
30	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,000,000	99.96 625,989,504	101.50 635,652,387	4.000000 2030/03/31	0.47

(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	97.83%
合計	97.83%

(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 26	買建	2	36,724,091	36,282,780	0.03%
		US 10YR NOTE MAR 26	買建	10	177,406,982	176,472,475	0.13%
		US 5YR NOTE MAR 26	買建	15	257,762,638	257,003,025	0.19%
		US 2YR NOTE MAR 26	買建	40	1,308,322,823	1,307,814,191	0.97%
		US ULTRA T-BOND MAR 26	買建	11	208,117,697	204,075,960	0.15%
為替予約取引	日本	豪ドル売/円買 2026年1月	売建	17,780,000	1,813,087,052	1,861,841,590	△1.38%
		イスラエル・シェケル 売/円買 2026年1月	売建	11,498,000	549,182,423	564,480,512	△0.42%
		オフショア人民元売/円 買 2026年1月	売建	716,923,000	15,802,649,609	16,012,761,974	△11.87%
		デンマーク・クローネ 売/円買 2026年1月	売建	14,620,000	353,983,826	360,609,610	△0.27%
		メキシコ・ペソ売/円買 2026年1月	売建	146,547,000	1,238,058,365	1,272,130,542	△0.94%
		ニュージーランド・ドル 売/円買 2026年1月	売建	4,514,000	403,441,007	409,834,636	△0.30%
		米ドル売/円買 2026年1 月	売建	388,309,000	60,362,904,925	60,730,517,995	△45.01%
		マレーシア・リングgit 売/円買 2026年1月	売建	17,630,000	681,427,708	678,245,493	△0.50%
		ユーロ売/円買 2026年1 月	売建	220,983,000	39,954,101,970	40,709,421,963	△30.17%
		ノルウェー・クローネ 売/円買 2026年1月	売建	13,058,000	200,692,319	203,515,459	△0.15%
		カナダ・ドル売/円買 2026年1月	売建	24,977,000	2,790,587,795	2,853,130,203	△2.11%
		ポーランド・ズロチ売/ 円買 2026年1月	売建	22,594,000	963,030,840	983,268,286	△0.73%
		シンガポール・ドル売/ 円買 2026年1月	売建	4,419,000	531,868,630	537,876,261	△0.40%
		英ポンド売/円買 2026年 1月	売建	38,081,000	7,843,783,480	8,042,840,483	△5.96%
		スウェーデン・クローネ 売/円買 2026年1月	売建	17,388,000	287,209,767	296,488,004	△0.22%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

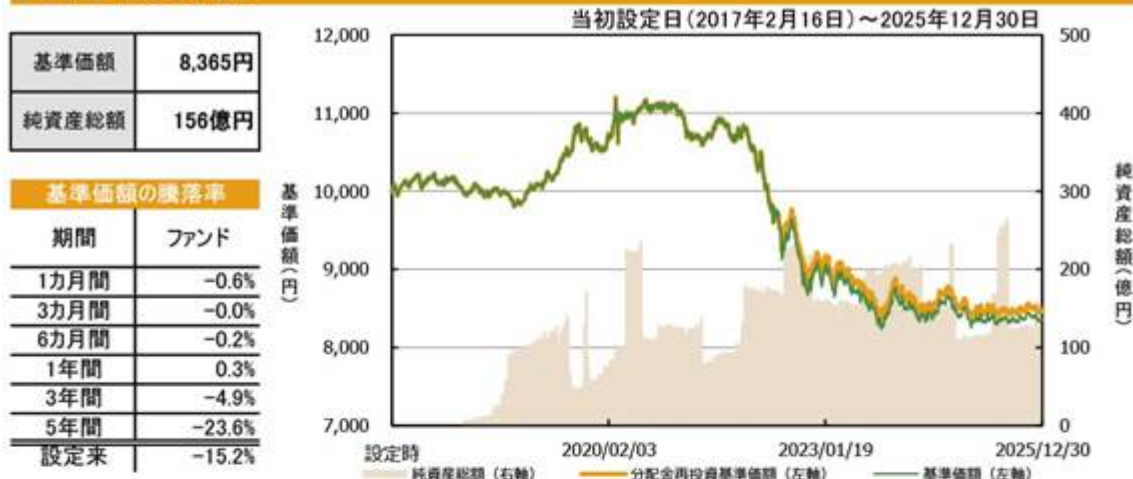
（参考情報）運用実績

●外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

2025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



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移 (10,000口当たり、税引前)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円					設定来分配金合計額: 120円				
	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月	第5期 21年6月	第6期 22年6月	第7期 23年6月	第8期 24年6月	第9期 25年6月	
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	120円	0円	0円	0円	

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	償還日	比率
外国債券・先物	680	99.0%	日本円	100.8%	直接利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2027/08/15	1.0%
			マレーシア・リンギット	0.0%	最終利回り(%)	US 2YR NOTE MAR 26	-	1.0%
ユーロ・ローン、その他		2.4%	オフショア人民元	0.0%	修正デュレーション	United States Treasury Note/Bond	2027/11/15	1.0%
合計	680	-	ポーランド・ズロチ	0.0%	残存年数	United States Treasury Note/Bond	2027/10/31	0.9%
債券種別構成		比率	英ポンド	0.0%	格付別構成	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2029/06/30	0.8%
国債		97.6%	南アフリカ・ランド	0.0%	AAA	United States Treasury Note/Bond	2027/05/15	0.8%
			イスラエル・シェケル	-0.0%	AA	United States Treasury Note/Bond	2029/02/15	0.7%
			バルウェア・クローネ	-0.0%	A	United States Treasury Note/Bond	2028/04/30	0.7%
			ニュージーランド・ドル	-0.0%	BBB	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2029/01/31	0.7%
			その他	-0.9%	BB	United States Treasury Note/Bond	2028/03/31	0.6%
合計		97.6%	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	8.1%

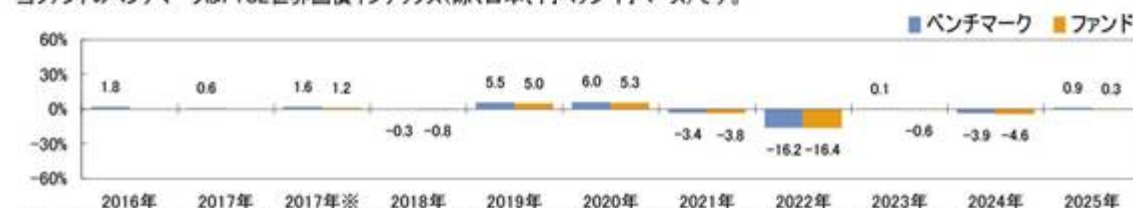
※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※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額を表示していません。

年間収益率の推移

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



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

・2017年※は設定日(2月16日)から年末、2025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。

【ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）】

(1) 【投資状況】（2025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		25,700,564,244	99.71
	内 日本	25,700,564,244	99.71
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		74,727,555	0.29
純資産総額		25,775,291,799	100.00

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

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

(2) 【投資資産】（2025年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	6,303,174,632	3.7749 23,794,157,806	4.0774 25,700,564,244	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)	1,006,543	1,009,043	1.0065	1.0090
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,002,760	1,014,760	1.0028	1.0148
第3計算期間末 (2019年6月17日)	11,002,175	11,110,214	1.0184	1.0284
第4計算期間末 (2020年6月15日)	55,667,910	55,667,910	1.0764	1.0764
第5計算期間末 (2021年6月15日)	5,570,659,890	5,580,511,300	1.1309	1.1329
第6計算期間末 (2022年6月15日)	7,907,633,750	8,029,900,681	1.0995	1.1165
第7計算期間末 (2023年6月15日)	7,912,131,124	8,132,324,719	1.1139	1.1449
第8計算期間末 (2024年6月17日)	11,665,375,642	11,984,792,092	1.2417	1.2757
2024年12月末日	15,643,284,450	—	1.2488	—
2025年1月末日	20,426,371,480	—	1.2222	—
2月末日	19,864,948,468	—	1.1981	—
3月末日	20,569,842,598	—	1.2104	—
4月末日	17,364,316,290	—	1.1891	—
5月末日	22,212,497,910	—	1.1953	—
第9計算期間末 (2025年6月16日)	22,598,284,988	23,144,132,987	1.1799	1.2084
6月末日	22,876,587,270	—	1.1954	—
7月末日	16,245,022,974	—	1.2165	—
8月末日	16,306,360,968	—	1.2134	—
9月末日	17,384,761,888	—	1.2360	—
10月末日	18,216,355,100	—	1.2832	—
11月末日	25,063,615,538	—	1.3099	—
12月末日	25,775,291,799	—	1.3156	—

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0025
第2計算期間	0.0120
第3計算期間	0.0100
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0020
第6計算期間	0.0170
第7計算期間	0.0310
第8計算期間	0.0340
第9計算期間	0.0285
2025年6月17日～ 2025年12月16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	0.8
第3計算期間	2.6
第4計算期間	5.7
第5計算期間	5.2
第6計算期間	△1.3
第7計算期間	4.1
第8計算期間	14.5
第9計算期間	△2.7
2025年6月17日～ 2025年12月16日	9.8

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量 (口)	解約数量 (口)
第1計算期間	0	0
第2計算期間	0	0
第3計算期間	83,995,237	74,191,315
第4計算期間	9,243,518,976	9,202,608,333
第5計算期間	15,970,263,749	11,096,272,833
第6計算期間	3,239,365,115	972,898,169
第7計算期間	4,176,709,431	4,265,862,658
第8計算期間	8,719,913,600	6,428,331,301
第9計算期間	20,351,059,548	10,593,099,662

2025年6月17日～ 2025年12月16日	8,273,832,502	7,473,165,589

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2025年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		384,547,383,419	97.67
	内 ユーロ	114,220,665,364	29.01
	内 中国	44,781,903,843	11.37
	内 シンガポール	1,402,420,098	0.36
	内 マレーシア	1,999,404,589	0.51
	内 イスラエル	1,436,902,105	0.36
	内 ノルウェー	557,837,256	0.14
	内 スウェーデン	640,963,533	0.16
	内 デンマーク	780,556,876	0.20
	内 イギリス	22,658,356,811	5.75
	内 ポーランド	2,664,447,667	0.68
	内 カナダ	7,684,121,500	1.95
	内 アメリカ	176,946,551,010	44.94
	内 メキシコ	3,197,009,880	0.81
	内 オーストラリア	4,628,799,899	1.18
	内 ニュージーランド	947,442,988	0.24
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		9,191,431,037	2.33
純資産総額		393,738,814,456	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引（買建）		2,525,066,072	0.64
	内 日本	2,525,066,072	0.64
為替予約取引（売建）		77,106,400	△0.02
	内 日本	77,106,400	△0.02

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

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

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

(2) 投資資産（2025年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	100.69 1,912,624,264	100.72 1,913,194,103	1.850000 2027/05/15	0.49
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	11,500,000	98.56 1,774,585,681	98.64 1,776,026,033	2.875000 2028/05/15	0.45
3	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	73,000,000	101.76 1,660,143,215	101.95 1,663,193,750	2.050000 2029/04/15	0.42
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,500,000	99.61 1,637,485,306	98.97 1,627,079,546	3.875000 2034/08/15	0.41
5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	104.38 1,634,298,528	103.74 1,624,184,752	4.500000 2033/11/15	0.41
6	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,200,000	102.07 1,630,000,016	101.57 1,622,079,333	4.125000 2032/11/15	0.41
7	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,200,000	100.81 1,609,910,863	100.20 1,600,121,793	4.000000 2034/02/15	0.41
8	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	102.26 1,601,092,152	101.58 1,590,414,760	4.250000 2034/11/15	0.40
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,600,000	104.92 1,577,042,823	104.35 1,568,370,485	4.625000 2035/02/15	0.40
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	102.08 1,518,330,622	101.38 1,507,874,762	4.250000 2035/05/15	0.38
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	88.41 1,481,037,247	88.31 1,479,362,055	1.125000 2031/02/15	0.38
12	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	87.58 1,412,432,185	87.41 1,409,642,442	1.250000 2031/08/15	0.36
13	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,000,000	100.21 1,412,027,164	99.64 1,404,080,179	3.875000 2033/08/15	0.36
14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	94.00 1,398,080,800	93.61 1,392,324,871	2.750000 2032/08/15	0.35
15	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,800,000	99.98 1,377,456,124	100.05 1,378,499,527	3.500000 2027/10/31	0.35
16	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	87.63 1,372,029,216	87.42 1,368,757,112	1.375000 2031/11/15	0.35

17	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,500,000	103.40 1,376,112,300	102.73 1,367,169,593	4.375000 2034/05/15	0.35
18	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,500,000	101.45 1,350,122,558	101.39 1,349,337,409	4.000000 2029/01/31	0.34
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	87.72 1,345,908,119	87.65 1,344,926,175	0.875000 2030/11/15	0.34
20	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	58,000,000	102.77 1,332,043,730	102.90 1,333,767,547	2.370000 2029/01/15	0.34
21	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,300,000	101.57 1,319,875,322	101.45 1,318,393,951	4.000000 2029/07/31	0.33
22	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	100.54 1,259,318,540	100.62 1,260,257,900	3.875000 2027/07/31	0.32
23	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	100.01 1,252,617,772	99.98 1,252,329,702	3.500000 2028/10/15	0.32
24	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	98.05 1,228,156,838	97.60 1,222,533,203	3.500000 2033/02/15	0.31
25	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,500,000	101.68 1,193,961,786	101.50 1,191,871,710	4.000000 2030/02/28	0.30
26	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,500,000	101.96 1,197,214,320	101.28 1,189,241,502	4.250000 2035/08/15	0.30
27	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	52,000,000	100.57 1,168,728,073	100.73 1,170,587,310	1.790000 2032/03/25	0.30
28	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	50,000,000	104.50 1,167,632,196	104.58 1,168,503,714	2.540000 2030/12/25	0.30
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	90.07 1,128,108,736	89.89 1,125,954,470	1.625000 2031/05/15	0.29
30	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	101.69 1,114,517,762	101.50 1,112,391,677	4.000000 2030/03/31	0.28

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.67%
合計	97.67%

(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 2026年1月	買建	284,000	59,800,299	59,995,988	0.02%
		シンガポール・ドル買/円売 2026年1月	買建	328,000	39,403,820	39,923,832	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2026年1月	買建	1,872,000	209,116,424	213,844,596	0.05%
		豪ドル買/円売 2026年1月	買建	620,000	63,513,641	64,928,899	0.02%
		イスラエル・シェケル買/円売 2026年1月	買建	1,330,000	63,376,096	65,294,754	0.02%
		オフショア人民元買/円売 2026年1月	買建	39,451,000	869,710,039	881,163,491	0.22%
		ニュージーランド・ドル買/円売 2026年1月	買建	1,828,000	162,869,498	165,967,593	0.04%
		米ドル買/円売 2026年1月	買建	2,415,000	377,450,378	377,777,876	0.10%
		ユーロ買/円売 2026年1月	買建	3,369,000	613,134,626	620,665,274	0.16%
		ノルウェー・クローネ買/円売 2026年1月	買建	2,278,000	34,934,724	35,503,769	0.01%
		マレーシア・リングgit売/円買 2026年1月	売建	2,000,000	77,086,000	77,106,400	△0.02%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

●外国債券インデックス(為替ヘッジなし)

2025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	13,156円
純資産総額	257億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.4%
3カ月間	6.4%
6カ月間	10.1%
1年間	7.9%
3年間	33.7%
5年間	31.4%
設定来	48.3%



※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: 285円 設定来分配金合計額: 1,370円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月	第5期 21年6月	第6期 22年6月	第7期 23年6月	第8期 24年6月	第9期 25年6月			
分配金	25円	120円	100円	0円	20円	170円	310円	340円	285円			

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	償還日	比率
外国債券	1,057	97.4%	米ドル	45.6%	直接利回り(%)	CHINA GOVERNMENT BOND	2027/05/15	0.5%
			ユーロ	29.5%	最終利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2028/05/15	0.4%
コール・ローン、その他		2.6%	オフショア人民元	11.7%	修正デュレーション	CHINA GOVERNMENT BOND	2029/04/15	0.4%
合計	1,057	100.0%	英ポンド	5.9%	残存年数	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2034/08/15	0.4%
債券種別構成			カナダ・ドル	2.1%	格付別構成	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2033/11/15	0.4%
国債		97.4%	豪ドル	1.2%	AAA	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2032/11/15	0.4%
			メキシコ・ペソ	0.9%	AA	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2034/02/15	0.4%
			ポーランド・ズロチ	0.7%	A	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2034/11/15	0.4%
			マレーシア・リンギット	0.5%	BBB	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2035/02/15	0.4%
			その他	1.9%	BB	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2035/05/15	0.4%
合計		97.4%	合計	100.0%	合計	合計		4.2%

※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。

・2017年※は設定日(2月16日)から年末、2025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J-REITインデックス(ダイワSMA専用)】

(1) 【投資状況】(2025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		4,358,401,182	99.96
内 日本		4,358,401,182	99.96
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,841,098	0.04
純資産総額		4,360,242,280	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（2）【投資資産】（2025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	1,092,550,181	3.4928 3,816,101,955	3.9892 4,358,401,182	99.96

（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	99.96%
合計	99.96%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

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)	3,456,480	3,474,147	0.9782	0.9832
第2計算期間末 (2018年6月15日)	321,051,059	322,484,783	1.0077	1.0122
第3計算期間末 (2019年6月17日)	1,249,306,029	1,280,156,651	1.1339	1.1619
第4計算期間末 (2020年6月15日)	569,353,890	587,148,598	0.9599	0.9899
第5計算期間末 (2021年6月15日)	1,329,867,898	1,362,116,299	1.2784	1.3094
第6計算期間末 (2022年6月15日)	1,133,538,419	1,163,781,811	1.1244	1.1544
第7計算期間末 (2023年6月15日)	1,291,290,049	1,332,713,587	1.1222	1.1582
第8計算期間末 (2024年6月17日)	2,228,074,656	2,292,175,348	1.0428	1.0728
2024年12月末日	4,307,202,589	—	1.0325	—
2025年1月末日	4,399,068,449	—	1.0687	—
2月末日	4,093,235,433	—	1.0745	—
3月末日	4,407,330,252	—	1.0707	—
4月末日	4,550,129,024	—	1.0869	—
5月末日	4,377,977,215	—	1.1055	—
第9計算期間末 (2025年6月16日)	4,329,887,992	4,492,254,591	1.0934	1.1344
6月末日	4,187,387,284	—	1.0956	—
7月末日	3,868,014,319	—	1.1496	—
8月末日	4,021,177,529	—	1.1944	—
9月末日	4,252,134,300	—	1.1981	—
10月末日	4,526,476,093	—	1.2268	—
11月末日	4,922,561,984	—	1.2684	—
12月末日	4,360,242,280	—	1.2682	—

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0050
第2計算期間	0.0045
第3計算期間	0.0280
第4計算期間	0.0300
第5計算期間	0.0310

第6計算期間	0.0300
第7計算期間	0.0360
第8計算期間	0.0300
第9計算期間	0.0410
2025年6月17日～ 2025年12月16日	—

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	△1.7
第2計算期間	3.5
第3計算期間	15.3
第4計算期間	△12.7
第5計算期間	36.4
第6計算期間	△9.7
第7計算期間	3.0
第8計算期間	△4.4
第9計算期間	8.8
2025年6月17日～ 2025年12月16日	14.3

(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	2,533,441	0
第2計算期間	315,071,967	0
第3計算期間	1,083,924,855	300,722,332
第4計算期間	3,863,471,660	4,372,122,644
第5計算期間	633,413,235	186,299,155
第6計算期間	1,050,973,291	1,083,131,246
第7計算期間	276,978,902	134,438,138
第8計算期間	1,494,983,095	508,947,181
第9計算期間	2,580,617,335	757,146,121
2025年6月17日～ 2025年12月16日	647,608,686	802,835,425

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

(1) 投資状況（2025年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		245,207,068,500	95.95
	内 日本	245,207,068,500	95.95
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		10,358,060,583	4.05
純資産総額		255,565,129,083	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引（買建）		10,291,620,000	4.03
	内 日本	10,291,620,000	4.03

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

(2) 投資資産（2025年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	123,811	143,910.55 17,817,710,093	142,900.00 17,692,591,900	6.92
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	107,189	131,292.26 14,073,086,393	130,900.00 14,031,040,100	5.49
3	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	108,372	116,660.05 12,642,683,876	124,100.00 13,448,965,200	5.26
4	野村不動産マスターF	日本	投資証券	66,505	165,047.51 10,976,484,679	173,100.00 11,512,015,500	4.50
5	KDX不動産投資法人	日本	投資証券	60,857	171,846.95 10,458,089,923	175,900.00 10,704,746,300	4.19
6	GLP投資法人	日本	投資証券	68,672	136,701.69 9,387,578,847	148,900.00 10,225,260,800	4.00
7	日本プロロジスリート	日本	投資証券	107,437	86,078.74 9,248,042,655	92,900.00 9,980,897,300	3.91

8	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	65,705	129,213.71 8,489,986,931	143,200.00 9,408,956,000	3.68
9	オリックス不動産投資	日本	投資証券	83,168	101,350.02 8,429,078,872	106,300.00 8,840,758,400	3.46
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	48,117	182,699.55 8,790,954,325	183,000.00 8,805,411,000	3.45
11	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	115,207	67,392.17 7,764,049,912	64,400.00 7,419,330,800	2.90
12	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	42,975	168,027.18 7,220,968,217	171,400.00 7,365,915,000	2.88
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	76,795	88,974.99 6,832,835,071	81,800.00 6,281,831,000	2.46
14	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	57,873	106,195.60 6,145,858,088	105,700.00 6,117,176,100	2.39
15	産業ファンド	日本	投資証券	38,212	130,231.34 4,976,400,075	154,200.00 5,892,290,400	2.31
16	三井不ロジパーク	日本	投資証券	46,085	109,998.34 5,069,273,646	122,100.00 5,626,978,500	2.20
17	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	61,604	81,624.91 5,028,421,294	90,000.00 5,544,360,000	2.17
18	三井不動産アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	36,032	129,939.59 4,681,983,514	134,400.00 4,842,700,800	1.89
19	API投資法人	日本	投資証券	32,223	138,141.08 4,451,320,095	140,800.00 4,536,998,400	1.78
20	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	41,376	98,055.56 4,057,147,238	104,100.00 4,307,241,600	1.69
21	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	27,057	142,250.25 3,848,865,105	158,600.00 4,291,240,200	1.68
22	森ヒルズリート	日本	投資証券	24,156	141,483.96 3,417,686,613	149,000.00 3,599,244,000	1.41
23	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	10,581	325,083.92 3,439,713,047	333,500.00 3,528,763,500	1.38
24	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	30,557	110,042.45 3,362,567,225	114,100.00 3,486,553,700	1.36
25	イオンリート投資	日本	投資証券	25,343	134,598.69 3,411,134,752	137,300.00 3,479,593,900	1.36
26	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	36,680	90,531.94 3,320,711,590	93,000.00 3,411,240,000	1.33
27	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	18,442	168,680.07 3,110,797,948	176,500.00 3,255,013,000	1.27

28	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	8,526	376,541.27 3,210,390,870	374,500.00 3,192,987,000	1.25
29	森トラストリート投資法人	日本	投資証券	40,228	76,425.21 3,074,433,490	78,100.00 3,141,806,800	1.23
30	NTT都市開発リート投資法人	日本	投資証券	21,015	137,526.58 2,890,121,216	140,400.00 2,950,506,000	1.15

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	95.95%
合計	95.95%

(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

(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 0803月	買建	5,160	9,931,452,000	10,291,620,000	4.03%

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

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

(参考情報) 運用実績

●J-REITインデックス

2025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	12,682円
純資産総額	43億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-0.0%
3カ月間	5.9%
6カ月間	15.8%
1年間	27.4%
3年間	21.0%
5年間	37.2%
設定来	56.7%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

決算期	直近1年間分配金合計額: 410円					設定来分配金合計額: 2,355円						
	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月	第5期 21年6月	第6期 22年6月	第7期 23年6月	第8期 24年6月	第9期 25年6月			
分配金	50円	45円	280円	300円	310円	300円	360円	300円	410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	58	95.9%	各種不動産投資信託	29.1%	日本ビルファンド	オフィス不動産投資信託	6.9%
国内リート 先物	1	4.0%	オフィス不動産投資信託	25.1%	ジャパンリアルエステイト	オフィス不動産投資信託	5.5%
			工業用不動産投資信託	18.0%	日本都市ファンド投資法人	店舗用不動産投資信託	5.3%
			店舗用不動産投資信託	8.8%	野村不動産マスターF	各種不動産投資信託	4.5%
			集合住宅用不動産投資信託	8.1%	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	6.7%	TREIT 先物 0803月	-	4.0%
			ヘルスケア不動産投資信託	0.2%	GLP投資法人	工業用不動産投資信託	4.0%
					日本プロロジスリート	工業用不動産投資信託	3.9%
					大和ハウスリート投資法人	各種不動産投資信託	3.7%
コール・ローン、その他		4.1%			オリックス不動産投資	オフィス不動産投資信託	3.5%
合計	59	-	合計	95.9%	合計		45.4%

※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。

・2017年※は設定日(2月16日)から年末、2025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。

【ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)】

(1) 【投資状況】(2025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	5,147,735,687	100.01
内 日本	5,147,735,687	100.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	△547,438	△0.01
純資産総額	5,147,188,249	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（2）【投資資産】（2025年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	5,828,505,081	0.8764 5,108,103,580	0.8832 5,147,735,687	100.01

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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)	10,195,310	10,275,310	1.0195	1.0275
第2計算期間末 (2018年6月15日)	279,933,693	283,060,364	0.9848	0.9958
第3計算期間末 (2019年6月17日)	695,159,967	714,215,108	1.0580	1.0870
第4計算期間末 (2020年6月15日)	134,966,460	134,966,460	0.8945	0.8945
第5計算期間末 (2021年6月15日)	3,546,416,313	3,594,317,836	1.1846	1.2006
第6計算期間末 (2022年6月15日)	2,194,549,819	2,242,959,745	0.9973	1.0193
第7計算期間末 (2023年6月15日)	2,791,144,777	2,863,213,916	0.9295	0.9535
第8計算期間末 (2024年6月17日)	3,120,340,217	3,203,631,778	0.8991	0.9231
2024年12月末日	4,041,587,089	—	0.9295	—
2025年1月末日	4,430,973,596	—	0.9412	—
2月末日	4,562,709,887	—	0.9554	—
3月末日	4,510,957,126	—	0.9226	—
4月末日	5,605,749,488	—	0.9050	—
5月末日	5,613,442,793	—	0.9306	—
第9計算期間末 (2025年6月16日)	5,755,806,117	5,894,998,868	0.9097	0.9317
6月末日	5,616,601,746	—	0.9018	—
7月末日	4,272,375,767	—	0.9108	—
8月末日	4,527,116,923	—	0.9249	—
9月末日	4,684,745,781	—	0.9259	—
10月末日	4,555,048,140	—	0.9166	—
11月末日	5,083,601,888	—	0.9283	—
12月末日	5,147,188,249	—	0.9161	—

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0080
第2計算期間	0.0110

第3計算期間	0.0290
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0160
第6計算期間	0.0220
第7計算期間	0.0240
第8計算期間	0.0240
第9計算期間	0.0220
2025年6月17日～ 2025年12月16日	—

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.8
第2計算期間	△2.3
第3計算期間	10.4
第4計算期間	△15.5
第5計算期間	34.2
第6計算期間	△14.0
第7計算期間	△4.4
第8計算期間	△0.7
第9計算期間	3.6
2025年6月17日～ 2025年12月16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	0	0
第2計算期間	275,571,977	1,329,127
第3計算期間	644,244,585	271,413,599
第4計算期間	4,068,922,456	4,575,108,293
第5計算期間	3,792,473,085	949,515,894
第6計算期間	2,073,516,186	2,866,910,155
第7計算期間	1,781,193,842	978,764,230
第8計算期間	4,481,040,966	4,013,440,087
第9計算期間	4,912,799,008	2,056,337,491
2025年6月17日～ 2025年12月16日	1,772,912,428	2,364,689,856

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

(参考) マザーファンド

先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

(1) 投資状況（2025年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		295,530,171	0.92
	内 アメリカ	295,530,171	0.92
投資証券		30,954,931,711	95.91
	内 ガーンジー	42,067,078	0.13
	内 韓国	65,044,839	0.20
	内 香港	273,786,077	0.85
	内 シンガポール	1,146,390,947	3.55
	内 イスラエル	63,478,440	0.20
	内 イギリス	1,296,638,361	4.02
	内 アイルランド	11,510,561	0.04
	内 オランダ	47,756,633	0.15
	内 ベルギー	340,592,331	1.06
	内 フランス	672,902,060	2.08
	内 ドイツ	6,907,466	0.02
	内 スペイン	155,132,098	0.48
	内 イタリア	4,194,739	0.01
	内 カナダ	391,489,157	1.21
	内 アメリカ	23,842,523,080	73.87
	内 オーストラリア	2,555,270,769	7.92
	内 ニュージーランド	39,247,075	0.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,023,858,641	3.17
純資産総額		32,274,320,523	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）		1,350,477,287	4.18
	内 ドイツ	160,256,502	0.50
	内 アメリカ	1,190,220,785	3.69
為替予約取引（売建）		31,992,942,933	△99.13
	内 日本	31,992,942,933	△99.13

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

（2）投資資産（2025年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	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	88,346	25,670.51 2,267,900,274	29,690.03 2,622,996,132	8.13
2	PROLOGIS REIT INC	アメリカ	投資証券	119,567	16,761.00 2,004,064,280	20,114.82 2,405,069,735	7.45
3	EQUINIX REIT INC	アメリカ	投資証券	12,639	121,443.12 1,534,921,304	119,768.40 1,513,752,808	4.69
4	SIMON PROPERTY GROUP REIT INC	アメリカ	投資証券	42,023	27,163.47 1,141,495,140	29,373.78 1,234,374,660	3.82
5	REALTY INCOME REIT CORP	アメリカ	投資証券	118,413	9,055.43 1,072,290,889	8,894.17 1,053,185,778	3.26
6	DIGITAL REALTY TRUST REIT INC	アメリカ	投資証券	41,564	25,992.24 1,080,344,832	24,368.56 1,012,854,994	3.14
7	GOODMAN GROUP UNITS	オーストラ リア	投資証券	277,056	3,711.15 1,028,219,952	3,282.96 909,564,431	2.82
8	PUBLIC STORAGE REIT	アメリカ	投資証券	20,328	43,860.28 891,593,920	40,599.13 825,299,302	2.56
9	VENTAS REIT INC	アメリカ	投資証券	60,466	10,687.72 646,249,345	12,470.00 754,011,262	2.34
10	VICI PPTYS INC	アメリカ	投資証券	137,581	5,075.04 698,230,924	4,430.64 609,572,982	1.89
11	EXTRA SPACE STORAGE REIT INC	アメリカ	投資証券	27,321	21,361.51 583,620,041	20,468.65 559,224,107	1.73
12	AVALONBAY COMMUNITIES REIT INC	アメリカ	投資証券	18,205	29,586.55 538,625,919	28,791.38 524,147,146	1.62
13	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	38,049	14,318.35 544,799,722	12,936.55 492,222,897	1.53
14	EQUITY RESIDENTIAL REIT	アメリカ	投資証券	44,568	9,931.38 442,623,940	9,907.11 441,540,382	1.37
15	ESSEX PROPERTY TRUST REIT INC	アメリカ	投資証券	8,290	40,171.88 333,026,136	41,173.71 341,330,092	1.06
16	MID AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	アメリカ	投資証券	15,071	21,872.84 329,646,254	21,790.02 328,397,403	1.02

17	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	72,597	4,714.80 342,285,691	4,342.97 315,286,913	0.98
18	SCENTRE GROUP UNIT	オーストラリア	投資証券	706,791	401.25 283,623,637	439.19 310,419,639	0.96
19	VANGUARD REAL ESTATE INDEX FUND;ET	アメリカ	投資信託 受益証券	21,200	13,972.66 296,221,321	13,940.10 295,530,171	0.92
20	SUN COMMUNITIES REIT INC	アメリカ	投資証券	14,964	19,901.43 297,806,250	19,541.81 292,423,783	0.91
21	W. P. CAREY REIT INC	アメリカ	投資証券	28,209	10,221.64 288,346,149	10,141.95 286,094,459	0.89
22	KIMCO REALTY REIT CORP	アメリカ	投資証券	87,171	3,309.99 288,540,763	3,192.25 278,272,357	0.86
23	SEGRO REIT PLC	イギリス	投資証券	177,959	1,355.47 241,226,100	1,509.18 268,573,469	0.83
24	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS REIT IN	アメリカ	投資証券	38,041	6,421.62 244,287,814	6,982.57 265,624,174	0.82
25	UNIBAIL RODAMCO WE STAPLED UNITS	フランス	投資証券	15,085	16,370.16 246,944,411	17,080.01 257,652,069	0.80
26	GAMING AND LEISURE PROPERTIES REIT	アメリカ	投資証券	36,430	7,182.65 261,667,225	6,996.66 254,888,557	0.79
27	LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	香港	投資証券	350,600	855.40 299,909,718	700.12 245,462,563	0.76
28	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES REIT I	アメリカ	投資証券	24,950	9,450.11 235,781,361	9,537.63 237,963,998	0.74
29	HOST HOTELS & RESORTS REIT INC	アメリカ	投資証券	82,325	2,514.51 207,012,449	2,879.13 237,025,069	0.73
30	CAMDEN PROPERTY TRUST REIT	アメリカ	投資証券	13,696	16,600.83 227,365,901	17,220.03 235,845,591	0.73

(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	0.92%
投資証券	95.91%
合計	96.83%

(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 26	買建	211	1,191,171,746	1,190,220,785	3.69%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE MAR 26	買建	138	155,738,286	160,256,502	0.50%
為替予約取引	日本	カナダ・ドル売/円買 2026年1月	売建	3,600,300	400,774,955	411,235,626	△1.27%
		豪ドル売/円買 2026年1月	売建	24,183,200	2,457,946,227	2,532,075,354	△7.85%
		イスラエル・シェケル売/円買 2026年1月	売建	1,306,300	62,356,230	64,123,262	△0.20%
		ニュージーランド・ドル売/円買 2026年1月	売建	481,900	42,938,253	43,749,532	△0.14%
		米ドル売/円買 2026年1月	売建	158,527,500	24,612,362,446	24,790,435,333	△76.81%
		ユーロ売/円買 2026年1月	売建	7,200,100	1,299,857,813	1,326,311,700	△4.11%
		シンガポール・ドル売/円買 2026年1月	売建	9,019,800	1,084,001,232	1,097,820,602	△3.40%
		英ポンド売/円買 2026年1月	売建	6,712,000	1,380,026,158	1,417,429,420	△4.39%
		香港ドル売/円買 2026年1月	売建	15,400,400	307,416,831	309,762,104	△0.96%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

●外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

2025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	9,161円
純資産総額	51億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-1.3%
3カ月間	-1.1%
6カ月間	1.6%
1年間	0.9%
3年間	3.6%
5年間	4.8%
設定来	7.2%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、
「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 220円 設定来分配金合計額: 1,560円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期			
	17年6月	18年6月	19年6月	20年6月	21年6月	22年6月	23年6月	24年6月	25年6月			
分配金	80円	110円	290円	0円	160円	220円	240円	240円	220円			

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

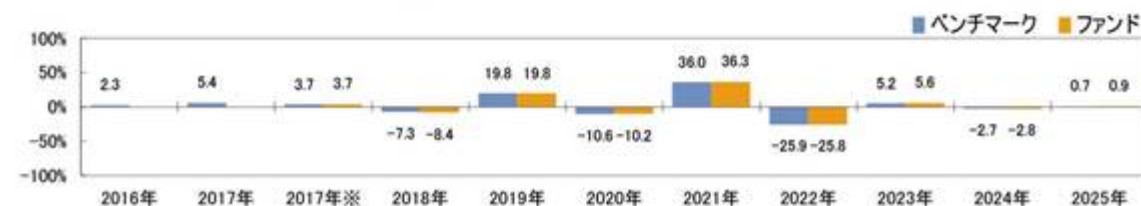
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	288	100.1%	日本円	100.5%	小売	18.9%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	8.1%
外国投資信託等	2	0.9%	韓国ウォン	0.2%	産業用	17.1%	PROLOGIS REIT INC	産業用	アメリカ	7.5%
コール・ローン、その他		3.2%	豪ドル	0.1%	ヘルスケア	15.8%	EQUINIX REIT INC	データセンター	アメリカ	4.7%
合計	290	-	ユーロ	0.1%	住宅	11.3%	SIMON PROPERTY GROUP REIT INC	小売	アメリカ	3.8%
国・地域別構成			シンガポール・ドル	0.0%	データセンター	8.2%	DOW JONES US REAL ESTATE MAR 26	-	アメリカ	3.7%
アメリカ		78.5%	カナダ・ドル	0.0%	倉庫	7.1%	REALTY INCOME REIT CORP	小売	アメリカ	3.3%
オーストラリア		7.9%	イスラエル・シェケル	0.0%	ダイバーシファイド	6.6%	DIGITAL REALTY TRUST REIT INC	データセンター	アメリカ	3.1%
イギリス		4.0%	ニュージーランド・ドル	0.0%	特殊	4.3%	GOODMAN GROUP UNITS	産業用	オーストラリア	2.8%
シンガポール		3.6%	香港ドル	-0.0%	オフィススペース	4.3%	PUBLIC STORAGE REIT	倉庫	アメリカ	2.6%
その他		7.0%	その他	-1.0%	その他	2.1%	VENTAS REIT INC	ヘルスケア	アメリカ	2.3%
合計		101.0%	合計	100.0%	合計	95.9%	合計			41.9%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

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



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

・2017年※は設定日(2月16日)から年末、2025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。

【ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)】

(1) 【投資状況】(2025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		1,483,599,934	99.99
	内 日本	1,483,599,934	99.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		74,793	0.01
純資産総額		1,483,674,727	100.00

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

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

（2）【投資資産】（2025年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	342,332,349	3.9562 1,354,346,008	4.3338 1,483,599,934	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)	9,896,754	9,996,754	0.9897	0.9997
第2計算期間末 (2018年6月15日)	9,693,791	10,023,791	0.9694	1.0024
第3計算期間末 (2019年6月17日)	518,637,200	534,240,737	1.0304	1.0614
第4計算期間末 (2020年6月15日)	424,828,364	439,928,561	0.8440	0.8740
第5計算期間末 (2021年6月15日)	1,290,025,686	1,308,743,688	1.1716	1.1886
第6計算期間末 (2022年6月15日)	11,992,308	12,107,308	1.1992	1.2107
第7計算期間末 (2023年6月15日)	12,131,636	12,531,636	1.2132	1.2532
第8計算期間末 (2024年6月17日)	109,840,357	111,305,714	1.4242	1.4432
2024年12月末日	1,079,451,241	—	1.5261	—
2025年1月末日	1,089,866,894	—	1.5125	—
2月末日	1,077,366,278	—	1.4952	—
3月末日	1,046,479,475	—	1.4523	—
4月末日	959,140,837	—	1.3705	—
5月末日	999,503,856	—	1.4282	—
第9計算期間末 (2025年6月16日)	987,493,934	1,007,789,233	1.4110	1.4400
6月末日	961,941,607	—	1.4072	—
7月末日	1,013,590,385	—	1.4638	—
8月末日	1,019,390,110	—	1.4722	—
9月末日	1,246,770,131	—	1.4986	—
10月末日	1,295,604,282	—	1.5375	—
11月末日	1,358,223,682	—	1.5866	—
12月末日	1,483,674,727	—	1.5764	—

② 【分配の推移】

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

第6計算期間	0.0115
第7計算期間	0.0400
第8計算期間	0.0190
第9計算期間	0.0290
2025年6月17日～ 2025年12月16日	—

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	△0.0
第2計算期間	1.3
第3計算期間	9.5
第4計算期間	△15.2
第5計算期間	40.8
第6計算期間	3.3
第7計算期間	4.5
第8計算期間	19.0
第9計算期間	1.1
2025年6月17日～ 2025年12月16日	10.0

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量 (口)	解約数量 (口)
第1計算期間	0	0
第2計算期間	0	0
第3計算期間	493,339,911	0
第4計算期間	0	0
第5計算期間	597,719,068	0
第6計算期間	0	1,091,058,979
第7計算期間	0	0
第8計算期間	91,547,167	24,423,063
第9計算期間	728,838,034	106,124,217
2025年6月17日～ 2025年12月16日	296,988,918	38,462,209

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

(参考) マザーファンド

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（2025年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		1,443,915,807	2.38
	内 アメリカ	1,443,915,807	2.38
投資証券		57,817,319,489	95.50
	内 ガーンジー	75,269,382	0.12
	内 韓国	121,229,550	0.20
	内 香港	512,856,796	0.85
	内 シンガポール	2,139,897,422	3.53
	内 イスラエル	118,993,036	0.20
	内 イギリス	2,385,349,087	3.94
	内 アイルランド	19,956,985	0.03
	内 オランダ	85,712,691	0.14
	内 ベルギー	602,932,275	1.00
	内 フランス	1,200,680,174	1.98
	内 ドイツ	12,220,965	0.02
	内 スペイン	276,239,803	0.46
	内 イタリア	7,173,548	0.01
	内 カナダ	723,747,781	1.20
	内 アメリカ	44,684,130,690	73.80
	内 オーストラリア	4,778,773,762	7.89
	内 ニュージーランド	72,155,542	0.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,282,397,232	2.12
純資産総額		60,543,632,528	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）		1,647,767,222	2.72
	内 ドイツ	418,060,440	0.69
	内 アメリカ	1,229,706,782	2.03
為替予約取引（買建）		624,543,220	1.03
	内 日本	624,543,220	1.03

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

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

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

(2) 投資資産（2025年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	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	165,477	32,447.52 5,369,323,135	29,690.03 4,913,018,484	8.11
2	PROLOGIS REIT INC	アメリカ	投資証券	223,955	20,118.74 4,505,693,289	20,114.82 4,504,816,484	7.44
3	EQUINIX REIT INC	アメリカ	投資証券	23,673	117,955.90 2,792,371,405	119,768.40 2,835,277,333	4.68
4	SIMON PROPERTY GROUP REIT INC	アメリカ	投資証券	78,712	29,166.18 2,295,735,517	29,373.78 2,312,069,538	3.82
5	REALTY INCOME REIT CORP	アメリカ	投資証券	221,794	9,014.41 1,999,373,344	8,894.17 1,972,674,339	3.26
6	DIGITAL REALTY TRUST REIT INC	アメリカ	投資証券	77,851	25,027.83 1,948,449,250	24,368.56 1,897,117,076	3.13
7	GOODMAN GROUP UNITS	オーストラリア	投資証券	514,406	3,109.38 1,599,485,919	3,282.96 1,688,775,556	2.79
8	PUBLIC STORAGE REIT	アメリカ	投資証券	38,075	42,937.20 1,634,834,192	40,599.13 1,545,812,225	2.55
9	VANGUARD REAL ESTATE INDEX FUND;ET	アメリカ	投資信託 受益証券	103,580	14,098.69 1,460,358,818	13,940.10 1,443,915,807	2.38
10	VENTAS REIT INC	アメリカ	投資証券	113,255	12,611.37 1,428,308,304	12,470.00 1,412,290,303	2.33
11	VICI PPTYS INC	アメリカ	投資証券	257,696	4,508.30 1,161,809,702	4,430.64 1,141,760,267	1.89
12	EXTRA SPACE STORAGE REIT INC	アメリカ	投資証券	51,174	20,840.01 1,066,473,951	20,468.65 1,047,462,920	1.73
13	AVALONBAY COMMUNITIES REIT INC	アメリカ	投資証券	34,098	28,478.73 971,069,869	28,791.38 981,728,612	1.62
14	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	71,268	13,500.01 962,121,562	12,936.55 921,962,245	1.52
15	EQUITY RESIDENTIAL REIT	アメリカ	投資証券	83,478	9,666.64 806,958,471	9,907.11 827,026,296	1.37
16	ESSEX PROPERTY TRUST REIT INC	アメリカ	投資証券	15,528	41,254.34 640,597,526	41,173.71 639,345,437	1.06
17	MID AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	アメリカ	投資証券	28,229	21,270.08 600,434,616	21,790.02 615,110,497	1.02

18	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	135,978	4,411.54 599,891,838	4,342.97 590,548,973	0.98
19	SCENTRE GROUP UNIT	オーストラリア	投資証券	1,325,831	428.08 567,604,242	439.19 582,299,407	0.96
20	SUN COMMUNITIES REIT INC	アメリカ	投資証券	28,028	20,164.77 565,178,876	19,541.81 547,718,109	0.90
21	W. P. CAREY REIT INC	アメリカ	投資証券	52,837	10,539.14 556,860,059	10,141.95 535,870,571	0.89
22	KIMCO REALTY REIT CORP	アメリカ	投資証券	163,275	3,232.49 527,805,455	3,192.25 521,215,990	0.86
23	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS REIT IN	アメリカ	投資証券	71,254	7,182.97 511,822,880	6,982.57 497,536,470	0.82
24	SEGRO REIT PLC	イギリス	投資証券	326,548	1,510.45 493,267,433	1,509.18 492,822,107	0.81
25	GAMING AND LEISURE PROPERTIES REIT	アメリカ	投資証券	68,235	6,818.34 465,252,976	6,996.66 477,417,532	0.79
26	LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	香港	投資証券	659,374	741.38 488,853,452	700.12 461,641,848	0.76
27	UNIBAIL RODAMCO WE STAPLED UNITS	フランス	投資証券	26,946	16,891.26 455,156,574	17,080.01 460,238,160	0.76
28	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES REIT I	アメリカ	投資証券	46,733	9,838.23 459,773,073	9,537.63 445,722,306	0.74
29	HOST HOTELS & RESORTS REIT INC	アメリカ	投資証券	154,199	2,762.65 426,015,211	2,879.13 443,960,262	0.73
30	CAMDEN PROPERTY TRUST REIT	アメリカ	投資証券	25,652	16,650.62 427,124,077	17,220.03 441,728,322	0.73

(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	2.38%
投資証券	95.50%
合計	97.88%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指数先物取引	アメリカ	DOW JONES US REAL ESTATE MAR 26	買建	218	1,225,572,941	1,229,706,782	2.03%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE MAR 26	買建	360	407,269,172	418,060,440	0.69%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2026年1月	買建	2,626,200	410,587,068	410,862,636	0.68%
		ユーロ買/円売 2026年1月	買建	1,160,000	209,633,645	213,680,584	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

●外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

2025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	15,764円
純資産総額	14億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-0.6%
3カ月間	5.2%
6カ月間	12.0%
1年間	5.4%
3年間	45.9%
5年間	90.2%
設定来	92.2%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 290円 設定来分配金合計額: 2,205円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月	第5期 21年6月	第6期 22年6月	第7期 23年6月	第8期 24年6月	第9期 25年6月			
分配金	100円	330円	310円	300円	170円	115円	400円	190円	290円			

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

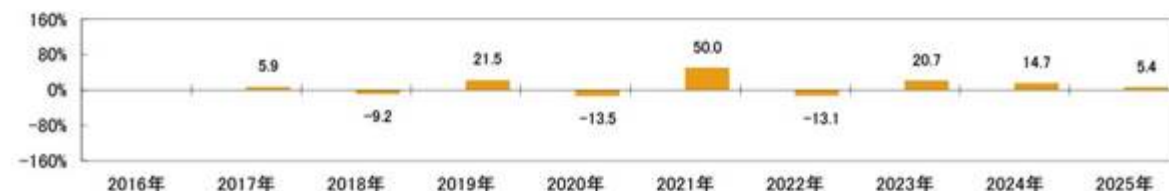
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	289	98.2%	米ドル	78.2%	小売	18.8%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	8.1%
外国投資信託等	2	2.4%	豪ドル	7.9%	産業用	17.0%	PROLOGIS REIT INC	産業用	アメリカ	7.4%
コール・ローン、その他		2.1%	ユーロ	4.3%	ヘルスケア	15.8%	EQUINIX REIT INC	データセンター	アメリカ	4.7%
合計	291	-	英ポンド	4.2%	住宅	11.2%	SIMON PROPERTY GROUP REIT INC	小売	アメリカ	3.8%
国・地域別構成			シンガポール・ドル	3.3%	データセンター	8.2%	REALTY INCOME REIT CORP	小売	アメリカ	3.3%
アメリカ		78.2%	カナダ・ドル	1.2%	倉庫	7.1%	DIGITAL REALTY TRUST REIT INC	データセンター	アメリカ	3.1%
オーストラリア		7.9%	香港ドル	0.9%	ダイバーシファイド	6.6%	GOODMAN GROUP UNITS	産業用	オーストラリア	2.8%
イギリス		3.9%	イスラエル・シケル	0.2%	特殊	4.3%	PUBLIC STORAGE REIT	倉庫	アメリカ	2.6%
シンガポール		3.5%	韓国ウォン	0.2%	オフィススペース	4.3%	VANGUARD REAL ESTATE INDEX FUND ET	-	アメリカ	2.4%
その他		7.0%	その他	-0.5%	その他	2.2%	VENTAS REIT INC	ヘルスケア	アメリカ	2.3%
合計		100.6%	合計	100.0%	合計	95.5%	合計			40.5%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2017年は設定日(2月16日)から年末、2025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。

(参考情報) ファンドの総経費率

	総経費率(①+②)	運用管理費用の比率 ①	その他費用の比率 ②
ダイワTOPIXインデックス (ダイワSMA専用)	0.35%	0.34%	0.01%
ダイワ日経225インデックス (ダイワSMA専用)	0.35%	0.34%	0.01%
ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)	0.47%	0.45%	0.02%
ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	0.47%	0.45%	0.02%
ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)	0.28%	0.27%	0.01%
ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)	0.44%	0.42%	0.02%
ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	0.44%	0.42%	0.02%
ダイワJ-REITインデックス (ダイワSMA専用)	0.35%	0.34%	0.01%
ダイワ外国REITインデックス (為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用)	0.48%	0.44%	0.05%
ダイワ外国REITインデックス (為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	0.47%	0.44%	0.03%

※対象期間は2024年6月18日～2025年6月16日です。

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

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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を行いません。

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

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

<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。

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

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

2【換金（解約）手続等】

<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。

＜「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（「TOPIXインデックス」、「日経225インデックス」、「日本債券インデックス」および「J-REITインデックス」を除きます。）その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受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
TOPIXインデックス 日経225インデックス 日本債券インデックス	4営業日目

外国株式インデックス（為替ヘッジあり） 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） J－REITインデックス 外国REITインデックス（為替ヘッジあり） 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）	5営業日目

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

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

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

[別表A]

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

[別表B]

ファンド名	価額
TOPIXインデックス 日経225インデックス 日本債券インデックス J－REITインデックス	申込受付日の基準価額

外国株式インデックス（為替ヘッジあり） 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） 外国REITインデックス（為替ヘッジあり） 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）	申込受付日の翌営業日の基準価額

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

＊「J－REITインデックス」を除きます。

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。また、予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします（「TOPIXインデックス」、「日経22

5 インデックス」、「日本債券インデックス」および「J－R E I T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、2017年2月16日から2017年6月15日までとします。

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

(5) 【その他】

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（「外国R E I Tインデックス（為替ヘッジあり）」および「外国R E I Tインデックス（為替ヘッジなし）」を除きます。）、もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
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、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2. の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。

5. 前2.から前4.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2.から前4.までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
6. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、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、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2.の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前2.から前5.までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1.から前6.までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前7.までの規定にしたがいます。

③ 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

④ 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書を計算期間の末日および償還時に作成し、信託財産にかかる知れている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
 - ・委託会社のホームページ
アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>
3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

⑤ 公告

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

⑥ 関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

＜収益分配金および償還金にかかる請求権＞

受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）および償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）を持分に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、）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

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

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

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

＜換金請求権＞

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

第3 【ファンドの経理状況】

【ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(2024年6月18日から2025年6月16日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	23,859,673	53,844,758
親投資信託受益証券	17,793,397,320	31,310,729,479
未収入金	800,000	147,500,000
流動資産合計	17,818,056,993	31,512,074,237
資産合計	17,818,056,993	31,512,074,237
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	229,938,446	585,118,333
未払解約金	-	146,372,128
未払受託者報酬	1,485,346	3,354,383
未払委託者報酬	21,538,213	48,639,323
その他未払費用	371,256	838,527
流動負債合計	253,333,261	784,322,694
負債合計	253,333,261	784,322,694
純資産の部		
元本等		
元本	※1 9,580,768,591	※1 16,253,287,030
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,983,955,141	14,474,464,513
（分配準備積立金）	1,728,660,151	1,689,875,163
元本等合計	17,564,723,732	30,727,751,543
純資産合計	17,564,723,732	30,727,751,543
負債純資産合計	17,818,056,993	31,512,074,237

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期 自 2023年6月16日 至 2024年6月17日	第9期 自 2024年6月18日 至 2025年6月16日
営業収益		
受取利息	3,897	103,746
有価証券売買等損益	1,943,018,323	1,291,532,159
営業収益合計	1,943,022,220	1,291,635,905
営業費用		
支払利息	1,072	-
受託者報酬	2,437,041	5,943,891
委託者報酬	35,338,413	86,187,776
その他費用	609,112	1,485,833
営業費用合計	38,385,638	93,617,500
営業利益又は営業損失（△）	1,904,636,582	1,198,018,405
経常利益又は経常損失（△）	1,904,636,582	1,198,018,405
当期純利益又は当期純損失（△）	1,904,636,582	1,198,018,405
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（△）	431,535,993	△ 34,230,516
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,993,972,228	7,983,955,141
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,619,105,243	12,293,177,956
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,619,105,243	12,293,177,956
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,872,284,473	6,449,799,172
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,872,284,473	6,449,799,172
分配金	※ 1 229,938,446	※ 1 585,118,333
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,983,955,141	14,474,464,513

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2024年6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2024年6月17日としており、2025年6月15日が休日のため、当計算期間末日を2025年6月16日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
1. ※1 期首元本額	3,639,859,036円	9,580,768,591円
期中追加設定元本額	9,114,805,565円	14,304,105,605円
期中一部解約元本額	3,173,896,010円	7,631,587,166円
2. 計算期間末日における受益権の総数	9,580,768,591口	16,253,287,030口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

※1 分配金の計算過程	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 (241,773,915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 (1,231,326,674円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (6,255,294,990円)及び分配準備積立金(485,498,008円)より分配対象額は8,213,893,587円 (1万口当たり8,573.31円)であり、うち229,938,446円(1万口当たり240円)を分配金額としております。	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 (610,777,768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 (621,471,153円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (12,784,589,350円)及び分配準備積立金(1,042,744,575円)より分配対象額は 15,059,582,846円(1万口当たり9,265.56円)であり、うち585,118,333円(1万口当たり360円)を分配金額としております。

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

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	第9期 2025年6月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,537,351,521	1,302,378,898
合計	1,537,351,521	1,302,378,898

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	1.8333円	1.8906円

(1万口当たり純資産額)	(18,333円)	(18,906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	15,145,711,546	31,310,729,479	
親投資信託受益証券 合計			31,310,729,479	
合計			31,310,729,479	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年6月17日現在 金額 (円)	2025年6月16日現在 金額 (円)

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 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6月17日現在	2025年6月16日現在
1. ※1 期首	2023年6月16日	2024年6月18日
期首元本額	155,385,420,480円	179,077,569,301円
期中追加設定元本額	39,993,423,771円	58,539,565,430円
期中一部解約元本額	16,301,274,950円	25,790,677,361円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
トピックス・インデックスファンド	2,805,279,280円	2,816,144,305円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA	4,071,973,852円	3,541,764,641円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドVA2	907,848円	901,535円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	9,102,808円	8,694,234円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	139,851,291円	101,848,648円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	11,667,234円	9,684,377円

ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	344,658,301円	256,901,047円
国内株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,209,547,484円	1,491,494,139円
日本株式インデックスファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	725,039,138円	935,176,883円
アセット・アロケーションファンド（リスク判断付き）2023-07（適格機関投資家専用）	-円	838,959,109円
D-I's TOPIXインデックス	12,953,393円	10,777,091円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	240,654,595円	238,587,466円
iFree TOPIXインデックス	8,054,701,433円	10,982,479,990円
iFree 8資産バランス	4,637,002,543円	5,466,222,980円
iFree 年金バランス	1,099,589,540円	1,269,176,267円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	3,602,255円	5,613,242円
DCダイワ日本株式インデックス	71,150,512,428円	72,586,462,326円
ダイワ・ライフ・バランス30	2,999,401,241円	2,925,579,709円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,894,560,071円	5,227,986,997円
ダイワ・ライフ・バランス70	5,901,383,202円	6,287,931,709円
年金ダイワ日本株式インデックス	7,735,661,770円	10,737,241,945円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	46,288,571円	38,232,962円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	72,209,078円	72,797,436円
ダイワつみたてインデックス日本株式	5,724,760,722円	7,378,410,418円
ダイワつみたてインデックスバランス30	12,074,009円	12,589,096円
ダイワつみたてインデックスバランス50	11,970,580円	14,921,757円
ダイワつみたてインデックスバランス70	30,025,521円	286,160,972円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	17,911,277,269円	29,168,373,075円

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

	ダイワライフスタイル２５	92,819,702円	85,281,713円
	ダイワライフスタイル５０	440,379,096円	413,468,231円
	ダイワライフスタイル７５	381,811,643円	370,161,705円
	DC・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）	7,888,735,670円	7,410,454,858円
計		179,077,569,301円	211,826,457,370円
2.	期末日における受益権の総数	179,077,569,301口	211,826,457,370口
3.	※2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 7,145,926,840円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 9,012,751,320円
4.	※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 731,860,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 925,595,000円
5.	※4 その他未収収益	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。	貸付有価証券に係る配当金相当額の未入金分が含まれております。

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	32,396,981,321	22,761,626,778
合計	32,396,981,321	22,761,626,778

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種類	2024年6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買建	8,087,635,000	-	7,838,085,000	△249,550,000	6,071,360,000	-	6,061,490,000	△9,870,000
合計	8,087,635,000	-	7,838,085,000	△249,550,000	6,071,360,000	-	6,061,490,000	△9,870,000

(注) 1. 時価の算定方法

株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6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	1.9605円	2.0673円
(1万口当たり純資産額)	(19,605円)	(20,673円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極 洋	6,400	4,515.00	28,896,000	
ニッスイ	153,400	842.00	129,162,800	
マルハニチロ	22,800	3,036.00	69,220,800	
ユキグニファクトリー	13,100	1,098.00	14,383,800	
カネコ種苗	4,300	1,365.00	5,869,500	貸付株式数 1,100株
サカタのタネ	19,000	3,375.00	64,125,000	貸付株式数 400株
ホクト	13,700	1,813.00	24,838,100	

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

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

日比谷総合設備	8,800	3,530.00	31,064,000	貸付株式数	3,400株
ニッポン	35,500	2,137.00	75,863,500	貸付株式数	3,400株
日清製粉G本社	107,100	1,732.00	185,497,200		
日東富士製粉	1,900	7,100.00	13,490,000		
昭和産業	9,100	2,927.00	26,635,700		
中部飼料	14,900	1,562.00	23,273,800		
フィード・ワン	15,700	975.00	15,307,500		
日本甜菜糖	5,600	2,340.00	13,104,000	貸付株式数	2,200株
DM三井製糖	10,700	3,085.00	33,009,500		
ウェルネオシュガー	6,000	2,254.00	13,524,000		
L I F U L L	33,000	191.00	6,303,000		
M I X I	21,100	3,305.00	69,735,500		
ジェイエイシーリクルート メント	40,700	985.00	40,089,500		
日本M&Aセンターホールデ メンバーズ	165,500	711.80	117,802,900		
メンバーズ	4,400	1,261.00	5,548,400	貸付株式数	1,700株
U T グループ	14,700	2,355.00	34,618,500		
アイティメディア	6,000	1,615.00	9,690,000	貸付株式数	1,300株
ケアネット	23,000	670.00	15,410,000	貸付株式数	9,100株
E・Jホールディングス	6,500	1,479.00	9,613,500		
オープンアップグループ	37,600	1,715.00	64,484,000		
コシダカホールディングス	30,900	1,085.00	33,526,500	貸付株式数	13,200株
パソナグループ	13,200	2,162.00	28,538,400		
リンクアンドモチベーショ ン	26,800	495.00	13,266,000	貸付株式数	10,700株
エス・エム・エス	43,000	1,401.00	60,243,000	貸付株式数	17,000株
パーソルホールディングス	1,025,800	277.10	284,249,180		
クックパッド	30,800	188.00	5,790,400	貸付株式数	12,100株
森永製菓	43,200	2,341.50	101,152,800		
中 村 屋	2,700	3,120.00	8,424,000		
江崎グリコ	30,800	4,634.00	142,727,200		
名糖産業	4,800	2,016.00	9,676,800		
井村屋グループ	5,900	2,423.00	14,295,700		
不 二 家	7,400	2,352.00	17,404,800	貸付株式数	2,900株
山崎製パン	72,100	3,235.00	233,243,500		
モロゾフ	10,400	1,601.00	16,650,400	貸付株式数	4,100株
亀田製菓	6,900	3,695.00	25,495,500	貸付株式数	2,400株
寿スピリッツ	63,700	2,124.00	135,298,800	貸付株式数	25,400株
カルビー	49,300	2,735.00	134,835,500		
森永乳業	40,100	3,335.00	133,733,500		

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

西日本旅客鉄道	269,900	3,211.00	866,648,900	
東海旅客鉄道	421,600	3,092.00	1,303,587,200	
東京地下鉄	244,000	1,708.50	416,874,000	貸付株式数 97,400株
西武ホールディングス	119,100	4,305.00	512,725,500	
鴻池運輸	18,600	2,838.00	52,786,800	
西日本鉄道	31,700	2,038.00	64,604,600	
ハマキョウレックス	37,400	1,347.00	50,377,800	
サカイ引越センター	13,900	2,690.00	37,391,000	貸付株式数 5,200株
近鉄グループHLDGS	117,100	2,677.00	313,476,700	
阪急阪神HLDGS	145,000	3,834.00	555,930,000	貸付株式数 1,000株
南海電鉄	48,700	2,160.00	105,192,000	
京阪ホールディングス	60,200	3,033.00	182,586,600	
神戸電鉄	3,000	2,308.00	6,924,000	貸付株式数 1,200株
名古屋鉄道	120,800	1,615.00	195,092,000	貸付株式数 47,900株
山陽電鉄	8,200	1,999.00	16,391,800	貸付株式数 3,200株
ヤマトホールディングス	132,800	2,002.00	265,865,600	
山 九	25,000	7,566.00	189,150,000	
日 新	7,400	8,080.00	59,792,000	
丸全昭和運輸	6,800	6,710.00	45,628,000	貸付株式数 2,500株
センコーグループHLDGS	71,900	1,850.00	133,015,000	
ニッコンホールディングス	62,100	3,235.00	200,893,500	貸付株式数 24,500株
福山通運	11,700	3,265.00	38,200,500	
セイノーホールディングス	53,800	2,207.50	118,763,500	
神奈川中央交通	3,100	3,600.00	11,160,000	
AZ-COM丸和ホールディ	33,900	1,070.00	36,273,000	貸付株式数 5,900株
日本郵船	226,400	5,146.00	1,165,054,400	
商船三井	207,900	4,993.00	1,038,044,700	
川崎汽船	235,400	2,095.50	493,280,700	
NSユニテッド海運	6,900	4,020.00	27,738,000	
飯野海運	40,100	1,048.00	42,024,800	
九州旅客鉄道	83,700	3,753.00	314,126,100	
SGホールディングス	183,500	1,655.00	303,692,500	
NIPPON EXPRESS	117,500	2,786.00	327,355,000	
日本航空	250,500	2,783.00	697,141,500	
ANAホールディングス	297,300	2,750.00	817,575,000	
ビーウィズ	2,900	1,452.00	4,210,800	貸付株式数 1,100株
サンウェルズ	5,700	624.00	3,556,800	貸付株式数 2,200株
TREホールディングス	25,800	1,411.00	36,403,800	
人・夢・技術グループ	4,600	1,620.00	7,452,000	貸付株式数 1,800株
シルバーライフ	3,100	729.00	2,259,900	貸付株式数 500株

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

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

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

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

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

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

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

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワ日経２２５インデックス（ダイワＳＭＡ専用）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(2024年6月18日から2025年6月16日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワ日経２２５インデックス（ダイワＳＭＡ専用）

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,784,991	9,600,396
親投資信託受益証券	3,453,636,920	4,810,995,188
未収入金	751,500,000	410,230,000
流動資産合計	4,211,921,911	5,230,825,584
資産合計	4,211,921,911	5,230,825,584
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	45,878,436	68,173,059
未払解約金	751,429,955	410,120,442
未払受託者報酬	397,414	565,161
未払委託者報酬	5,762,952	8,195,487
その他未払費用	99,281	141,207
流動負債合計	803,568,038	487,195,356
負債合計	803,568,038	487,195,356
純資産の部		
元本等		
元本	※1 1,699,201,340	※1 2,350,795,154
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,709,152,533	2,392,835,074
（分配準備積立金）	20,966,294	8,225,006
元本等合計	3,408,353,873	4,743,630,228
純資産合計	3,408,353,873	4,743,630,228
負債純資産合計	4,211,921,911	5,230,825,584

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期 自 2023年6月16日 至 2024年6月17日	第9期 自 2024年6月18日 至 2025年6月16日
営業収益		
受取利息	931	20,198
有価証券売買等損益	485,362,479	153,938,268
営業収益合計	485,363,410	153,958,466
営業費用		
支払利息	592	-
受託者報酬	684,009	1,003,862
委託者報酬	9,919,126	14,557,392
その他費用	170,857	250,797
営業費用合計	10,774,584	15,812,051
営業利益又は営業損失（△）	474,588,826	138,146,415
経常利益又は経常損失（△）	474,588,826	138,146,415
当期純利益又は当期純損失（△）	474,588,826	138,146,415
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（△）	411,454,103	64,605,801
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,251,342,312	1,709,152,533
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,764,376,558	5,026,707,857
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,764,376,558	5,026,707,857
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,323,822,624	4,348,392,871
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,323,822,624	4,348,392,871
分配金	※1 45,878,436	※1 68,173,059
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,709,152,533	2,392,835,074

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2024年6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2024年6月17日としており、2025年6月15日が休日のため、当計算期間末日を2025年6月16日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
1. ※1 期首元本額	1,644,514,833円	1,699,201,340円
期中追加設定元本額	6,758,588,320円	4,921,775,792円
期中一部解約元本額	6,703,901,813円	4,270,181,978円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,699,201,340口	2,350,795,154口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

※1 分配金の計算過程	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 (47,857,037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 (15,277,686円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (1,688,186,239円)及び分配準備積立金(3,710,007円)より分配対象額は1,755,030,969円(1万口当たり10,328.56円)であり、うち45,878,436円(1万口当たり270円)を分配金額としております。	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 (68,859,952円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額 (4,680,662円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (2,384,610,068円)及び分配準備積立金(2,857,451円)より分配対象額は2,461,008,133円(1万口当たり10,468.83円)であり、うち68,173,059円(1万口当たり290円)を分配金額としております。

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

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	第9期 2025年6月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	67,292,176	83,567,028
合計	67,292,176	83,567,028

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0059円 (20,059円)	2.0179円 (20,179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	894,486,416	4,810,995,188	
親投資信託受益証券 合計			4,810,995,188	
合計			4,810,995,188	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「ストックインデックス２２５・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年6月17日現在 金 額 (円)	2025年6月16日現在 金 額 (円)
資産の部		

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 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6月17日現在	2025年6月16日現在
1. ※1 期首	2023年6月16日	2024年6月18日
期首元本額	56,240,375,491円	62,582,339,693円
期中追加設定元本額	24,015,857,414円	26,408,350,814円
期中一部解約元本額	17,673,893,212円	16,939,066,512円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ストック インデックス ファン ド 2 2 5	23,368,091,905円	25,666,912,776円
適格機関投資家専用・ダイワ・ ストックインデックスファンド 2 2 5 V A	187,814,147円	158,940,517円
大和 スtock インデックス 2 2 5 ファン ド	7,615,504,332円	8,508,877,888円
D－I's 日経 2 2 5 インデッ クス	44,597,896円	20,260,477円
i F r e e 日経 2 2 5 インデッ クス	14,577,741,227円	21,238,515,348円

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）	5,589,483,405円	5,526,738,710円
ダイワ・ノーロード 日経２２５ ファンド	433,048,723円	466,535,909円
ダイワファンドラップ 日経２２ ５インデックス	4,577,487,398円	4,717,142,010円
ダイワ日経２２５インデックス （ダイワSMA専用）	657,522,498円	894,486,416円
ダイワ・インデックスセレクト 日経２２５	5,531,048,162円	4,853,213,944円
計	62,582,339,693円	72,051,623,995円
2. 期末日における受益権の総数	62,582,339,693口	72,051,623,995口
3. ※2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以 下のとおり有価証券の貸付を 行っております。 株式 679,445,020円	株券貸借取引契約により、以 下のとおり有価証券の貸付を 行っております。 株式 4,442,472,220円
4. ※3 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 株式 5,008,330,000円	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として以下の とおり差入を行っております。 株式 5,243,094,000円
5. ※4 その他未収収益	該当事項はありません。	貸付有価証券に係る配当金相 当額の未入金分が含まれてお ります。

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

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

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

II 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）

株式	38,890,746,083	13,072,573,499
合計	38,890,746,083	13,072,573,499

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種類	2024年6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買建	8,460,880,000	-	8,208,000,000	△252,880,000	6,304,280,000	-	6,291,040,000	△13,240,000
合計	8,460,880,000	-	8,208,000,000	△252,880,000	6,304,280,000	-	6,291,040,000	△13,240,000

（注） 1. 時価の算定方法

株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6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	5.2525円	5.3785円
（1万口当たり純資産額）	（52,525円）	（53,785円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

銘柄	株式数	評価額（円）	備考

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

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

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

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

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

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

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

武田薬品 50,000株

ダイキン工業 26,000株

アドバンテスト 100,000株

ファーストリテイリング 50,000株

ソフトバンクグループ

156,000株

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(2024年6月18日から2025年6月16日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	53,479,973	77,953,417
親投資信託受益証券	22,938,575,191	30,515,583,755
未収入金	-	54,640,000
流動資産合計	22,992,055,164	30,648,177,172
資産合計	22,992,055,164	30,648,177,172
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	318,987,932	404,638,125
未払解約金	-	52,894,981
未払受託者報酬	2,422,945	3,654,884
未払委託者報酬	46,642,655	70,357,208
その他未払費用	605,655	913,650
流動負債合計	368,659,187	532,458,848
負債合計	368,659,187	532,458,848
純資産の部		
元本等		
元本	※ 1 13,291,163,863	※ 1 16,859,921,911
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	9,332,232,114	13,255,796,413
（分配準備積立金）	2,329,140,526	1,765,809,500
元本等合計	22,623,395,977	30,115,718,324
純資産合計	22,623,395,977	30,115,718,324
負債純資産合計	22,992,055,164	30,648,177,172

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期 自 2023年6月16日 至 2024年6月17日	第9期 自 2024年6月18日 至 2025年6月16日
営業収益		
受取利息	8,690	156,560
有価証券売買等損益	3,242,111,874	1,758,069,119
営業収益合計	3,242,120,564	1,758,225,679
営業費用		
支払利息	3,349	-
受託者報酬	4,406,317	6,619,062
委託者報酬	84,823,457	127,418,510
その他費用	1,101,419	1,654,618
営業費用合計	90,334,542	135,692,190
営業利益又は営業損失（△）	3,151,786,022	1,622,533,489
経常利益又は経常損失（△）	3,151,786,022	1,622,533,489
当期純利益又は当期純損失（△）	3,151,786,022	1,622,533,489
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（△）	927,944,350	500,456,247
期首剰余金又は期首欠損金（△）	4,290,263,773	9,332,232,114
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,318,900,391	12,840,640,001
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,318,900,391	12,840,640,001
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,181,785,790	9,634,514,819
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,181,785,790	9,634,514,819
分配金	※ 1 318,987,932	※ 1 404,638,125
期末剰余金又は期末欠損金（△）	9,332,232,114	13,255,796,413

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2024年6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2024年6月17日としており、2025年6月15日が休日のため、当計算期間末日を2025年6月16日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
1. ※1 期首元本額	8,528,354,682円	13,291,163,863円
期中追加設定元本額	12,945,394,819円	16,814,410,901円
期中一部解約元本額	8,182,585,638円	13,245,652,853円
2. 計算期間末日における受益権の総数	13,291,163,863口	16,859,921,911口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

※1 分配金の計算過程	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 (341,508,141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 (1,882,333,531円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (7,003,091,588円)及び分配準備積立金(424,286,786円)より分配対象額は9,651,220,046円 (1万口当たり7,261.38円)であり、うち318,987,932円(1万口当たり240円)を分配金額としております。	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 (417,800,858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 (704,276,384円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (11,489,986,913円)及び分配準備積立金(1,048,370,383円)より分配対象額は 13,660,434,538円(1万口当たり8,102.31円)であり、うち404,638,125円(1万口当たり240円)を分配金額としております。

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

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	第9期
	2025年6月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	2,303,589,058	1,222,833,343
合計	2,303,589,058	1,222,833,343

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	1.7021円	1.7862円

(1万口当たり純資産額)	(17,021円)	(17,862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	9,095,282,929	30,515,583,755	
親投資信託受益証券 合計			30,515,583,755	
合計			30,515,583,755	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年6月17日現在 金額 (円)	2025年6月16日現在 金額 (円)

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

(2)新株予約権証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

(3)投資証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。

なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2. デリバティブ取引の評価基準 及び評価方法

(1)先物取引

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

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

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。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	2025年6月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	12,071,986,049	2,906,142,354
新株予約権証券	0	0
投資証券	△57,929,406	84,095,059
合計	12,014,056,643	2,990,237,413

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種類	2024年6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買建	7,770,809,548	-	7,922,332,463	151,522,915	7,028,050,976	-	7,298,509,513	270,458,537
合計	7,770,809,548	-	7,922,332,463	151,522,915	7,028,050,976	-	7,298,509,513	270,458,537

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2. 通貨関連

種類	2024年6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売建	112,992,750,187	-	113,256,902,363	△264,152,176	135,923,571,413	-	137,141,568,029	△1,217,996,616
アメリカ・ドル	84,682,068,669	-	85,049,813,019	△367,744,350	103,712,228,720	-	104,418,262,215	△706,033,495
イギリス・ ポンド	4,890,336,769	-	4,886,729,590	3,607,179	5,429,552,602	-	5,489,671,105	△60,118,503
イスラエル・ シェケル	138,042,327	-	137,790,205	252,122	209,420,539	-	204,897,117	4,523,422

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

(注) 1. 時価の算定方法

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

- 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6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	3.1407円	3.3551円
(1万口当たり純資産額)	(31,407円)	(33,551円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

	UNITED UTILITIES GROUP PLC	9,399	11.655	109,545.340	
	SEVERN TRENT PLC	3,938	27.050	106,522.900	
	RENTOKIL INITIAL PLC	36,742	3.483	127,972.380	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	9,243	50.960	471,023.280	
	SCHRODERS PLC	10,596	3.558	37,700.560	
	SSE PLC	14,868	18.150	269,854.200	
	BARRATT REDROW PLC	19,293	4.745	91,545.280	
	ASTRAZENECA PLC	20,894	109.860	2,295,414.840	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	83,379	2.529	210,865.490	
	3I GROUP PLC	13,116	41.230	540,772.680	
	ASHTED GROUP PLC	5,884	42.670	251,070.280	
	SAGE GROUP PLC/THE	14,189	12.620	179,065.180	
	NATIONAL GRID PLC	65,922	10.630	700,750.860	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	816,813	0.765	624,861.940	
	IMPERIAL BRANDS PLC	10,684	29.090	310,797.560	
	CENTRICA PLC	72,294	1.660	120,008.040	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	26,781	35.880	960,902.280	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,460	20.480	91,340.800	
	HSBC HOLDINGS PLC	240,839	8.665	2,086,869.930	
	ANGLO AMERICAN PLC	13,335	21.135	281,835.220	
	MONDI PLC	5,778	11.725	67,747.050	
	COMPASS GROUP PLC	22,873	25.540	584,176.420	
	BT GROUP PLC	87,192	1.840	160,476.870	
	COCA-COLA HBC AG-DI	3,014	39.460	118,932.440	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	2,135	82.480	176,094.800	
	INTERTEK GROUP PLC	2,128	47.620	101,335.360	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	6,445	110.450	711,850.250	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2,039	21.280	43,389.920	
	ADMIRAL GROUP PLC	3,793	33.000	125,169.000	
	ANTOFAGASTA PLC	5,200	17.910	93,132.000	
	EXPERIAN PLC	12,394	37.480	464,527.120	
イギリス・ポンド 小計				27,318,380.420 (5,344,294,761)	
イスラエル・ シェケル	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	17,851	28.500	508,753.500	
	AZRIELI GROUP LTD	530	260.000	137,800.000	
	ICL GROUP LTD	8,294	23.690	196,484.860	
	ELBIT SYSTEMS LTD	385	1,616.900	622,506.500	
	BANK HAPOLIM BM	18,333	56.900	1,043,147.700	

	BANK LEUMI LE-ISRAEL	21,975	56.350	1,238,291.250	
	NICE LTD	907	594.600	539,302.200	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	2,264	189.000	427,896.000	
イスラエル・シェケル 小計				4,714,182.010 (188,075,592)	
オーストラリア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	29,120	5.290	154,044.800	
	TELSTRA GROUP LTD	53,342	4.890	260,842.380	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	39,320	29.630	1,165,051.600	
	SGH LTD	2,833	53.680	152,075.440	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	36,006	4.900	176,429.400	
	BHP GROUP LTD	67,914	37.340	2,535,908.760	
	SOUTH32 LTD	62,620	2.940	184,102.800	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	25,090	25.210	632,518.900	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	22,377	15.730	351,990.210	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	40,582	38.870	1,577,422.340	
	WESTPAC BANKING CORP	45,298	33.360	1,511,141.280	
	SANTOS LTD	43,240	6.960	300,950.400	
	RIO TINTO LTD	4,906	106.380	521,900.280	
	ORIGIN ENERGY LTD	24,239	11.450	277,536.550	
	XERO LTD	1,921	188.700	362,492.700	
	PRO MEDICUS LTD	812	270.500	219,646.000	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,397	40.320	136,967.040	
	COLES GROUP LTD	17,681	22.220	392,871.820	
	WISETECH GLOBAL LTD	2,603	105.390	274,330.170	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	17,907	22.530	403,444.710	
	EVOLUTION MINING LTD	28,748	9.200	264,481.600	
	REECE LTD	3,155	16.530	52,152.150	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	22,389	179.350	4,015,467.150	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	19,894	23.280	463,132.320	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	16,144	32.200	519,836.800	
	QANTAS AIRWAYS LTD	11,139	10.190	113,506.410	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	5,798	40.210	233,137.580	
	MACQUARIE GROUP LTD	4,785	212.830	1,018,391.550	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	7,462	64.040	477,866.480	
	CSL LTD	6,390	238.860	1,526,315.400	
	WESFARMERS LTD	14,974	84.770	1,269,345.980	
	COCHLEAR LTD	905	272.850	246,929.250	
	BLUESCOPE STEEL LTD	6,110	22.530	137,658.300	

	SUNCORP GROUP LTD	14,965	21.430	320,699.950	
	ASX LTD	2,592	72.770	188,619.840	
	COMPUTERSHARE LTD	6,955	40.650	282,720.750	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	31,872	8.980	286,210.560	
	SONIC HEALTHCARE LTD	5,915	26.890	159,054.350	
	BRAMBLES LTD	19,213	23.030	442,475.390	
	CARSales.COM LTD	5,460	35.950	196,287.000	
	SIGMA HEALTHCARE LTD	66,293	3.250	215,452.250	
	REA GROUP LTD	733	232.410	170,356.530	
オーストラリア・ドル 小計				24,191,765.170 (2,268,461,821)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	9,413	73.120	688,278.560	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	5,176	74.200	384,059.200	
	BROOKFIELD RENEWABLE SUBORDINATE V	1,532	43.870	67,208.840	
	CELESTICA INC	1,400	170.260	238,364.000	
	IMPERIAL OIL LTD	2,195	111.150	243,974.250	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	261	4,829.990	1,260,627.390	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	4,004	91.390	365,925.560	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	5,569	124.570	693,730.330	
	INTACT FINANCIAL CORP	2,231	309.500	690,494.500	
	BCE INC	668	31.010	20,714.680	
	FRANCO-NEVADA CORP	2,356	233.330	549,725.480	
	SUNCOR ENERGY INC	15,487	55.670	862,161.290	
	METRO INC/CN	2,550	104.340	266,067.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	4,789	135.420	648,526.380	
	BANK OF NOVA SCOTIA	15,303	73.780	1,129,055.340	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	11,580	92.610	1,072,423.800	
	TORONTO-DOMINION BANK	21,537	96.230	2,072,505.510	
	GREAT-WEST LIFECO INC	3,735	51.190	191,194.650	
	ROYAL BANK OF CANADA	17,390	173.550	3,018,034.500	
	TOURMALINE OIL CORP	4,356	66.630	290,240.280	
	TC ENERGY CORP	12,754	67.350	858,981.900	
	PEMBINA PIPELINE CORP	7,094	52.260	370,732.440	
	BARRICK MINING CORP	21,152	29.320	620,176.640	
	CAE INC	3,752	36.410	136,610.320	
	THOMSON REUTERS CORP	1,897	264.980	502,667.060	

EMPIRE CO LTD 'A'	1,800	51.840	93,312.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	631	103.350	65,213.850	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,860	77.630	144,391.800	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	5,400	32.380	174,852.000	
HYDRO ONE LTD	4,066	49.240	200,209.840	
LOBLAW COMPANIES LTD	1,861	222.310	413,718.910	
STANTEC INC	1,400	144.850	202,790.000	
WSP GLOBAL INC	1,557	271.520	422,756.640	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	974	121.550	118,389.700	
QUEBECOR INC -CL B	1,949	40.250	78,447.250	
EMERA INC	3,924	61.380	240,855.120	
TFI INTERNATIONAL INC	1,024	122.190	125,122.560	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	1,593	38.100	60,693.300	
WHITECAP RESOURCES INC	13,000	9.390	122,070.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	4,543	37.560	170,635.080	
IVANHOE MINES LTD-CL A	8,902	9.880	87,951.760	
AGNICO EAGLE MINES LTD	6,183	169.130	1,045,730.790	
ALAMOS GOLD INC-CLASS A	6,000	37.420	224,520.000	
KINROSS GOLD CORP	15,057	21.460	323,123.220	
BANK OF MONTREAL	9,035	145.290	1,312,695.150	
POWER CORP OF CANADA	6,872	52.290	359,336.880	
LUNDIN GOLD INC	1,600	73.870	118,192.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	14,861	143.180	2,127,797.980	
NUTRIEN LTD	5,974	85.420	510,299.080	
CAMECO CORP	5,402	90.530	489,043.060	
FIRSTSERVICE CORP	522	240.000	125,280.000	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	2,882	68.270	196,754.140	
TELUS CORP	600	21.920	13,152.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	6,174	52.450	323,826.300	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	623	177.990	110,887.770	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	26,018	45.900	1,194,226.200	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	244	2,355.550	574,754.200	
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,647	50.720	184,975.840	
WESTON (GEORGE) LTD	700	267.610	187,327.000	
PAN AMERICAN SILVER CORP	4,423	39.420	174,354.660	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	1,000	134.800	134,800.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	7,120	87.290	621,504.800	
ENBRIDGE INC	26,808	63.370	1,698,822.960	
BROOKFIELD CORP	16,842	78.520	1,322,433.840	

	MANULIFE FINANCIAL CORP	21,267	42.340	900,444.780	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	11,526	109.240	1,259,100.240	
	IA FINANCIAL CORP INC	1,209	142.260	171,992.340	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	1,864	62.920	117,282.880	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	6,599	141.090	931,052.910	
	CGI INC - CLASS A	2,606	147.080	383,290.480	
	IGM FINANCIAL INC	1,318	43.070	56,766.260	
	TMX GROUP LTD	3,490	55.980	195,370.200	
	OPEN TEXT CORP	3,610	38.410	138,660.100	
	SAPUTO INC	2,900	26.520	76,908.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	8,981	21.030	188,870.430	
	FORTIS INC	6,138	65.450	401,732.100	
	RB GLOBAL INC	2,396	144.440	346,078.240	
	LUNDIN MINING CORP	10,100	13.910	140,491.000	
	CENOVUS ENERGY INC	17,331	20.160	349,392.960	
	DOLLARAMA INC	3,434	193.740	665,303.160	
	ALTAGAS LTD	3,901	38.740	151,124.740	
	KEYERA CORP	2,970	42.580	126,462.600	
	ARC RESOURCES LTD	7,934	30.650	243,177.100	
カナダ・ドル 小計				40,181,228.100 (4,269,657,297)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	33,600	2.580	86,688.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	17,800	34.950	622,110.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	30,610	44.450	1,360,614.500	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	22,850	6.940	158,579.000	
	KEPPEL CORP LTD	21,000	7.220	151,620.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	35,600	2.250	80,100.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	47,700	16.060	766,062.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	81,200	0.705	57,246.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	104,700	3.950	413,565.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	24,100	7.800	187,980.000	
	SEMBICORP INDUSTRIES LTD	11,400	6.890	78,546.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	13,200	14.000	184,800.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	27,800	3.010	83,678.000	
シンガポール・ドル 小計				4,231,588.500 (476,265,286)	
スイス・フラン	SANDOZ GROUP AG	5,862	42.760	250,659.120	
	GALDERMA GROUP N AG	1,384	111.300	154,039.200	

AVOLTA AG	1,251	42.680	53,392.680	
UBS GROUP AG-REG	44,398	26.100	1,158,787.800	
ROCHE HOLDING AG-BR	442	286.400	126,588.800	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	89	596.000	53,044.000	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	9,484	269.700	2,557,834.800	
SIKA AG-REG	2,058	209.000	430,122.000	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	132,400.000	132,400.000	
ABB LTD-REG	21,349	47.620	1,016,639.380	
SWISS RE AG	4,072	136.400	555,420.800	
NESTLE SA-REG	35,367	84.250	2,979,669.750	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	307	1,014.500	311,451.500	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	550	296.800	163,240.000	
JULIUS BAER GROUP LTD	2,780	52.440	145,783.200	
SGS SA-REG	2,123	84.620	179,648.260	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	342	287.500	98,325.000	
TEMENOS AG - REG	793	59.700	47,342.100	
HELVETIA HOLDING AG-REG	539	185.500	99,984.500	
VAT GROUP AG	357	334.000	119,238.000	
BKW AG	250	172.500	43,125.000	
ALCON INC	6,745	70.900	478,220.500	
SIG GROUP N AG	4,054	15.720	63,728.880	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	377	134.100	50,555.700	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,976	561.200	1,108,931.200	
BALOISE HOLDING AG - REG	550	185.400	101,970.000	
NOVARTIS AG-REG	25,648	97.160	2,491,959.680	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	50	876.500	43,825.000	
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	7,257	150.400	1,091,452.800	
SWISSCOM AG-REG	364	556.500	202,566.000	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	357	89.500	31,951.500	
GEBERIT AG-REG	468	636.400	297,835.200	
GIVAUDAN-REG	125	4,124.000	515,500.000	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,569	104.950	164,666.550	
SONOVA HOLDING AG-REG	684	251.100	171,752.400	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	2,060	69.620	143,417.200	
LONZA GROUP AG-REG	975	568.800	554,580.000	
HOLCIM LTD	7,036	93.100	655,051.600	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	388	798.400	309,779.200	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	639	186.500	119,173.500	
SWISS PRIME SITE-REG	1,070	116.300	124,441.000	

	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	13	13,480.000	175,240.000	
スイス・フラン 小計				19,573,333.800 (3,480,334,483)	
スウェーデン・ クローナ	SAGAX CLASS B	3,211	202.000	648,622.000	
	ERICSSON LM-B SHS	39,125	79.700	3,118,262.500	
	VOLVO AB-B SHS	22,373	264.600	5,919,895.800	
	SKF AB-B SHARES	4,980	206.600	1,028,868.000	
	TELE2 AB-B SHS	8,442	139.900	1,181,035.800	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	22,350	163.000	3,643,050.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	20,544	125.750	2,583,408.000	
	SWEDBANK AB - A SHARES	11,958	247.000	2,953,626.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	8,285	131.100	1,086,163.500	
	SVENSKA CELLULOZA AB SCA-B	8,820	123.300	1,087,506.000	
	SKANSKA AB-B SHS	5,222	228.800	1,194,793.600	
	SANDVIK AB	15,017	210.500	3,161,078.500	
	INVESTOR AB-B SHS	24,378	274.900	6,701,512.200	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	37,832	152.950	5,786,404.400	
	HOLMEN AB-B SHARES	1,114	377.400	420,423.600	
	SECURITAS AB-B SHS	7,595	137.500	1,044,312.500	
	TELIA CO AB	34,471	35.240	1,214,758.040	
	ALFA LAVAL AB	4,075	403.400	1,643,855.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	21,984	135.850	2,986,526.400	
	ASSA ABLOY AB-B	14,117	302.400	4,268,980.800	
	TRELLEBORG AB-B SHS	3,113	344.100	1,071,183.300	
	SAAB AB-B	4,511	460.000	2,075,060.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	1,710	341.000	583,110.000	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	11,089	63.460	703,707.940	
	INDUTRADE AB	4,193	256.400	1,075,085.200	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	2,616	285.000	745,560.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	948	466.600	442,336.800	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	2,048	244.200	500,121.600	
	LIFCO AB-B SHS	3,406	390.200	1,329,021.200	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	22,143	40.390	894,355.770	
	BEIJER REF AB	5,166	144.050	744,162.300	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	8,595	263.800	2,267,361.000	
	BOLIDEN AB	3,947	293.200	1,157,260.400	
	EPIROC AB-A	9,282	211.800	1,965,927.600	
	EPIROC AB-B	6,023	183.900	1,107,629.700	

	EQT AB	5,390	275.200	1,483,328.000	
	EVOLUTION AB	2,238	669.000	1,497,222.000	
	HEXAGON AB-B SHS	29,242	92.240	2,697,282.080	
	ADDTECH AB-B SHARES	4,014	314.600	1,262,804.400	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,020	339.600	685,992.000	
スウェーデン・クローナ 小計				75,961,593.930 (1,153,856,612)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	45,426	516.200	23,448,901.200	
	DANSKE BANK A/S	9,729	256.000	2,490,624.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	39	12,490.000	487,110.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	14,244	108.050	1,539,064.200	
	CARLSBERG AS-B	1,379	932.400	1,285,779.600	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	4,970	485.500	2,412,935.000	
	COLOPLAST-B	1,779	637.000	1,133,223.000	
	DSV PANALPINA A/S	2,883	1,596.500	4,602,709.500	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	1,340	298.150	399,521.000	
	DEMANT A/S	1,352	281.600	380,723.200	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	70	12,630.000	884,100.000	
	TRYG A/S	5,039	164.800	830,427.200	
	PANDORA A/S	1,183	1,149.000	1,359,267.000	
	GENMAB A/S	887	1,481.000	1,313,647.000	
	ORSTED A/S	2,730	273.500	746,655.000	
デンマーク・クローネ 小計				43,314,686.900 (967,216,959)	
ニュージーランド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	18,677	5.870	109,633.990	
	INFRATIL LTD	12,669	10.275	130,173.970	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	25,799	7.965	205,489.030	
	CONTACT ENERGY LTD	11,562	8.990	103,942.380	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	8,427	36.600	308,428.200	
ニュージーランド・ドル 小計				857,667.570 (74,599,926)	
ノルウェー・クローネ	DNB BANK	12,613	278.400	3,511,459.200	
	NORSK HYDRO ASA	20,547	55.240	1,135,016.280	
	ORKLA ASA	10,826	110.000	1,190,860.000	
	TELENOR ASA	9,088	152.500	1,385,920.000	
	EQUINOR ASA	11,801	273.300	3,225,213.300	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,541	388.400	986,924.400	

	MOWI ASA	7,143	188.400	1,345,741.200	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,886	249.000	718,614.000	
	AKER BP ASA	4,241	273.000	1,157,793.000	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	6,195	384.850	2,384,145.750	
	SALMAR ASA	1,013	454.400	460,307.200	
ノルウェー・クローネ 小計				17,501,994.330 (254,829,038)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	14,794	27.910	412,900.540	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	6,373	38.130	243,002.490	
	EXOR NV	1,143	80.950	92,525.850	
	DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	1,527	41.390	63,202.530	
	DSM FIRMENICH AG	2,549	96.420	245,774.580	
	FERROVIAL	6,181	44.550	275,363.550	
	LOTUS BAKERIES NV	5	8,640.000	43,200.000	
	SYENSCO SA	902	67.000	60,434.000	
	CVC CAPITAL PARTNERS PLC	2,933	15.770	46,253.410	
	COVESTRO V AG	2,578	60.400	155,711.200	
	BAYER AG-REG	12,776	27.480	351,084.480	
	EVONIK INDUSTRIES AG	3,091	18.650	57,647.150	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	24,075	23.880	574,911.000	
	COMMERZBANK AG	12,352	28.100	347,091.200	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	2,688	88.840	238,801.920	
	SIEMENS AG-REG	9,848	214.950	2,116,827.600	
	E.ON SE	29,204	15.485	452,223.940	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	3,778	75.300	284,483.400	
	GEA GROUP AG	2,139	59.000	126,201.000	
	CONTINENTAL AG	1,511	76.660	115,833.260	
	BASF SE	11,610	42.120	489,013.200	
	ALLIANZ SE-REG	4,987	341.600	1,703,559.200	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	2,323	67.420	156,616.660	
	RHEINMETALL AG	597	1,795.500	1,071,913.500	
	RWE AG	8,241	35.590	293,297.190	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	8,607	6.882	59,233.370	
	BRENNTAG SE	1,739	60.000	104,340.000	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	5,494	44.000	241,736.000	
	SAP SE	13,799	254.750	3,515,295.250	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,740	553.400	962,916.000	
	ZALANDO SE	3,091	28.500	88,093.500	

HEIDELBERG MATERIALS AG	1,776	176.000	312,576.000	
RATIONAL AG	58	708.500	41,093.000	
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	887	103.600	91,893.200	
SARTORIUS AG-VORZUG	359	205.600	73,810.400	
TALANX AG	804	110.400	88,761.600	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	2,057	33.860	69,650.020	
DELIVERY HERO SE	2,550	22.100	56,355.000	
NEMETSCHEK SE	794	123.800	98,297.200	
SCOUT24 AG	1,040	117.300	121,992.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	3,869	45.650	176,619.850	
KNORR-BREMSE AG	926	83.700	77,506.200	
SIEMENS ENERGY AG	9,018	84.820	764,906.760	
BEIERSDORF AG	1,290	115.450	148,930.500	
MERCK KGAA	1,772	114.800	203,425.600	
ADIDAS AG	2,228	200.000	445,600.000	
HENKEL AG & CO KGAA	1,311	61.700	80,888.700	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	45,403	30.730	1,395,234.190	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	2,759	49.880	137,618.920	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	9,392	50.820	477,301.440	
QIAGEN N.V.	2,946	40.680	119,843.280	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	16,987	35.420	601,679.540	
HANNOVER RUECK SE	827	268.600	222,132.200	
DHL GROUP	12,510	40.770	510,032.700	
DEUTSCHE BOERSE AG	2,449	267.900	656,087.100	
MTU AERO ENGINES AG	738	341.200	251,805.600	
SYMRISE AG	1,726	101.700	175,534.200	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	733	70.650	51,786.450	
VONOVIA SE	9,631	28.320	272,749.920	
LEG IMMOBILIEN SE	1,022	70.550	72,102.100	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	10,952	19.885	217,780.520	
NN GROUP NV	3,687	55.200	203,522.400	
ARCELORMITTAL	6,098	26.080	159,035.840	
HEINEKEN NV	3,754	78.100	293,187.400	
AEGON LTD	18,115	6.028	109,197.220	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	11,973	35.850	429,232.050	
AKZO NOBEL N.V.	2,289	58.080	132,945.120	
WOLTERS KLUWER	3,103	146.450	454,434.350	
ING GROEP NV	40,938	18.006	737,129.620	
KONINKLIJKE KPN NV	50,565	4.097	207,164.800	

ASML HOLDING NV	5,123	664.600	3,404,745.800	
ABN AMRO BANK NV-CVA	6,323	22.760	143,911.480	
IMCD NV	817	117.450	95,956.650	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	1,034	125.900	130,180.600	
ASR NEDERLAND NV	2,047	54.360	111,274.920	
ADYEN NV	337	1,656.200	558,139.400	
PROSUS NV	17,795	46.680	830,670.600	
JDE PEET'S NV	2,435	23.480	57,173.800	
INPOST SA	2,468	13.970	34,477.960	
ASM INTERNATIONAL NV	611	519.400	317,353.400	
RANDSTAD NV	1,226	37.840	46,391.840	
HEINEKEN HOLDING NV	1,735	67.550	117,199.250	
TOTALENERGIES SE	28,069	54.800	1,538,181.200	
MICHELIN (CGDE)	8,741	32.200	281,460.200	
AIR LIQUIDE SA	7,522	182.800	1,375,021.600	
KERING	1,022	172.580	176,376.760	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	7,113	220.450	1,568,060.850	
BOUYGUES SA	2,624	37.820	99,239.680	
BNP PARIBAS	13,238	75.280	996,556.640	
THALES SA	1,205	250.600	301,973.000	
DANONE	8,397	72.620	609,790.140	
CARREFOUR SA	6,992	12.815	89,602.480	
L'OREAL	3,128	371.050	1,160,644.400	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	5,842	95.800	559,663.600	
LEGRAND SA	3,419	109.900	375,748.100	
PERNOD RICARD SA	2,631	89.700	236,000.700	
EURAZEO SE	603	58.950	35,546.850	
REXEL SA	3,113	24.960	77,700.480	
SOCIETE GENERALE SA	9,388	48.440	454,754.720	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	3,580	461.400	1,651,812.000	
ACCOR SA	2,614	43.260	113,081.640	
CAPGEMINI SE	2,006	150.400	301,702.400	
PUBLICIS GROUPE	2,984	95.060	283,659.040	
BUREAU VERITAS SA	4,257	29.200	124,304.400	
EIFFAGE	945	118.200	111,699.000	
SODEXO SA	1,085	55.500	60,217.500	
IPSEN	460	103.300	47,518.000	
AMUNDI SA	751	66.900	50,241.900	
TELEPERFORMANCE	749	90.740	67,964.260	

EURONEXT NV	1,079	142.000	153,218.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	1,852	60.320	111,712.640	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	369	199.050	73,449.450	
ESSILORLUXOTTICA	3,868	242.000	936,056.000	
DASSAULT AVIATION SA	274	304.200	83,350.800	
FDJ UNITED	1,287	31.840	40,978.080	
AXA SA	23,048	41.620	959,257.760	
EDENRED	3,410	25.420	86,682.200	
RENAULT SA	2,649	43.040	114,012.960	
HERMES INTERNATIONAL	412	2,295.000	945,540.000	
STMICROELECTRONICS NV	9,177	25.590	234,839.430	
DASSAULT SYSTEMES SE	8,724	31.680	276,376.320	
ORANGE	24,270	12.750	309,442.500	
ALSTOM	4,483	18.850	84,504.550	
SANOFI	14,787	86.800	1,283,511.600	
VINCI SA	6,433	124.650	801,873.450	
AIRBUS SE	7,729	161.580	1,248,851.820	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	9,171	30.200	276,964.200	
CREDIT AGRICOLE SA	13,873	15.845	219,817.680	
BIOMERIEUX	578	120.600	69,706.800	
ENGIE	23,807	19.875	473,164.120	
SAFRAN SA	4,684	253.200	1,185,988.800	
ARKEMA	650	60.250	39,162.500	
ADP	470	107.800	50,666.000	
GETLINK SE	4,114	16.430	67,593.020	
BOLLORE	8,529	5.230	44,606.670	
UCB SA	1,648	163.450	269,365.600	
KBC GROUP NV	2,994	84.180	252,034.920	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,067	72.000	76,824.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	13,189	61.960	817,190.440	
AGEAS	1,934	56.550	109,367.700	
D'IETEREN GROUP	296	176.900	52,362.400	
ELIA GROUP SA/NV	705	92.800	65,424.000	
SOFINA	210	253.600	53,256.000	
ARGENX SE	787	502.600	395,546.200	
PRYSMIAN SPA	3,856	55.800	215,164.800	
GENERALI	12,273	30.820	378,253.860	
MEDIOBANCA SPA	6,709	19.185	128,712.160	
TENARIS SA	5,705	15.550	88,712.750	

UNICREDIT SPA	18,162	56.150	1,019,796.300	
UNIPOL GRUPPO SPA	4,636	16.755	77,676.180	
TELECOM ITALIA SPA	143,071	0.375	53,651.620	
INTESA SANPAOLO	196,851	4.820	948,920.240	
POSTE ITALIANE SPA	6,337	18.670	118,311.790	
MONCLER SPA	3,226	50.700	163,558.200	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	1,602	54.350	87,068.700	
ENI SPA	27,790	14.002	389,115.580	
BPER BANCA	13,730	7.550	103,661.500	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	7,862	5.632	44,278.780	
BANCO BPM SPA	16,647	9.916	165,071.650	
DIASORIN SPA	277	93.320	25,849.640	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	4,568	10.140	46,319.520	
NEXI SPA	6,511	4.837	31,493.700	
BANCA MEDIOLANUM SPA	3,210	14.150	45,421.500	
LEONARDO SPA	5,263	48.610	255,834.430	
ENEL SPA	105,795	7.982	844,455.690	
SNAM SPA	27,553	5.256	144,818.560	
TERNA SPA	19,186	8.942	171,561.210	
FINECOBANK SPA	8,199	19.090	156,518.910	
STELLANTIS NV	26,415	8.483	224,078.440	
FERRARI NV	1,640	401.500	658,460.000	
TELEFONICA SA	54,478	4.594	250,271.930	
ENDESA SA	4,398	27.220	119,713.560	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	74,966	12.955	971,184.530	
IBERDROLA SA	75,788	16.205	1,228,144.540	
BANCO DE SABADELL SA	74,115	2.778	205,891.470	
BANKINTER SA	9,679	11.020	106,662.580	
REPSOL SA	15,621	12.255	191,435.350	
GRIFOLS SA	4,069	10.195	41,483.450	
BANCO SANTANDER SA	197,093	6.859	1,351,860.880	
AMADEUS IT GROUP SA	5,872	70.660	414,915.520	
CAIXABANK SA	51,415	7.300	375,329.500	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	17,844	3.726	66,486.740	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,317	56.350	130,562.950	
AENA SME SA	1,029	230.400	237,081.600	
CELLNEX TELECOM SA	6,891	32.970	227,196.270	
ACCIONA SA	291	145.200	42,253.200	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	14,189	45.720	648,721.080	

	RED ELECTRICA CORPORACION SA	5,772	17.730	102,337.560	
	UPM-KYMMENE OYJ	7,324	23.040	168,744.960	
	NOKIA OYJ	69,424	4.490	311,713.760	
	WARTSILA OYJ ABP	6,460	19.245	124,322.700	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	7,978	8.356	66,664.160	
	ELISA OYJ	2,022	45.540	92,081.880	
	SAMPO OYJ-A SHS	31,488	9.104	286,666.750	
	FORTUM OYJ	5,703	16.010	91,305.030	
	KESKO OYJ-B SHS	3,470	20.340	70,579.800	
	KONE OYJ-B	4,430	56.060	248,345.800	
	NESTE OYJ	5,676	10.395	59,002.020	
	ORION OYJ-CLASS B	1,543	63.300	97,671.900	
	METSO CORPORATION	8,549	10.795	92,286.450	
	NORDEA BANK ABP	41,005	12.420	509,282.100	
	VERBUND AG	876	68.300	59,830.800	
	OMV AG	2,041	44.540	90,906.140	
	ERSTE GROUP BANK AG	4,007	70.850	283,895.950	
	RYANAIR HOLDINGS PLC	12,206	23.280	284,155.680	
	AIB GROUP PLC	29,064	6.935	201,558.840	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	13,044	11.965	156,071.460	
	KINGSPAN GROUP PLC	2,010	76.100	152,961.000	
	JERONIMO MARTINS	3,591	21.560	77,421.960	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	42,031	3.609	151,689.870	
	GALP ENERGIA SGPS SA	5,978	15.780	94,332.840	
	EDP RENOVAVEIS SA	4,084	9.500	38,798.000	
	KERRY GROUP PLC-A	1,945	97.050	188,762.250	
ユーロ 小計				73,885,376.330 (12,306,348,281)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	20,000	51.400	1,028,000.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	32,000	32.750	1,048,000.000	
	MTR CORP	24,000	28.000	672,000.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	20,500	86.550	1,774,275.000	
	SINO LAND CO	54,000	8.300	448,200.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	38,052	47.400	1,803,664.800	
	WHARF HOLDINGS LTD	14,000	23.100	323,400.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	5,000	68.700	343,500.000	
	CLP HOLDINGS LTD	24,000	66.100	1,586,400.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	18,565	25.700	477,120.500	
	HONG KONG & CHINA GAS	162,027	6.800	1,101,783.600	

	HANG SENG BANK LTD	11,000	114.800	1,262,800.000	
	WH GROUP LTD	129,000	7.520	970,080.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	17,000	413.600	7,031,200.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	28,052	33.450	938,339.400	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	8,500	51.500	437,750.000	
	AIA GROUP LTD	152,000	69.150	10,510,800.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	17,000	26.000	442,000.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	26,000	20.950	544,700.000	
	SANDS CHINA LTD	32,200	14.920	480,424.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	19,500	89.600	1,747,200.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	52,000	34.750	1,807,000.000	
香港・ドル 小計				36,778,637.300 (676,359,139)	
合計				132,137,357,958 [132,137,357,958]	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約 権証券	カナダ・ドル	CONSTELLATION SOFTWARE IN- 28	261.000	0.000	
	カナダ・ドル 小計			0.000 (0)	
新株予約権証券 合計				0 [0]	
投資証券	アメリカ・ドル	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,860	383,494.800	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	4,392	689,104.800	
		BXP INC	2,058	148,381.800	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	1,465	333,770.950	
		EQUITY RESIDENTIAL	4,626	318,638.880	
		EQUINIX INC	1,286	1,147,935.040	
		AMERICAN TOWER CORP	6,257	1,344,003.600	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	4,767	173,518.800	
		KIMCO REALTY CORP	9,371	195,197.930	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	3,800	175,560.000	
		INVITATION HOMES INC	8,188	274,625.520	
		VICI PROPERTIES INC	14,188	455,718.560	
		VENTAS INC	5,894	376,390.840	
		WEYERHAEUSER CO	10,211	273,654.800	
		CROWN CASTLE INTL CORP	5,883	578,828.370	

	IRON MOUNTAIN INC	3,972	403,515.480	
	SUN COMMUNITIES INC	1,787	220,891.070	
	PROLOGIS INC	12,536	1,344,862.080	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,237	161,310.070	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	1,545	179,405.400	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	908	258,289.680	
	WELLTOWER INC	8,755	1,334,262.000	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	9,752	169,489.760	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,626	243,656.100	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,366	147,543.760	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	7,913	151,771.340	
	REALTY INCOME CORP	11,786	679,345.040	
	PUBLIC STORAGE	2,101	619,689.950	
	REGENCY CENTERS CORP	2,261	158,835.250	
	UDR INC	4,280	176,464.400	
	WP CAREY INC	2,962	187,613.080	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	4,523	789,127.810	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	2,889	432,194.400	
アメリカ・ドル 小計			14,527,091.360 (2,098,002,534)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	9,796	60,343.360	
	SEGRO PLC	17,980	124,349.680	
イギリス・ポンド 小計			184,693.040 (36,131,499)	
オーストラリア・ドル	TRANSURBAN GROUP	41,021	593,573.870	
	APA GROUP	16,458	138,247.200	
	SCENTRE GROUP	71,825	264,316.000	
	STOCKLAND	30,751	172,513.110	
	GOODMAN GROUP	26,815	911,173.700	
	VICINITY CENTRES	50,371	127,942.340	
オーストラリア・ドル 小計			2,207,766.220 (207,022,238)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	54,600	142,506.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	88,426	188,347.380	

シンガポール・ドル 小計			330,853.380 (37,237,548)	
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,592	131,881.280	
	GECINA SA	578	54,910.000	
	KLEPIERRE	2,896	96,320.960	
	COVIVIO	652	33,284.600	
ユーロ 小計			316,396.840 (52,699,058)	
香港・ドル	LINK REIT	36,600	1,539,030.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	51,000	580,380.000	
香港・ドル 小計			2,119,410.000 (38,975,950)	
投資証券 合計			2,470,068,827 [2,470,068,827]	
合計			2,470,068,827 [2,470,068,827]	

新株予約権証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 新株予約 権証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 527銘柄	98%	-	2.0%	76.3%
	投資証券 33銘柄				
イギリス・ポンド	株式 71銘柄	99.3%	-	0.7%	4.0%
	投資証券 2銘柄				
イスラエル・シェケル	株式 8銘柄	100%	-	-	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 42銘柄	91.6%	-	8.4%	1.8%
	投資証券 6銘柄				
カナダ・ドル	株式 83銘柄	100%	0%	-	3.2%
	新株予約権証券 1銘柄				
シンガポール・ドル	株式 13銘柄	92.7%	-	7.3%	0.4%
	投資証券 2銘柄				

スイス・フラン	株式	42銘柄	100%	-%	-%	2.6%
スウェーデン・クローナ	株式	40銘柄	100%	-%	-%	0.9%
デンマーク・クローネ	株式	15銘柄	100%	-%	-%	0.7%
ニュージーランド・ドル	株式	5銘柄	100%	-%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式	11銘柄	100%	-%	-%	0.2%
ユーロ	株式	213銘柄	99.6%	-%	0.4%	9.2%
	投資証券	4銘柄				
香港・ドル	株式	22銘柄	94.6%	-%	5.4%	0.5%
	投資証券	2銘柄				

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(2024年6月18日から2025年6月16日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	36,545,362	83,269,695
親投資信託受益証券	26,105,793,752	29,217,450,644
未収入金	1,309,000	36,153,000
流動資産合計	26,143,648,114	29,336,873,339
資産合計	26,143,648,114	29,336,873,339
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	229,306,510	289,882,647
未払解約金	-	34,734,147
未払受託者報酬	1,718,969	3,987,927
未払委託者報酬	33,090,978	76,768,461
その他未払費用	429,658	996,908
流動負債合計	264,546,115	406,370,090
負債合計	264,546,115	406,370,090
純資産の部		
元本等		
元本	※1 9,172,260,424	※1 9,995,953,351
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	16,706,841,575	18,934,549,898
（分配準備積立金）	3,810,379,631	1,590,045,675
元本等合計	25,879,101,999	28,930,503,249
純資産合計	25,879,101,999	28,930,503,249
負債純資産合計	26,143,648,114	29,336,873,339

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期 自 2023年6月16日 至 2024年6月17日	第9期 自 2024年6月18日 至 2025年6月16日
営業収益		
受取利息	6,085	161,942
有価証券売買等損益	4,155,617,949	△ 439,661,108
営業収益合計	4,155,624,034	△ 439,499,166
営業費用		
支払利息	1,882	-
受託者報酬	2,849,166	7,027,739
委託者報酬	54,848,068	135,285,683
その他費用	712,128	1,756,787
営業費用合計	58,411,244	144,070,209
営業利益又は営業損失（△）	4,097,212,790	△ 583,569,375
経常利益又は経常損失（△）	4,097,212,790	△ 583,569,375
当期純利益又は当期純損失（△）	4,097,212,790	△ 583,569,375
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（△）	635,127,963	△ 1,106,357,329
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,901,900,664	16,706,841,575
剰余金増加額又は欠損金減少額	12,346,975,117	21,385,804,387
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	12,346,975,117	21,385,804,387
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,774,812,523	19,391,001,371
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,774,812,523	19,391,001,371
分配金	※ 1 229,306,510	※ 1 289,882,647
期末剰余金又は期末欠損金（△）	16,706,841,575	18,934,549,898

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2024年6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2024年6月17日としており、2025年6月15日が休日のため、当計算期間末日を2025年6月16日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
1. ※1 期首元本額	3,575,653,475円	9,172,260,424円
期中追加設定元本額	7,956,911,859円	11,344,974,483円
期中一部解約元本額	2,360,304,910円	10,521,281,556円
2. 計算期間末日における受益権の総数	9,172,260,424口	9,995,953,351口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

※1 分配金の計算過程	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 (244,206,416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 (3,217,878,411円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (12,896,461,944円)及び分配準備積立金(577,601,314円)より分配対象額は16,936,148,085円(1万口当たり18,464.53円)であり、うち229,306,510円(1万口当たり250円)を分配金額としております。	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 (348,213,496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 (174,574,458円)、投資信託約款に規定される収益調整金 (17,344,504,223円)及び分配準備積立金(1,357,140,368円)より分配対象額は19,224,432,545円(1万口当たり19,232.22円)であり、うち289,882,647円(1万口当たり290円)を分配金額としております。

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

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	第9期 2025年6月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	3,553,702,690	611,481,032
合計	3,553,702,690	611,481,032

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	2.8215円	2.8942円

(1万口当たり純資産額)	(28,215円)	(28,942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	4,227,306,361	29,217,450,644	
親投資信託受益証券 合計			29,217,450,644	
合計			29,217,450,644	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年6月17日現在 金額（円）	2025年6月16日現在 金額（円）

資産の部		
流動資産		
預金	2,236,979,602	1,931,267,490
コール・ローン	11,966,362,644	6,016,732,896
株式	545,633,714,414	659,045,294,969
投資証券	10,592,747,681	12,370,196,711
派生商品評価勘定	569,796,005	915,727,801
未収入金	5,417,991	19,010,700
未収配当金	663,562,906	678,769,379
差入委託証拠金	11,832,320,065	11,917,877,863
流動資産合計	583,500,901,308	692,894,877,809
資産合計	583,500,901,308	692,894,877,809
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	237,964,360	107,927,544
未払解約金	82,052,800	142,631,200
流動負債合計	320,017,160	250,558,744
負債合計	320,017,160	250,558,744
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	87,815,492,483	100,214,393,190
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	495,365,391,665	592,429,925,875
元本等合計	583,180,884,148	692,644,319,065
純資産合計	583,180,884,148	692,644,319,065
負債純資産合計	583,500,901,308	692,894,877,809

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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6月17日現在	2025年6月16日現在
1. ※1 期首	2023年6月16日	2024年6月18日
期首元本額	73,496,843,463円	87,815,492,483円
期中追加設定元本額	19,734,159,966円	22,464,610,843円
期中一部解約元本額	5,415,510,946円	10,065,710,136円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国株式インデックスV A	231,333,447円	202,501,703円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	1,404,824円	1,294,757円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	18,302,724円	13,002,845円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	3,622,837円	2,898,468円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	105,788,926円	79,141,486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)	104,416,847円	132,624,384円
ダイワバランスファンド2023-01(適格機関投資家専用)	80,511,800円	-円
外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	3,590,641,743円	9,833,826,354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）	769,541,646円	801,703,799円
ダイワファンドラップ 外国株式 インデックス（為替ヘッジな し）	5,260,608,935円	6,919,533,009円
ダイワファンドラップオンライ ン 外国株式インデックス エ マージングプラス（為替ヘッジ なし）	565,612,570円	630,101,185円
D－I's 外国株式インデック ス	16,220,910円	16,195,205円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	48,106,388円	46,218,358円
iFree 外国株式インデック ス（為替ヘッジなし）	8,593,037,781円	10,941,106,395円
iFree 8資産バランス	1,461,674,755円	1,662,950,033円
iFree 年金バランス	334,612,172円	384,329,560円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2060	16,396,142円	28,736,837円
DCダイワ外国株式インデック ス	50,051,961,691円	51,421,990,357円
ダイワ・ライフ・バランス30	477,517,025円	448,451,441円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,037,795,264円	1,058,751,948円
ダイワ・ライフ・バランス70	1,023,255,355円	1,050,740,402円
大和DC海外株式インデックス ファンド	1,358,344,119円	1,035,513,077円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	9,664,774円	8,244,466円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	11,406,458円	12,252,822円
ダイワつみたてインデックス外 国株式	2,496,704,868円	3,188,082,289円
ダイワつみたてインデックスバ ランス30	1,881,563円	1,936,492円
ダイワつみたてインデックスバ ランス50	2,480,657円	3,052,509円
ダイワつみたてインデックスバ ランス70	5,066,336円	47,820,292円
ダイワ先進国株式インデックス （為替ヘッジなし）（投資一任 専用）	15,003,878円	19,045,605円

ダイワ世界バランスファンド 4 0 V A	43,911,825円	37,716,041円
ダイワ世界バランスファンド 6 0 V A	29,814,954円	28,624,114円
ダイワ・バランスファンド 3 5 V A	747,327,456円	581,067,180円
ダイワ・バランスファンド 2 5 V A（適格機関投資家専用）	42,849,718円	32,496,251円
ダイワバランスファンド2021-02 （適格機関投資家専用）	126,698,728円	105,554,382円
スタイル9（4資産分散・保守 型）	128,545円	549,705円
スタイル9（4資産分散・バラン ス型）	1,053,961円	3,716,390円
スタイル9（4資産分散・積極 型）	1,493,797円	5,558,711円
スタイル9（6資産分散・保守 型）	78,128円	208,338円
スタイル9（6資産分散・バラン ス型）	1,870,987円	6,948,523円
スタイル9（6資産分散・積極 型）	2,371,238円	7,743,551円
スタイル9（8資産分散・保守 型）	93,292円	294,819円
スタイル9（8資産分散・バラン ス型）	1,361,677円	5,369,709円
スタイル9（8資産分散・積極 型）	4,133,920円	14,734,328円
全世界株式インデックス・ファ ンド（オール・カントリー）	-円	104,771,525円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,290,475,524円	1,108,583,684円
ダイワ・ノーロード 外国株式 ファンド	422,583,457円	404,953,530円
ダイワ外国株式インデックス （為替ヘッジなし）（ダイワ S MA 専用）	3,931,003,426円	4,227,306,361円
ダイワ投信倶楽部外国株式イン デックス	3,177,264,120円	3,352,711,410円
ダイワライフスタイル 2 5	7,154,772円	6,398,214円
ダイワライフスタイル 5 0	34,512,063円	31,141,882円
ダイワライフスタイル 7 5	29,568,667円	27,721,857円

ダイワバランスファンド2023-08 （適格機関投資家専用）	80,244,732円	-円
ダイワバランスファンド2024-01 （適格機関投資家専用）	78,139,734円	64,513,249円
ダイワバランスファンド2024-05 （適格機関投資家専用）	68,441,327円	63,663,358円
計	87,815,492,483円	100,214,393,190円
2. 期末日における受益権の総数	87,815,492,483口	100,214,393,190口

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	73,225,509,726	5,816,042,911
投資証券	406,178,693	△685,665,949
合計	73,631,688,419	5,130,376,962

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種類	2024年6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買建	26,529,692,703	-	26,834,236,108	304,543,405	20,056,087,739	-	20,776,975,256	720,887,517
合計	26,529,692,703	-	26,834,236,108	304,543,405	20,056,087,739	-	20,776,975,256	720,887,517

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2. 通貨関連

種類	2024年6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
買建	11,909,403,160	-	11,936,691,400	27,288,240	6,109,954,260	-	6,196,867,000	86,912,740
アメリカ・ドル	6,609,608,630	-	6,644,991,600	35,382,970	2,449,786,520	-	2,478,004,000	28,217,480
イギリス・ ポンド	578,355,880	-	578,091,800	△264,080	366,614,770	-	370,859,100	4,244,330
オーストラリ ア・ドル	698,436,580	-	696,371,200	△2,065,380	508,265,450	-	514,657,000	6,391,550
カナダ・ドル	1,516,785,440	-	1,510,344,000	△6,441,440	1,211,739,650	-	1,230,992,000	19,252,350
スイス・フラン	1,028,102,860	-	1,042,648,000	14,545,140	839,659,670	-	853,622,400	13,962,730
ユーロ	1,478,113,770	-	1,464,244,800	△13,868,970	733,888,200	-	748,732,500	14,844,300
合計	11,909,403,160	-	11,936,691,400	27,288,240	6,109,954,260	-	6,196,867,000	86,912,740

(注) 1. 時価の算定方法

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

- 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6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	6.6410円	6.9116円
(1万口当たり純資産額)	(66,410円)	(69,116円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	8,000	237.180	1,897,440.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	44,900	196.270	8,812,523.000	
	FIRST SOLAR INC	7,000	175.200	1,226,400.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	11,800	158.190	1,866,642.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,600	103.300	888,380.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	26,400	59.840	1,579,776.000	
	ABBOTT LABORATORIES	117,566	135.620	15,944,300.920	
	HOWMET AEROSPACE INC	26,083	171.200	4,465,409.600	
	VERISK ANALYTICS INC	9,500	310.410	2,948,895.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	24,100	40.330	971,953.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	82,200	92.490	7,602,678.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,300	673.010	2,220,933.000	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	35,800	79.350	2,840,730.000	
	AFLAC INC	35,100	102.180	3,586,518.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	8,000	217.500	1,740,000.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	11,000	138.170	1,519,870.000	
	ADOBE INC	28,920	391.680	11,327,385.600	

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	11,300	99.930	1,129,209.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,500	239.110	1,793,325.000	
GARMIN LTD	10,500	201.320	2,113,860.000	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	15,100	280.370	4,233,587.000	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	44,000	224.290	9,868,760.000	
WR BERKLEY CORP	20,613	73.290	1,510,726.770	
AUTOZONE INC	1,220	3,642.600	4,443,972.000	
DOLLAR TREE INC	13,871	95.190	1,320,380.490	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	80,300	16.990	1,364,297.000	
DR HORTON INC	19,216	123.080	2,365,105.280	
AUTODESK INC	14,500	292.160	4,236,320.000	
MOODY'S CORP	11,000	471.880	5,190,680.000	
DEVON ENERGY CORP	41,500	35.110	1,457,065.000	
ATMOS ENERGY CORP	10,800	152.990	1,652,292.000	
ALLIANT ENERGY CORP	17,500	61.080	1,068,900.000	
CITIGROUP INC	127,573	76.360	9,741,474.280	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	27,600	306.820	8,468,232.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	36,200	102.900	3,724,980.000	
DOMINO'S PIZZA INC	2,230	452.150	1,008,294.500	
HESS CORP	20,000	142.260	2,845,200.000	
DAVITA INC	3,050	136.120	415,166.000	
DANAHER CORP	43,650	200.670	8,759,245.500	
FORTIVE CORP	23,100	69.430	1,603,833.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	39,000	178.440	6,959,160.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	32,600	52.000	1,695,200.000	
APPLE INC	1,018,800	196.450	200,143,260.000	
BOEING CO/THE	51,000	200.320	10,216,320.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,615	146.360	1,553,611.400	
BECTON DICKINSON AND CO	19,499	172.210	3,357,922.790	
LEIDOS HOLDINGS INC	8,300	149.160	1,238,028.000	
NISOURCE INC	31,900	39.520	1,260,688.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,100	93.540	757,674.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	48,671	88.600	4,312,250.600	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	286,004	43.010	12,301,032.040	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	90,850	487.540	44,293,009.000	
ANSYS INC	6,000	338.010	2,028,060.000	
TRUIST FINANCIAL CORP	88,717	38.970	3,457,301.490	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	49,500	136.410	6,752,295.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	137,900	49.750	6,860,525.000	

JPMORGAN CHASE & CO	189,470	264.950	50,200,076.500	
T ROWE PRICE GROUP INC	15,100	91.580	1,382,858.000	
LKQ CORP	17,300	38.120	659,476.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	12,412	26.440	328,173.280	
CADENCE DESIGN SYS INC	18,600	300.000	5,580,000.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,500	501.680	3,260,920.000	
DOLLAR GENERAL CORP	15,000	111.680	1,675,200.000	
SERVICENOW INC	14,100	988.660	13,940,106.000	
CATERPILLAR INC	32,400	357.050	11,568,420.000	
BROWN & BROWN INC	16,600	106.620	1,769,892.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	17,800	38.050	677,290.000	
CMS ENERGY CORP	20,300	70.530	1,431,759.000	
DELTA AIR LINES INC	11,100	47.040	522,144.000	
CORNING INC	55,200	49.600	2,737,920.000	
CISCO SYSTEMS INC	269,650	64.090	17,281,868.500	
MORGAN STANLEY	82,052	129.490	10,624,913.480	
DECKERS OUTDOOR CORP	10,300	101.480	1,045,244.000	
MSCI INC	5,300	542.730	2,876,469.000	
FAIR ISAAC CORP	1,700	1,784.570	3,033,769.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,200	538.090	1,183,798.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	15,100	79.160	1,195,316.000	
BROADCOM INC	302,720	248.700	75,286,464.000	
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,900	283.350	821,715.000	
CNH INDUSTRIAL NV	59,200	12.570	744,144.000	
DICK'S SPORTING GOODS INC	3,900	176.740	689,286.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	8,900	307.990	2,741,111.000	
DTE ENERGY COMPANY	14,100	135.220	1,906,602.000	
CENTENE CORP	33,507	55.220	1,850,256.540	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,100	225.810	1,603,251.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	29,700	40.330	1,197,801.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,400	316.640	5,509,536.000	
GARTNER INC	5,250	404.970	2,126,092.500	
DOMINION ENERGY INC	57,841	55.510	3,210,753.910	
MONSTER BEVERAGE CORP	49,500	63.060	3,121,470.000	
DEERE & CO	17,500	509.590	8,917,825.000	
QUANTA SERVICES INC	10,100	358.260	3,618,426.000	
POOL CORP	2,600	288.900	751,140.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	16,684	74.620	1,244,960.080	
BURLINGTON STORES INC	4,300	228.830	983,969.000	

NASDAQ INC	29,300	85.590	2,507,787.000	
TARGA RESOURCES CORP	14,800	174.810	2,587,188.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,600	123.870	569,802.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	24,500	103.960	2,547,020.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,400	139.850	755,190.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,900	221.910	1,087,359.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	10,500	282.550	2,966,775.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	3,800	298.140	1,132,932.000	
CARLISLE COS INC	3,000	356.940	1,070,820.000	
IDEX CORP	5,200	177.820	924,664.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	52,200	90.260	4,711,572.000	
ROLLINS INC	19,807	56.880	1,126,622.160	
AECOM	8,900	111.990	996,711.000	
WATSCO INC	2,400	431.990	1,036,776.000	
GRACO INC	11,300	83.540	944,002.000	
AMETEK INC	15,700	176.960	2,778,272.000	
CHURCH & DWIGHT CO INC	16,700	97.090	1,621,403.000	
HEICO CORP	3,000	305.500	916,500.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,600	419.900	1,091,740.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	17,300	60.100	1,039,730.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,000	579.720	1,739,160.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	30,160	990.210	29,864,733.600	
RPM INTERNATIONAL INC	8,600	108.080	929,488.000	
RELIANCE INC	3,600	310.120	1,116,432.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	91,900	50.240	4,617,056.000	
CUMMINS INC	9,400	319.530	3,003,582.000	
CDW CORP/DE	9,000	170.420	1,533,780.000	
COSTAR GROUP INC	28,700	81.160	2,329,292.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	13,000	160.180	2,082,340.000	
INTERACTIVE BROKERS GRO-CL A	7,400	202.160	1,495,984.000	
MERCADOLIBRE INC	3,090	2,371.980	7,329,418.200	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,000	179.100	895,500.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	16,316	243.880	3,979,146.080	
DEXCOM INC	26,600	81.990	2,180,934.000	
NORDSON CORP	3,690	214.360	790,988.400	
COPART INC	62,300	48.590	3,027,157.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	13,000	154.910	2,013,830.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,800	177.850	853,680.000	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	5,500	374.080	2,057,440.000	

TRANSDIGM GROUP INC	3,890	1,439.610	5,600,082.900	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,800	124.390	845,852.000	
KINDER MORGAN INC	135,581	27.640	3,747,458.840	
HCA HEALTHCARE INC	12,500	371.180	4,639,750.000	
COTERRA ENERGY INC	51,900	26.700	1,385,730.000	
T-MOBILE US INC	30,827	228.000	7,028,556.000	
ZILLOW GROUP INC - C	11,150	70.370	784,625.500	
EMCOR GROUP INC	3,100	477.920	1,481,552.000	
COCA-COLA CO/THE	277,050	71.020	19,676,091.000	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,400	92.850	1,429,890.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	9,350	114.260	1,068,331.000	
CSX CORP	128,100	32.120	4,114,572.000	
EXPEDIA GROUP INC	8,425	165.630	1,395,432.750	
AMAZON.COM INC	647,400	212.100	137,313,540.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	39,700	75.150	2,983,455.000	
EXXON MOBIL CORP	293,009	112.120	32,852,169.080	
EVEREST GROUP LTD	3,300	334.610	1,104,213.000	
EOG RESOURCES INC	37,400	125.280	4,685,472.000	
EQT CORP	38,500	56.840	2,188,340.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	10,000	77.030	770,300.000	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	700	1,818.680	1,273,076.000	
CENCORA INC	12,600	295.540	3,723,804.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	19,400	117.080	2,271,352.000	
FORD MOTOR CO	264,723	10.430	2,761,060.890	
ENTEGRIS INC	10,300	75.340	776,002.000	
MICROSTRATEGY INC-CL A	16,900	382.870	6,470,503.000	
AERCAP HOLDINGS NV	12,200	115.840	1,413,248.000	
FORTINET INC	44,400	100.830	4,476,852.000	
MARKEL CORP	860	1,928.770	1,658,742.200	
NEXTERA ENERGY INC	139,580	74.780	10,437,792.400	
FREEMPORT-MCMORAN INC	97,408	40.940	3,987,883.520	
INSULET CORP	4,800	304.630	1,462,224.000	
US BANCORP	105,600	42.990	4,539,744.000	
UNITED RENTALS INC	4,500	694.840	3,126,780.000	
F5 NETWORKS INC	4,000	286.610	1,146,440.000	
SUPER MICRO COMPUTER INC	34,200	41.560	1,421,352.000	
FASTENAL CO	76,200	42.170	3,213,354.000	
FISERV INC	37,833	163.020	6,167,535.660	
GENERAL ELECTRIC CO	72,306	236.600	17,107,599.600	

AXON ENTERPRISE INC	5,000	780.630	3,903,150.000	
GENERAL MOTORS CO	65,200	48.650	3,171,980.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	15,500	283.000	4,386,500.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	21,150	613.540	12,976,371.000	
ALPHABET INC-CL A	395,300	174.670	69,047,051.000	
ALPHABET INC-CL C	335,240	175.880	58,962,011.200	
OWENS CORNING	5,700	134.490	766,593.000	
GENERAL MILLS INC	37,100	53.560	1,987,076.000	
FIRSTENERGY CORP	37,218	40.340	1,501,374.120	
GENUINE PARTS CO	9,450	119.680	1,130,976.000	
FIFTH THIRD BANCORP	45,300	37.980	1,720,494.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	12,750	256.990	3,276,622.500	
HALLIBURTON CO	58,400	23.190	1,354,296.000	
HOME DEPOT INC	67,350	354.660	23,886,351.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	99,000	15.510	1,535,490.000	
HERSHEY CO/THE	10,100	169.120	1,708,112.000	
HUMANA INC	8,200	235.260	1,929,132.000	
NXP SEMICONDUCTORS NV	17,200	210.900	3,627,480.000	
HP INC	63,900	23.840	1,523,376.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	89,100	17.650	1,572,615.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	25,500	90.990	2,320,245.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	60,303	26.080	1,572,702.240	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	62,900	277.220	17,437,138.000	
HUBBELL INC	3,700	382.030	1,413,511.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	34,000	45.890	1,560,260.000	
ZOETIS INC	30,300	164.330	4,979,199.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	15,199	421.390	6,404,706.610	
CHENIERE ENERGY INC	15,100	238.340	3,598,934.000	
HYATT HOTELS CORP - CL A	2,900	130.560	378,624.000	
ALLEGION PLC	5,850	135.300	791,505.000	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	7,700	111.290	856,933.000	
WASTE CONNECTIONS INC	17,537	190.670	3,343,779.790	
JUNIPER NETWORKS INC	16,900	35.770	604,513.000	
JM SMUCKER CO/THE	7,300	95.720	698,756.000	
JOHNSON & JOHNSON	163,300	157.100	25,654,430.000	
ABBVIE INC	119,872	191.080	22,905,141.760	
HOLOGIC INC	15,300	64.750	990,675.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	22,500	130.840	2,943,900.000	
KROGER CO	42,500	65.560	2,786,300.000	

KLA CORP	9,100	867.670	7,895,797.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	14,300	486.450	6,956,235.000	
CORPAY INC	4,600	323.250	1,486,950.000	
LOWE'S COS INC	38,000	217.270	8,256,260.000	
ELI LILLY & CO	54,685	819.360	44,806,701.600	
LAM RESEARCH CORP	87,000	89.520	7,788,240.000	
LOEWS CORP	12,300	88.660	1,090,518.000	
MCDONALD'S CORP	48,450	301.910	14,627,539.500	
3M CO	36,590	142.320	5,207,488.800	
META PLATFORMS INC CLASS A	148,500	682.870	101,406,195.000	
S&P GLOBAL INC	21,339	501.490	10,701,295.110	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,200	542.470	2,278,374.000	
PHILLIPS 66	27,500	122.150	3,359,125.000	
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	11,200	196.820	2,204,384.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	17,200	74.010	1,272,972.000	
METLIFE INC	39,300	77.350	3,039,855.000	
MARVELL TECHNOLOGY INC	58,700	67.190	3,944,053.000	
ARISTA NETWORKS INC	72,700	92.350	6,713,845.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11,398	408.100	4,651,523.800	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,500	1,155.420	1,733,130.000	
BAKER HUGHES CO	67,123	39.040	2,620,481.920	
ROCKWELL AUTOMATION INC	7,700	317.850	2,447,445.000	
MERCK & CO. INC.	170,521	81.710	13,933,270.910	
DUPONT DE NEMOURS INC	28,451	66.870	1,902,518.370	
MASCO CORP	14,400	61.880	891,072.000	
M & T BANK CORP	11,099	178.030	1,975,954.970	
MARSH & MCLENNAN COS	33,470	217.380	7,275,708.600	
HEICO CORP-CLASS A	5,120	238.790	1,222,604.800	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	15,902	254.990	4,054,850.980	
WORKDAY INC-CLASS A	14,600	244.540	3,570,284.000	
BLOCK INC CLASS A	38,012	61.570	2,340,398.840	
TRANSUNION	13,300	83.980	1,116,934.000	
VISTRA CORP	23,100	173.750	4,013,625.000	
NETAPP INC	14,000	100.490	1,406,860.000	
NIKE INC -CL B	79,900	60.530	4,836,347.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	15,400	248.600	3,828,440.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	36,500	65.730	2,399,145.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	13,205	145.620	1,922,912.100	
NORTHROP GRUMMAN CORP	9,300	516.720	4,805,496.000	

NEWMONT CORP	76,411	57.900	4,424,196.900	
MCKESSON CORP	8,500	728.200	6,189,700.000	
XYLEM INC	16,500	125.500	2,070,750.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	105,500	184.330	19,446,815.000	
NUCOR CORP	15,600	121.920	1,901,952.000	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	10,800	710.850	7,677,180.000	
GODADDY INC - CLASS A	9,600	175.740	1,687,104.000	
EVERGY INC	15,650	67.985	1,063,965.250	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	47,724	46.450	2,216,779.800	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,750	356.760	624,330.000	
OKTA INC	11,300	97.480	1,101,524.000	
WIX.COM LTD	3,710	149.100	553,161.000	
EQUITABLE HOLDINGS INC	20,900	51.610	1,078,649.000	
KKR & CO INC	42,200	121.330	5,120,126.000	
PAYCHEX INC	22,000	153.220	3,370,840.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	58,500	89.910	5,259,735.000	
ALTRIA GROUP INC	114,300	59.810	6,836,283.000	
P G & E CORP	149,000	13.640	2,032,360.000	
PFIZER INC	384,313	24.540	9,431,041.020	
CIGNA CORP	18,400	317.400	5,840,160.000	
DELL TECHNOLOGIES -C	21,901	109.560	2,399,473.560	
XCEL ENERGY INC	39,100	67.620	2,643,942.000	
STERIS PLC	6,700	241.340	1,616,978.000	
SEA LTD-ADR	26,800	154.380	4,137,384.000	
FOX CORP - CLASS B	9,433	49.300	465,046.900	
FOX CORP - CLASS A	14,799	53.690	794,558.310	
STRYKER CORP	23,280	377.300	8,783,544.000	
DOW INC	47,718	29.900	1,426,768.200	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	7,900	137.260	1,084,354.000	
ZOOM COMMUNICATIONS INC CLASS A	17,100	76.630	1,310,373.000	
PARKER HANNIFIN CORP	8,800	654.090	5,755,992.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	127,600	83.930	10,709,468.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	158,867	160.280	25,463,202.760	
EXELON CORP	68,422	43.250	2,959,251.500	
INGERSOLL-RAND INC	27,408	80.500	2,206,344.000	
NVR INC	210	7,225.670	1,517,390.700	
CONOCOPHILLIPS	85,603	96.960	8,300,066.880	
TWILIO INC - A	9,800	113.390	1,111,222.000	

DOCUSIGN INC	13,800	74.060	1,022,028.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,600	245.000	882,000.000	
PURE STORAGE INC - CLASS A	21,000	51.650	1,084,650.000	
PEPSICO INC	93,000	130.850	12,169,050.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,320	386.690	1,283,810.800	
MONGODB INC	5,600	205.630	1,151,528.000	
SNAP INC - A	73,400	7.940	582,796.000	
CORTEVA INC	46,368	72.430	3,358,434.240	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	24,100	102.970	2,481,577.000	
AMCOR PLC	156,700	9.100	1,425,970.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,800	480.620	8,074,416.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,300	141.440	1,881,152.000	
ACCENTURE PLC-CL A	42,500	311.710	13,247,675.000	
PENTAIR PLC	11,275	96.620	1,089,390.500	
QUALCOMM INC	75,000	154.720	11,604,000.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	15,200	75.900	1,153,680.000	
DATADOG INC - CLASS A	19,500	120.450	2,348,775.000	
PINTEREST INC- CLASS A	40,300	33.840	1,363,752.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,300	529.240	3,863,452.000	
REPUBLIC SERVICES INC	14,900	251.260	3,743,774.000	
BOOKING HOLDINGS INC	2,300	5,298.380	12,186,274.000	
ROSS STORES INC	22,300	131.845	2,940,143.500	
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,130	188.560	1,155,872.800	
RESMED INC	10,000	249.340	2,493,400.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	7,630	180.210	1,375,002.300	
HUBSPOT INC	3,380	554.590	1,874,514.200	
REVVITY INC	8,200	93.530	766,946.000	
CARRIER GLOBAL CORP	52,687	71.240	3,753,421.880	
OTIS WORLDWIDE CORP	26,838	95.820	2,571,617.160	
AVANTOR INC	45,200	13.070	590,764.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	16,000	46.190	739,040.000	
DYNATRACE INC	20,300	53.030	1,076,509.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	30,700	67.960	2,086,372.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	61,385	21.510	1,320,391.350	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	25,100	34.840	874,484.000	
CHEVRON CORP	112,418	145.910	16,402,910.380	
ZSCALER INC	6,900	301.950	2,083,455.000	
EDISON INTERNATIONAL	26,100	48.320	1,261,152.000	
TESLA INC	196,250	325.310	63,842,087.500	

SNOWFLAKE INC-CLASS A	21,600	208.180	4,496,688.000	
GEN DIGITAL INC	35,500	29.780	1,057,190.000	
SYNOPSYS INC	10,500	478.860	5,028,030.000	
CARVANA CO	8,300	297.030	2,465,349.000	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	21,000	171.970	3,611,370.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	6,305	388.720	2,450,879.600	
DOORDASH INC - A	24,350	218.960	5,331,676.000	
ROBLOX CORP -CLASS A	36,400	97.170	3,536,988.000	
AIRBNB INC-CLASS A	29,600	135.540	4,011,984.000	
CBRE GROUP INC - A	20,400	132.970	2,712,588.000	
SOUTHERN CO/THE	74,400	90.350	6,722,040.000	
SYSCO CORP	33,200	74.290	2,466,428.000	
TRAVELERS COS INC/THE	15,403	263.470	4,058,228.410	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,400	111.500	490,600.000	
STEEL DYNAMICS INC	9,650	133.480	1,288,082.000	
SCHLUMBERGER LTD	92,052	36.300	3,341,487.600	
AT&T INC	486,491	28.190	13,714,181.290	
ON SEMICONDUCTOR CORP	28,300	51.020	1,443,866.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	16,200	335.880	5,441,256.000	
SEMPRA ENERGY	44,300	74.080	3,281,744.000	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	10,700	49.340	527,938.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	145,300	137.400	19,964,220.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	14,350	127.270	1,826,324.500	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	13,600	242.710	3,300,856.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	61,700	195.000	12,031,500.000	
SALESFORCE.COM INC	65,166	258.400	16,838,894.400	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	27,109	132.110	3,581,369.990	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	44,734	101.970	4,561,525.980	
TERADYNE INC	10,900	83.080	905,572.000	
UNION PACIFIC CORP	40,680	223.370	9,086,691.600	
MARATHON PETROLEUM CORP	21,088	166.150	3,503,771.200	
RTX CORP	90,479	145.690	13,181,885.510	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	49,800	100.000	4,980,000.000	
IQVIA HOLDINGS INC	12,104	156.890	1,898,996.560	
AMEREN CORPORATION	18,400	95.700	1,760,880.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	62,066	313.530	19,459,552.980	
APPROVIN CORP CLASS A	15,800	364.490	5,758,942.000	
TOAST INC CLASS A	30,300	41.540	1,258,662.000	

VERISIGN INC	5,800	279.900	1,623,420.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	53,400	13.420	716,628.000	
ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	49,900	72.600	3,622,740.000	
VALERO ENERGY CORP	21,342	134.110	2,862,175.620	
ULTA BEAUTY INC	3,100	459.170	1,423,427.000	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	17,788	55.270	983,142.760	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,930	171.070	672,305.100	
ELEVANCE HEALTH INC	15,400	384.550	5,922,070.000	
WALT DISNEY CO/THE	122,562	117.940	14,454,962.280	
WELLS FARGO & CO	221,022	72.360	15,993,151.920	
WASTE MANAGEMENT INC	27,300	236.500	6,456,450.000	
WILLIAMS COS INC	82,800	59.780	4,949,784.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	36,100	51.540	1,860,594.000	
WALMART INC	298,800	94.440	28,218,672.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	13,500	91.280	1,232,280.000	
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	166,100	4.570	759,077.000	
WABTEC CORP	11,611	201.700	2,341,938.700	
TJX COMPANIES INC	75,700	123.910	9,379,987.000	
WATERS CORP	4,100	342.300	1,403,430.000	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	5,700	74.000	421,800.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	3,500	283.610	992,635.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,763	296.330	2,004,079.790	
WILLIAMS-SONOMA INC	8,400	153.960	1,293,264.000	
WESTERN DIGITAL CORP	23,500	55.700	1,308,950.000	
WEC ENERGY GROUP INC	21,700	105.110	2,280,887.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	33,800	81.000	2,737,800.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	116,850	352.850	41,230,522.500	
PPL CORP	50,100	33.890	1,697,889.000	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	21,324	296.890	6,330,882.360	
PULTEGROUP INC	13,650	101.610	1,386,976.500	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	159,353	10.030	1,598,310.590	
PPG INDUSTRIES INC	15,500	106.300	1,647,650.000	
NORTHERN TRUST CORP	13,200	107.750	1,422,300.000	
NVIDIA CORP	1,655,100	141.970	234,974,547.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	26,813	173.370	4,648,569.810	

DRAFTKINGS INC CLASS A	30,600	36.500	1,116,900.000	
TYSON FOODS INC-CL A	19,400	54.810	1,063,314.000	
NETFLIX INC	28,990	1,212.150	35,140,228.500	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	25,600	402.760	10,310,656.000	
NRG ENERGY INC	13,850	152.040	2,105,754.000	
TEXTRON INC	12,400	77.380	959,512.000	
NEWS CORP - CLASS A	25,187	27.420	690,627.540	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,350	1,119.580	1,511,433.000	
OMNICOM GROUP	13,300	69.480	924,084.000	
JACOBS SOLUTIONS INC	8,320	125.890	1,047,404.800	
ORACLE CORP	114,033	215.220	24,542,182.260	
MASTERCARD INC - A	55,200	562.030	31,024,056.000	
ONEOK INC	42,400	83.750	3,551,000.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,300	560.750	4,093,475.000	
U HAUL NON VOTING SERIES N	6,600	55.100	363,660.000	
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	13,900	166.560	2,315,184.000	
EXPAND ENERGY CORP	14,200	116.460	1,653,732.000	
YUM! BRANDS INC	18,900	144.000	2,721,600.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,000	230.230	2,762,760.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	12,000	50.590	607,080.000	
BANK OF AMERICA CORP	490,401	44.090	21,621,780.090	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,200	487.470	1,559,904.000	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,000	56.220	730,860.000	
AMERICAN EXPRESS CO	38,000	287.790	10,936,020.000	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	31,035	72.250	2,242,278.750	
LINDE PLC	32,046	465.980	14,932,795.080	
ANALOG DEVICES INC	33,691	225.030	7,581,485.730	
ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	25,100	21.220	532,622.000	
MONDAYCOM LTD	2,900	279.950	811,855.000	
ADVANCED MICRO DEVICES	110,127	116.160	12,792,352.320	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	17,200	32.050	551,260.000	
NATERA INC	8,700	165.340	1,438,458.000	
LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER	14,400	96.720	1,392,768.000	
KENVUE INC	130,100	21.450	2,790,645.000	
VERALTO CORP	16,816	97.320	1,636,533.120	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	39,472	84.610	3,339,725.920	
BUNGE GLOBAL LTD	9,200	81.410	748,972.000	

VERTIV HOLDINGS CLASS A	24,600	110.970	2,729,862.000	
NUTANIX INC CLASS A	17,200	72.130	1,240,636.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17,400	258.080	4,490,592.000	
AVERY DENNISON CORP	5,430	174.640	948,295.200	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	33,600	78.950	2,652,720.000	
EMERSON ELECTRIC CO	38,200	125.540	4,795,628.000	
AON PLC-CLASS A	13,200	353.000	4,659,600.000	
AMGEN INC	36,500	295.220	10,775,530.000	
SAMSARA INC CLASS A	19,400	39.210	760,674.000	
EATON CORP PLC	26,536	323.660	8,588,641.760	
COOPER INC	13,600	69.700	947,920.000	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	11,100	164.880	1,830,168.000	
APPLIED MATERIALS INC	55,100	170.590	9,399,509.000	
CME GROUP INC	24,500	269.500	6,602,750.000	
ECOLAB INC	17,300	264.210	4,570,833.000	
EQUIFAX INC	8,500	264.290	2,246,465.000	
GILEAD SCIENCES INC	84,500	109.980	9,293,310.000	
KEURIG DR PEPPER INC	87,700	33.020	2,895,854.000	
HORMEL FOODS CORP	20,100	30.580	614,658.000	
STATE STREET CORP	19,513	96.140	1,875,979.820	
SOLVENTUM CORP	9,972	73.800	735,933.600	
GE VERNOVA	18,526	478.450	8,863,764.700	
SCHWAB (CHARLES) CORP	117,040	87.360	10,224,614.400	
CRH PUBLIC LIMITED PLC	46,000	90.040	4,141,840.000	
LABCORP HOLDINGS	5,700	261.120	1,488,384.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	34,800	30.620	1,065,576.000	
SMURFIT WESTROCK PLC	35,400	41.980	1,486,092.000	
FERGUSON ENTERPRISES LTD	13,500	212.850	2,873,475.000	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	12,000	264.610	3,175,320.000	
THE CAMPBELL S COMPANY	12,900	32.790	422,991.000	
CROWN HOLDINGS INC	7,980	99.850	796,803.000	
REDDIT INC CLASS A	4,600	118.180	543,628.000	
TE CONNECTIVITY LTD	20,295	162.620	3,300,372.900	
BLACKROCK INC	10,000	971.820	9,718,200.000	
CARDINAL HEALTH INC	16,400	161.410	2,647,124.000	
APTIV HOLDINGS LTD	15,600	67.250	1,049,100.000	
FEDEX CORP	15,500	224.380	3,477,890.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	43,974	192.830	8,479,506.420	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	17,413	76.090	1,324,955.170	

INTEL CORP	295,600	20.140	5,953,384.000	
HARTFORD INSURANCE GROUP INC	19,250	125.230	2,410,677.500	
ILLINOIS TOOL WORKS	18,900	241.480	4,563,972.000	
ILLUMINA INC	10,800	86.930	938,844.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	24,300	512.180	12,445,974.000	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,150	218.930	1,346,419.500	
SNAP-ON INC	3,600	310.000	1,116,000.000	
DUKE ENERGY CORP	52,728	116.860	6,161,794.080	
TARGET CORP	30,900	95.370	2,946,933.000	
DOVER CORP	9,300	176.540	1,641,822.000	
WW GRAINGER INC	3,200	1,064.230	3,405,536.000	
JABIL INC	7,300	175.840	1,283,632.000	
CINTAS CORP	24,700	221.980	5,482,906.000	
CONAGRA BRANDS INC	32,400	21.570	698,868.000	
CLOROX COMPANY	8,300	123.070	1,021,481.000	
ENTERGY CORP	29,400	82.070	2,412,858.000	
MICROSOFT CORP	478,600	474.960	227,315,856.000	
INCYTE CORP	11,200	67.750	758,800.000	
CVS HEALTH CORP	85,569	67.460	5,772,484.740	
MEDTRONIC PLC	86,998	87.270	7,592,315.460	
MICRON TECHNOLOGY INC	75,800	115.600	8,762,480.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	44,200	36.370	1,607,554.000	
KELLOGG CO	18,800	79.880	1,501,744.000	
KEYCORP	63,200	15.650	989,080.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	87,711	66.930	5,870,497.230	
CHUBB LTD	25,799	286.790	7,398,895.210	
ALLSTATE CORP	18,000	198.920	3,580,560.000	
EBAY INC	31,600	77.360	2,444,576.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	63,750	70.830	4,515,412.500	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	15,900	67.310	1,070,229.000	
TRIMBLE INC	16,700	71.080	1,187,036.000	
LENNAR CORP-A	15,900	108.610	1,726,899.000	
PROGRESSIVE CORP	39,800	267.850	10,660,430.000	
PACCAR INC	35,655	91.880	3,275,981.400	
BIOGEN INC	10,000	130.650	1,306,500.000	
IDEXX LABORATORIES INC	5,500	522.700	2,874,850.000	
STARBUCKS CORP	77,000	93.260	7,181,020.000	
PTC INC	8,200	169.340	1,388,588.000	
EVERSOURCE ENERGY	24,900	65.210	1,623,729.000	

	INTUIT INC	18,980	753.980	14,310,540.400	
	BEST BUY CO INC	13,550	69.600	943,080.000	
	BALL CORP	18,204	54.370	989,751.480	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	100,297	99.740	10,003,622.780	
	ELECTRONIC ARTS INC	16,800	148.480	2,494,464.000	
	VULCAN MATERIALS CO	9,000	260.770	2,346,930.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	17,500	455.450	7,970,375.000	
	CARNIVAL CORP	71,200	22.410	1,595,592.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	255,490	35.010	8,944,704.900	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,300	45.440	513,472.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	77,200	5.610	433,092.000	
アメリカ・ドル 小計				3,484,930,406.550 (503,293,649,314)	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	397,606	26.310	10,461,013.860	
	HALEON PLC	600,757	3.961	2,379,598.470	
	WISE PLC CLASS A	43,484	10.270	446,580.680	
	BP PLC	1,063,428	3.863	4,108,554.070	
	UNILEVER PLC	166,246	46.350	7,705,502.100	
	BARCLAYS PLC	949,472	3.193	3,031,664.090	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	562,984	8.700	4,897,960.800	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	136,540	3.743	511,069.220	
	PRUDENTIAL PLC	172,851	8.876	1,534,225.470	
	NATWEST GROUP PLC	537,988	5.134	2,762,030.390	
	BAE SYSTEMS PLC	200,044	19.390	3,878,853.160	
	AVIVA PLC	177,900	6.058	1,077,718.200	
	GSK	273,284	15.115	4,130,687.660	
	INFORMA PLC	86,836	7.762	674,021.030	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	83,923	4.725	396,536.170	
	AUTO TRADER GROUP PLC	58,028	8.158	473,392.420	
	DCC PLC	6,470	46.860	303,184.200	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	4,807	59.450	285,776.150	
	HALMA PLC	25,182	31.120	783,663.840	
	ENTAIN PLC	39,644	7.514	297,885.010	
	JD SPORTS FASHION PLC	172,738	0.760	131,419.070	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	45,835	6.520	298,844.200	
	M&G PLC	149,120	2.548	379,957.760	
	RELX PLC	122,691	38.950	4,778,814.450	
	DIAGEO PLC	147,757	19.500	2,881,261.500	

RIO TINTO PLC	74,913	42.885	3,212,644.000	
STANDARD CHARTERED PLC	134,147	11.455	1,536,653.880	
TESCO PLC	446,828	3.982	1,779,269.090	
SMITH & NEPHEW PLC	55,249	10.940	604,424.060	
GLENCORE PLC	676,969	2.917	1,974,718.570	
SMITHS GROUP PLC	22,378	22.340	499,924.520	
PEARSON PLC	39,175	10.660	417,605.500	
SAINSBURY (J) PLC	116,988	2.868	335,521.580	
NEXT PLC	7,770	127.700	992,229.000	
WHITBREAD PLC	11,775	27.780	327,109.500	
BUNZL PLC	21,570	22.840	492,658.800	
VODAFONE GROUP PLC	1,322,159	0.737	974,431.180	
CRODA INTERNATIONAL PLC	8,668	30.710	266,194.280	
KINGFISHER PLC	118,387	2.740	324,380.380	
WPP PLC	70,427	5.510	388,052.770	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	44,555	11.655	519,288.520	
SEVERN TRENT PLC	17,641	27.050	477,189.050	
RENTOKIL INITIAL PLC	164,797	3.483	573,987.950	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	45,267	50.960	2,306,806.320	
SCHRODERS PLC	50,139	3.558	178,394.560	
SSE PLC	73,530	18.150	1,334,569.500	
BARRATT REDROW PLC	90,081	4.745	427,434.340	
ASTRAZENECA PLC	103,018	109.860	11,317,557.480	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	389,969	2.529	986,231.600	
3I GROUP PLC	64,643	41.230	2,665,230.890	
ASHTED GROUP PLC	28,468	42.670	1,214,729.560	
SAGE GROUP PLC/THE	65,433	12.620	825,764.460	
NATIONAL GRID PLC	325,244	10.630	3,457,343.720	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,993,144	0.765	3,054,755.160	
IMPERIAL BRANDS PLC	51,754	29.090	1,505,523.860	
CENTRICA PLC	331,287	1.660	549,936.420	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	131,526	35.880	4,719,152.880	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	21,410	20.480	438,476.800	
HSBC HOLDINGS PLC	1,173,146	8.665	10,165,310.090	
ANGLO AMERICAN PLC	74,294	21.135	1,570,203.690	
MONDI PLC	28,810	11.725	337,797.250	
COMPASS GROUP PLC	112,708	25.540	2,878,562.320	
BT GROUP PLC	394,982	1.840	726,964.370	
COCA-COLA HBC AG-DI	14,486	39.460	571,617.560	

	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	9,846	82.480	812,098.080	
	INTERTEK GROUP PLC	10,550	47.620	502,391.000	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	31,626	110.450	3,493,091.700	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	10,876	21.280	231,441.280	
	ADMIRAL GROUP PLC	17,013	33.000	561,429.000	
	ANTOFAGASTA PLC	25,763	17.910	461,415.330	
	EXPERIAN PLC	60,939	37.480	2,283,993.720	
イギリス・ポンド 小計				133,884,719.540 (26,191,867,684)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	86,033	28.500	2,451,940.500	
	AZRIELI GROUP LTD	3,016	260.000	784,160.000	
	ICL GROUP LTD	54,223	23.690	1,284,542.870	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,868	1,616.900	3,020,369.200	
	BANK HAPOLIM BM	87,812	56.900	4,996,502.800	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	104,878	56.350	5,909,875.300	
	NICE LTD	4,434	594.600	2,636,456.400	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,881	189.000	2,056,509.000	
イスラエル・シュケル 小計				23,140,356.070 (923,200,704)	
オーストラリ ア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	140,138	5.290	741,330.020	
	TELSTRA GROUP LTD	254,089	4.890	1,242,495.210	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	189,249	29.630	5,607,447.870	
	SGH LTD	12,846	53.680	689,573.280	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	173,395	4.900	849,635.500	
	BHP GROUP LTD	323,392	37.340	12,075,457.280	
	SOUTH32 LTD	283,778	2.940	834,307.320	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	120,996	25.210	3,050,309.160	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	107,902	15.730	1,697,298.460	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	195,047	38.870	7,581,476.890	
	WESTPAC BANKING CORP	217,978	33.360	7,271,746.080	
	SANTOS LTD	204,063	6.960	1,420,278.480	
	RIO TINTO LTD	23,626	106.380	2,513,333.880	
	ORIGIN ENERGY LTD	108,239	11.450	1,239,336.550	
	XERO LTD	9,145	188.700	1,725,661.500	
	PRO MEDICUS LTD	3,616	270.500	978,128.000	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	15,021	40.320	605,646.720	
	COLES GROUP LTD	85,414	22.220	1,897,899.080	
	WISETECH GLOBAL LTD	12,856	105.390	1,354,893.840	

	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	87,872	22.530	1,979,756.160	
	EVOLUTION MINING LTD	140,100	9.200	1,288,920.000	
	REECE LTD	13,293	16.530	219,733.290	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	106,643	179.350	19,126,422.050	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	96,188	23.280	2,239,256.640	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	77,861	32.200	2,507,124.200	
	QANTAS AIRWAYS LTD	46,622	10.190	475,078.180	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	27,010	40.210	1,086,072.100	
	MACQUARIE GROUP LTD	23,045	212.830	4,904,667.350	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	35,867	64.040	2,296,922.680	
	CSL LTD	30,825	238.860	7,362,859.500	
	WESFARMERS LTD	72,296	84.770	6,128,531.920	
	COCHLEAR LTD	4,209	272.850	1,148,425.650	
	BLUESCOPE STEEL LTD	27,548	22.530	620,656.440	
	SUNCORP GROUP LTD	68,038	21.430	1,458,054.340	
	ASX LTD	12,189	72.770	886,993.530	
	COMPUTERSHARE LTD	33,110	40.650	1,345,921.500	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	148,594	8.980	1,334,374.120	
	SONIC HEALTHCARE LTD	28,670	26.890	770,936.300	
	BRAMBLES LTD	86,834	23.030	1,999,787.020	
	CARSales.COM LTD	23,716	35.950	852,590.200	
	SIGMA HEALTHCARE LTD	323,100	3.250	1,050,075.000	
	REA GROUP LTD	3,320	232.410	771,601.200	
オーストラリア・ドル 小計				115,231,014.490 (10,805,212,230)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	47,800	73.120	3,495,136.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	26,181	74.200	1,942,630.200	
	BROOKFIELD RENEWABLE SUBORDINATE V	8,500	43.870	372,895.000	
	CELESTICA INC	7,300	170.260	1,242,898.000	
	IMPERIAL OIL LTD	11,300	111.150	1,255,995.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,300	4,829.990	6,278,987.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	19,687	91.390	1,799,194.930	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	28,600	124.570	3,562,702.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	11,250	309.500	3,481,875.000	
	BCE INC	4,130	31.010	128,071.300	
	FRANCO-NEVADA CORP	12,200	233.330	2,846,626.000	

SUNCOR ENERGY INC	77,830	55.670	4,332,796.100	
METRO INC/CN	13,200	104.340	1,377,288.000	
NATIONAL BANK OF CANADA	24,600	135.420	3,331,332.000	
BANK OF NOVA SCOTIA	78,500	73.780	5,791,730.000	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	59,200	92.610	5,482,512.000	
TORONTO-DOMINION BANK	110,300	96.230	10,614,169.000	
GREAT-WEST LIFECO INC	17,300	51.190	885,587.000	
ROYAL BANK OF CANADA	89,150	173.550	15,471,982.500	
TOURMALINE OIL CORP	22,400	66.630	1,492,512.000	
TC ENERGY CORP	65,450	67.350	4,408,057.500	
PEMBINA PIPELINE CORP	36,629	52.260	1,914,231.540	
BARRICK MINING CORP	108,300	29.320	3,175,356.000	
CAE INC	19,100	36.410	695,431.000	
THOMSON REUTERS CORP	9,941	264.980	2,634,166.180	
EMPIRE CO LTD 'A'	8,100	51.840	419,904.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,400	103.350	351,390.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	9,150	77.630	710,314.500	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	25,000	32.380	809,500.000	
HYDRO ONE LTD	20,800	49.240	1,024,192.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	9,460	222.310	2,103,052.600	
STANTEC INC	7,100	144.850	1,028,435.000	
WSP GLOBAL INC	8,300	271.520	2,253,616.000	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,200	121.550	632,060.000	
QUEBECOR INC -CL B	9,800	40.250	394,450.000	
EMERA INC	18,800	61.380	1,153,944.000	
TFI INTERNATIONAL INC	5,000	122.190	610,950.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	8,300	38.100	316,230.000	
WHITECAP RESOURCES INC	76,600	9.390	719,274.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	22,900	37.560	860,124.000	
IVANHOE MINES LTD-CL A	45,700	9.880	451,516.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	31,717	169.130	5,364,296.210	
ALAMOS GOLD INC-CLASS A	29,500	37.420	1,103,890.000	
KINROSS GOLD CORP	77,500	21.460	1,663,150.000	
BANK OF MONTREAL	45,600	145.290	6,625,224.000	
POWER CORP OF CANADA	35,200	52.290	1,840,608.000	
LUNDIN GOLD INC	7,600	73.870	561,412.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	76,700	143.180	10,981,906.000	
NUTRIEN LTD	30,819	85.420	2,632,558.980	
CAMECO CORP	27,500	90.530	2,489,575.000	

	FIRSTSERVICE CORP	2,600	240.000	624,000.000	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	13,200	68.270	901,164.000	
	TELUS CORP	10,800	21.920	236,736.000	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	29,300	52.450	1,536,785.000	
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,300	177.990	587,367.000	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	132,100	45.900	6,063,390.000	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,300	2,355.550	3,062,215.000	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	16,600	50.720	841,952.000	
	WESTON (GEORGE) LTD	3,737	267.610	1,000,058.570	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	22,400	39.420	883,008.000	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	5,300	134.800	714,440.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	36,100	87.290	3,151,169.000	
	ENBRIDGE INC	137,200	63.370	8,694,364.000	
	BROOKFIELD CORP	85,825	78.520	6,738,979.000	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	108,500	42.340	4,593,890.000	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	58,620	109.240	6,403,648.800	
	IA FINANCIAL CORP INC	5,800	142.260	825,108.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,200	62.920	578,864.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	33,650	141.090	4,747,678.500	
	CGI INC - CLASS A	12,600	147.080	1,853,208.000	
	IGM FINANCIAL INC	5,200	43.070	223,964.000	
	TMX GROUP LTD	17,600	55.980	985,248.000	
	OPEN TEXT CORP	16,300	38.410	626,083.000	
	SAPUTO INC	15,900	26.520	421,668.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	43,800	21.030	921,114.000	
	FORTIS INC	31,600	65.450	2,068,220.000	
	RB GLOBAL INC	11,700	144.440	1,689,948.000	
	LUNDIN MINING CORP	43,300	13.910	602,303.000	
	CENOVUS ENERGY INC	86,100	20.160	1,735,776.000	
	DOLLARAMA INC	17,500	193.740	3,390,450.000	
	ALTAGAS LTD	18,400	38.740	712,816.000	
	KEYERA CORP	14,200	42.580	604,636.000	
	ARC RESOURCES LTD	36,500	30.650	1,118,725.000	
カナダ・ドル 小計				204,254,709.410 (21,704,105,421)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	164,800	2.580	425,184.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	88,400	34.950	3,089,580.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	149,040	44.450	6,624,828.000	

	SINGAPORE AIRLINES LTD	104,175	6.940	722,974.500	
	KEPPEL CORP LTD	101,900	7.220	735,718.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	180,800	2.250	406,800.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	237,000	16.060	3,806,220.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	423,100	0.705	298,285.500	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	519,950	3.950	2,053,802.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	109,300	7.800	852,540.000	
	SEMBICORP INDUSTRIES LTD	62,600	6.890	431,314.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	60,000	14.000	840,000.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	134,500	3.010	404,845.000	
シンガポール・ドル 小計				20,692,091.500 (2,328,894,898)	
スイス・フラン	SANDOZ GROUP AG	26,616	42.760	1,138,100.160	
	GALDERMA GROUP N AG	6,955	111.300	774,091.500	
	AVOLTA AG	5,644	42.680	240,885.920	
	UBS GROUP AG-REG	209,664	26.100	5,472,230.400	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,003	286.400	573,659.200	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	438	596.000	261,048.000	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	44,776	269.700	12,076,087.200	
	SIKA AG-REG	9,748	209.000	2,037,332.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	7	132,400.000	926,800.000	
	ABB LTD-REG	100,886	47.620	4,804,191.320	
	SWISS RE AG	19,275	136.400	2,629,110.000	
	NESTLE SA-REG	167,093	84.250	14,077,585.250	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,423	1,014.500	1,443,633.500	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,549	296.800	756,543.200	
	JULIUS BAER GROUP LTD	12,899	52.440	676,423.560	
	SGS SA-REG	10,295	84.620	871,162.900	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,471	287.500	422,912.500	
	TEMENOS AG - REG	3,532	59.700	210,860.400	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,328	185.500	431,844.000	
	VAT GROUP AG	1,698	334.000	567,132.000	
	BKW AG	1,374	172.500	237,015.000	
	ALCON INC	31,875	70.900	2,259,937.500	
	SIG GROUP N AG	19,184	15.720	301,572.480	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,820	134.100	244,062.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	9,363	561.200	5,254,515.600	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,624	185.400	486,489.600	
	NOVARTIS AG-REG	121,137	97.160	11,769,670.920	

	BARRY CALLEBAUT AG-REG	212	876.500	185,818.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	34,254	150.400	5,151,801.600	
	SWISSCOM AG-REG	1,621	556.500	902,086.500	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,896	89.500	169,692.000	
	GEBERIT AG-REG	2,087	636.400	1,328,166.800	
	GIVAUDAN-REG	582	4,124.000	2,400,168.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	6,982	104.950	732,760.900	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,272	251.100	821,599.200	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	9,727	69.620	677,193.740	
	LONZA GROUP AG-REG	4,626	568.800	2,631,268.800	
	HOLCIM LTD	33,222	93.100	3,092,968.200	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,805	798.400	1,441,112.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	3,118	186.500	581,507.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,148	116.300	598,712.400	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	59	13,480.000	795,320.000	
スイス・フラン 小計				92,455,071.250 (16,439,436,219)	
スウェーデン・ クローナ	SAGAX CLASS B	15,363	202.000	3,103,326.000	
	ERICSSON LM-B SHS	194,367	79.700	15,491,049.900	
	VOLVO AB-B SHS	111,147	264.600	29,409,496.200	
	SKF AB-B SHARES	23,823	206.600	4,921,831.800	
	TELE2 AB-B SHS	38,341	139.900	5,363,905.900	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	110,995	163.000	18,092,185.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	102,045	125.750	12,832,158.750	
	SWEDBANK AB - A SHARES	59,384	247.000	14,667,848.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	39,631	131.100	5,195,624.100	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	42,503	123.300	5,240,619.900	
	SKANSKA AB-B SHS	23,765	228.800	5,437,432.000	
	SANDVIK AB	74,595	210.500	15,702,247.500	
	INVESTOR AB-B SHS	121,108	274.900	33,292,589.200	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	187,909	152.950	28,740,681.550	
	HOLMEN AB-B SHARES	5,377	377.400	2,029,279.800	
	SECURITAS AB-B SHS	34,394	137.500	4,729,175.000	
	TELIA CO AB	165,046	35.240	5,816,221.040	
	ALFA LAVAL AB	20,196	403.400	8,147,066.400	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	109,221	135.850	14,837,672.850	
	ASSA ABLOY AB-B	70,124	302.400	21,205,497.600	
	TRELLEBORG AB-B SHS	14,114	344.100	4,856,627.400	

	SAAB AB-B	22,379	460.000	10,294,340.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	8,345	341.000	2,845,645.000	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	50,255	63.460	3,189,182.300	
	INDUTRADE AB	19,117	256.400	4,901,598.800	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	13,673	285.000	3,896,805.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	5,314	466.600	2,479,512.400	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	10,335	244.200	2,523,807.000	
	LIFCO AB-B SHS	16,328	390.200	6,371,185.600	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	106,077	40.390	4,284,450.030	
	BEIJER REF AB	26,893	144.050	3,873,936.650	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	42,104	263.800	11,107,035.200	
	BOLIDEN AB	19,894	293.200	5,832,920.800	
	EPIROC AB-A	46,115	211.800	9,767,157.000	
	EPIROC AB-B	27,287	183.900	5,018,079.300	
	EQT AB	26,064	275.200	7,172,812.800	
	EVOLUTION AB	10,373	669.000	6,939,537.000	
	HEXAGON AB-B SHS	145,259	92.240	13,398,690.160	
	ADDTECH AB-B SHARES	18,173	314.600	5,717,225.800	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,859	339.600	3,687,716.400	
スウェーデン・クローナ 小計				372,414,173.130 (5,656,971,290)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK A/S-B	225,287	516.200	116,293,149.400	
	DANSKE BANK A/S	48,242	256.000	12,349,952.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	207	12,490.000	2,585,430.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	70,628	108.050	7,631,355.400	
	CARLSBERG AS-B	6,814	932.400	6,353,373.600	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	24,648	485.500	11,966,604.000	
	COLOPLAST-B	8,851	637.000	5,638,087.000	
	DSV PANALPINA A/S	14,276	1,596.500	22,791,634.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	7,990	298.150	2,382,218.500	
	DEMANT A/S	6,239	281.600	1,756,902.400	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	401	12,630.000	5,064,630.000	
	TRYG A/S	23,759	164.800	3,915,483.200	
	PANDORA A/S	5,758	1,149.000	6,615,942.000	
	GENMAB A/S	4,467	1,481.000	6,615,627.000	
	ORSTED A/S	11,806	273.500	3,228,941.000	
デンマーク・クローネ 小計				215,189,329.500 (4,805,177,728)	

ニュージーランド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	91,451	5.870	536,817.370	
	INFRATIL LTD	64,300	10.275	660,682.500	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	118,067	7.965	940,403.650	
	CONTACT ENERGY LTD	56,210	8.990	505,327.900	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	40,994	36.600	1,500,380.400	
ニュージーランド・ドル 小計				4,143,611.820 (360,411,356)	
ノルウェー・クローネ	DNB BANK	62,650	278.400	17,441,760.000	
	NORSK HYDRO ASA	98,439	55.240	5,437,770.360	
	ORKLA ASA	49,132	110.000	5,404,520.000	
	TELENOR ASA	43,057	152.500	6,566,192.500	
	EQUINOR ASA	59,779	273.300	16,337,600.700	
	YARA INTERNATIONAL ASA	11,626	388.400	4,515,538.400	
	MOWI ASA	32,574	188.400	6,136,941.600	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	14,018	249.000	3,490,482.000	
	AKER BP ASA	22,064	273.000	6,023,472.000	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	30,645	384.850	11,793,728.250	
	SALMAR ASA	4,713	454.400	2,141,587.200	
ノルウェー・クローネ 小計				85,289,593.010 (1,241,816,474)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	73,957	27.910	2,064,139.870	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	31,525	38.130	1,202,048.250	
	EXOR NV	5,778	80.950	467,729.100	
	DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	7,428	41.390	307,444.920	
	DSM FIRMENICH AG	12,323	96.420	1,188,183.660	
	FERROVIAL	34,020	44.550	1,515,591.000	
	LOTUS BAKERIES NV	25	8,640.000	216,000.000	
	SYENSQO SA	4,807	67.000	322,069.000	
	CVC CAPITAL PARTNERS PLC	13,810	15.770	217,783.700	
	COVESTRO V AG	11,566	60.400	698,586.400	
	BAYER AG-REG	65,129	27.480	1,789,744.920	
	EVONIK INDUSTRIES AG	16,731	18.650	312,033.150	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	122,803	23.880	2,932,535.640	
	COMMERZBANK AG	58,682	28.100	1,648,964.200	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	13,642	88.840	1,211,955.280	
	SIEMENS AG-REG	50,438	214.950	10,841,648.100	
	E.ON SE	148,932	15.485	2,306,212.020	

BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	19,201	75.300	1,445,835.300	
GEA GROUP AG	9,711	59.000	572,949.000	
CONTINENTAL AG	7,171	76.660	549,728.860	
BASF SE	59,170	42.120	2,492,240.400	
ALLIANZ SE-REG	25,658	341.600	8,764,772.800	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	11,235	67.420	757,463.700	
RHEINMETALL AG	2,941	1,795.500	5,280,565.500	
RWE AG	41,911	35.590	1,491,612.490	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	39,785	6.882	273,800.370	
BRENNTAG SE	7,967	60.000	478,020.000	
FRESENIUS SE & CO KGAA	28,027	44.000	1,233,188.000	
SAP SE	69,258	254.750	17,643,475.500	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	8,824	553.400	4,883,201.600	
ZALANDO SE	14,625	28.500	416,812.500	
HEIDELBERG MATERIALS AG	8,907	176.000	1,567,632.000	
RATIONAL AG	336	708.500	238,056.000	
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	4,070	103.600	421,652.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,707	205.600	350,959.200	
TALANX AG	4,211	110.400	464,894.400	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	9,997	33.860	338,498.420	
DELIVERY HERO SE	12,282	22.100	271,432.200	
NEMETSCHEK SE	3,764	123.800	465,983.200	
SCOUT24 AG	4,899	117.300	574,652.700	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	22,677	45.650	1,035,205.050	
KNORR-BREMSE AG	4,732	83.700	396,068.400	
SIEMENS ENERGY AG	45,182	84.820	3,832,337.240	
BEIERSDORF AG	6,464	115.450	746,268.800	
MERCK KGAA	8,427	114.800	967,419.600	
ADIDAS AG	11,372	200.000	2,274,400.000	
HENKEL AG & CO KGAA	6,771	61.700	417,770.700	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	231,501	30.730	7,114,025.730	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	14,685	49.880	732,487.800	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	47,936	50.820	2,436,107.520	
QIAGEN N.V.	14,061	40.680	572,001.480	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	86,624	35.420	3,068,222.080	
HANNOVER RUECK SE	4,030	268.600	1,082,458.000	
DHL GROUP	63,695	40.770	2,596,845.150	
DEUTSCHE BOERSE AG	12,475	267.900	3,342,052.500	
MTU AERO ENGINES AG	3,613	341.200	1,232,755.600	

SYMRISE AG	8,658	101.700	880,518.600	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,705	70.650	261,758.250	
VONOVIA SE	49,069	28.320	1,389,634.080	
LEG IMMOBILIEN SE	4,856	70.550	342,590.800	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	55,277	19.885	1,099,183.140	
NN GROUP NV	17,832	55.200	984,326.400	
ARCELORMITTAL	31,074	26.080	810,409.920	
HEINEKEN NV	19,075	78.100	1,489,757.500	
AEGON LTD	87,754	6.028	528,981.110	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	60,471	35.850	2,167,885.350	
AKZO NOBEL N.V.	11,137	58.080	646,836.960	
WOLTERS KLUWER	15,849	146.450	2,321,086.050	
ING GROEP NV	208,773	18.006	3,759,166.630	
KONINKLIJKE KPN NV	257,935	4.097	1,056,759.690	
ASML HOLDING NV	26,150	664.600	17,379,290.000	
ABN AMRO BANK NV-CVA	29,855	22.760	679,499.800	
IMCD NV	3,862	117.450	453,591.900	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	5,313	125.900	668,906.700	
ASR NEDERLAND NV	9,732	54.360	529,031.520	
ADYEN NV	1,638	1,656.200	2,712,855.600	
PROSUS NV	86,578	46.680	4,041,461.040	
JDE PEET'S NV	11,285	23.480	264,971.800	
INPOST SA	14,300	13.970	199,771.000	
ASM INTERNATIONAL NV	3,154	519.400	1,638,187.600	
RANDSTAD NV	7,252	37.840	274,415.680	
HEINEKEN HOLDING NV	8,448	67.550	570,662.400	
TOTALENERGIES SE	135,045	54.800	7,400,466.000	
MICHELIN (CGDE)	44,504	32.200	1,433,028.800	
AIR LIQUIDE SA	38,395	182.800	7,018,606.000	
KERING	4,955	172.580	855,133.900	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	36,239	220.450	7,988,887.550	
BOUYGUES SA	12,369	37.820	467,795.580	
BNP PARIBAS	67,533	75.280	5,083,884.240	
THALES SA	6,139	250.600	1,538,433.400	
DANONE	42,772	72.620	3,106,102.640	
CARREFOUR SA	35,355	12.815	453,074.320	
L'OREAL	15,978	371.050	5,928,636.900	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	29,764	95.800	2,851,391.200	
LEGRAND SA	17,390	109.900	1,911,161.000	

PERNOD RICARD SA	13,353	89.700	1,197,764.100	
EURAZEO SE	2,599	58.950	153,211.050	
REXEL SA	14,843	24.960	370,481.280	
SOCIETE GENERALE SA	47,751	48.440	2,313,058.440	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	18,240	461.400	8,415,936.000	
ACCOR SA	13,005	43.260	562,596.300	
CAPGEMINI SE	10,845	150.400	1,631,088.000	
PUBLICIS GROUPE	15,216	95.060	1,446,432.960	
BUREAU VERITAS SA	20,709	29.200	604,702.800	
EIFFAGE	4,559	118.200	538,873.800	
SODEXO SA	5,916	55.500	328,338.000	
IPSEN	2,461	103.300	254,221.300	
AMUNDI SA	4,052	66.900	271,078.800	
TELEPERFORMANCE	3,431	90.740	311,328.940	
EURONEXT NV	5,201	142.000	738,542.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	7,815	60.320	471,400.800	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,910	199.050	380,185.500	
ESSILORLUXOTTICA	19,689	242.000	4,764,738.000	
DASSAULT AVIATION SA	1,289	304.200	392,113.800	
FDJ UNITED	7,358	31.840	234,278.720	
AXA SA	117,536	41.620	4,891,848.320	
EDENRED	15,773	25.420	400,949.660	
RENAULT SA	12,530	43.040	539,291.200	
HERMES INTERNATIONAL	2,061	2,295.000	4,729,995.000	
STMICROELECTRONICS NV	44,912	25.590	1,149,298.080	
DASSAULT SYSTEMES SE	44,423	31.680	1,407,320.640	
ORANGE	123,469	12.750	1,574,229.750	
ALSTOM	22,563	18.850	425,312.550	
SANOFI	73,577	86.800	6,386,483.600	
VINCI SA	32,817	124.650	4,090,639.050	
AIRBUS SE	39,426	161.580	6,370,453.080	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	41,461	30.200	1,252,122.200	
CREDIT AGRICOLE SA	70,174	15.845	1,111,907.030	
BIOMERIEUX	2,702	120.600	325,861.200	
ENGIE	121,144	19.875	2,407,737.000	
SAFRAN SA	23,850	253.200	6,038,820.000	
ARKEMA	3,724	60.250	224,371.000	
ADP	2,262	107.800	243,843.600	
GETLINK SE	20,144	16.430	330,965.920	

BOLLORE	46,528	5.230	243,341.440	
UCB SA	8,339	163.450	1,363,009.550	
KBC GROUP NV	15,265	84.180	1,285,007.700	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,411	72.000	389,592.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	65,875	61.960	4,081,615.000	
AGEAS	9,768	56.550	552,380.400	
D'IETEREN GROUP	1,402	176.900	248,013.800	
ELIA GROUP SA/NV	3,400	92.800	315,520.000	
SOFINA	1,011	253.600	256,389.600	
ARGENX SE	4,039	502.600	2,030,001.400	
PRYSMIAN SPA	18,610	55.800	1,038,438.000	
GENERALI	56,994	30.820	1,756,555.080	
MEDIOBANCA SPA	32,588	19.185	625,200.780	
TENARIS SA	26,963	15.550	419,274.650	
UNICREDIT SPA	92,982	56.150	5,220,939.300	
UNIPOL GRUPPO SPA	23,180	16.755	388,380.900	
TELECOM ITALIA SPA	716,514	0.375	268,692.750	
INTESA SANPAOLO	1,003,568	4.820	4,837,699.540	
POSTE ITALIANE SPA	29,833	18.670	556,982.110	
MONCLER SPA	15,521	50.700	786,914.700	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	7,629	54.350	414,636.150	
ENI SPA	146,354	14.002	2,049,248.700	
BPER BANCA	64,630	7.550	487,956.500	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	38,820	5.632	218,634.240	
BANCO BPM SPA	83,944	9.916	832,388.700	
DIASORIN SPA	1,344	93.320	125,422.080	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	18,401	10.140	186,586.140	
NEXI SPA	32,152	4.837	155,519.220	
BANCA MEDIOLANUM SPA	15,600	14.150	220,740.000	
LEONARDO SPA	26,885	48.610	1,306,879.850	
ENEL SPA	539,416	7.982	4,305,618.510	
SNAM SPA	131,435	5.256	690,822.360	
TERNA SPA	93,311	8.942	834,386.960	
FINECOBANK SPA	40,524	19.090	773,603.160	
STELLANTIS NV	132,358	8.483	1,122,792.910	
FERRARI NV	8,316	401.500	3,338,874.000	
TELEFONICA SA	243,404	4.594	1,118,197.970	
ENDESA SA	20,725	27.220	564,134.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	382,244	12.955	4,951,971.020	

IBERDROLA SA	384,318	16.205	6,227,873.190	
BANCO DE SABADELL SA	354,585	2.778	985,037.130	
BANKINTER SA	47,200	11.020	520,144.000	
REPSOL SA	76,779	12.255	940,926.640	
GRIFOLS SA	18,913	10.195	192,818.030	
BANCO SANTANDER SA	1,004,985	6.859	6,893,192.110	
AMADEUS IT GROUP SA	29,859	70.660	2,109,836.940	
CAIXABANK SA	261,770	7.300	1,910,921.000	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	87,000	3.726	324,162.000	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11,617	56.350	654,617.950	
AENA SME SA	4,988	230.400	1,149,235.200	
CELLNEX TELECOM SA	32,639	32.970	1,076,107.830	
ACCIONA SA	1,612	145.200	234,062.400	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	72,301	45.720	3,305,601.720	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	26,487	17.730	469,614.510	
UPM-KYMMENE OYJ	35,388	23.040	815,339.520	
NOKIA OYJ	354,278	4.490	1,590,708.220	
WARTSILA OYJ ABP	32,783	19.245	630,908.830	
STORA ENSO OYJ-R SHS	38,002	8.356	317,544.710	
ELISA OYJ	9,284	45.540	422,793.360	
SAMPO OYJ-A SHS	160,775	9.104	1,463,695.600	
FORTUM OYJ	29,279	16.010	468,756.790	
KESKO OYJ-B SHS	18,150	20.340	369,171.000	
KONE OYJ-B	22,553	56.060	1,264,321.180	
NESTE OYJ	27,615	10.395	287,057.920	
ORION OYJ-CLASS B	7,066	63.300	447,277.800	
METSO CORPORATION	40,573	10.795	437,985.530	
NORDEA BANK ABP	208,352	12.420	2,587,731.840	
VERBUND AG	4,439	68.300	303,183.700	
OMV AG	9,614	44.540	428,207.560	
ERSTE GROUP BANK AG	20,378	70.850	1,443,781.300	
RYANAIR HOLDINGS PLC	59,500	23.280	1,385,160.000	
AIB GROUP PLC	137,275	6.935	952,002.120	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	65,450	11.965	783,109.250	
KINGSPAN GROUP PLC	10,273	76.100	781,775.300	
JERONIMO MARTINS	18,484	21.560	398,515.040	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	208,130	3.609	751,141.170	
GALP ENERGIA SGPS SA	27,055	15.780	426,927.900	
EDP RENOVAVEIS SA	20,383	9.500	193,638.500	

	KERRY GROUP PLC-A	11,056	97.050	1,072,984.800	
ユーロ 小計				371,916,712.780 (61,946,447,681)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	97,000	51.400	4,985,800.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	154,000	32.750	5,043,500.000	
	MTR CORP	109,000	28.000	3,052,000.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	101,500	86.550	8,784,825.000	
	SINO LAND CO	284,000	8.300	2,357,200.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	187,669	47.400	8,895,510.600	
	WHARF HOLDINGS LTD	77,000	23.100	1,778,700.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	29,000	68.700	1,992,300.000	
	CLP HOLDINGS LTD	115,000	66.100	7,601,500.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	102,507	25.700	2,634,429.900	
	HONG KONG & CHINA GAS	783,475	6.800	5,327,630.000	
	HANG SENG BANK LTD	52,700	114.800	6,049,960.000	
	WH GROUP LTD	583,500	7.520	4,387,920.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	84,300	413.600	34,866,480.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	135,169	33.450	4,521,403.050	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	45,000	51.500	2,317,500.000	
	AIA GROUP LTD	748,400	69.150	51,751,860.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	96,000	26.000	2,496,000.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	117,000	20.950	2,451,150.000	
	SANDS CHINA LTD	170,000	14.920	2,536,400.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	103,000	89.600	9,228,800.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	259,000	34.750	9,000,250.000	
香港・ドル 小計				182,061,118.550 (3,348,103,970)	
合計				659,045,294,969 [659,045,294,969]	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,737	2,007,574.660	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	22,107	3,468,588.300	
		BXP INC	10,000	721,000.000	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	7,400	1,685,942.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	23,200	1,598,016.000	
		EQUINIX INC	6,708	5,987,829.120	
		AMERICAN TOWER CORP	31,800	6,830,640.000	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	22,600	822,640.000	

	KIMCO REALTY CORP	46,100	960,263.000	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18,700	863,940.000	
	INVITATION HOMES INC	39,500	1,324,830.000	
	VICI PROPERTIES INC	71,700	2,303,004.000	
	VENTAS INC	29,700	1,896,642.000	
	WEYERHAEUSER CO	49,214	1,318,935.200	
	CROWN CASTLE INTL CORP	29,600	2,912,344.000	
	IRON MOUNTAIN INC	20,000	2,031,800.000	
	SUN COMMUNITIES INC	8,700	1,075,407.000	
	PROLOGIS INC	62,854	6,742,977.120	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,500	757,155.000	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	7,300	847,676.000	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,400	1,251,624.000	
	WELLTOWER INC	44,000	6,705,600.000	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	47,400	823,812.000	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	8,000	1,198,800.000	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	12,400	773,264.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	40,600	778,708.000	
	REALTY INCOME CORP	60,495	3,486,931.800	
	PUBLIC STORAGE	10,700	3,155,965.000	
	REGENCY CENTERS CORP	11,700	821,925.000	
	UDR INC	21,400	882,322.000	
	WP CAREY INC	14,900	943,766.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	22,900	3,995,363.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	14,400	2,154,240.000	
アメリカ・ドル 小計			73,129,524.200 (10,561,365,885)	
イギリス・ポ ンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	46,190	284,530.400	
	SEGRO PLC	83,895	580,217.820	
イギリス・ポンド 小計			864,748.220 (169,170,694)	
オーストラ リア・ドル	TRANSURBAN GROUP	198,019	2,865,334.930	
	APA GROUP	83,515	701,526.000	
	SCENTRE GROUP	326,820	1,202,697.600	
	STOCKLAND	149,947	841,202.670	

	GOODMAN GROUP	130,028	4,418,351.440	
	VICINITY CENTRES	243,623	618,802.420	
オーストラリア・ドル 小計			10,647,915.060 (998,454,995)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	261,700	683,037.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	409,391	872,002.830	
シンガポール・ドル 小計			1,555,039.830 (175,019,733)	
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	8,107	671,583.880	
	GECINA SA	3,108	295,260.000	
	KLEPIERRE	14,042	467,036.920	
	COVIVIO	3,649	186,281.450	
ユーロ 小計			1,620,162.250 (269,854,224)	
香港・ドル	LINK REIT	181,900	7,648,895.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	266,000	3,027,080.000	
香港・ドル 小計			10,675,975.000 (196,331,180)	
投資証券 合計			12,370,196,711 [12,370,196,711]	
合計			12,370,196,711 [12,370,196,711]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 527銘柄	97.9%	2.1%	76.6%
	投資証券 33銘柄			
イギリス・ポンド	株式 71銘柄	99.4%	0.6%	3.9%
	投資証券 2銘柄			
イスラエル・シェケル	株式 8銘柄	100%	-%	0.1%

オーストラリア・ドル	株式 投資証券	42銘柄 6銘柄	91.5%	8.5%	1.8%
カナダ・ドル	株式	83銘柄	100%	-%	3.2%
シンガポール・ドル	株式 投資証券	13銘柄 2銘柄	93%	7.0%	0.4%
スイス・フラン	株式	42銘柄	100%	-%	2.4%
スウェーデン・クローナ	株式	40銘柄	100%	-%	0.8%
デンマーク・クローネ	株式	15銘柄	100%	-%	0.7%
ニュージーランド・ドル	株式	5銘柄	100%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式	11銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式 投資証券	213銘柄 4銘柄	99.6%	0.4%	9.3%
香港・ドル	株式 投資証券	22銘柄 2銘柄	94.5%	5.5%	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。

【ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(2024年6月18日から2025年6月16日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	169,716,624	267,241,406
親投資信託受益証券	20,996,580,646	19,503,042,971
未収入金	15,128,259	16,529,604
流動資産合計	21,181,425,529	19,786,813,981
資産合計	21,181,425,529	19,786,813,981
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	134,538,907	218,726,349
未払解約金	14,751,517	16,292,826
未払受託者報酬	1,070,063	1,917,754
未払委託者報酬	13,529,629	27,328,619
その他未払費用	513,073	479,359
流動負債合計	164,403,189	264,744,907
負債合計	164,403,189	264,744,907
純資産の部		
元本等		
元本	※ 1 22,423,151,229	※ 1 21,872,634,914
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※ 2 △ 1,406,128,889	※ 2 △ 2,350,565,840
（分配準備積立金）	56,052,440	-
元本等合計	21,017,022,340	19,522,069,074
純資産合計	21,017,022,340	19,522,069,074
負債純資産合計	21,181,425,529	19,786,813,981

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期 自 2023年6月16日 至 2024年6月17日	第9期 自 2024年6月18日 至 2025年6月16日
営業収益		
受取利息	7,133	117,081
有価証券売買等損益	△ 797,772,155	△ 600,997,581
営業収益合計	△ 797,765,022	△ 600,880,500
営業費用		
支払利息	5,329	-
受託者報酬	2,147,522	3,609,613
委託者報酬	26,998,368	50,017,862
その他費用	1,051,735	1,105,150
営業費用合計	30,202,954	54,732,625
営業利益又は営業損失（△）	△ 827,967,976	△ 655,613,125
経常利益又は経常損失（△）	△ 827,967,976	△ 655,613,125
当期純利益又は当期純損失（△）	△ 827,967,976	△ 655,613,125
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（△）	△ 211,866,407	△ 70,328,950
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 360,239,097	△ 1,406,128,889
剰余金増加額又は欠損金減少額	224,432,128	913,956,548
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	224,432,128	913,956,548
剰余金減少額又は欠損金増加額	519,681,444	1,054,382,975
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	519,681,444	1,054,382,975
分配金	※1 134,538,907	※1 218,726,349
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△ 1,406,128,889	△ 2,350,565,840

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2024年6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2024年6月17日としており、2025年6月15日が休日のため、当計算期間末日を2025年6月16日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
1. ※1 期首元本額	25,221,028,431円	22,423,151,229円
期中追加設定元本額	11,346,984,854円	13,807,969,263円
期中一部解約元本額	14,144,862,056円	14,358,485,578円
2. 計算期間末日における受益権の総数	22,423,151,229口	21,872,634,914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1,406,128,889円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,350,565,840円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（107,096,283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（980,763,790円）及び分配準備積立金（83,495,064円）より分配対象額は1,171,355,137円（1万口当たり522.39円）であり、うち134,538,907円（1万口当たり60円）を分配金額としております。	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（105,797,463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（989,739,662円）及び分配準備積立金（28,562,353円）より分配対象額は1,124,099,478円（1万口当たり513.93円）であり、うち218,726,349円（1万口当たり100円）を分配金額としております。

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

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	第9期 2025年6月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	△597,005,329	△540,108,150
合計	△597,005,329	△540,108,150

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9373円 (9,373円)	0.8925円 (8,925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	15,310,914,564	19,503,042,971	
親投資信託受益証券 合計			19,503,042,971	
合計			19,503,042,971	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年6月17日現在 金 額 (円)	2025年6月16日現在 金 額 (円)
資産の部		

流動資産		
コール・ローン	551,265,147	371,897,741
国債証券	100,536,383,570	112,302,429,390
地方債証券	6,991,689,200	6,097,020,700
特殊債券	3,954,024,200	3,843,766,200
社債券	8,953,662,000	8,720,607,000
未収利息	273,015,858	354,403,183
前払費用	26,969,752	30,738,602
流動資産合計	121,287,009,727	131,720,862,816
資産合計	121,287,009,727	131,720,862,816
負債の部		
流動負債		
未払金	200,000,000	-
未払解約金	26,075,931	21,974,891
流動負債合計	226,075,931	21,974,891
負債合計	226,075,931	21,974,891
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	91,769,046,895	103,390,699,779
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	29,291,886,901	28,308,188,146
元本等合計	121,060,933,796	131,698,887,925
純資産合計	121,060,933,796	131,698,887,925
負債純資産合計	121,287,009,727	131,720,862,816

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
有価証券の評価基準及び評価方法	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な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6月17日現在	2025年6月16日現在
1. ※1 期首	2023年6月16日	2024年6月18日
期首元本額	81,482,693,217円	91,769,046,895円
期中追加設定元本額	28,834,163,818円	29,241,960,313円
期中一部解約元本額	18,547,810,140円	17,620,307,429円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	34,251,260円	32,289,249円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	214,018,411円	165,868,655円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	41,043,894円	35,582,786円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	510,580,994円	420,295,551円
DCダイワ日本債券インデックス	10,373,209,124円	10,852,963,402円
ダイワ国内債券インデックス(ラップ専用)	16,035,511,576円	26,112,989,477円
ダイワ・バランスファンド35VA	8,266,520,169円	7,359,581,695円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	1,455,649,064円	1,366,798,648円
ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	186,728,513円	163,662,413円
ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)	207,601,314円	178,299,358円

ダイワ・ノーロード 日本債券 ファンド	60,843,581円	47,479,769円
ダイワファンドラップ 日本債券 インデックス	28,754,589,712円	31,824,691,835円
ダイワ日本債券インデックス （ダイワSMA専用）	15,916,146,639円	15,310,914,564円
ダイワファンドラップオンライ ン 日本債券インデックス	1,729,671,691円	1,747,985,093円
スタイル9（4資産分散・保守 型）	2,103,275円	9,389,402円
スタイル9（4資産分散・バラン ス型）	4,723,980円	18,083,199円
スタイル9（4資産分散・積極 型）	489,227円	2,043,691円
スタイル9（6資産分散・保守 型）	1,426,296円	3,767,446円
スタイル9（6資産分散・バラン ス型）	9,366,134円	34,455,402円
スタイル9（6資産分散・積極 型）	810,659円	2,523,674円
スタイル9（8資産分散・保守 型）	1,868,339円	6,108,052円
スタイル9（8資産分散・バラン ス型）	7,325,726円	30,318,323円
スタイル9（8資産分散・積極 型）	1,414,372円	3,553,566円
ダイワ国内債券インデックス （投資一任専用）	-円	8,444,232円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	729,326,060円	623,698,801円
ダイワ投信倶楽部日本債券イン デックス	5,933,409,590円	5,726,038,799円
ダイワライフスタイル2 5	458,021,377円	448,275,204円
ダイワライフスタイル5 0	640,423,493円	659,038,099円
ダイワライフスタイル7 5	191,972,425円	195,559,394円
計	91,769,046,895円	103,390,699,779円
2. 期末日における受益権の総数	91,769,046,895口	103,390,699,779口

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

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

II 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	△2,362,219,800	△3,717,321,680
地方債証券	△58,396,600	△117,546,800
特殊債券	△58,579,600	△72,261,000
社債券	△33,639,200	△72,342,600

合計	△2,512,835,200	△3,979,472,080

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	1.3192円	1.2738円
（1万口当たり純資産額）	（13,192円）	（12,738円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 （円）	備考
国債証券	463 2年国債	50,000,000	49,888,000	
	464 2年国債	720,000,000	718,099,200	
	465 2年国債	250,000,000	249,230,000	
	466 2年国債	900,000,000	898,092,000	
	467 2年国債	270,000,000	269,705,700	
	468 2年国債	230,000,000	229,682,600	
	469 2年国債	900,000,000	899,919,000	
	470 2年国債	150,000,000	150,214,500	
	471 2年国債	250,000,000	250,727,500	
	472 2年国債	490,000,000	489,637,400	
	149 5年国債	1,150,000,000	1,141,145,000	
	150 5年国債	1,400,000,000	1,386,084,000	
	151 5年国債	850,000,000	839,749,000	
	152 5年国債	600,000,000	593,754,000	
	153 5年国債	1,000,000,000	985,450,000	
	154 5年国債	1,300,000,000	1,280,786,000	
	155 5年国債	730,000,000	721,371,400	

156 5年国債	1,080,000,000	1,064,577,600	
157 5年国債	200,000,000	196,736,000	
158 5年国債	1,310,000,000	1,285,096,900	
161 5年国債	850,000,000	836,893,000	
162 5年国債	500,000,000	491,275,000	
163 5年国債	1,000,000,000	985,720,000	
164 5年国債	270,000,000	263,746,800	
165 5年国債	450,000,000	441,112,500	
166 5年国債	1,100,000,000	1,082,015,000	
167 5年国債	150,000,000	147,220,500	
168 5年国債	400,000,000	395,496,000	
169 5年国債	300,000,000	295,530,000	
170 5年国債	300,000,000	296,115,000	
171 5年国債	50,000,000	48,957,000	
172 5年国債	300,000,000	294,957,000	
173 5年国債	360,000,000	354,693,600	
174 5年国債	740,000,000	732,119,000	
175 5年国債	500,000,000	498,160,000	
176 5年国債	620,000,000	620,533,200	
177 5年国債	250,000,000	251,295,000	
178 5年国債	1,050,000,000	1,049,517,000	
1 40年国債	100,000,000	98,051,000	
2 40年国債	110,000,000	102,933,600	
3 40年国債	195,000,000	180,263,850	
4 40年国債	180,000,000	163,837,800	
5 40年国債	185,000,000	159,314,600	
6 40年国債	285,000,000	237,159,900	
7 40年国債	290,000,000	227,064,200	
8 40年国債	340,000,000	244,293,400	
9 40年国債	220,000,000	111,392,600	
10 40年国債	230,000,000	137,678,000	
11 40年国債	320,000,000	181,232,000	
12 40年国債	380,000,000	186,165,800	
13 40年国債	420,000,000	200,419,800	
14 40年国債	430,000,000	218,328,200	
15 40年国債	410,000,000	230,059,200	
16 40年国債	900,000,000	554,517,000	
17 40年国債	1,080,000,000	874,249,200	
18 40年国債	135,000,000	136,089,450	

2 CT5年国債	900,000,000	884,016,000	
1 CT10年国債	400,000,000	380,588,000	
2 CT10年国債	800,000,000	777,464,000	
344 10年国債	780,000,000	774,922,200	
345 10年国債	950,000,000	941,906,000	
346 10年国債	780,000,000	771,880,200	
347 10年国債	900,000,000	888,597,000	
348 10年国債	1,050,000,000	1,034,481,000	
349 10年国債	1,250,000,000	1,229,075,000	
350 10年国債	800,000,000	784,792,000	
351 10年国債	600,000,000	587,226,000	
352 10年国債	20,000,000	19,521,000	
353 10年国債	750,000,000	729,952,500	
354 10年国債	1,100,000,000	1,067,440,000	
355 10年国債	320,000,000	309,555,200	
356 10年国債	700,000,000	675,080,000	
357 10年国債	620,000,000	596,049,400	
358 10年国債	1,100,000,000	1,053,855,000	
359 10年国債	1,000,000,000	955,700,000	
360 10年国債	1,300,000,000	1,238,744,000	
361 10年国債	750,000,000	712,515,000	
362 10年国債	1,000,000,000	947,140,000	
363 10年国債	1,080,000,000	1,019,703,600	
364 10年国債	1,280,000,000	1,204,313,600	
365 10年国債	1,450,000,000	1,359,433,000	
366 10年国債	900,000,000	846,657,000	
367 10年国債	1,050,000,000	984,343,500	
368 10年国債	1,250,000,000	1,167,287,500	
369 10年国債	1,250,000,000	1,189,312,500	
370 10年国債	1,550,000,000	1,469,353,500	
371 10年国債	1,060,000,000	992,965,600	
372 10年国債	1,050,000,000	1,011,969,000	
373 10年国債	1,000,000,000	944,190,000	
374 10年国債	490,000,000	468,709,500	
375 10年国債	1,000,000,000	978,340,000	
376 10年国債	810,000,000	775,842,300	
377 10年国債	950,000,000	931,703,000	
378 10年国債	750,000,000	746,790,000	
1 30年国債	16,000,000	17,229,600	

2 30年国債	184,000,000	195,777,840	
3 30年国債	30,000,000	31,859,700	
4 30年国債	36,000,000	39,541,320	
5 30年国債	28,000,000	29,837,080	
6 30年国債	24,000,000	25,942,800	
7 30年国債	55,000,000	59,303,200	
8 30年国債	27,000,000	28,211,220	
9 30年国債	43,000,000	43,682,410	
10 30年国債	45,000,000	44,649,000	
11 30年国債	40,000,000	41,415,600	
12 30年国債	60,000,000	63,913,800	
13 30年国債	75,000,000	79,265,250	
14 30年国債	82,000,000	89,230,760	
15 30年国債	50,000,000	54,838,000	
16 30年国債	250,000,000	274,115,000	
17 30年国債	130,000,000	141,324,300	
18 30年国債	80,000,000	86,180,000	
19 30年国債	500,000,000	538,085,000	
21 30年国債	60,000,000	64,386,600	
22 30年国債	170,000,000	185,572,000	
24 30年国債	92,000,000	100,138,320	
25 30年国債	150,000,000	159,972,000	
26 30年国債	300,000,000	322,470,000	
27 30年国債	150,000,000	162,256,500	
28 30年国債	350,000,000	376,978,000	
29 30年国債	200,000,000	212,164,000	
30 30年国債	220,000,000	229,847,200	
31 30年国債	300,000,000	308,022,000	
32 30年国債	385,000,000	398,159,300	
33 30年国債	280,000,000	277,082,400	
34 30年国債	270,000,000	272,548,800	
35 30年国債	270,000,000	263,690,100	
36 30年国債	350,000,000	339,972,500	
37 30年国債	450,000,000	428,553,000	
38 30年国債	260,000,000	242,387,600	
39 30年国債	270,000,000	254,785,500	
40 30年国債	240,000,000	222,280,800	
41 30年国債	250,000,000	227,132,500	
42 30年国債	320,000,000	289,715,200	

43 30年国債	300,000,000	270,819,000	
44 30年国債	300,000,000	269,850,000	
45 30年国債	300,000,000	259,635,000	
46 30年国債	300,000,000	258,444,000	
47 30年国債	350,000,000	305,945,500	
48 30年国債	470,000,000	394,630,800	
49 30年国債	220,000,000	184,069,600	
50 30年国債	400,000,000	294,596,000	
51 30年国債	400,000,000	260,320,000	
52 30年国債	400,000,000	271,600,000	
53 30年国債	350,000,000	241,920,000	
54 30年国債	400,000,000	288,136,000	
55 30年国債	350,000,000	250,754,000	
56 30年国債	390,000,000	277,890,600	
57 30年国債	350,000,000	248,038,000	
58 30年国債	510,000,000	359,478,600	
59 30年国債	350,000,000	239,116,500	
60 30年国債	350,000,000	249,816,000	
61 30年国債	300,000,000	202,362,000	
62 30年国債	400,000,000	253,896,000	
63 30年国債	330,000,000	202,075,500	
64 30年国債	330,000,000	200,517,900	
65 30年国債	370,000,000	223,095,200	
66 30年国債	270,000,000	161,443,800	
67 30年国債	470,000,000	295,724,000	
68 30年国債	370,000,000	230,939,200	
69 30年国債	410,000,000	261,268,400	
70 30年国債	420,000,000	265,742,400	
71 30年国債	400,000,000	251,100,000	
72 30年国債	400,000,000	249,300,000	
73 30年国債	360,000,000	222,922,800	
74 30年国債	420,000,000	282,332,400	
75 30年国債	380,000,000	275,800,200	
76 30年国債	380,000,000	281,846,000	
77 30年国債	375,000,000	291,480,000	
78 30年国債	400,000,000	294,376,000	
79 30年国債	370,000,000	257,090,800	
80 30年国債	330,000,000	266,580,600	
81 30年国債	375,000,000	287,261,250	

82 30年国債	330,000,000	264,976,800	
83 30年国債	350,000,000	308,003,500	
84 30年国債	300,000,000	257,727,000	
85 30年国債	407,000,000	365,840,090	
86 30年国債	220,000,000	202,268,000	
90 20年国債	20,000,000	20,396,400	
91 20年国債	100,000,000	102,107,000	
92 20年国債	310,000,000	316,646,400	
93 20年国債	100,000,000	102,273,000	
94 20年国債	130,000,000	133,179,800	
95 20年国債	50,000,000	51,553,500	
96 20年国債	55,000,000	56,491,050	
97 20年国債	40,000,000	41,288,800	
98 20年国債	320,000,000	329,600,000	
99 20年国債	100,000,000	103,287,000	
100 20年国債	155,000,000	160,916,350	
101 20年国債	350,000,000	365,246,000	
108 20年国債	300,000,000	310,629,000	
109 20年国債	55,000,000	57,019,050	
110 20年国債	260,000,000	271,432,200	
111 20年国債	400,000,000	419,952,000	
112 20年国債	250,000,000	261,452,500	
113 20年国債	310,000,000	324,796,300	
114 20年国債	70,000,000	73,448,900	
115 20年国債	180,000,000	189,646,200	
116 20年国債	200,000,000	211,040,000	
117 20年国債	200,000,000	210,130,000	
118 20年国債	95,000,000	99,578,050	
119 20年国債	93,000,000	96,571,200	
120 20年国債	317,000,000	326,069,370	
121 20年国債	200,000,000	208,942,000	
122 20年国債	200,000,000	207,942,000	
123 20年国債	200,000,000	211,376,000	
124 20年国債	300,000,000	315,498,000	
125 20年国債	130,000,000	138,339,500	
126 20年国債	110,000,000	115,828,900	
127 20年国債	350,000,000	366,646,000	
128 20年国債	250,000,000	262,157,500	
129 20年国債	200,000,000	208,594,000	

130 20年国債	140,000,000	146,081,600	
131 20年国債	150,000,000	155,589,000	
132 20年国債	100,000,000	103,770,000	
133 20年国債	100,000,000	104,410,000	
134 20年国債	30,000,000	31,330,200	
135 20年国債	92,000,000	95,500,600	
136 20年国債	550,000,000	567,292,000	
138 20年国債	300,000,000	307,407,000	
139 20年国債	370,000,000	381,662,400	
140 20年国債	570,000,000	591,597,300	
141 20年国債	400,000,000	414,920,000	
142 20年国債	240,000,000	250,696,800	
143 20年国債	210,000,000	216,113,100	
144 20年国債	140,000,000	143,029,600	
145 20年国債	340,000,000	352,032,600	
146 20年国債	20,000,000	20,681,400	
147 20年国債	600,000,000	614,730,000	
148 20年国債	400,000,000	405,648,000	
149 20年国債	432,000,000	437,201,280	
150 20年国債	670,000,000	670,824,100	
151 20年国債	550,000,000	539,407,000	
152 20年国債	850,000,000	830,764,500	
153 20年国債	300,000,000	295,035,000	
154 20年国債	580,000,000	563,023,400	
155 20年国債	660,000,000	625,495,200	
156 20年国債	560,000,000	495,376,000	
157 20年国債	710,000,000	609,826,100	
158 20年国債	500,000,000	441,830,000	
159 20年国債	480,000,000	426,705,600	
160 20年国債	500,000,000	447,280,000	
161 20年国債	550,000,000	483,158,500	
162 20年国債	690,000,000	602,294,100	
163 20年国債	550,000,000	477,009,500	
164 20年国債	650,000,000	552,870,500	
165 20年国債	470,000,000	397,018,400	
166 20年国債	720,000,000	620,920,800	
167 20年国債	550,000,000	458,353,500	
168 20年国債	660,000,000	538,520,400	
169 20年国債	600,000,000	478,692,000	

	170 20年国債	550,000,000	435,616,500	
	171 20年国債	520,000,000	408,631,600	
	172 20年国債	280,000,000	221,998,000	
	173 20年国債	650,000,000	511,634,500	
	174 20年国債	800,000,000	625,128,000	
	175 20年国債	600,000,000	473,286,000	
	176 20年国債	700,000,000	548,254,000	
	177 20年国債	560,000,000	427,996,800	
	178 20年国債	680,000,000	525,198,000	
	179 20年国債	600,000,000	460,302,000	
	180 20年国債	650,000,000	522,593,500	
	181 20年国債	520,000,000	423,233,200	
	182 20年国債	640,000,000	536,492,800	
	183 20年国債	490,000,000	429,852,500	
	184 20年国債	550,000,000	456,714,500	
	185 20年国債	580,000,000	479,167,000	
	186 20年国債	600,000,000	529,086,000	
	187 20年国債	450,000,000	381,906,000	
	188 20年国債	350,000,000	311,566,500	
	189 20年国債	530,000,000	494,437,000	
	190 20年国債	430,000,000	393,424,200	
	191 20年国債	400,000,000	377,232,000	
	192 20年国債	285,000,000	285,763,800	
	27 メキシコ国債	100,000,000	97,250,100	
	11 フィリピン共和国	100,000,000	98,183,700	
国債証券 合計			112,302,429,390	
地方債証券	796 東京都公債	100,000,000	95,555,200	
	808 東京都公債	100,000,000	94,529,200	
	827 東京都公債	100,000,000	93,672,300	
	16 東京都20年	100,000,000	103,391,900	
	3-5 北海道公債	100,000,000	93,725,700	
	37-2 宮城県公債	100,000,000	93,298,500	
	262 神奈川県公債	100,000,000	96,786,300	
	27 神奈川県20年	100,000,000	98,760,700	
	31 神奈川県20年	100,000,000	93,408,300	
	420 大阪府公債	200,000,000	197,295,600	
	7 大阪府20年	200,000,000	207,277,000	
	26-2 京都府15年	100,000,000	100,059,000	

2-1 京都府公債	200,000,000	190,434,200	
19兵庫県公債20年	100,000,000	100,906,300	
2-1 静岡県公債	100,000,000	95,194,600	
8 静岡県20年	200,000,000	209,289,400	
21-5 愛知県公債	100,000,000	104,669,600	
26-4 愛知県20年	100,000,000	100,345,900	
27-12 愛知県15年	100,000,000	97,796,000	
29-5 広島県公債	100,000,000	98,226,500	
25-1 広島県20年	100,000,000	102,548,800	
2-7 埼玉県公債	100,000,000	94,539,000	
4 埼玉県30年	100,000,000	80,524,800	
9 埼玉県20年	100,000,000	104,726,000	
12 埼玉県20年	100,000,000	102,893,200	
29-1 福岡県公債	100,000,000	98,645,800	
5-1 福岡県公債	100,000,000	94,690,400	
13 千葉県20年	100,000,000	102,644,900	
16 千葉県20年	100,000,000	100,548,600	
28-2 新潟県公債	100,000,000	98,964,500	
168 共同発行地方	100,000,000	98,891,000	
170 共同発行地方	200,000,000	197,356,200	
195 共同発行地方	100,000,000	95,853,800	
196 共同発行地方	100,000,000	95,860,700	
206 共同発行地方	100,000,000	95,066,700	
244 共同発行地方	200,000,000	187,590,800	
255 共同発行地方	100,000,000	96,365,000	
4-3 長崎県公債	100,000,000	93,779,400	
6-1 大阪市5年	100,000,000	98,092,800	
6-2 大阪市公債	100,000,000	95,775,000	
11 名古屋市20年	200,000,000	208,846,400	
10 京都市20年	100,000,000	103,501,500	
20-1 神戸市20年	100,000,000	104,129,000	
14 横浜市20年	100,000,000	103,735,500	
19 横浜市20年	100,000,000	104,491,400	
26-5 札幌市15年	100,000,000	99,409,600	
2-4 札幌市公債	100,000,000	94,606,700	
4 川崎市公債30年	100,000,000	96,989,900	
1 北九州市15年	100,000,000	99,259,700	
17 北九州市20年	100,000,000	100,142,700	
23-4 福岡市20年	100,000,000	103,967,000	

	1-5 千葉市公債	100,000,000	95,106,500	
	3-2 徳島県公債	100,000,000	93,164,800	
	1-1 山梨県公債	100,000,000	95,497,500	
	2-2 岡山県公債	100,000,000	94,192,900	
地方債証券 合計			6,097,020,700	
特殊債券	47日本政策投資C0	100,000,000	99,528,400	
	174 日本政策投資	300,000,000	282,299,700	
	69 政保政策投資C	100,000,000	94,252,100	
	247 道路機構	200,000,000	152,636,200	
	86 政保道路機構	100,000,000	103,709,400	
	97 政保道路機構	100,000,000	104,396,800	
	160 政保道路機構	200,000,000	206,921,200	
	223 政保道路機構	100,000,000	99,294,600	
	235 政保道路機構	100,000,000	97,074,300	
	284 政保道路機構	200,000,000	167,881,000	
	298 政保道路機構	100,000,000	87,100,600	
	321 政保道路機構	200,000,000	196,801,000	
	403 政保道路機構	100,000,000	94,687,200	
	478 政保道路機構	100,000,000	96,544,500	
	F124地方公共団体	100,000,000	100,997,300	
	F143地方公共団体	100,000,000	100,892,800	
	1 地方公共団15年	100,000,000	100,946,200	
	31 地方公共団20	100,000,000	102,272,800	
	F192地方公共団体	100,000,000	100,459,400	
	F221地方公共団体	200,000,000	200,010,000	
	F226地方公共団体	100,000,000	100,056,900	
	97政保地方公共団	100,000,000	98,597,500	
	129 地方公共団体	200,000,000	190,053,600	
	F568地方公共団体	200,000,000	174,866,800	
	4 国際協力銀行C0	100,000,000	98,383,200	
	127 都市再生	100,000,000	99,091,800	
	80 住宅支援機構	100,000,000	100,969,100	
	123 住宅支援機構	100,000,000	103,148,300	
	33 沖縄振興開発	200,000,000	190,900,000	
	19 利付商工債	100,000,000	98,993,500	
特殊債券 合計			3,843,766,200	
社債券	39 BPCE S.A.	100,000,000	99,227,000	
	4 香港上海銀行	100,000,000	99,480,700	
	33 首都高速道路	100,000,000	98,062,000	

30 阪神高速道路	100,000,000	98,868,300	
20 成田国際空港	100,000,000	99,161,000	
8 ビーエヌピーパリバ	100,000,000	98,797,500	
111 東日本高速道	100,000,000	98,027,200	
101 中日本高速道	400,000,000	392,422,800	
88 西日本高速道	100,000,000	97,414,600	
32大和ハウス工業	300,000,000	297,973,800	
22 積水ハウス	100,000,000	97,831,300	
12 アサヒグループHD	100,000,000	98,677,800	
11サントリーホールディング	100,000,000	97,964,100	
23 森ビル	100,000,000	82,878,600	
18 セブンアンドアイ	100,000,000	96,394,800	
35 東レ	300,000,000	292,127,400	
1 レゾナックHD	100,000,000	97,881,900	
4 アステラス製薬	300,000,000	294,114,600	
20 ZHD	100,000,000	96,615,100	
18 楽天グループ	100,000,000	86,008,200	
2 AGC	100,000,000	93,954,800	
7 日本製鉄	100,000,000	98,276,800	
32 住友電工	100,000,000	96,847,900	
16 クボタ	100,000,000	98,203,500	
62 日本電気	200,000,000	194,994,200	
17 パナソニック	100,000,000	99,430,000	
41 ソニーG	100,000,000	94,816,600	
15 デンソー	100,000,000	98,527,200	
31 トヨタ自動車	100,000,000	94,059,200	
6 楽天カード	100,000,000	97,644,100	
3 オリックス銀行	200,000,000	195,536,400	
1 日生2021基金	100,000,000	99,216,000	
7 凸版印刷	100,000,000	99,131,400	
31 豊田通商	200,000,000	195,427,000	
63 住友商事	100,000,000	93,573,200	
26 りそなホールデイン	100,000,000	97,910,800	
27 りそなホールデイン	200,000,000	196,025,000	
28 三井住友TB	300,000,000	292,833,900	
33 NTTファイナンス	100,000,000	97,693,600	
38 NTTファイナンス	200,000,000	190,859,000	
81 ホンダファイナンス	100,000,000	97,205,400	
78 トヨタファイナンス	100,000,000	98,491,100	

42 リコーリース	100,000,000	98,578,000	
22 イオンFS	200,000,000	197,513,200	
1 SOMPOHD	100,000,000	97,955,500	
7 三井住友海上	100,000,000	98,958,300	
82 三井不動産	100,000,000	97,732,000	
143 三菱地所	100,000,000	94,710,500	
111 住友不動産	100,000,000	98,233,000	
13 NTTファイナンス	100,000,000	99,091,700	
107東日本旅客鉄	100,000,000	80,846,000	
41 東海旅客鉄道	100,000,000	103,557,900	
52 阪急阪神HLDG	100,000,000	95,528,000	
67 阪急阪神HLDG	100,000,000	93,611,900	
68 名古屋鉄道	200,000,000	195,435,600	
34 KDDI	100,000,000	98,081,600	
15 ソフトバンク	100,000,000	96,412,800	
509 関西電力	100,000,000	98,918,100	
538 関西電力	100,000,000	94,214,000	
448 中国電力	100,000,000	93,653,800	
560 東北電力	200,000,000	185,816,000	
332 北海道電力	100,000,000	87,752,800	
34 沖縄電力	100,000,000	97,801,900	
85 電源開発	100,000,000	98,019,500	
87 電源開発	100,000,000	93,997,700	
11 東京電力パワー	100,000,000	98,744,700	
83 東京電力PG	100,000,000	101,069,000	
16 JERA	100,000,000	98,314,300	
65 東京瓦斯	100,000,000	94,526,900	
44 大阪瓦斯	100,000,000	92,935,200	
50 大阪瓦斯	100,000,000	98,011,300	
社債券 合計		8,720,607,000	
合計		130,963,823,290	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(2024年6月18日から2025年6月16日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	83,474,116	104,128,338
親投資信託受益証券	14,173,157,533	25,407,309,728
未収入金	-	38,323,957
流動資産合計	14,256,631,649	25,549,762,023
資産合計	14,256,631,649	25,549,762,023
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	37,793,524
未払受託者報酬	2,186,138	1,543,080
未払委託者報酬	39,351,312	27,776,300
その他未払費用	819,722	578,579
流動負債合計	42,357,172	67,691,483
負債合計	42,357,172	67,691,483
純資産の部		
元本等		
元本	※1 16,805,681,010	※1 30,504,357,999
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △ 2,591,406,533	※2 △ 5,022,287,459
（分配準備積立金）	542,673,238	585,808,798
元本等合計	14,214,274,477	25,482,070,540
純資産合計	14,214,274,477	25,482,070,540
負債純資産合計	14,256,631,649	25,549,762,023

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期 自 2023年6月16日 至 2024年6月17日	第9期 自 2024年6月18日 至 2025年6月16日
営業収益		
受取利息	16,476	182,153
有価証券売買等損益	△ 451,730,162	△ 121,921,756
営業収益合計	△ 451,713,686	△ 121,739,603
営業費用		
支払利息	14,433	-
受託者報酬	4,274,680	3,188,049
委託者報酬	76,945,835	57,386,614
その他費用	1,602,851	1,195,364
営業費用合計	82,837,799	61,770,027
営業利益又は営業損失（△）	△ 534,551,485	△ 183,509,630
経常利益又は経常損失（△）	△ 534,551,485	△ 183,509,630
当期純利益又は当期純損失（△）	△ 534,551,485	△ 183,509,630
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（△）	△ 231,294,278	△ 21,755,357
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 2,304,435,151	△ 2,591,406,533
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,682,932,046	2,402,672,911
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,682,932,046	2,402,672,911
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,666,646,221	4,671,799,564
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,666,646,221	4,671,799,564
分配金	※ 1 -	※ 1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△ 2,591,406,533	△ 5,022,287,459

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2024年6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2024年6月17日としており、2025年6月15日が休日のため、当計算期間末日を2025年6月16日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
1. ※1 期首元本額	17,697,664,507円	16,805,681,010円
期中追加設定元本額	11,562,078,814円	29,874,378,732円
期中一部解約元本額	12,454,062,311円	16,175,701,743円
2. 計算期間末日における受益権の総数	16,805,681,010口	30,504,357,999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2,591,406,533円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は5,022,287,459円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（301,120,409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（1,715,628,467円）及び分配準備積立金（241,552,829円）より分配対象額は2,258,301,705円（1万口当たり1,343.77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（355,377,752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（3,923,077,934円）及び分配準備積立金（230,431,046円）より分配対象額は4,508,886,732円（1万口当たり1,478.11円）であり、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

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

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	第9期
	2025年6月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	△252,394,370	△115,273,752
合計	△252,394,370	△115,273,752

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8458円 (8,458円)	0.8354円 (8,354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	30,468,053,398	25,407,309,728	
親投資信託受益証券 合計			25,407,309,728	
合計			25,407,309,728	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

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

預金	1,766,384,203	1,213,941,714
コール・ローン	1,134,496,806	1,202,132,901
国債証券	122,603,987,234	131,381,088,870
派生商品評価勘定	547,672,494	19,112,737
未収入金	256,710	948,413
未収利息	870,695,083	950,523,358
前払費用	43,765,372	123,929,595
差入委託証拠金	231,066,642	226,471,478
流動資産合計	127,198,324,544	135,118,149,066
資産合計	127,198,324,544	135,118,149,066
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	297,470,129	1,081,611,756
未払金	848,406	11,810,530
未払解約金	33,437,142	62,422,385
流動負債合計	331,755,677	1,155,844,671
負債合計	331,755,677	1,155,844,671
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	150,884,982,568	160,646,455,421
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△24,018,413,701	△26,684,151,026
元本等合計	126,866,568,867	133,962,304,395
純資産合計	126,866,568,867	133,962,304,395
負債純資産合計	127,198,324,544	135,118,149,066

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価 方法	国債証券

	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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. 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6月17日現在	2025年6月16日現在
1. ※1 期首	2023年6月16日	2024年6月18日
期首元本額	141,933,741,025円	150,884,982,568円
期中追加設定元本額	40,419,718,586円	44,552,509,331円

期中一部解約元本額	31,468,477,043円	34,791,036,478円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワバランスファンド2023-01 （適格機関投資家専用）	2,345,854,351円	-円
ダイワファンドラップ 外国債券 インデックス（為替ヘッジあ り）	116,437,041,046円	116,741,899,391円
ダイワファンドラップオンライ ン 外国債券インデックス（為替 ヘッジあり）	4,599,899,537円	4,792,001,832円
ダイワ先進国債券インデックス （為替ヘッジあり）（ラップ専 用）	18,119,568円	21,625,656円
ダイワバランスファンド2021-02 （適格機関投資家専用）	3,691,729,083円	3,888,821,561円
ダイワ先進国債券インデックス （為替ヘッジあり）（投資一任 専用）	-円	11,715,977円
ダイワ外国債券インデックス （為替ヘッジあり）（ダイワS MA専用）	16,856,752,538円	30,468,053,398円
ダイワバランスファンド2023-08 （適格機関投資家専用）	2,338,208,341円	-円
ダイワバランスファンド2024-01 （適格機関投資家専用）	2,268,146,411円	2,376,780,748円
ダイワバランスファンド2024-05 （適格機関投資家専用）	2,329,231,693円	2,345,556,858円
計	150,884,982,568円	160,646,455,421円
2. 期末日における受益権の総数	150,884,982,568口	160,646,455,421口
3. ※2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その 差額は24,018,413,701円であ ります。	貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その 差額は26,684,151,026円であ ります。

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における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	2025年6月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	686,388,010	338,753,591
合計	686,388,010	338,753,591

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 債券関連

種類	2024年6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
債券先物取引								
買建	2,102,527,984	-	2,130,027,159	27,499,175	1,952,330,673	-	1,959,625,843	7,295,170
合計	2,102,527,984	-	2,130,027,159	27,499,175	1,952,330,673	-	1,959,625,843	7,295,170

（注） 1. 時価の算定方法

債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2. 通貨関連

種類	2024年6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	124,144,766,074	-	123,922,062,884	222,703,190	133,122,565,752	-	134,192,359,941	△1,069,794,189
アメリカ・ドル	56,537,161,105	-	56,787,658,356	△250,497,251	59,522,290,805	-	59,660,395,490	△138,104,685
イギリス・ポンド	6,549,941,192	-	6,555,959,696	△6,018,504	7,855,894,782	-	7,909,448,658	△53,553,876
イスラエル・シェケル	501,946,602	-	503,870,427	△1,923,825	447,732,735	-	436,423,176	11,309,559
オーストラリア・ドル	1,792,406,775	-	1,789,466,112	2,940,663	1,656,065,932	-	1,674,506,730	△18,440,798
オフショア・人民元	12,653,663,385	-	12,688,397,505	△34,734,120	15,553,876,935	-	15,605,895,030	△52,018,095
カナダ・ドル	2,679,675,175	-	2,670,677,220	8,997,955	2,745,198,236	-	2,781,829,680	△36,631,444
シンガポール・ドル	632,703,708	-	634,615,800	△1,912,092	586,730,157	-	590,673,585	△3,943,428
スウェーデン・クローナ	316,454,982	-	317,587,554	△1,132,572	257,460,256	-	260,466,899	△3,006,643
デンマーク・クローネ	407,755,647	-	403,512,012	4,243,635	319,197,161	-	324,752,113	△5,554,952
ニュージーランド・ドル	299,709,388	-	300,677,838	△968,450	372,738,757	-	376,738,014	△3,999,257
ノルウェー・クローネ	228,045,706	-	225,459,668	2,586,038	229,252,557	-	236,728,450	△7,475,893
ポーランド・ズロチ	734,895,305	-	710,494,358	24,400,947	834,741,336	-	846,518,918	△11,777,582
マレーシア・リンギット	638,502,010	-	637,354,210	1,147,800	647,994,316	-	649,302,808	△1,308,492
メキシコ・ペソ	1,109,162,182	-	1,027,983,216	81,178,966	1,082,865,077	-	1,113,648,400	△30,783,323
ユーロ	39,062,742,912	-	38,668,348,912	394,394,000	41,010,526,710	-	41,725,031,990	△714,505,280
合計	124,144,766,074	-	123,922,062,884	222,703,190	133,122,565,752	-	134,192,359,941	△1,069,794,189

(注) 1. 時価の算定方法

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

- 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6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	0.8408円	0.8339円
(1万口当たり純資産額)	(8,408円)	(8,339円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	7,950,000.000	8,354,019.000	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	400,000.000	416,296.000	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	1,500,000.000	1,647,885.000	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	630,000.000	670,824.000	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	1,300,000.000	1,361,867.000	

3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	430,000.000	381,741.100	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,410,000.000	1,360,142.400	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	390,000.000	386,220.900	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,970,000.000	1,964,523.400	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	600,000.000	528,816.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	3,700,000.000	2,981,238.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	670,000.000	537,514.200	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	1,500,000.000	1,127,100.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,000,000.000	747,530.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,000,000.000	1,579,200.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,500,000.000	1,892,575.000	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	1,100,000.000	929,533.000	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	532,000.000	456,477.280	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	1,000,000.000	840,850.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,200,000.000	2,584,864.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	940,000.000	727,503.600	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	370,000.000	277,903.300	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	800,000.000	586,528.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	300,000.000	203,859.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	1,070,000.000	724,336.500	

1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,750,000.000	5,581,985.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	500,000.000	320,895.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	10,350,000.000	10,060,510.500	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	722,140.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	5,000,000.000	4,860,150.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	900,000.000	662,589.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	5,000,000.000	4,854,450.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	950,000.000	697,708.500	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	21,000,000.000	20,268,150.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	1,000,000.000	698,350.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	700,000.000	487,564.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	4,000,000.000	3,881,400.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	1,000,000.000	727,750.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	1,000,000.000	743,320.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	4,000,000.000	3,885,000.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	3,000,000.000	2,905,650.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	1,800,000.000	1,303,722.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	4,300,000.000	4,187,770.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,350,000.000	2,595,848.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,500,000.000	6,207,695.000	

3% United States Treasury Note/Bond 20490215	1,500,000.000	1,082,010.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	1,800,000.000	1,264,590.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	2,300,000.000	2,168,371.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	4,500,000.000	4,397,850.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	2,000,000.000	1,823,900.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	1,500,000.000	919,680.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	300,000.000	188,700.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,500,000.000	2,415,325.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	4,500,000.000	4,028,355.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	1,000,000.000	574,080.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	5,000,000.000	4,250,150.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	2,500,000.000	1,172,250.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	500,000.000	305,260.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	2,800,000.000	2,358,048.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	1,800,000.000	865,818.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,100,000.000	664,675.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	4,000,000.000	3,711,840.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	5,000,000.000	4,232,000.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	1,100,000.000	565,983.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	4,500,000.000	4,155,165.000	

0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	3,300,000.000	3,040,356.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	2,500,000.000	1,372,650.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	4,900,000.000	4,183,522.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	1,000,000.000	928,630.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	600,000.000	405,510.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	5,500,000.000	5,113,350.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	4,600,000.000	4,004,668.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,566,740.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	2,400,000.000	1,489,200.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,600,000.000	1,143,120.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	1,000,000.000	925,970.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	1,500,000.000	1,385,730.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	3,500,000.000	3,385,480.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	4,700,000.000	3,966,612.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	2,400,000.000	1,352,952.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	2,750,000.000	1,793,137.500	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	3,000,000.000	2,886,420.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,573,000.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	1,000,000.000	916,170.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	2,400,000.000	2,306,424.000	

1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	1,500,000.000	1,376,535.000	
0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,000,000.000	2,880,570.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	7,000,000.000	5,907,860.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	1,300,000.000	706,875.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	2,000,000.000	1,351,560.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	4,000,000.000	3,843,880.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	4,000,000.000	3,686,840.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	500,000.000	433,230.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	6,000,000.000	5,557,140.000	
2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	2,500,000.000	1,494,125.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	1,000,000.000	714,510.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	2,500,000.000	2,322,600.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	1,500,000.000	1,448,115.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	4,000,000.000	3,778,880.000	
2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	1,500,000.000	1,462,140.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	4,800,000.000	4,420,656.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	2,300,000.000	1,585,068.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,000,000.000	813,160.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	1,000,000.000	955,680.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	1,500,000.000	1,480,095.000	

2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	2,500,000.000	2,274,450.000	
3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	2,000,000.000	1,414,320.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	4,000,000.000	3,796,480.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	1,200,000.000	1,194,840.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	3,000,000.000	3,013,290.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	4,000,000.000	3,976,000.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	2,000,000.000	1,714,960.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	3,001,110.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	700,000.000	696,416.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	1,000,000.000	978,750.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	4,000,000.000	3,804,040.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	1,000,000.000	879,800.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	1,800,000.000	1,440,000.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131	3,500,000.000	3,463,145.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,500,000.000	1,474,305.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	3,000,000.000	2,820,030.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	1,800,000.000	1,438,650.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	2,500,000.000	2,194,325.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	2,000,000.000	1,974,640.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630	1,000,000.000	1,002,320.000	

4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260715	1,000,000.000	1,004,210.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815	4,800,000.000	4,662,336.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815	1,900,000.000	1,664,115.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430815	1,500,000.000	1,405,890.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	4,700,000.000	4,692,245.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	3,000,000.000	3,039,240.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930	3,000,000.000	3,081,090.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20331115	4,500,000.000	4,560,615.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20431115	600,000.000	589,404.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20531115	2,100,000.000	2,041,305.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301130	1,500,000.000	1,522,635.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	2,500,000.000	2,534,275.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340215	2,900,000.000	2,830,023.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540215	800,000.000	715,744.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440215	1,200,000.000	1,139,712.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310331	2,000,000.000	2,002,840.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270415	5,000,000.000	5,045,950.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340515	4,700,000.000	4,707,614.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	4,000,000.000	4,093,320.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540515	2,500,000.000	2,382,225.000	

4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440515	1,900,000.000	1,832,151.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260531	10,000,000.000	10,067,300.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	5,000,000.000	5,050,450.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310731	3,500,000.000	3,499,230.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340815	3,800,000.000	3,657,690.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540815	2,000,000.000	1,791,640.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,500,000.000	3,518,515.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20341115	2,000,000.000	1,978,280.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20541115	2,200,000.000	2,057,330.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20441115	1,200,000.000	1,154,616.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	3,500,000.000	3,553,935.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311231	3,500,000.000	3,565,870.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350215	4,500,000.000	4,578,390.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550215	2,300,000.000	2,197,558.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20450215	1,500,000.000	1,466,130.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320131	3,500,000.000	3,539,970.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	4,000,000.000	3,998,400.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	5,000,000.000	4,980,650.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550515	500,000.000	487,965.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350515	1,000,000.000	987,100.000	

アメリカ・ドル 小計			407,255,033.180 (58,815,771,892)	
イギリス・ポンド	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	810,000.000	451,494.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	475,000.000	463,362.500	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	730,000.000	380,884.800	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	820,000.000	595,869.400	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	900,000.000	422,946.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	650,000.000	616,629.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	800,000.000	746,040.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	917,000.000	371,605.080	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	500,000.000	268,805.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20541022	1,070,000.000	500,503.200	
	0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,200,000.000	1,057,848.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20411022	300,000.000	176,211.000	
	0.375% United Kingdom Gilt 20301022	400,000.000	331,684.000	
	0.5% United Kingdom Gilt 20611022	850,000.000	225,632.500	
	0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,500,000.000	1,366,665.000	
	0.625% United Kingdom Gilt 20501022	520,000.000	193,429.600	
	0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,330,000.000	910,917.000	
	0.25% United Kingdom Gilt 20310731	1,700,000.000	1,354,084.000	
	0.375% United Kingdom Gilt 20261022	1,050,000.000	1,005,343.500	

1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,000,000.000	440,160.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	1,000,000.000	635,200.000	
0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	200,000.000	177,504.000	
0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	1,300,000.000	992,290.000	
1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	200,000.000	91,392.000	
1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	500,000.000	408,990.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	500,000.000	165,315.000	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	1,100,000.000	1,103,630.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	800,000.000	722,904.000	
3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	1,000,000.000	930,530.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	700,000.000	548,100.000	
4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	600,000.000	476,160.000	
4.5% UNITED KINGDOM GILT 20280607	1,000,000.000	1,016,050.000	
4.625% UNITED KINGDOM GILT 20340131	1,000,000.000	1,013,250.000	
4.75% UNITED KINGDOM GILT 20431022	700,000.000	665,140.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20270307	1,100,000.000	1,096,689.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20540731	300,000.000	260,709.000	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20290722	1,000,000.000	1,005,250.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT 20340731	1,260,000.000	1,237,622.400	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20400131	510,000.000	480,440.400	

4.375% UNITED KINGDOM GILT 20280307	800,000.000	808,424.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20300307	700,000.000	709,436.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	963,000.000	1,032,037.470	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,690,000.000	1,696,050.200	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	915,000.000	886,186.650	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	550,000.000	546,650.500	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	770,000.000	676,468.100	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	500,000.000	505,530.000	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	911,000.000	852,404.480	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	907,500.000	940,433.170	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	743,000.000	643,824.360	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	330,000.000	308,391.600	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	600,000.000	601,944.000	
4% United Kingdom Gilt 20600122	827,000.000	667,529.590	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,200,000.000	1,108,236.000	
3.75% United Kingdom Gilt 20520722	700,000.000	550,991.000	
3.25% United Kingdom Gilt 20440122	875,000.000	678,527.500	
3.5% United Kingdom Gilt 20680722	838,900.000	603,982.830	
3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,150,000.000	917,021.500	
イギリス・ポンド 小計		39,641,348.330 (7,755,036,974)	

イスラエル・ シュケル	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,200,000.000	1,293,072.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	4,000,000.000	3,841,080.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	1,200,000.000	1,014,732.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,000,000.000	936,460.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	1,700,000.000	1,453,262.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,000,000.000	711,650.000	
	2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129	500,000.000	335,865.000	
	4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20350330	1,000,000.000	954,930.000	
イスラエル・シュケル 小計			10,541,051.000 (420,542,608)	
オーストラリ ア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	889,000.000	912,469.600	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	320,000.000	318,656.000	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	359,000.000	373,076.390	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	725,000.000	691,091.750	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	800,000.000	709,032.000	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	184,000.000	162,273.280	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,800,000.000	1,778,148.000	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	658,000.000	638,970.640	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	775,000.000	592,379.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,250,000.000	1,227,100.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	200,000.000	194,488.000	

	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	1,000,000.000	955,910.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	510,000.000	408,239.700	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	1,800,000.000	1,592,424.000	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	850,000.000	718,326.500	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	900,000.000	488,592.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	1,000,000.000	844,990.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	500,000.000	431,490.000	
	3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,000,000.000	928,690.000	
	3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	1,000,000.000	978,400.000	
	3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221	1,000,000.000	953,590.000	
	4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20351221	1,500,000.000	1,510,620.000	
オーストラリア・ドル 小計			17,408,956.860 (1,632,437,885)	
オフショア・人 民元	3.25% China Government Bond 20281122	6,500,000.000	6,917,625.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	11,000,000.000	11,818,400.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	15,000,000.000	15,299,550.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	3,000,000.000	3,081,630.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	5,300,000.000	5,684,780.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	24,000,000.000	24,684,960.000	
	3.28% China Government Bond 20271203	14,000,000.000	14,677,180.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	12,000,000.000	13,149,000.000	

3.81% China Government Bond 20500914	5,500,000.000	7,595,390.000	
3.01% China Government Bond 20280513	8,000,000.000	8,370,480.000	
3.72% China Government Bond 20510412	7,000,000.000	9,547,090.000	
3.02% China Government Bond 20310527	8,800,000.000	9,542,808.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	5,000,000.000	5,076,150.000	
2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	13,000,000.000	13,208,260.000	
3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	6,500,000.000	6,836,570.000	
3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	6,000,000.000	6,435,540.000	
3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	10,000,000.000	10,723,600.000	
4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	7,400,000.000	10,351,564.000	
3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	7,000,000.000	9,551,080.000	
3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	10,600,000.000	13,574,254.000	
2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	3,500,000.000	3,665,375.000	
3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	3,300,000.000	4,368,903.000	
2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	5,300,000.000	5,718,329.000	
2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	12,000,000.000	12,179,280.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	9,800,000.000	10,504,620.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	4,000,000.000	4,191,840.000	
2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	10,500,000.000	10,701,180.000	
3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,000,000.000	6,428,850.000	

2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	8,000,000.000	8,609,360.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	3,000,000.000	3,144,030.000	
2.5% CHINA GOVERNMENT BOND 20270725	12,000,000.000	12,240,360.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	7,000,000.000	7,506,310.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	2,000,000.000	2,134,540.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	13,000,000.000	13,589,810.000	
2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	16,000,000.000	16,346,400.000	
3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	4,000,000.000	4,989,200.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	8,000,000.000	8,655,600.000	
2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	13,000,000.000	13,718,380.000	
2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	8,000,000.000	8,722,880.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	21,000,000.000	22,226,610.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	4,000,000.000	4,128,720.000	
3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	6,000,000.000	7,593,480.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	9,000,000.000	9,669,510.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	11,000,000.000	11,570,350.000	
2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	20,000,000.000	20,558,000.000	
2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	11,000,000.000	11,705,980.000	
2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	15,000,000.000	15,130,800.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	11,000,000.000	11,571,780.000	

3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	7,300,000.000	9,059,446.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	12,000,000.000	12,928,440.000	
2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225	8,000,000.000	8,407,600.000	
2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20290115	10,000,000.000	10,302,800.000	
2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20270225	25,000,000.000	25,253,750.000	
2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225	9,000,000.000	9,479,070.000	
2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325	10,000,000.000	10,384,000.000	
2.05% CHINA GOVERNMENT BOND 20290415	21,000,000.000	21,425,040.000	
2.27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525	10,000,000.000	10,485,000.000	
1.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20260615	20,000,000.000	20,050,800.000	
2.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20310625	21,000,000.000	21,640,500.000	
1.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20290715	10,000,000.000	10,154,300.000	
1.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20270815	10,000,000.000	10,036,700.000	
2.11% CHINA GOVERNMENT BOND 20340825	5,000,000.000	5,177,000.000	
1.42% CHINA GOVERNMENT BOND 20271115	17,000,000.000	16,992,520.000	
2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20341125	18,000,000.000	18,537,480.000	
1.43% CHINA GOVERNMENT BOND 20300125	15,000,000.000	14,957,250.000	
1.92% CHINA GOVERNMENT BOND 20550115	4,000,000.000	4,010,920.000	
1.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20350215	12,000,000.000	11,914,800.000	
1.45% CHINA GOVERNMENT BOND 20280225	5,000,000.000	5,001,950.000	

	1.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20320325	15,000,000.000	15,191,400.000	
	1.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20280525	7,000,000.000	7,004,830.000	
	1.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20350525	7,000,000.000	7,015,960.000	
オフショア・人民元 小計			763,107,944.000 (15,327,480,920)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	560,000.000	460,219.200	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	907,000.000	1,002,788.270	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	300,000.000	344,775.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	620,000.000	654,527.800	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	140,000.000	138,244.400	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	500,000.000	430,505.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,920,000.000	1,898,515.200	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	930,000.000	900,100.500	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	600,000.000	586,848.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	2,020,000.000	1,451,955.800	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,300,000.000	1,269,944.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	2,400,000.000	2,207,880.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	2,000,000.000	1,827,140.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	250,000.000	166,037.500	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	1,500,000.000	1,463,835.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,000,000.000	904,540.000	

	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	500,000.000	462,885.000	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,000,000.000	951,680.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	1,500,000.000	1,527,930.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201	800,000.000	667,880.000	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20331201	1,500,000.000	1,494,495.000	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340601	1,500,000.000	1,460,865.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260801	1,200,000.000	1,217,088.000	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20341201	800,000.000	792,352.000	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20350601	1,000,000.000	987,450.000	
カナダ・ドル 小計			25,270,480.670 (2,685,241,276)	
シンガポール・ ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	203,000.000	208,856.550	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	600,000.000	627,300.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	239,000.000	250,352.500	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	420,000.000	456,120.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	500,000.000	518,500.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	300,000.000	316,674.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	200,000.000	200,536.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	660,000.000	658,020.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	800,000.000	817,600.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	350,000.000	315,700.000	

	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	400,000.000	390,000.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	170,000.000	151,130.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	200,000.000	225,700.000	
シンガポール・ドル 小計			5,136,489.050 (578,111,843)	
スウェーデン・ クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	2,520,000.000	2,822,299.200	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	4,780,000.000	4,725,269.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	2,550,000.000	2,473,500.000	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	500,000.000	504,125.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	3,000,000.000	2,851,500.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	4,000,000.000	3,578,280.000	
スウェーデン・クローナ 小計			16,954,973.200 (257,546,043)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	4,740,000.000	5,764,314.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	3,200,000.000	3,109,280.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	1,700,000.000	1,593,988.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	2,400,000.000	1,272,624.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	2,000,000.000	1,741,780.000	
デンマーク・クローネ 小計			13,481,986.000 (301,052,747)	
ニュージーラン ド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	1,000,000.000	1,019,120.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	300,000.000	283,068.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	300,000.000	246,183.000	

	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	500,000.000	486,585.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	500,000.000	432,070.000	
	2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	500,000.000	432,865.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	200,000.000	130,462.000	
	5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20540515	250,000.000	240,192.500	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20350515	700,000.000	696,850.000	
ニュージーランド・ドル 小計			3,967,395.500 (345,084,061)	
ノルウェー・ク ローネ	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,000,000.000	2,901,300.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	2,000,000.000	1,904,620.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	2,000,000.000	1,837,320.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	2,500,000.000	2,208,800.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	2,000,000.000	1,705,620.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	2,000,000.000	1,780,840.000	
ノルウェー・クローネ 小計			12,338,500.000 (179,648,560)	
ポーランド・ズ ロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	2,640,000.000	2,588,942.400	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	1,815,000.000	1,738,951.500	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	2,300,000.000	2,110,089.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	1,800,000.000	1,487,034.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	900,000.000	851,508.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	1,000,000.000	799,410.000	

	7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	2,000,000.000	2,157,100.000	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	2,000,000.000	2,071,200.000	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725	1,000,000.000	993,610.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20341025	2,000,000.000	1,924,340.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300125	1,500,000.000	1,500,960.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	600,000.000	618,666.000	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	1,800,000.000	1,709,442.000	
ポーランド・ズロチ 小計			20,551,252.900 (801,704,376)	
マレーシア・リンギット	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,760,000.000	1,854,793.600	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,000,000.000	1,043,530.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	1,950,000.000	1,975,174.500	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,400,000.000	1,426,992.000	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,500,000.000	1,523,610.000	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	700,000.000	804,153.000	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	500,000.000	528,915.000	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	1,420,000.000	1,581,525.000	
	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	500,000.000	509,045.000	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,000,000.000	1,102,060.000	
	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	1,600,000.000	1,785,472.000	
	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	1,500,000.000	1,513,980.000	

	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,200,000.000	1,227,336.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,327,482.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	400,000.000	401,188.000	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	1,400,000.000	1,417,220.000	
マレーシア・リングgit 小計			20,022,476.100 (680,385,763)	
メキシコ・ペソ	8% Mexican Bonos 20471107	11,450,000.000	9,446,364.500	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	10,000,000.000	9,591,300.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	10,000,000.000	8,224,200.000	
	7.5% MEXICAN BONOS 20330526	10,000,000.000	9,057,200.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20290301	30,000,000.000	29,834,400.000	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	20,800,000.000	20,571,408.000	
	10% Mexican Bonos 20361120	2,750,000.000	2,879,882.500	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	6,500,000.000	6,459,895.000	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	5,000,000.000	4,572,850.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	12,700,000.000	12,020,042.000	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	14,050,000.000	11,557,811.000	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	10,300,000.000	9,315,217.000	
メキシコ・ペソ 小計			133,530,570.000 (1,017,823,417)	
ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	190,000.000	172,005.100	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	270,000.000	185,697.900	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	200,000.000	193,618.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	150,000.000	129,729.000	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	474,490.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	300,000.000	278,349.000	

0.125% Finland Government Bond 20360415	350,000.000	255,696.000	
0.25% Finland Government Bond 20400915	150,000.000	95,647.500	
0.125% Finland Government Bond 20520415	200,000.000	86,448.000	
0.125% Finland Government Bond 20310915	200,000.000	171,922.000	
FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	400,000.000	390,876.000	
1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	1,300,000.000	1,197,729.000	
2.95% FINLAND GOVERNMENT BOND 20550415	500,000.000	449,785.000	
0.75% Austria Government Bond 20261020	490,000.000	482,821.500	
1.5% Austria Government Bond 20470220	270,000.000	191,295.000	
1.5% Austria Government Bond 20861102	280,000.000	142,970.800	
0.5% Austria Government Bond 20270420	1,000,000.000	974,240.000	
2.1% Austria Government Bond 21170920	200,000.000	127,682.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	700,000.000	658,161.000	
Austria Government Bond 20300220	450,000.000	403,488.000	
0.75% Austria Government Bond 20510320	1,100,000.000	604,340.000	
Austria Government Bond 20401020	500,000.000	302,850.000	
0.85% Austria Government Bond 21200630	100,000.000	34,129.000	
Austria Government Bond 20310220	1,000,000.000	868,930.000	
0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	200,000.000	146,018.000	
0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	150,000.000	56,826.000	

0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	500,000.000	447,490.000	
1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	200,000.000	149,114.000	
2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	1,000,000.000	1,001,600.000	
2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	800,000.000	809,048.000	
1% Belgium Government Bond 20310622	300,000.000	273,549.000	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	460,000.000	389,578.600	
1% Belgium Government Bond 20260622	95,000.000	94,152.600	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	300,000.000	192,339.000	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	730,000.000	713,640.700	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	310,000.000	216,156.800	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	400,000.000	327,600.000	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	500,000.000	446,265.000	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	600,000.000	568,308.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	350,000.000	231,714.000	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	900,000.000	800,865.000	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	600,000.000	384,216.000	
Belgium Government Bond 20271022	300,000.000	286,404.000	
Belgium Government Bond 20311022	400,000.000	338,964.000	
0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	1,000,000.000	848,380.000	
1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	400,000.000	234,164.000	

2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	500,000.000	463,705.000	
3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	1,300,000.000	1,312,857.000	
3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	400,000.000	360,836.000	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20550622	400,000.000	372,340.000	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	455,000.000	497,506.100	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	800,000.000	874,504.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	800,000.000	866,400.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	496,000.000	585,121.280	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	2,000,000.000	2,341,880.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,270,000.000	1,505,000.800	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	1,390,000.000	1,573,076.900	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,020,000.000	1,192,859.400	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	656,000.000	690,039.840	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,098,000.000	1,034,601.480	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,125,000.000	1,985,302.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,150,000.000	2,106,032.500	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,000,000.000	974,740.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	1,100,000.000	1,069,200.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	1,250,000.000	900,787.500	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	200,000.000	189,832.000	

0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	1,300,000.000	1,221,883.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	500,000.000	460,055.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,000,000.000	967,780.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	700,000.000	635,768.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	500,000.000	388,615.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,076,412.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,300,000.000	1,151,085.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	200,000.000	150,252.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	1,500,000.000	1,404,780.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	800,000.000	388,072.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,000,000.000	873,690.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,000,000.000	874,110.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	1,100,000.000	946,957.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	800,000.000	622,992.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	1,000,000.000	1,000,520.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	400,000.000	312,100.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330815	1,700,000.000	1,722,695.000	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340215	800,000.000	783,880.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20540815	1,100,000.000	997,645.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20410515	1,000,000.000	966,670.000	

2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340815	1,000,000.000	1,008,320.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20350215	1,200,000.000	1,197,036.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	200,000.000	91,210.000	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20261210	1,200,000.000	1,202,580.000	
1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270610	1,800,000.000	1,794,906.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	1,000,000.000	976,490.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	2,000,000.000	1,934,760.000	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	1,000,000.000	1,008,260.000	
2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300418	3,000,000.000	3,036,450.000	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	2,300,000.000	2,561,142.000	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,600,000.000	3,086,434.000	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	1,210,000.000	1,365,618.100	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	182,000.000	183,181.180	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	1,265,000.000	1,332,993.750	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	1,143,000.000	1,262,123.460	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,000,000.000	998,600.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	2,410,000.000	2,446,029.500	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	1,990,000.000	1,852,073.100	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,200,000.000	5,186,272.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	1,650,000.000	1,336,731.000	

1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	800,000.000	440,904.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	1,000,000.000	805,980.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	2,700,000.000	2,648,835.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	560,000.000	406,380.800	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,000,000.000	3,835,120.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	1,000,000.000	855,190.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	2,750,000.000	2,609,145.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	1,250,000.000	780,237.500	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	4,000,000.000	3,716,080.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	1,400,000.000	902,230.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	2,200,000.000	1,842,830.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	500,000.000	484,005.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	1,000,000.000	468,810.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	1,100,000.000	903,650.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	1,000,000.000	767,510.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	1,500,000.000	1,445,220.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	2,000,000.000	1,876,020.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,400,000.000	1,178,884.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	1,100,000.000	920,040.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20331125	3,600,000.000	3,713,796.000	

3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20490625	100,000.000	87,060.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270924	2,000,000.000	2,018,580.000	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550525	800,000.000	698,424.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20341125	1,300,000.000	1,279,941.000	
3.2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350525	2,200,000.000	2,190,628.000	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	800,000.000	889,856.000	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	880,000.000	963,028.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	390,000.000	389,091.300	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	910,000.000	865,146.100	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,670,000.000	1,645,434.300	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	700,000.000	648,277.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	250,000.000	177,357.500	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,100,000.000	495,110.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	700,000.000	606,417.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	1,500,000.000	1,391,820.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	1,000,000.000	872,080.000	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	700,000.000	553,336.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715	500,000.000	496,665.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20340715	500,000.000	493,035.000	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,000,000.000	1,071,640.000	

6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	1,135,000.000	1,249,566.900	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	505,000.000	449,136.900	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	500,000.000	461,195.000	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	300,000.000	242,898.000	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	450,000.000	397,876.500	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	350,000.000	255,279.500	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,700,000.000	1,706,562.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	710,000.000	645,567.500	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,050,000.000	2,050,164.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	700,000.000	646,170.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	1,500,000.000	1,495,290.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	900,000.000	915,840.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	700,000.000	699,951.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	500,000.000	481,030.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	3,500,000.000	3,505,565.000	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	500,000.000	472,755.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	900,000.000	667,863.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	900,000.000	737,046.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	500,000.000	459,005.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	600,000.000	566,862.000	

1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	700,000.000	529,851.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,000,000.000	898,980.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	400,000.000	249,872.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	200,000.000	150,140.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	2,000,000.000	1,749,100.000	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	700,000.000	465,787.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	450,000.000	273,937.500	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	300,000.000	265,731.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	300,000.000	262,071.000	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	700,000.000	653,716.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	200,000.000	135,962.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	500,000.000	506,905.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	400,000.000	382,484.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	1,400,000.000	1,479,702.000	
4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	1,000,000.000	1,088,240.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	1,500,000.000	1,581,570.000	
3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,300,000.000	1,341,717.000	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	650,000.000	677,423.500	
3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	500,000.000	523,635.000	
4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	800,000.000	866,592.000	

3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280801	1,000,000.000	1,045,420.000	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,200,000.000	1,241,952.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350201	1,000,000.000	1,037,790.000	
4.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20541001	700,000.000	703,885.000	
3.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311115	1,000,000.000	1,011,210.000	
3.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350801	1,600,000.000	1,626,752.000	
3.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20351001	500,000.000	505,050.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	1,840,000.000	2,052,520.000	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	1,488,000.000	1,746,867.360	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,900,000.000	2,238,827.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	1,650,000.000	1,872,106.500	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	1,270,000.000	1,327,010.300	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,290,000.000	1,465,968.900	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	500,000.000	566,505.000	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,080,000.000	2,237,830.400	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	605,000.000	666,776.550	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,370,000.000	1,428,855.200	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,000,000.000	1,091,390.000	

5% Belgium Government Bond 20350328	750,000.000	872,647.500	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	865,000.000	939,355.400	
4% Belgium Government Bond 20320328	500,000.000	539,805.000	
3% Belgium Government Bond 20340622	300,000.000	300,714.000	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	680,000.000	682,910.400	
2% IRISH TREASURY 20450218	510,000.000	417,414.600	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	500,000.000	435,225.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	150,000.000	135,694.500	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	100,000.000	94,407.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	300,000.000	288,036.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	419,568.000	
IRISH TREASURY 20311018	200,000.000	170,940.000	
0.55% IRISH TREASURY 20410422	200,000.000	134,478.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	380,000.000	412,915.600	
4.15% Austria Government Bond 20370315	300,000.000	330,819.000	
3.8% Austria Government Bond 20620126	170,000.000	179,275.200	
3.15% Austria Government Bond 20440620	400,000.000	388,324.000	
2.4% Austria Government Bond 20340523	800,000.000	771,536.000	
2.75% Finland Government Bond 20280704	120,000.000	122,305.200	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,420,000.000	1,603,094.800	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	910,000.000	885,839.500	

2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,100,000.000	961,213.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	880,000.000	778,236.800	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	500,000.000	495,800.000	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	2,100,000.000	2,082,129.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	820,000.000	785,789.600	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	1,170,000.000	1,153,701.900	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	3,650,000.000	3,576,379.500	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	780,000.000	647,267.400	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	900,000.000	871,164.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	900,000.000	833,040.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	400,000.000	218,688.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	800,000.000	747,680.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	150,000.000	107,793.000	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	1,500,000.000	1,296,225.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	306,819.500	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	1,000,000.000	946,750.000	
0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	900,000.000	674,505.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	500,000.000	331,975.000	
0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,000,000.000	1,742,760.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	1,400,000.000	1,313,606.000	

3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	640,000.000	615,424.000	
3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	1,000,000.000	1,016,680.000	
3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730	630,000.000	654,948.000	
3.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20331031	1,200,000.000	1,249,944.000	
3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290531	1,500,000.000	1,563,870.000	
3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20340430	2,100,000.000	2,132,508.000	
3.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310730	1,000,000.000	1,023,020.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300131	1,000,000.000	1,010,000.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	680,000.000	808,948.400	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,100,000.000	1,192,389.000	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	800,000.000	921,720.000	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	500,000.000	564,720.000	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,000,000.000	1,043,760.000	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	490,000.000	584,927.700	
4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20370415	1,000,000.000	1,090,070.000	
2.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20260721	500,000.000	505,480.000	
2.125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20281017	1,000,000.000	1,002,390.000	
4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20450215	300,000.000	320,439.000	
2.25% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20340418	500,000.000	476,030.000	
1.95% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20290615	500,000.000	496,025.000	

		0.475% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20301018	500,000.000	453,045.000	
		0.3% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20311017	600,000.000	522,390.000	
		3.625% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20540612	400,000.000	387,072.000	
	ユーロ 小計			243,655,262.400 (40,583,220,505)	
国債証券 合計				131,381,088,870 [131,381,088,870]	
合計				131,381,088,870 [131,381,088,870]	

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 165銘柄	100%	44.9%
イギリス・ポンド	国債証券 58銘柄	100%	5.9%
イスラエル・シェケル	国債証券 8銘柄	100%	0.3%
オーストラリア・ドル	国債証券 22銘柄	100%	1.2%
オフショア・人民元	国債証券 71銘柄	100%	11.7%
カナダ・ドル	国債証券 25銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券 13銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 6銘柄	100%	0.2%
デンマーク・クローネ	国債証券 5銘柄	100%	0.2%
ニュージーランド・ドル	国債証券 9銘柄	100%	0.3%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	100%	0.1%
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	100%	0.6%
マレーシア・リングgit	国債証券 16銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 12銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券 268銘柄	100%	30.9%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(2024年6月18日から2025年6月16日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	380,253,007	652,857,748
親投資信託受益証券	11,631,584,155	22,531,157,621
未収入金	-	26,061,156
流動資産合計	12,011,837,162	23,210,076,525
資産合計	12,011,837,162	23,210,076,525
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	319,416,450	545,847,999
未払解約金	-	25,419,888
未払受託者報酬	1,395,839	2,091,504
未払委託者報酬	25,125,871	37,647,906
その他未払費用	523,360	784,240
流動負債合計	346,461,520	611,791,537
負債合計	346,461,520	611,791,537
純資産の部		
元本等		
元本	※1 9,394,601,499	※1 19,152,561,385
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,270,774,143	3,445,723,603
（分配準備積立金）	754,800,123	180,186,182
元本等合計	11,665,375,642	22,598,284,988
純資産合計	11,665,375,642	22,598,284,988
負債純資産合計	12,011,837,162	23,210,076,525

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期 自 2023年6月16日 至 2024年6月17日	第9期 自 2024年6月18日 至 2025年6月16日
営業収益		
受取利息	11,919	230,240
有価証券売買等損益	1,628,551,188	△ 238,223,657
営業収益合計	1,628,563,107	△ 237,993,417
営業費用		
支払利息	8,312	-
受託者報酬	2,530,848	3,593,457
委託者報酬	45,556,722	64,683,745
その他費用	948,909	1,347,391
営業費用合計	49,044,791	69,624,593
営業利益又は営業損失（△）	1,579,518,316	△ 307,618,010
経常利益又は経常損失（△）	1,579,518,316	△ 307,618,010
当期純利益又は当期純損失（△）	1,579,518,316	△ 307,618,010
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（△）	534,544,818	△ 205,103,197
期首剰余金又は期首欠損金（△）	809,111,924	2,270,774,143
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,653,389,842	4,203,943,651
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,653,389,842	4,203,943,651
剰余金減少額又は欠損金増加額	917,284,671	2,380,631,379
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	917,284,671	2,380,631,379
分配金	※ 1 319,416,450	※ 1 545,847,999
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,270,774,143	3,445,723,603

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2024年6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2024年6月17日としており、2025年6月15日が休日のため、当計算期間末日を2025年6月16日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
1. ※1 期首元本額	7,103,019,200円	9,394,601,499円
期中追加設定元本額	8,719,913,600円	20,351,059,548円
期中一部解約元本額	6,428,331,301円	10,593,099,662円
2. 計算期間末日における受益権の総数	9,394,601,499口	19,152,561,385口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

※1 分配金の計算過程	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（275,467,765円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（769,505,733円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,019,290,099円）及び分配準備積立金（29,243,075円）より分配対象額は4,093,506,672円（1万口当たり4,357.30円）であり、うち319,416,450円（1万口当たり340円）を分配金額としております。	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（388,014,540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（7,399,006,190円）及び分配準備積立金（338,019,641円）より分配対象額は8,125,040,371円（1万口当たり4,242.27円）であり、うち545,847,999円（1万口当たり285円）を分配金額としております。

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

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	第9期 2025年6月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,056,282,028	△48,609,203
合計	1,056,282,028	△48,609,203

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2417円 (12,417円)	1.1799円 (11,799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	6,177,489,546	22,531,157,621	
親投資信託受益証券 合計			22,531,157,621	
合計			22,531,157,621	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年6月17日現在 金 額 (円)	2025年6月16日現在 金 額 (円)
資産の部		

流動資産		
預金	2,275,059,100	2,411,669,275
コール・ローン	1,934,895,701	1,239,485,159
国債証券	316,701,120,710	332,386,902,609
派生商品評価勘定	7,054,649	7,692,152
未収入金	336,112	2,715,975
未収利息	2,345,610,298	2,649,765,248
前払費用	158,918,326	173,055,867
流動資産合計	323,422,994,896	338,871,286,285
資産合計	323,422,994,896	338,871,286,285
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	12,155,750	1,242,505
未払金	62,857	35,510
未払解約金	50,784,648	76,754,967
流動負債合計	63,003,255	78,032,982
負債合計	63,003,255	78,032,982
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	86,637,182,960	92,889,444,303
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	236,722,808,681	245,903,809,000
元本等合計	323,359,991,641	338,793,253,303
純資産合計	323,359,991,641	338,793,253,303
負債純資産合計	323,422,994,896	338,871,286,285

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	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6月17日現在	2025年6月16日現在
1. ※1 期首	2023年6月16日	2024年6月18日
期首元本額	79,274,139,359円	86,637,182,960円
期中追加設定元本額	14,136,210,121円	16,478,826,746円
期中一部解約元本額	6,773,166,520円	10,226,565,403円
期末元本額の内訳		
ファンド名		

ダイワ外国債券インデックスV A	353,386,145円	277,900,961円
ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	4,950,980円	4,730,030円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	32,397,835円	24,917,757円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	14,812,611円	12,385,718円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	185,995,811円	147,712,078円
外国債券インデックスファンド (F0Fs用) (適格機関投資家専 用)	731,151,994円	964,924,636円
外国債券インデックスファンド VA (適格機関投資家専用)	590,336,025円	667,057,238円
ダイワファンドラップ 外国債券 インデックス エマージングプラ ス (為替ヘッジなし)	956,757,996円	1,028,574,741円
ダイワファンドラップ 外国債券 インデックス (為替ヘッジな し)	4,952,142,404円	7,142,958,728円
ダイワファンドラップオンライ ン 外国債券インデックス エ マージングプラス (為替ヘッジ なし)	1,134,690,990円	1,077,882,036円
D-I's 外国債券インデック ス	1,759,500円	1,389,137円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	21,281,066円	26,007,029円
iFree 外国債券インデック ス	2,085,512,930円	1,314,132,605円
iFree 8資産バランス	2,512,941,378円	3,091,527,705円
iFree 年金バランス	596,873,006円	720,414,402円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2060	1,954,816円	3,641,146円
DCダイワ外国債券インデック ス	51,717,310,895円	50,894,144,304円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,176,149,491円	1,217,184,241円
ダイワ・ライフ・バランス50	875,664,748円	975,382,066円
ダイワ・ライフ・バランス70	712,618,374円	792,786,843円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	712,072,206円	776,125,300円

DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／6分散コース）	579,249,593円	634,495,162円
DCダイワ・ワールドアセット （六つの羽／成長コース）	236,172,504円	302,956,186円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	34,551,660円	32,815,448円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	21,468,866円	27,157,786円
ダイワつみたてインデックス外 国債券	2,292,449,559円	2,702,030,472円
ダイワつみたてインデックスバ ランス30	4,872,476円	5,257,691円
ダイワつみたてインデックスバ ランス50	2,179,468円	2,866,171円
ダイワつみたてインデックスバ ランス70	3,623,955円	36,309,993円
ダイワ先進国債券インデックス （為替ヘッジなし）（ラップ専 用）	1,855,240,936円	2,911,995,855円
ダイワ世界バランスファンド4 0VA	90,058,800円	83,002,090円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	26,205,450円	26,997,549円
ダイワ・バランスファンド35 VA	2,623,544,925円	2,220,067,551円
ダイワ・バランスファンド25 VA（適格機関投資家専用）	169,056,701円	146,975,221円
スタイル9（4資産分散・保守 型）	85,432円	315,795円
スタイル9（4資産分散・ balan ス型）	1,110,127円	3,721,549円
スタイル9（4資産分散・積極 型）	989,244円	3,928,369円
スタイル9（6資産分散・保守 型）	27,564円	117,952円
スタイル9（6資産分散・ balan ス型）	728,074円	3,601,928円
スタイル9（6資産分散・積極 型）	279,364円	1,637,839円
スタイル9（8資産分散・保守 型）	36,200円	180,725円

スタイル9（8資産分散・バランス型）	724,764円	2,278,539円
スタイル9（8資産分散・積極型）	789,451円	2,378,158円
ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	-円	2,825,120円
ダイワ・インデックスセレクト外国債券	139,355,079円	117,205,552円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	69,704,013円	66,986,339円
ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）	3,116,465,492円	6,177,489,546円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,895,512,178円	6,112,379,343円
ダイワライフスタイル2 5	25,294,949円	24,284,842円
ダイワライフスタイル5 0	59,367,643円	58,130,970円
ダイワライフスタイル7 5	17,277,292円	17,275,861円
計	86,637,182,960円	92,889,444,303円
2. 期末日における受益権の総数	86,637,182,960口	92,889,444,303口

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	3,710,370,172	△2,989,504,497
合計	3,710,370,172	△2,989,504,497

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種類	2024年6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	1,848,810,519	-	1,843,709,418	△5,101,101	1,145,772,252	-	1,152,221,899	6,449,647
アメリカ・ドル	547,073,296	-	551,559,227	4,485,931	69,180,071	-	69,729,880	549,809
イギリス・ポンド	17,396,464	-	17,373,673	△22,791	9,832,979	-	9,954,639	121,660
イスラエル・シェケル	-	-	-	-	44,810,036	-	43,678,152	△1,131,884
オフショア・人民元	736,173,859	-	738,429,295	2,255,436	620,721,263	-	623,312,551	2,591,288
カナダ・ドル	168,635,030	-	168,197,400	△437,630	233,241,297	-	236,223,120	2,981,823
シンガポール・ドル	51,914,150	-	52,071,040	156,890	29,822,378	-	30,022,815	200,437
スウェーデン・クローナ	-	-	-	-	17,962,692	-	18,172,462	209,770
ニュージーランド・ドル	15,374,640	-	15,424,320	49,680	-	-	-	-
ノルウェー・クローネ	12,131,042	-	11,993,476	△137,566	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	148,292,739	-	137,439,276	△10,853,463	-	-	-	-
ユーロ	151,819,299	-	151,221,711	△597,588	120,201,536	-	121,128,280	926,744
合計	1,848,810,519	-	1,843,709,418	△5,101,101	1,145,772,252	-	1,152,221,899	6,449,647

(注) 1. 時価の算定方法

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

- 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6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.7323円 (37,323円)	3.6473円 (36,473円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	745,031.380	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	768,066.120	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	784,393.260	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,545,936.800	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	2,976,000.000	3,010,104.960	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	887,308.730	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	538,963.480	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	516,970.710	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	931,270.730	

4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,074,310.350	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,039,330.000	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,167,214.400	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,000,213.100	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,178,000.000	1,134,143.060	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	987,224.080	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	1,385,678.320	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,250,513.880	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,301,814.150	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,337,023.120	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,168,323.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,302,067.980	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,060,982.010	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	5,231,000.000	3,930,573.400	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,218,473.900	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,073,489.600	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,739,654.940	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	2,715,926.420	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	1,785,581.240	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	4,307,000.000	3,621,540.950	

3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	1,327,000.000	1,071,910.790	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,492,930.260	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,074,822.680	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,063,000.000	1,423,944.490	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	2,935,000.000	2,204,449.150	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,373,208.680	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	492,319.130	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	1,148,000.000	780,100.440	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	1,911,029.850	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,242,212.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	1,784,176.200	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	5,151,759.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	722,140.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,538,189.200	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	1,726,412.450	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,213,696.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,468,860.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,694,385.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,450,000.000	1,710,957.500	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,289,020.000	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	1,741,300.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	6,161,722.500	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,183,250.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	2,824,616.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	11,500,000.000	11,169,375.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	6,489,285.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,332,213.800	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,603,430.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,340,137.600	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,303,198.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	3,390,298.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,150,000.000	2,915,582.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,676,803.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,943,480.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,736,440.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,439,500.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,286,165.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	2,200,000.000	1,348,864.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,711,128.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,424,200.000	

1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	2,903,760.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,350,000.000	4,876,525.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	2,830,500.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	1,932,260.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,415,800.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,475,950.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	6,500,000.000	6,245,655.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	4,400,000.000	2,525,952.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	1,300,000.000	1,239,056.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,508,432.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,780,204.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,251,488.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	1,900,000.000	890,910.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	3,400,000.000	2,075,768.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,274,460.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,265,780.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,737,280.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,639,550.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,200,000.000	2,982,262.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	3,400,000.000	2,054,450.000	

0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,247,860.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,691,480.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	8,294,720.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,691,560.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,000,000.000	3,087,180.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	3,193,569.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,616,850.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,604,250.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,449,240.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	3,239,454.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	9,135,446.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,643,150.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,176,495.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,718,800.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,000,000.000	6,964,640.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	1,500,000.000	1,391,685.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	3,971,200.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	2,714,910.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	6,000,000.000	5,555,820.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	4,400,000.000	4,261,004.000	

1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,619,100.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,836,400.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,692,788.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	3,900,000.000	2,198,547.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	5,700,000.000	3,716,685.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,772,840.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,573,000.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,580,850.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,805,050.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,588,450.000	
0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,360,665.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	10,000,000.000	8,439,800.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,600,000.000	3,588,750.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	2,703,120.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,517,420.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	7,000,000.000	6,727,770.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	5,000,000.000	4,804,850.000	
1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	5,161,576.000	
1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	6,500,000.000	5,952,830.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	4,000,000.000	3,836,160.000	

1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	7,900,000.000	6,845,034.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	3,982,617.000	
2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	6,900,000.000	4,123,785.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	1,786,275.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,645,200.000	
1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	5,000,000.000	4,827,050.000	
2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,834,160.000	
2.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,873,800.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	6,300,000.000	5,802,111.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	3,445,800.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,219,740.000	
2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,883,390.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	3,000,000.000	2,934,540.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	5,000,000.000	4,778,400.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,950,060.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,892,320.000	
3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,960,190.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	3,971,506.000	
2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	9,500,000.000	8,642,910.000	
3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	5,200,000.000	3,677,232.000	

3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	2,000,000.000	1,649,640.000	
2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,189,043.200	
3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,457,450.000	
3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,384,535.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,489,250.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	3,500,000.000	3,515,505.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031	3,000,000.000	3,012,510.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	6,700,000.000	6,659,800.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	3,700,000.000	3,172,676.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	3,001,110.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	2,500,000.000	2,487,625.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	3,000,000.000	2,995,950.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20421115	2,500,000.000	2,242,425.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	5,000,000.000	4,974,400.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271231	1,500,000.000	1,498,500.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	5,000,000.000	4,893,750.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	8,000,000.000	7,608,080.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	2,500,000.000	2,199,500.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	4,500,000.000	3,600,000.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131	3,700,000.000	3,661,039.000	

4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300228	7,500,000.000	7,501,125.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280229	3,000,000.000	3,005,490.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,800,000.000	1,769,166.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280331	3,700,000.000	3,671,510.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	3,000,000.000	2,930,910.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280430	2,000,000.000	1,976,740.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	6,300,000.000	5,922,063.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	5,600,000.000	4,475,800.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	2,500,000.000	2,194,325.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280531	3,700,000.000	3,669,142.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531	1,500,000.000	1,481,385.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260615	3,000,000.000	3,000,060.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	3,000,000.000	2,961,960.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630	3,500,000.000	3,508,120.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260715	5,000,000.000	5,021,050.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	3,500,000.000	3,519,740.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815	11,000,000.000	10,684,520.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260815	6,000,000.000	6,018,000.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815	5,000,000.000	4,379,250.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430815	2,300,000.000	2,155,698.000	

4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	3,000,000.000	2,995,050.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300831	3,100,000.000	3,112,276.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	3,000,000.000	3,039,240.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260915	3,000,000.000	3,019,380.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930	1,500,000.000	1,540,545.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	4,200,000.000	4,288,578.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261015	1,000,000.000	1,007,220.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	6,174,600.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20331115	10,000,000.000	10,134,700.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261115	3,800,000.000	3,829,526.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20431115	2,300,000.000	2,259,382.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301031	3,100,000.000	3,221,024.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20531115	5,300,000.000	5,151,865.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301130	3,000,000.000	3,045,270.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	4,000,000.000	4,054,840.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261215	2,000,000.000	2,009,840.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310131	2,000,000.000	1,991,980.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301231	4,500,000.000	4,427,820.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	8,500,000.000	8,511,900.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	1,000,000.000	993,510.000	

4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270115	7,000,000.000	6,998,180.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340215	10,200,000.000	9,953,874.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270215	4,000,000.000	4,007,480.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540215	4,400,000.000	3,936,592.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440215	3,000,000.000	2,849,280.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310228	3,600,000.000	3,629,448.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,200,000.000	5,251,896.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270315	5,000,000.000	5,022,350.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	5,000,000.000	5,028,200.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310331	2,000,000.000	2,002,840.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270415	5,000,000.000	5,045,950.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340515	8,500,000.000	8,513,770.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270515	4,000,000.000	4,038,720.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	2,500,000.000	2,558,325.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310430	1,600,000.000	1,643,088.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540515	7,000,000.000	6,670,230.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440515	3,500,000.000	3,375,015.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	5,600,000.000	5,707,352.000	
4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260531	5,000,000.000	5,033,650.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310531	2,300,000.000	2,361,318.000	

4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270615	4,500,000.000	4,557,915.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260630	4,000,000.000	4,020,240.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310630	2,500,000.000	2,517,325.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	100,000.000	101,009.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270715	2,200,000.000	2,218,546.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	4,200,000.000	4,212,222.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	8,300,000.000	8,306,640.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310731	5,000,000.000	4,998,900.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340815	10,500,000.000	10,106,775.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270815	7,000,000.000	6,972,070.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540815	5,300,000.000	4,747,846.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310831	4,000,000.000	3,915,040.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440815	1,800,000.000	1,620,486.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	4,500,000.000	4,481,505.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	5,000,000.000	4,931,050.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270915	1,000,000.000	988,260.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	4,500,000.000	4,467,645.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	800,000.000	784,776.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310930	2,300,000.000	2,234,128.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271015	1,310,000.000	1,308,336.300	

4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	5,000,000.000	5,026,450.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20341115	9,000,000.000	8,902,260.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271115	4,200,000.000	4,218,354.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20541115	6,100,000.000	5,704,415.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261031	5,700,000.000	5,703,762.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311031	5,800,000.000	5,790,546.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261130	6,000,000.000	6,017,220.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	5,500,000.000	5,529,920.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20441115	2,400,000.000	2,309,232.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311130	3,500,000.000	3,493,280.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271215	4,000,000.000	4,007,880.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	4,000,000.000	4,061,640.000	
4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311231	3,500,000.000	3,565,870.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20261231	1,500,000.000	1,504,980.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280115	3,000,000.000	3,022,950.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	6,500,000.000	6,566,495.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350215	8,600,000.000	8,749,812.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280215	5,500,000.000	5,544,110.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550215	5,600,000.000	5,350,576.000	
4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20450215	3,500,000.000	3,420,970.000	

	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270131	6,500,000.000	6,511,115.000	
	4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320131	4,000,000.000	4,045,680.000	
	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320229	4,000,000.000	3,987,080.000	
	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270228	4,000,000.000	4,008,560.000	
	3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280315	3,000,000.000	2,997,060.000	
	3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270331	5,000,000.000	4,991,400.000	
	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320331	3,500,000.000	3,487,400.000	
	4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	7,000,000.000	6,997,200.000	
	3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280415	3,000,000.000	2,985,810.000	
	3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270430	2,500,000.000	2,490,325.000	
	4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320430	3,500,000.000	3,460,065.000	
	4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550515	2,300,000.000	2,244,639.000	
	4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350515	3,500,000.000	3,454,850.000	
	3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280515	4,000,000.000	3,981,080.000	
	3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	4,500,000.000	4,472,550.000	
アメリカ・ドル 小計			1,054,588,957.790 (152,303,737,283)	
イギリス・ポンド	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,282,000.000	714,586.800	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,429,107.500	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	918,297.600	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	1,450,000.000	1,053,671.500	

1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	850,591.400	
1.25% United Kingdom Gilt 20270722	2,610,000.000	2,476,002.600	
1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,398,825.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,740,000.000	705,117.600	
1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	650,508.100	
1.625% United Kingdom Gilt 20541022	1,600,000.000	748,416.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20291022	2,100,000.000	1,851,234.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20411022	2,190,000.000	1,286,340.300	
0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,300,000.000	1,077,973.000	
0.5% United Kingdom Gilt 20611022	3,300,000.000	875,985.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20280131	2,200,000.000	2,004,442.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,700,000.000	632,366.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	3,700,000.000	2,534,130.000	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	1,991,300.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20460131	1,550,000.000	717,464.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20261022	2,700,000.000	2,585,169.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,800,000.000	792,288.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	3,100,000.000	1,969,120.000	
0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	2,700,000.000	2,396,304.000	
0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	3,100,000.000	2,366,230.000	

1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	1,300,000.000	594,048.000	
1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	4,100,000.000	3,353,718.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	1,220,000.000	403,368.600	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20270129	2,000,000.000	2,006,600.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	1,000,000.000	903,630.000	
3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	2,600,000.000	2,419,378.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	2,500,000.000	1,957,500.000	
4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	1,000,000.000	793,600.000	
4.5% UNITED KINGDOM GILT 20280607	2,700,000.000	2,743,335.000	
4.625% UNITED KINGDOM GILT 20340131	3,300,000.000	3,343,725.000	
4.75% UNITED KINGDOM GILT 20431022	1,500,000.000	1,425,300.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20270307	2,300,000.000	2,293,077.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20540731	1,280,000.000	1,112,358.400	
4% UNITED KINGDOM GILT 20311022	2,200,000.000	2,176,218.000	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20290722	2,100,000.000	2,111,025.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT 20340731	2,500,000.000	2,455,600.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20400131	2,000,000.000	1,884,080.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20280307	1,300,000.000	1,313,689.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20300307	1,600,000.000	1,621,568.000	
4.5% UNITED KINGDOM GILT 20350307	1,000,000.000	996,270.000	

5.375% UNITED KINGDOM GILT 20560131	350,000.000	356,412.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,017,033.810	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,440,000.000	1,445,155.200	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,862,000.000	1,803,365.620	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,757,000.000	1,746,299.870	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	1,451,851.240	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,200,071.980	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,245,625.920	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	1,979,898.880	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	2,300,000.000	2,383,467.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	1,163,736.360	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,846,000.000	1,725,123.920	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	1,565,054.400	
4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	947,617.580	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,456,406.810	
3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	1,221,625.760	
3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,466,000.000	1,912,284.360	
3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	997,878.420	
3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,724,000.000	1,374,734.840	
イギリス・ポンド 小計		96,927,201.370 (18,961,868,404)	

イスラエル・ シュケル	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	1,800,000.000	1,847,340.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	2,200,000.000	2,370,632.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,728,486.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,029,464.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,123,752.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,051,664.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	3,000,000.000	2,134,950.000	
	1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	2,300,000.000	1,873,603.000	
	2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129	1,720,000.000	1,155,375.600	
	3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290228	3,800,000.000	3,718,414.000	
	4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20350330	1,500,000.000	1,432,395.000	
	3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20270930	2,500,000.000	2,466,550.000	
	4.6% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290831	1,600,000.000	1,612,672.000	
イスラエル・シュケル 小計			25,545,297.600 (1,019,147,530)	
オーストラリ ア・ドル	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,041,509.600	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,354,000.000	1,348,313.200	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	2,258,000.000	2,346,536.180	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,060,944.990	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	2,207,000.000	1,956,042.030	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	698,480.640	

2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,651,701.920	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,143,932.240	
3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	956,978.720	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,472,520.000	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,847,636.000	
2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,743,461.700	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,112,653.300	
1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,512,491.200	
1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	2,700,000.000	2,281,743.000	
1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,744,320.000	
1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	760,032.000	
1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,112,475.000	
0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,158,576.000	
1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,600,000.000	1,380,768.000	
3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,700,000.000	1,578,773.000	
3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	2,000,000.000	1,956,800.000	
3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221	1,600,000.000	1,525,744.000	
4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20540621	900,000.000	885,807.000	
4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340621	1,100,000.000	1,117,149.000	
4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20351221	1,700,000.000	1,712,036.000	

	4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20360321	1,500,000.000	1,508,010.000	
オーストラリア・ドル 小計			42,615,434.720 (3,996,049,314)	
オフショア・人 民元	3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,321,250.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,372,000.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	5,000,000.000	5,099,850.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	12,000,000.000	12,326,520.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	25,000,000.000	26,815,000.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,371,020.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	16,500,000.000	17,384,400.000	
	3.28% China Government Bond 20271203	29,000,000.000	30,402,730.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	12,500,000.000	13,696,875.000	
	3.81% China Government Bond 20500914	16,300,000.000	22,509,974.000	
	3.01% China Government Bond 20280513	27,000,000.000	28,250,370.000	
	3.72% China Government Bond 20510412	17,000,000.000	23,185,790.000	
	3.02% China Government Bond 20310527	15,800,000.000	17,133,678.000	
	2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,568,535.000	
	2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	5,000,000.000	5,080,100.000	
	3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,784,790.000	
	3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,362,950.000	
	3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,825,620.000	

4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	7,000,000.000	9,792,020.000	
3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	8,800,000.000	12,007,072.000	
3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	23,000,000.000	29,453,570.000	
2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	15,500,000.000	16,232,375.000	
3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	11,500,000.000	15,224,965.000	
2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	16,000,000.000	17,262,880.000	
2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	17,000,000.000	17,253,980.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	15,200,000.000	16,292,880.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	15,719,400.000	
2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	15,000,000.000	15,287,400.000	
3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	7,071,735.000	
2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	5,000,000.000	5,380,850.000	
2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	4,000,000.000	4,192,040.000	
2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	19,000,000.000	20,374,270.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	32,000,000.000	34,152,640.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	9,931,015.000	
2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	17,200,000.000	17,572,380.000	
3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	19,500,000.000	24,322,350.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	5,500,000.000	5,950,725.000	
2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	19,000,000.000	20,049,940.000	

2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	20,000,000.000	20,606,000.000	
2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	15,000,000.000	16,355,400.000	
2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	15,000,000.000	15,876,150.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	25,000,000.000	25,804,500.000	
3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	21,700,000.000	27,463,086.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	35,000,000.000	37,603,650.000	
2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	33,000,000.000	34,711,050.000	
2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	35,000,000.000	35,976,500.000	
2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	40,000,000.000	42,567,200.000	
2.18% CHINA GOVERNMENT BOND 20260815	30,000,000.000	30,261,600.000	
2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925	25,000,000.000	25,790,000.000	
2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	30,000,000.000	31,559,400.000	
3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	36,000,000.000	44,676,720.000	
2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	20,000,000.000	20,690,200.000	
2.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20261115	60,000,000.000	60,809,400.000	
2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	36,000,000.000	38,785,320.000	
2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225	50,000,000.000	52,547,500.000	
2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20290115	58,000,000.000	59,756,240.000	
2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20270225	35,000,000.000	35,355,250.000	
2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225	8,000,000.000	8,425,840.000	

2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325	35,000,000.000	36,344,000.000	
2.05% CHINA GOVERNMENT BOND 20290415	73,000,000.000	74,477,520.000	
1.85% CHINA GOVERNMENT BOND 20270515	85,000,000.000	85,664,700.000	
2.27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525	21,000,000.000	22,018,500.000	
1.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20260615	45,000,000.000	45,114,300.000	
2.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20310625	30,000,000.000	30,915,000.000	
1.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20290715	28,000,000.000	28,432,040.000	
1.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20270815	45,000,000.000	45,165,150.000	
2.11% CHINA GOVERNMENT BOND 20340825	44,000,000.000	45,557,600.000	
1.87% CHINA GOVERNMENT BOND 20310915	33,000,000.000	33,534,930.000	
1.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20260925	10,000,000.000	9,989,800.000	
1.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20291015	1,000,000.000	1,010,520.000	
1.42% CHINA GOVERNMENT BOND 20271115	13,000,000.000	12,994,280.000	
2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20341125	11,000,000.000	11,328,460.000	
1.06% CHINA GOVERNMENT BOND 20261215	5,000,000.000	4,973,200.000	
1.49% CHINA GOVERNMENT BOND 20311225	9,100,000.000	9,031,932.000	
1.43% CHINA GOVERNMENT BOND 20300125	20,000,000.000	19,943,000.000	
1.92% CHINA GOVERNMENT BOND 20550115	4,000,000.000	4,010,920.000	
1.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20350215	29,000,000.000	28,794,100.000	
1.45% CHINA GOVERNMENT BOND 20280225	5,000,000.000	5,001,950.000	

	1.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270315	10,000,000.000	10,029,400.000	
	1.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20320325	35,000,000.000	35,446,600.000	
	1.65% CHINA GOVERNMENT BOND 20350515	7,000,000.000	6,971,160.000	
	1.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20280525	30,000,000.000	30,020,700.000	
	1.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20350525	7,000,000.000	7,015,960.000	
オフショア・人民元 小計			1,869,422,667.000 (37,548,475,920)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	955,000.000	784,838.100	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,383,000.000	1,529,058.630	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,306,845.320	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,163,041.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	963,844.970	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	948,949.060	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,151,170.370	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,469,000.000	1,452,561.890	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,200,134.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	635,752.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,666,710.900	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,191,793.600	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,173,827.500	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,744,920.000	

1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	293,928.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	3,106,138.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	2,650,000.000	1,759,997.500	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	2,200,000.000	2,146,958.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,700,000.000	2,442,258.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,388,655.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	100,000.000	97,180.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	1,200,000.000	1,200,144.000	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	2,270,000.000	2,160,313.600	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	1,300,000.000	1,324,206.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,700,000.000	1,638,460.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201	1,180,000.000	985,123.000	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280901	1,200,000.000	1,215,072.000	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20331201	1,000,000.000	996,330.000	
4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290301	1,800,000.000	1,870,524.000	
3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340601	1,700,000.000	1,655,647.000	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340301	1,500,000.000	1,519,965.000	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290901	800,000.000	818,176.000	
4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260801	700,000.000	709,968.000	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20341201	2,600,000.000	2,575,144.000	

	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,700,000.000	1,712,274.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300301	2,000,000.000	1,981,300.000	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270201	1,700,000.000	1,707,701.000	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20350601	1,600,000.000	1,579,920.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20571201	850,000.000	822,604.500	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270501	700,000.000	700,469.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300901	300,000.000	296,109.000	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270801	500,000.000	497,635.000	
カナダ・ドル 小計			59,115,646.940 (6,281,628,644)	
シンガポール・ドル	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	794,272.200	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	845,809.500	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	419,000.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	616,848.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	648,125.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	818,000.000	863,464.440	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	451,206.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	747,750.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	562,100.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	650,000.000	650,962.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	487,080.000	

	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	585,000.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	500,000.000	444,500.000	
	1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20261101	200,000.000	198,456.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	247,320.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	620,000.000	699,670.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	500,000.000	511,350.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20280801	400,000.000	412,600.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20290401	600,000.000	624,300.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20340501	300,000.000	327,600.000	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20540601	100,000.000	116,693.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20350301	230,000.000	240,129.200	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20300401	160,000.000	164,616.000	
	シンガポール・ドル 小計		11,658,851.340 (1,312,203,718)	
スウェーデン・ クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	3,655,000.000	4,093,453.800	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	7,097,789.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,898,500.000	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,327,225.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	6,083,200.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,472,850.000	
	1.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20331111	4,000,000.000	3,857,600.000	

	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20350511	2,700,000.000	2,686,095.000	
スウェーデン・クローナ 小計			36,516,712.800 (554,688,868)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	16,614,358.200	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,955,415.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	4,090,000.000	3,834,947.600	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	3,500,000.000	1,855,910.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	435,445.000	
	2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20331115	2,000,000.000	1,985,580.000	
	2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20261115	50,000.000	50,504.000	
デンマーク・クローネ 小計			29,732,159.800 (663,919,128)	
ニュージーラン ド・ドル	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20270415	600,000.000	611,472.000	
	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	1,500,000.000	1,415,340.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	402,098.900	
	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	1,100,000.000	1,070,487.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	530,000.000	457,994.200	
	1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	225,907.500	
	0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	1,100,000.000	999,075.000	
	2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	940,000.000	813,786.200	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	247,877.800	
	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20340515	500,000.000	492,175.000	

	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20300515	1,100,000.000	1,127,841.000	
	5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20540515	700,000.000	672,539.000	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20350515	500,000.000	497,750.000	
	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20360515	1,300,000.000	1,256,463.000	
ニュージーランド・ドル 小計			10,290,806.600 (895,094,358)	
ノルウェー・クローネ	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,303,595.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,333,085.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,536,841.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,240,896.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	2,984,835.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	3,200,000.000	2,849,344.000	
	3.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20421006	1,600,000.000	1,515,696.000	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20330815	4,000,000.000	3,725,440.000	
	3.625% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20340413	3,500,000.000	3,392,655.000	
	3.625% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20390531	2,000,000.000	1,922,880.000	
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20350612	3,900,000.000	3,801,564.000	
ノルウェー・クローネ 小計			35,606,831.000 (518,435,460)	
ポーランド・ズロチ	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,292,348.820	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	3,037,177.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,440,361.200	

	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,478,390.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	2,200,000.000	2,081,464.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	5,000,000.000	3,997,050.000	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	3,700,000.000	3,645,018.000	
	7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	5,000,000.000	5,392,750.000	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	5,000,000.000	5,178,000.000	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725	6,000,000.000	5,961,660.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20341025	4,500,000.000	4,329,765.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300125	2,000,000.000	2,001,280.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20270125	1,000,000.000	931,190.000	
	4.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300725	1,400,000.000	1,364,118.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	852,727.970	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,466,368.500	
ポーランド・ズロチ 小計			53,449,668.490 (2,085,071,567)	
マレーシア・リ ンギット	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,391,343.290	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	3,378,000.000	3,559,939.080	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,800,000.000	1,878,354.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	740,437.210	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,454,512.560	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,915,685.640	

4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,493,427.000	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,290,552.600	
4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,035,787.500	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	1,550,000.000	1,569,096.000	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,211,527.100	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,950,000.000	2,149,017.000	
4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	2,200,000.000	2,370,852.000	
4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	2,000,000.000	2,231,840.000	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	656,058.000	
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,362,621.800	
4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,367,352.000	
3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	2,000,000.000	2,042,280.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	2,550,000.000	2,557,573.500	
4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,682,595.000	
2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,800,000.000	1,726,884.000	
3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	1,400,000.000	1,410,388.000	
4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	1,900,000.000	2,117,455.000	
4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	500,000.000	521,650.000	
4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	2,200,000.000	2,362,778.000	
3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	1,000,000.000	1,009,320.000	

	4.054% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390418	1,200,000.000	1,243,980.000	
	4.18% MALAYSIAN GOVERNMENT 20440516	1,500,000.000	1,578,960.000	
	3.336% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300515	1,000,000.000	1,004,650.000	
マレーシア・リングット 小計			49,936,916.280 (1,696,911,345)	
メキシコ・ペソ	8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	17,572,713.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	7,000,000.000	6,713,910.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	37,000,000.000	30,429,540.000	
	7.5% MEXICAN BONOS 20330526	30,000,000.000	27,171,600.000	
	7% MEXICAN BONOS 20260903	23,000,000.000	22,701,230.000	
	8% MEXICAN BONOS 20350524	5,000,000.000	4,572,150.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20290301	10,000,000.000	9,944,800.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20280302	10,000,000.000	10,019,700.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20300228	10,000,000.000	9,894,000.000	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	27,660,631.680	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,293,119.020	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	29,361,713.520	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	18,894,000.000	17,279,885.580	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	44,515,000.000	42,131,666.900	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	29,654,000.000	24,393,973.480	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	35,944,000.000	32,507,394.160	
メキシコ・ペソ 小計			321,648,027.340 (2,451,729,923)	
ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	329,525.560	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	247,597.200	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	774,472.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	406,484.200	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	474,490.000	

0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	463,915.000	
0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	226,473.600	
0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	255,060.000	
Finland Government Bond 20300915	500,000.000	440,065.000	
0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	172,896.000	
0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	515,766.000	
FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	195,438.000	
0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	278,991.000	
1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	800,000.000	737,064.000	
1.375% FINLAND GOVERNMENT BOND 20270415	270,000.000	267,378.300	
2.75% FINLAND GOVERNMENT BOND 20380415	400,000.000	381,836.000	
3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20330915	300,000.000	304,197.000	
2.875% FINLAND GOVERNMENT BOND 20290415	1,000,000.000	1,022,840.000	
2.95% FINLAND GOVERNMENT BOND 20550415	400,000.000	359,828.000	
3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20340915	600,000.000	604,890.000	
2.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20300415	500,000.000	502,390.000	
3.2% FINLAND GOVERNMENT BOND 20450415	350,000.000	340,172.000	
3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20350915	500,000.000	500,040.000	
0.75% Austria Government Bond 20261020	626,000.000	616,829.100	
1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	555,464.000	

1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	122,546.400	
0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,247,027.200	
2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	344,741.400	
0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,159,692.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,203,494.400	
Austria Government Bond 20300220	980,000.000	878,707.200	
0.75% Austria Government Bond 20510320	1,200,000.000	659,280.000	
Austria Government Bond 20401020	400,000.000	242,280.000	
0.85% Austria Government Bond 21200630	750,000.000	255,967.500	
Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	1,042,716.000	
0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	438,054.000	
0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	300,000.000	113,652.000	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	1,800,000.000	1,675,944.000	
0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	1,500,000.000	1,342,470.000	
1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	1,000,000.000	745,570.000	
2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260715	300,000.000	300,480.000	
2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	1,300,000.000	1,314,703.000	
3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20531020	500,000.000	468,480.000	
2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20290523	200,000.000	204,952.000	
3.45% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20301020	800,000.000	839,936.000	

2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20340220	500,000.000	502,255.000	
3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20390715	500,000.000	497,455.000	
2.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20291020	800,000.000	805,992.000	
2.95% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20350220	300,000.000	300,135.000	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,617,586.420	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	758,000.000	641,957.780	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,063,000.000	1,053,518.040	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	848,743.880	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	474,436.200	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,075,349.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	404,422.400	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	491,400.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,433,290.600	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	1,350,000.000	1,204,915.500	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,420,770.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	463,428.000	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	420,000.000	373,737.000	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	550,709.600	
Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,145,616.000	
Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,355,856.000	

0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	173,182.800	
0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	1,400,000.000	1,187,732.000	
1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	468,328.000	
2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	800,000.000	741,928.000	
3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	1,500,000.000	1,514,835.000	
3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	600,000.000	541,254.000	
3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20430622	700,000.000	683,732.000	
2.85% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20341022	1,100,000.000	1,084,369.000	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20550622	1,000,000.000	930,850.000	
2.7% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20291022	100,000.000	101,413.000	
3.1% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20350622	200,000.000	199,974.000	
3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20420622	700,000.000	685,818.000	
2.6% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20301022	550,000.000	552,024.000	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,276,021.140	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,363,347.060	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,028,850.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,301,555.680	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,048,000.000	3,569,025.120	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	2,731,517.200	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	1,371,000.000	1,551,574.410	

4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	2,725,000.000	3,186,805.750	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,147,925.850	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,174,000.000	1,234,918.860	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,708,000.000	2,551,640.080	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	2,502,882.540	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,370,511.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	2,200,000.000	2,144,428.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,207,600.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	3,470,000.000	2,500,586.100	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,832,626.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,891,556.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	4,700,000.000	4,417,577.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,760,330.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	3,150,000.000	1,524,253.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,589,420.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	3,500,000.000	2,720,305.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,913,440.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	2,500,000.000	2,242,525.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,076,856.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,900,000.000	1,682,355.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	2,400,000.000	1,803,024.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,873,040.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,700,000.000	824,653.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,600,000.000	1,397,904.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,000,000.000	874,110.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	3,800,000.000	3,271,306.000	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	1,600,000.000	1,298,224.000	
1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,592,783.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	2,650,000.000	2,063,661.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	3,200,000.000	3,201,664.000	
2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	2,400,000.000	2,388,048.000	
2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,000,000.000	995,410.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,000,000.000	780,250.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330815	2,400,000.000	2,432,040.000	
2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,516,515.000	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340215	2,400,000.000	2,351,640.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20540815	2,100,000.000	1,904,595.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20410515	1,000,000.000	966,670.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340815	3,500,000.000	3,529,120.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20350215	1,900,000.000	1,895,307.000	

2.9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20560815	950,000.000	930,705.500	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20350215	800,000.000	798,160.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	2,100,000.000	957,705.000	
2.9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260618	800,000.000	808,296.000	
2.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260917	1,000,000.000	1,010,390.000	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20261210	100,000.000	100,215.000	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270311	3,000,000.000	3,017,790.000	
1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270610	100,000.000	99,717.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	2,800,000.000	2,734,172.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20270416	2,600,000.000	2,515,188.000	
1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,963,850.000	
1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	424,865.800	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	1,000,000.000	1,008,260.000	
2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20281019	100,000.000	101,378.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	100,000.000	100,263.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	1,100,000.000	1,103,102.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291011	10,000.000	10,171.100	
2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300418	500,000.000	506,075.000	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,700,293.420	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,927,000.000	3,474,612.430	

4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	3,000,973.990	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	2,964,000.000	2,983,236.360	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,501,602.500	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,493,752.080	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	1,714,596.200	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,099,000.000	5,175,230.050	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,788,000.000	2,594,763.720	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	5,073,570.320	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,120,000.000	4,784,435.200	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	5,369,000.000	4,349,641.660	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	764,417.310	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	3,050,000.000	2,977,074.500	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,770,000.000	2,232,564.600	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,335,570.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	1,850,484.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	5,400,000.000	5,177,412.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	5,650,000.000	4,831,823.500	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,696,461.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,850,000.000	1,778,941.500	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	5,650,000.000	5,248,963.000	

FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,767,400.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,334,530.600	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	1,417,790.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	5,000,000.000	4,337,850.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	980,000.000	278,124.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	3,600,000.000	2,040,264.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	4,600,000.000	3,853,190.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	4,000,000.000	3,872,040.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,600,000.000	1,218,906.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	4,200,000.000	3,450,300.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	3,000,000.000	2,302,530.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	4,300,000.000	4,142,964.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	4,100,000.000	3,845,841.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,000,000.000	842,060.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	2,100,000.000	1,756,440.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260924	3,200,000.000	3,222,752.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20330525	4,600,000.000	4,597,838.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290225	4,300,000.000	4,356,975.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20331125	3,200,000.000	3,301,152.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20490625	700,000.000	609,420.000	

2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270924	3,100,000.000	3,128,799.000	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550525	1,200,000.000	1,047,636.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300225	4,600,000.000	4,642,872.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20341125	3,700,000.000	3,642,909.000	
3.6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20420525	1,200,000.000	1,186,524.000	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20560525	900,000.000	858,861.000	
3.2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350525	1,500,000.000	1,493,610.000	
2.4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280924	1,100,000.000	1,103,806.000	
2.7% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310225	1,200,000.000	1,200,192.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,238,935.860	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	1,952,121.600	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	1,892,131.150	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,464,579.560	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,879,000.000	1,786,384.090	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	138,000.000	135,970.020	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,148,806.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,299,064.500	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,111,332.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	1,200,000.000	851,316.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,248,044.000	

NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	2,300,000.000	2,233,185.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,450,000.000	652,645.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,126,203.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	624,069.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	835,092.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	1,000,000.000	872,080.000	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	1,500,000.000	1,185,720.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715	900,000.000	893,997.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300115	1,300,000.000	1,314,625.000	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20440115	600,000.000	617,052.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20340715	1,000,000.000	986,070.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20350715	600,000.000	586,872.000	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,189,520.400	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,633,448.480	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,342,074.420	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,904,735.350	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,303,552.600	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,378,030.760	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	2,054,811.080	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,057,651.080	

2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	706,030.160	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,424,355.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,515,828.600	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,650,000.000	1,500,262.500	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,700,216.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,200,030.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,093,406.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,594,880.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	2,470,000.000	2,469,827.100	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,450,000.000	1,394,987.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	2,900,000.000	2,964,960.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,103,339.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,151,462.500	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,796,469.000	
0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,310,731.500	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,150,208.500	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,228,410.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,836,020.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,984,017.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	2,146,848.000	

1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,135,395.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	2,600,000.000	2,337,348.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	749,616.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	525,490.000	
0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,803,727.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,574,190.000	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	1,100,000.000	731,951.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	960,000.000	584,400.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	2,300,000.000	2,182,102.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,682,963.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	3,100,000.000	3,034,745.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	2,300,000.000	2,009,211.000	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,600,000.000	2,428,088.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	543,848.000	
1.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270401	300,000.000	295,146.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	800,000.000	811,048.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,600,000.000	1,540,880.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	2,300,000.000	2,199,283.000	
2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	1,000,000.000	1,012,160.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	1,500,000.000	1,585,395.000	

4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	2,800,000.000	3,047,072.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	3,100,000.000	3,268,578.000	
3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,500,000.000	1,548,135.000	
4.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20430901	1,600,000.000	1,692,832.000	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	1,200,000.000	1,250,628.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311030	900,000.000	959,202.000	
3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	1,200,000.000	1,256,724.000	
4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	2,100,000.000	2,274,804.000	
3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280801	700,000.000	731,794.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260915	900,000.000	919,926.000	
4.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340301	2,100,000.000	2,249,142.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,592,205.000	
4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290201	600,000.000	635,202.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270215	200,000.000	202,918.000	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,000,000.000	1,034,960.000	
4.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20391001	2,000,000.000	2,073,240.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290701	400,000.000	413,012.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340701	700,000.000	729,435.000	
4.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20371030	50,000.000	52,143.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310715	1,200,000.000	1,236,936.000	

3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270715	1,500,000.000	1,540,695.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260828	100,000.000	101,254.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350201	500,000.000	518,895.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291001	200,000.000	203,670.000	
4.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20541001	1,000,000.000	1,005,550.000	
3.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311115	1,300,000.000	1,314,573.000	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271015	800,000.000	809,880.000	
3.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350801	1,000,000.000	1,016,720.000	
4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460430	200,000.000	202,450.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20401001	300,000.000	298,362.000	
2.55% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270225	800,000.000	806,064.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300701	500,000.000	505,575.000	
2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280615	500,000.000	505,305.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320715	700,000.000	708,029.000	
3.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20351001	600,000.000	606,060.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	1,254,000.000	1,398,837.000	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,344,640.530	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,126,885.650	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,607,333.780	

4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,862,998.600	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,544,000.000	1,754,617.040	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,541,341.430	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,592,870.800	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	1,998,125.430	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,417,581.280	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	2,006,000.000	2,189,328.340	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,215,361.120	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,504,000.000	1,633,283.840	
4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	842,095.800	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	650,420.220	
3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	748,777.860	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	965,113.080	
2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	761,986.260	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	478,747.500	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	775,608.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	678,472.500	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	708,052.500	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	912,114.000	

1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	419,568.000	
0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	275,065.000	
0.2% IRISH TREASURY 20270515	500,000.000	484,620.000	
0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	712,976.000	
IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	683,760.000	
0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	268,956.000	
0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	84,994.000	
3% IRISH TREASURY 20431018	200,000.000	193,222.000	
2.6% IRISH TREASURY 20341018	300,000.000	294,060.000	
3.15% IRISH TREASURY 20551018	320,000.000	303,398.400	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	896,461.500	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,514,048.290	
3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	356,441.280	
3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	701,895.630	
2.4% Austria Government Bond 20340523	1,371,000.000	1,322,219.820	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	396,472.690	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	370,858.400	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	2,993,948.880	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	1,997,519.400	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	1,705,716.160	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,250,000.000	1,105,450.000	

1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,607,908.000	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	1,883,831.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,676,990.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,021,443.500	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,351,592.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	2,200,000.000	1,825,626.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	2,830,893.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,548,736.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	3,450,000.000	3,062,634.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	3,800,000.000	3,517,280.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	2,560,000.000	2,329,548.800	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	765,408.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	1,200,000.000	1,169,664.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,243,040.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,600,000.000	1,149,792.000	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	1,901,130.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	306,819.500	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	2,500,000.000	2,366,875.000	
0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	700,000.000	524,615.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,900,000.000	1,657,541.000	

1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	398,370.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	2,200,000.000	2,131,514.000	
0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,100,000.000	1,829,898.000	
1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	1,600,000.000	1,068,256.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	3,600,000.000	3,377,844.000	
2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,700,000.000	1,667,088.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,300,000.000	1,250,080.000	
3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	2,600,000.000	2,643,368.000	
2.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260531	2,300,000.000	2,317,779.000	
3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730	2,100,000.000	2,183,160.000	
3.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20331031	1,500,000.000	1,562,430.000	
3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290531	1,400,000.000	1,459,612.000	
3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20340430	2,600,000.000	2,640,248.000	
2.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270531	200,000.000	201,826.000	
4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20541031	1,000,000.000	1,003,560.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20341031	1,600,000.000	1,644,784.000	
3.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310730	1,200,000.000	1,227,624.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300131	200,000.000	202,000.000	
3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350430	1,200,000.000	1,199,304.000	
2.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280531	500,000.000	502,890.000	

3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410131	500,000.000	491,000.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,592,203.770	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,901,318.460	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,858,000.000	2,140,694.700	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,228,385.120	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,050,988.400	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	1,935,335.700	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,699,000.000	2,028,147.270	
4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20370415	850,000.000	926,559.500	
4.125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20270414	680,000.000	707,200.000	
2.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20260721	840,000.000	849,206.400	
3.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20300215	630,000.000	673,873.200	
2.125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20281017	1,300,000.000	1,303,107.000	
4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20450215	570,000.000	608,834.100	
2.25% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20340418	720,000.000	685,483.200	
1.95% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20290615	1,000,000.000	992,050.000	
0.475% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20301018	900,000.000	815,481.000	
0.7% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20271015	620,000.000	603,619.600	
0.9% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20351012	750,000.000	608,955.000	
1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20520412	630,000.000	343,532.700	

	0.3% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20311017	750,000.000	652,987.500	
	1.15% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20420411	520,000.000	365,705.600	
	1.65% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20320716	570,000.000	533,685.300	
	3.5% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20380618	500,000.000	510,005.000	
	2.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20341020	630,000.000	626,509.800	
	3.625% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20540612	240,000.000	232,243.200	
	3% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20350615	300,000.000	299,028.000	
	3.375% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20400615	300,000.000	296,703.000	
	ユーロ 小計		612,979,954.050 (102,097,941,147)	
国債証券 合計			332,386,902,609 [332,386,902,609]	
合計			332,386,902,609 [332,386,902,609]	

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 284銘柄	100%	45.8%
イギリス・ポンド	国債証券 63銘柄	100%	5.7%
イスラエル・シェケル	国債証券 13銘柄	100%	0.3%
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	100%	1.2%
オフショア・人民元	国債証券 83銘柄	100%	11.3%
カナダ・ドル	国債証券 42銘柄	100%	1.9%
シンガポール・ドル	国債証券 23銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	100%	0.2%

デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	100%	0.2%
ニュージーランド・ドル	国債証券	14銘柄	100%	0.3%
ノルウェー・クローネ	国債証券	11銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券	16銘柄	100%	0.6%
マレーシア・リンギット	国債証券	29銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	16銘柄	100%	0.7%
ユーロ	国債証券	412銘柄	100%	30.7%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(2024年6月18日から2025年6月16日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,918,351	9,267,173
親投資信託受益証券	2,291,254,467	4,490,011,227
未収入金	20,000	460,000
流動資産合計	2,295,192,818	4,499,738,400
資産合計	2,295,192,818	4,499,738,400
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	64,100,692	162,366,599
未払受託者報酬	191,542	475,147
未払委託者報酬	2,778,122	6,889,966
その他未払費用	47,806	118,696
流動負債合計	67,118,162	169,850,408
負債合計	67,118,162	169,850,408
純資産の部		
元本等		
元本	※ 1 2,136,689,750	※ 1 3,960,160,964
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	91,384,906	369,727,028
（分配準備積立金）	15,998,053	28,225,309
元本等合計	2,228,074,656	4,329,887,992
純資産合計	2,228,074,656	4,329,887,992
負債純資産合計	2,295,192,818	4,499,738,400

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期 自 2023年6月16日 至 2024年6月17日	第9期 自 2024年6月18日 至 2025年6月16日
営業収益		
受取利息	536	19,261
有価証券売買等損益	△ 83,744,379	395,376,760
営業収益合計	△ 83,743,843	395,396,021
営業費用		
支払利息	210	-
受託者報酬	373,897	788,318
委託者報酬	5,422,986	11,431,314
その他費用	93,314	196,913
営業費用合計	5,890,407	12,416,545
営業利益又は営業損失（△）	△ 89,634,250	382,979,476
経常利益又は経常損失（△）	△ 89,634,250	382,979,476
当期純利益又は当期純損失（△）	△ 89,634,250	382,979,476
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（△）	△ 13,008,168	19,972,672
期首剰余金又は期首欠損金（△）	140,636,213	91,384,906
剰余金増加額又は欠損金減少額	153,811,407	109,019,667
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	153,811,407	109,019,667
剰余金減少額又は欠損金増加額	62,335,940	31,317,750
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	62,335,940	31,317,750
分配金	※ 1 64,100,692	※ 1 162,366,599
期末剰余金又は期末欠損金（△）	91,384,906	369,727,028

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2024年6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2024年6月17日としており、2025年6月15日が休日のため、当計算期間末日を2025年6月16日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
1. ※1 期首元本額	1,150,653,836円	2,136,689,750円
期中追加設定元本額	1,494,983,095円	2,580,617,335円
期中一部解約元本額	508,947,181円	757,146,121円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,136,689,750口	3,960,160,964口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

※1 分配金の計算過程	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（66,227,781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（441,144,677円）及び分配準備積立金（13,870,964円）より分配対象額は521,243,422円（1万口当たり2,439.49円）であり、うち64,100,692円（1万口当たり300円）を分配金額としております。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（165,820,156円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（11,606,094円）、投資信託約款に規定される収益調整金（836,104,797円）及び分配準備積立金（13,165,658円）より分配対象額は1,026,696,705円（1万口当たり2,592.56円）であり、うち162,366,599円（1万口当たり410円）を分配金額としております。

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

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	第9期 2025年6月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	△72,438,572	374,536,406
合計	△72,438,572	374,536,406

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0428円 (10,428円)	1.0934円 (10,934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	1,308,011,544	4,490,011,227	
親投資信託受益証券 合計			4,490,011,227	
合計			4,490,011,227	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年6月17日現在 金 額 (円)	2025年6月16日現在 金 額 (円)
資産の部		

流動資産		
コール・ローン	6,840,179,349	8,034,824,481
投資証券 ※2	314,436,883,200	244,793,677,200
派生商品評価勘定	-	159,656,000
未収入金	3,450,506,931	1,266,673,039
未収配当金	2,533,455,970	2,006,391,081
差入委託証拠金	508,426,997	397,099,042
流動資産合計	327,769,452,447	256,658,320,843
資産合計	327,769,452,447	256,658,320,843
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	28,616,000	-
前受金	8,400,000	160,272,000
未払解約金	1,747,066,000	626,750,000
流動負債合計	1,784,082,000	787,022,000
負債合計	1,784,082,000	787,022,000
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	103,664,583,904	74,539,061,065
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	222,320,786,543	181,332,237,778
元本等合計	325,985,370,447	255,871,298,843
純資産合計	325,985,370,447	255,871,298,843
負債純資産合計	327,769,452,447	256,658,320,843

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 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6月17日現在	2025年6月16日現在
1. ※1 期首	2023年6月16日	2024年6月18日
期首元本額	143,357,852,675円	103,664,583,904円
期中追加設定元本額	8,638,388,918円	5,213,729,543円
期中一部解約元本額	48,331,657,689円	34,339,252,382円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ-REITオープン	3,732,059,711円	3,125,772,749円
ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	84,518,908,283円	53,826,059,442円
ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	561,312,597円	697,894,699円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	24,574,738円	27,910,142円
iFree J-REITイン デックス	676,165,505円	511,672,995円
iFree 8資産バランス	2,865,827,270円	3,376,710,749円
ダイワJ-REITオープン (奇数月決算型)	97,468,809円	91,405,955円

	DCダイワ・ターゲットイヤー 2060	320,562円	471,097円
	DC・ダイワJ－REITオープン	5,277,909,415円	5,242,448,787円
	DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	9,135,460円	8,385,587円
	DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	10,258,995円	9,249,706円
	ダイワ国内REITインデックス（投資一任専用）	5,532,494円	6,138,165円
	ダイワ・ノーロード J－REITファン	89,714,633円	71,107,333円
	ダイワファンドラップ J－REITインデックス	3,723,274,510円	4,936,303,282円
	ダイワJ－REITインデックス（ダイワSMA専用）	728,631,453円	1,308,011,544円
	ダイワファンドラップオンライン J－REITインデックス	594,563,162円	674,397,154円
	スタイル9（6資産分散・保守型）	39,631円	50,544円
	スタイル9（6資産分散・バランス型）	1,163,872円	3,087,757円
	スタイル9（6資産分散・積極型）	687,709円	1,523,314円
	スタイル9（8資産分散・保守型）	46,263円	58,166円
	スタイル9（8資産分散・バランス型）	871,592円	2,258,085円
	スタイル9（8資産分散・積極型）	452,507円	3,266,088円
	ダイワ・インデックスセレクト J－REIT	745,664,733円	614,877,725円
計		103,664,583,904円	74,539,061,065円
2.	期末日における受益権の総数	103,664,583,904口	74,539,061,065口
3.	※2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 1,483,150,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 727,500,000円

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年6月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資証券	△1,535,913,516	13,909,959,533
合計	△1,535,913,516	13,909,959,533

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

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

種類	2024年6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
不動産投信								
指数先物取引								
買建	9,520,000,000	-	9,492,000,000	△28,000,000	9,676,128,000	-	9,836,400,000	160,272,000
合計	9,520,000,000	-	9,492,000,000	△28,000,000	9,676,128,000	-	9,836,400,000	160,272,000

（注） 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	3.1446円	3.4327円

(1万口当たり純資産額)	(31,446円)	(34,327円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	5,257	621,377,400	
	サンケイリアルエステート	7,610	687,183,000	
	SOSILA物流リート投	11,852	1,334,535,200	
	東海道リート投資法	4,619	509,013,800	
	日本アコモデーションファンド投資 法人	41,010	4,884,291,000	
	森ヒルズリート	27,933	3,751,401,900	
	産業ファンド	43,492	5,271,230,400	
	アドバンス・レジデンス	46,690	7,045,521,000	
	A P I 投資法人	34,638	4,173,879,000	
	G L P 投資法人	78,160	10,106,088,000	
	コンフォリア・レジデンシャル	12,027	3,444,532,800	
	日本プロロジスリート	124,141	9,906,451,800	
	星野リゾート・リート	10,046	2,435,150,400	
	O n e リート投資法人	4,143	1,041,135,900	
	イオンリート投資	28,845	3,669,084,000	
	ヒューリックリート投資法	20,990	3,253,450,000	
	日本リート投資法人	30,325	2,704,990,000	
	積水ハウス・リート投資	70,954	5,484,744,200	
	トーセイ・リート投資法人	5,165	687,461,500	
	ヘルスケア&メディカル投資	5,857	674,726,400	
	サムティ・レジデンシャル	6,472	610,956,800	
	野村不動産マスターF	75,694	11,013,477,000	※
	いちごホテルリート投資	3,931	493,733,600	
	ラサールロジポート投資	29,497	4,049,938,100	
	スターアジア不動産投	43,774	2,512,627,600	
	マリモ地方創生リート	4,313	477,880,400	
	三井不ロジパーク	51,779	5,333,237,000	

日本ホテル&レジデンシャル投資法人	5,009	341,112,900	
投資法人みらい	32,710	1,455,595,000	
三菱地所物流REIT	24,607	2,876,558,300	
CREロジスティクスファンド	10,168	1,558,754,400	
ザイマックス・リート	4,067	459,164,300	
タカラレーベン不動産投	15,513	1,396,170,000	
日本ビルファンド	138,555	18,469,381,500	
ジャパンリアルエステイト	122,000	14,688,800,000	
日本都市ファンド投資法人	123,173	12,428,155,700	
オリックス不動産投資	47,330	8,992,700,000	
日本プライムリアルティ	16,245	6,026,895,000	
NTT都市開発リート投資法人	23,919	3,152,524,200	
東急リアル・エステート	15,926	3,086,458,800	
グローバル・ワン不動産投資法人	17,125	2,303,312,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人	52,519	8,234,979,200	
森トラストリート投資法人	45,786	3,131,762,400	
インヴィンシブル投資法人	130,876	8,402,239,200	
フロンティア不動産投資	44,067	3,679,594,500	
平和不動産リート	18,205	2,434,008,500	
日本ロジスティクスファンド投資法人	47,367	4,433,551,200	
福岡リート投資法人	13,403	2,295,933,900	
KDX不動産投資法人	65,803	10,291,589,200	
いちごオフィスリート投資法人	17,332	1,572,012,400	
大和証券オフィス投資法人	9,738	3,086,946,000	
阪急阪神リート投資法人	11,326	1,766,856,000	
スターツプロシード投資法人	3,971	702,867,000	
大和ハウスリート投資法人	35,424	8,530,099,200	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	87,266	6,693,302,200	
大和証券リビング投資法人	35,083	3,389,017,800	
ジャパンエクセレント投資法人	20,397	2,735,237,700	
投資証券 合計		244,793,677,200	
合計		244,793,677,200	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

野村不動産マスターF

5,000口

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(2024年6月18日から2025年6月16日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,412,137	8,876,271
親投資信託受益証券	3,204,144,873	5,896,504,159
未収入金	-	10,870,000
流動資産合計	3,208,557,010	5,916,250,430
資産合計	3,208,557,010	5,916,250,430
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	83,291,561	139,192,751
未払解約金	-	10,809,594
未払受託者報酬	246,218	522,057
未払委託者報酬	4,617,526	9,789,476
その他未払費用	61,488	130,435
流動負債合計	88,216,793	160,444,313
負債合計	88,216,793	160,444,313
純資産の部		
元本等		
元本	※1 3,470,481,712	※1 6,326,943,229
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △ 350,141,495	※2 △ 571,137,112
（分配準備積立金）	39,789,280	34,617,724
元本等合計	3,120,340,217	5,755,806,117
純資産合計	3,120,340,217	5,755,806,117
負債純資産合計	3,208,557,010	5,916,250,430

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期 自 2023年6月16日 至 2024年6月17日	第9期 自 2024年6月18日 至 2025年6月16日
営業収益		
受取利息	437	17,357
有価証券売買等損益	△ 193,360,471	129,314,286
営業収益合計	△ 193,360,034	129,331,643
営業費用		
支払利息	353	-
受託者報酬	521,205	961,147
委託者報酬	9,774,288	18,023,553
その他費用	136,097	246,077
営業費用合計	10,431,943	19,230,777
営業利益又は営業損失（△）	△ 203,791,977	110,100,866
経常利益又は経常損失（△）	△ 203,791,977	110,100,866
当期純利益又は当期純損失（△）	△ 203,791,977	110,100,866
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（△）	△ 183,870,546	86,650,052
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 211,736,056	△ 350,141,495
剰余金増加額又は欠損金減少額	280,090,340	143,955,264
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	280,090,340	143,955,264
剰余金減少額又は欠損金増加額	315,282,787	249,208,944
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	315,282,787	249,208,944
分配金	※ 1 83,291,561	※ 1 139,192,751
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△ 350,141,495	△ 571,137,112

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2024年6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2024年6月17日としており、2025年6月15日が休日のため、当計算期間末日を2025年6月16日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
1. ※1 期首元本額	3,002,880,833円	3,470,481,712円
期中追加設定元本額	4,481,040,966円	4,912,799,008円
期中一部解約元本額	4,013,440,087円	2,056,337,491円
2. 計算期間末日における受益権の総数	3,470,481,712口	6,326,943,229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350,141,495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571,137,112円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（92,977,217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（1,227,484,674円）及び分配準備積立金（30,103,624円）より分配対象額は1,350,565,515円（1万口当たり3,891.58円）であり、うち83,291,561円（1万口当たり240円）を分配金額としております。	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（147,749,279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（2,297,304,494円）及び分配準備積立金（26,061,196円）より分配対象額は2,471,114,969円（1万口当たり3,905.70円）であり、うち139,192,751円（1万口当たり220円）を分配金額としております。

(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	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 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9期 2025年6月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	△14,672,159	39,704,048
合計	△14,672,159	39,704,048

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8991円 (8,991円)	0.9097円 (9,097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	6,738,861,896	5,896,504,159	
親投資信託受益証券 合計			5,896,504,159	
合計			5,896,504,159	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年6月17日現在 金 額 (円)	2025年6月16日現在 金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	203,072,547	261,179,826
コール・ローン	162,870,581	534,573,297
投資信託受益証券	382,552,153	482,734,580
投資証券	24,226,719,052	26,874,799,640
派生商品評価勘定	28,810,416	24,931,957
未収入金	26,004,087	103,221,956
未収配当金	68,941,817	68,255,651
差入委託証拠金	367,357,284	359,017,827
流動資産合計	25,466,327,937	28,708,714,734
資産合計	25,466,327,937	28,708,714,734
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	111,207,805	232,331,837
未払金	-	415,701
未払解約金	-	21,690,000
流動負債合計	111,207,805	254,437,538
負債合計	111,207,805	254,437,538
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	30,158,213,460	32,519,331,878
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△4,803,093,328	△4,065,054,682
元本等合計	25,355,120,132	28,454,277,196
純資産合計	25,355,120,132	28,454,277,196
負債純資産合計	25,466,327,937	28,708,714,734

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券

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

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1. ※1 期首	2023年6月16日	2024年6月18日
期首元本額	27,483,964,976円	30,158,213,460円
期中追加設定元本額	10,991,030,606円	9,878,138,629円
期中一部解約元本額	8,316,782,122円	7,517,020,211円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国RE	24,721,803,282円	24,167,634,143円
ITインデックス（為替ヘッジあり）		
ダイワファンドラップオンライン 外国RE ITインデックス	1,115,161,590円	1,192,223,759円
（為替ヘッジあり）		
ダイワ海外RE ITインデックス	1,517,667円	1,242,365円
（為替ヘッジあり）（投資一任専用）		
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）	508,448,807円	419,369,715円
ダイワ外国RE ITインデックス	3,811,282,114円	6,738,861,896円
（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）		

計	30,158,213,460円	32,519,331,878円
2. 期末日における受益権の総数	30,158,213,460口	32,519,331,878口
3. ※2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は4,803,093,328円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は4,065,054,682円であります。

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 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	2025年6月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	4,834,167	2,831,527
投資証券	691,987,897	△436,101,961
合計	696,822,064	△433,270,434

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 不動産投信関連

種類	2024年6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
不動産投信								
指数先物取引								
買建	864,506,730	-	847,236,722	△17,270,008	1,144,021,171	-	1,168,042,924	24,021,753
合計	864,506,730	-	847,236,722	△17,270,008	1,144,021,171	-	1,168,042,924	24,021,753

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2. 通貨関連

種類	2024年6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	24,598,604,673	-	24,663,732,054	△65,127,381	27,699,925,460	-	27,931,347,093	△231,421,633
アメリカ・ドル	18,738,965,171	-	18,821,412,448	△82,447,277	21,491,872,374	-	21,643,059,820	△151,187,446
イギリス・ポンド	1,353,097,721	-	1,352,156,720	941,001	1,349,694,734	-	1,364,937,158	△15,242,424
イスラエル・シェケル	31,962,707	-	31,904,330	58,377	42,139,672	-	41,229,468	910,204
オーストラリア・ドル	1,931,862,032	-	1,925,279,283	6,582,749	2,135,150,037	-	2,161,943,053	△26,793,016
カナダ・ドル	375,751,000	-	373,855,908	1,895,092	403,744,286	-	409,909,724	△6,165,438
シンガポール・ドル	789,317,071	-	790,828,920	△1,511,849	843,027,765	-	852,130,699	△9,102,934
ニュージーランド・ドル	78,224,046	-	78,316,984	△92,938	30,221,136	-	30,554,069	△332,933
ユーロ	1,049,195,211	-	1,038,536,662	10,658,549	1,104,605,564	-	1,126,809,135	△22,203,571
香港・ドル	250,229,714	-	251,440,799	△1,211,085	299,469,892	-	300,773,967	△1,304,075
合計	24,598,604,673	-	24,663,732,054	△65,127,381	27,699,925,460	-	27,931,347,093	△231,421,633

(注) 1. 時価の算定方法

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

- 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6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額	0.8407円	0.8750円
(1万口当たり純資産額)	(8,407円)	(8,750円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REAL ESTATE ETF	37,210	3,342,574.300	
	アメリカ・ドル 小計			3,342,574.300 (482,734,580)	
投資信託受益証券 合計				482,734,580 [482,734,580]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	15,519	139,050.240	
		URBAN EDGE PROPERTIES	15,723	288,359.820	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	13,201	158,147.980	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	17,804	3,670,828.720	

SIMON PROPERTY GROUP INC	38,435	6,030,451.500	
BXP INC	18,237	1,314,887.700	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	16,851	140,537.340	
VORNADO REALTY TRUST	20,808	840,643.200	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	4,886	113,501.780	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	8,788	289,828.240	
UNITI GROUP INC	31,651	129,769.100	
NEXPOINT RESIDENTIAL	2,718	92,194.560	
EQUITY RESIDENTIAL	42,827	2,949,923.760	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	27,963	319,057.830	
EPR PROPERTIES	9,491	536,716.050	
CITY OFFICE REIT INC	4,603	24,856.200	
GLOBAL NET LEASE INC	25,679	189,767.810	
EQUINIX INC	12,198	10,888,422.720	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	12,529	343,169.310	
CHATHAM LODGING TRUST	5,858	40,713.100	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7,507	712,639.510	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,864	47,800.160	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	6,929	16,629.600	
HOST HOTELS & RESORTS INC	87,603	1,333,317.660	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	39,756	1,447,118.400	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17,233	47,218.420	
RLJ LODGING TRUST	19,668	138,659.400	
FARMLAND PARTNERS INC	5,044	57,602.480	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	10,333	70,884.380	
KIMCO REALTY CORP	85,155	1,773,778.650	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7,392	46,495.680	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	44,412	663,515.280	
WHITESTONE REIT	5,779	71,659.600	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	34,387	1,588,679.400	
PIEDMONT REALTY TRUST INC CLASS A	15,712	117,682.880	

PARK HOTELS & RESORTS INC	26,137	258,756.300	
INVITATION HOMES INC	71,398	2,394,688.920	
OUTFRONT MEDIA INC	17,445	272,142.000	
LAMAR ADVERTISING CO-A	11,021	1,314,364.460	
JBG SMITH PROPERTIES	10,953	200,549.430	
ALEXANDER & BALDWIN INC	9,417	168,187.620	
GLADSTONE LAND CORP	3,874	39,204.880	
AMERICOLD REALTY TRUST	32,774	551,914.160	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	7,310	24,927.100	
VICI PROPERTIES INC	132,111	4,243,405.320	
BRT APARTMENTS CORP	1,402	21,969.340	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,673	206,973.550	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	23,522	762,112.800	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,826	78,422.500	
BROADSTONE NET LEASE INC	23,629	380,899.480	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	13,279	60,685.030	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	5,979	120,716.010	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	28,883	521,049.320	
PARAMOUNT GROUP INC	22,471	144,937.950	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	16,718	143,106.080	
NETSTREIT CORP	10,578	173,373.420	
CTO REALTY GROWTH INC	3,062	55,116.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	28,517	1,044,292.540	
STAG INDUSTRIAL INC	23,381	850,600.780	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	1,311	19,415.910	
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2,551	38,239.490	
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	15,687	556,104.150	
ORION OFFICE REIT INC	6,028	11,513.480	
DIGITAL CORE REIT UNITS	103,900	52,989.000	
VENTAS INC	54,783	3,498,442.380	
CARETRUST REIT INC	23,518	677,553.580	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	9,809	272,886.380	

BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	38,340	981,120.600	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	6,148	1,474.900	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	29,649	539,908.290	
UMH PROPERTIES INC	9,514	159,549.780	
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	1,769	43,181.290	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C	4,638	17,717.160	
PEAKSTONE REALTY TRUST CLASS E	4,650	59,845.500	
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	1,890	60,196.500	
AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	19,182	679,042.800	
LINEAGE INC	7,442	324,843.300	
MODIV INDUSTRIAL INC CLASS C	1,056	14,910.720	
SILA RLTY TR INC TRUST	7,134	172,000.740	
CURLINE PROPERTIES	11,971	268,748.950	
FRONTVIEW REIT INC	1,719	19,476.270	
MILLROSE PROPERTIES INC CLASS A	15,071	409,931.200	
IRON MOUNTAIN INC	36,812	3,739,731.080	
TERRENO REALTY CORP	12,504	734,610.000	
SUN COMMUNITIES INC	15,007	1,855,015.270	
ACADIA REALTY TRUST	14,996	289,272.840	
ALEXANDER'S INC	274	61,650.000	
PROLOGIS INC	116,155	12,461,108.400	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	19,306	1,392,155.660	
BRANDYWINE REALTY TRUST	22,387	100,517.630	
SAUL CENTERS INC	1,434	49,057.140	
VERIS RESIDENTIAL INC	10,473	156,257.160	
CAMDEN PROPERTY TRUST	13,369	1,552,408.280	
COUSINS PROPERTIES INC	21,011	631,800.770	
SITE CENTERS CORP	6,118	69,806.380	
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,509	1,112,973.910	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,054	2,291,040.840	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	16,592	819,976.640	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	9,664	920,882.560	

GETTY REALTY CORP	6,564	190,159.080	
WELLTOWER INC	76,351	11,635,892.400	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	87,671	1,523,721.980	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	13,488	424,737.120	
SERVICE PROPERTIES TRUST	21,206	49,834.100	
KILROY REALTY CORP	13,325	469,306.500	
LTC PROPERTIES INC	5,868	205,966.800	
LXP INDUSTRIAL TRUST	37,061	316,871.550	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	14,650	2,195,302.500	
MACERICH CO/THE	31,146	490,238.040	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	23,944	1,493,147.840	
NATL HEALTH INVESTORS INC	5,692	403,733.560	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	23,504	997,039.680	
REALTY INCOME CORP	109,683	6,322,128.120	
COPT DEFENSE PROPERTIES TRUST	14,095	403,117.000	
PUBLIC STORAGE	19,750	5,825,262.500	
REGENCY CENTERS CORP	20,456	1,437,034.000	
SAFEHOLD INC	5,623	85,863.210	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	13,872	411,720.960	
SL GREEN REALTY CORP	8,777	572,260.400	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	26,555	92,411.400	
UDR INC	37,732	1,555,690.360	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,652	67,500.720	
WP CAREY INC	27,426	1,737,162.840	
ELME	11,414	186,961.320	
AGREE REALTY CORP	13,413	999,939.150	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	35,320	1,307,546.400	
CUBESMART	28,342	1,218,706.000	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	25,177	213,752.730	
DIGITAL REALTY TRUST INC	39,657	6,918,956.790	
EXTRA SPACE STORAGE INC	26,566	3,974,273.600	
CENTERSPACE	2,149	136,504.480	
KITE REALTY GROUP TRUST	27,529	612,795.540	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,965	48,948.150	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,694	82,449.120	

	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	26,916	201,331.680	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	75,243	331,821.630	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	11,605	20,076.650	
	DOUGLAS EMMETT INC	20,985	313,306.050	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	203,400	12,610.800	
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	82,300	15,637.000	
	PRIME US REIT	75,240	10,985.040	
アメリカ・ドル 小計			143,296,965.170 (20,694,947,709)	
イギリス・ポンド	WAREHOUSE REIT PLC	54,523	58,230.560	
	HELICAL PLC	13,564	29,569.520	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	44,442	18,443.430	
	HAMMERSON REIT PLC	58,042	169,482.640	
	ASSURA PLC	389,248	195,013.240	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	89,696	90,054.780	
	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITE	51,354	2,701.220	
	CLS HOLDINGS PLC	20,382	13,309.440	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	73,653	59,953.540	
	REGIONAL REIT LTD	19,105	22,352.850	
	NEWRIVER REIT PLC	59,892	46,955.320	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	254,223	371,165.580	
	CUSTODIAN REIT PLC	59,552	48,177.560	
	PRS REIT PLC/THE	70,486	80,917.920	
	SOCIAL HOUSING REIT PLC	46,825	33,854.470	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	80,532	83,109.020	
	AEW UK REIT PLC	20,041	20,802.550	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	168,349	138,719.570	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	62,827	96,627.920	
	HOME REIT PLC	84,338	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	96,960	597,273.600	
	SEGRO PLC	176,087	1,217,817.690	
	UNITE GROUP PLC/THE	54,078	446,413.890	
	BRITISH LAND CO PLC	130,049	502,769.430	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	52,869	185,570.190	
	DERWENT LONDON PLC	14,616	288,227.520	

	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	173,957	180,045.490	
	WORKSPACE GROUP PLC	18,688	76,153.600	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	28,439	183,431.550	
	BIG YELLOW GROUP PLC	25,604	253,479.600	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	266,579	532,091.680	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	66,072	35,678.880	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	322,882	477,542.470	
イギリス・ポンド 小計			6,555,936.720 (1,282,537,901)	
イスラエル・ シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	101,181	188,196.660	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	26,700	238,190.700	
	REIT 1 LTD	23,763	465,754.800	
イスラエル・シュケル 小計			892,142.160 (35,592,635)	
オーストラリ ア・ドル	DEXUS/AU	144,388	1,012,159.880	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	53,426	39,535.240	
	ABACUS STORAGE KING STAPLED UNITS	71,161	109,587.940	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	45,710	139,415.500	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	184,360	65,447.800	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	74,476	236,088.920	
	RURAL FUNDS GROUP	50,015	92,277.670	
	WAYPOINT REIT	93,819	247,682.160	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	87,709	376,271.610	
	CENTURIA OFFICE REIT	52,359	65,448.750	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	108,969	185,792.140	
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	240,395	313,715.470	
	REGION GROUP	156,106	374,654.400	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	36,785	92,698.200	
	NATIONAL STORAGE REIT	185,499	450,762.570	
	DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	26,925	78,890.250	
	SCENTRE GROUP	698,305	2,569,762.400	

	ARENA REIT	55,651	220,377.960	
	BWP TRUST	74,833	276,882.100	
	GPT GROUP	257,155	1,272,917.250	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	69,444	281,942.640	
	MIRVAC GROUP	529,709	1,255,410.330	
	STOCKLAND	320,464	1,797,803.040	
	ABACUS GROUP UNIT	52,859	62,902.210	
	GOODMAN GROUP	272,650	9,264,647.000	
	VICINITY CENTRES	519,449	1,319,400.460	
	CHARTER HALL GROUP	63,497	1,224,222.160	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	50,420	278,822.600	
オーストラリア・ドル 小計			23,705,518.650 (2,222,866,484)	
カナダ・ドル	NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	4,700	34,686.000	
	PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	6,425	98,431.000	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	7,100	53,534.000	
	SLATE GROCERY REIT	3,600	52,272.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	7,700	150,458.000	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,500	35,775.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	15,700	78,343.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,100	288,558.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	19,000	222,490.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	10,100	137,057.000	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	14,000	246,960.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	21,600	315,360.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	2,400	43,992.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	7,200	115,200.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	9,500	243,105.000	

	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	10,600	473,078.000	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	18,000	194,400.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	19,500	342,420.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	1,000	15,940.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,200	222,336.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	7,200	106,488.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	8,400	141,456.000	
カナダ・ドル 小計			3,612,339.000 (383,847,143)	
シンガポール・ ドル	KEPPEL DC REIT	240,200	547,656.000	
	AIMS APAC REIT	85,000	111,350.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	393,900	322,998.000	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	66,400	42,164.000	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	234,600	116,127.000	
	EC WORLD REIT	32,900	0.000	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	472,600	1,233,486.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	744,600	1,585,998.000	
	SUNTEC REIT	295,400	336,756.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	454,900	509,488.000	
	KEPPEL REIT	322,200	281,925.000	
	CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	341,400	297,018.000	
	ESR-REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	85,450	197,389.500	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	90,100	68,476.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	181,854	396,441.720	
	STARHILL GLOBAL REIT	190,400	96,152.000	
	CAPITALAND CHINA TRUST	163,400	111,929.000	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	56,000	225,120.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	279,100	547,036.000	

	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	311,100	373,320.000	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	144,600	80,976.000	
	OUÉ REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	298,700	85,129.500	
シンガポール・ドル 小計			7,566,935.720 (851,658,615)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	146,115	286,385.400	
ニュージーランド・ドル 小計			286,385.400 (24,909,802)	
ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	5,346	135,788.400	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	3,770	132,515.500	
	HAMBORNER REIT AG	8,459	54,983.500	
	WERELDHAVE NV	4,001	69,777.440	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	12,345	1,022,659.800	
	NSI NV	2,144	49,740.800	
	ICADE	3,694	88,064.960	
	CARMILA	6,643	110,805.240	
	ALTAREA	567	60,215.400	
	GECINA SA	6,273	595,935.000	
	KLEPIERRE	26,554	883,186.040	
	COVIVIO	6,441	328,813.050	
	MERCIALYS	10,897	117,469.660	
	AEDIFICA	5,619	367,763.550	
	COFINIMMO	4,502	345,753.600	
	RETAIL ESTATES	1,562	94,657.200	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	21,419	443,801.680	
	CARE PROPERTY INVEST	4,567	56,356.780	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	4,523	140,439.150	
	MONTEA NV	2,570	163,966.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,703	19,472.210	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	40,725	249,644.250	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	47,438	507,112.220	
	STONEWEG EUROPEAN REAL ESTATE	41,700	64,218.000	

	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	65,387	69,571.760	
ユーロ 小計			6,172,711.190 (1,028,126,776)	
韓国・ウォン	SK REITS LTD	18,539	85,557,485.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT LTD	3,204	0.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	13,618	75,171,360.000	
	LOTTE REIT CO LTD	19,578	74,200,620.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	6,661	32,372,460.000	
	JR REIT XXVII	23,768	64,886,640.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	5,929	26,265,470.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	20,694	89,398,080.000	
韓国・ウォン 小計			447,852,115.000 (47,337,969)	
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	291,000	232,800.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	96,000	206,400.000	
	FORTUNE REIT	211,000	964,270.000	
	LINK REIT	346,700	14,578,735.000	
	CHAMPION REIT	254,000	492,760.000	
香港・ドル 小計			16,474,965.000 (302,974,606)	
投資証券 合計			26,874,799,640 [26,874,799,640]	
合計			27,357,534,220 [27,357,534,220]	

投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率

アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄 投資証券 141銘柄	2.3%	97.7%	77.4%
イギリス・ポンド	投資証券 33銘柄	-%	100%	4.7%
イスラエル・シケル	投資証券 3銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券 28銘柄	-%	100%	8.1%
カナダ・ドル	投資証券 22銘柄	-%	100%	1.4%
シンガポール・ドル	投資証券 22銘柄	-%	100%	3.1%
ニュージーランド・ドル	投資証券 1銘柄	-%	100%	0.1%
ユーロ	投資証券 25銘柄	-%	100%	3.8%
韓国・ウォン	投資証券 8銘柄	-%	100%	0.2%
香港・ドル	投資証券 5銘柄	-%	100%	1.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(2024年6月18日から2025年6月16日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	152,204	2,313,905
親投資信託受益証券	111,300,193	1,007,712,005
未収入金	1,000	25,000
流動資産合計	111,453,397	1,010,050,910
資産合計	111,453,397	1,010,050,910
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,465,357	20,295,299
未払受託者報酬	7,347	113,034
未払委託者報酬	138,621	2,120,461
その他未払費用	1,715	28,182
流動負債合計	1,613,040	22,556,976
負債合計	1,613,040	22,556,976
純資産の部		
元本等		
元本	※ 1 77,124,104	※ 1 699,837,921
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	32,716,253	287,656,013
（分配準備積立金）	9,166,672	2,718,362
元本等合計	109,840,357	987,493,934
純資産合計	109,840,357	987,493,934
負債純資産合計	111,453,397	1,010,050,910

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期 自 2023年6月16日 至 2024年6月17日	第9期 自 2024年6月18日 至 2025年6月16日
営業収益		
受取利息	-	2,688
有価証券売買等損益	11,555,589	△ 80,369,188
営業収益合計	11,555,589	△ 80,366,500
営業費用		
受託者報酬	10,159	139,523
委託者報酬	192,333	2,617,997
その他費用	2,313	34,717
営業費用合計	204,805	2,792,237
営業利益又は営業損失（△）	11,350,784	△ 83,158,737
経常利益又は経常損失（△）	11,350,784	△ 83,158,737
当期純利益又は当期純損失（△）	11,350,784	△ 83,158,737
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（△）	2,067,193	△ 5,851,006
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,131,636	32,716,253
剰余金増加額又は欠損金減少額	29,694,204	402,444,453
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	29,694,204	402,444,453
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,927,821	49,901,663
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,927,821	49,901,663
分配金	※1 1,465,357	※1 20,295,299
期末剰余金又は期末欠損金（△）	32,716,253	287,656,013

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2024年6月15日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2024年6月17日としており、2025年6月15日が休日のため、当計算期間末日を2025年6月16日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
1. ※1 期首元本額	10,000,000円	77,124,104円
期中追加設定元本額	91,547,167円	728,838,034円
期中一部解約元本額	24,423,063円	106,124,217円
2. 計算期間末日における受益権の総数	77,124,104口	699,837,921口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

※1 分配金の計算過程	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（1,730,063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（7,553,528円）、投資信託約款に規定される収益調整金（23,549,581円）及び分配準備積立金（1,348,438円）より分配対象額は34,181,610円（1万口当たり4,432.03円）であり、うち1,465,357円（1万口当たり190円）を分配金額としております。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（21,898,135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（284,937,651円）及び分配準備積立金（1,115,526円）より分配対象額は307,951,312円（1万口当たり4,400.32円）であり、うち20,295,299円（1万口当たり290円）を分配金額としております。

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

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	第9期 2025年6月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	9,440,671	△74,483,937
合計	9,440,671	△74,483,937

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第8期 2024年6月17日現在	第9期 2025年6月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4242円 (14,242円)	1.4110円 (14,110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	260,390,699	1,007,712,005	
親投資信託受益証券 合計			1,007,712,005	
合計			1,007,712,005	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

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

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2024年6月17日現在 金 額 (円)	2025年6月16日現在 金 額 (円)
資産の部		

流動資産		
預金	354,676,827	472,152,544
コール・ローン	317,329,086	359,903,106
投資信託受益証券	1,763,894,916	1,478,950,340
投資証券	38,951,062,271	45,521,940,900
派生商品評価勘定	7,265,592	36,431,290
未収入金	942,018	1,615,430
未収配当金	109,471,581	114,203,036
差入委託証拠金	418,509,770	410,251,991
流動資産合計	41,923,152,061	48,395,448,637
資産合計	41,923,152,061	48,395,448,637
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	44,675,540	7,374,085
未払金	33,085,238	-
未払解約金	831,000	12,725,000
流動負債合計	78,591,778	20,099,085
負債合計	78,591,778	20,099,085
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	10,981,310,353	12,500,149,430
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	30,863,249,930	35,875,200,122
元本等合計	41,844,560,283	48,375,349,552
純資産合計	41,844,560,283	48,375,349,552
負債純資産合計	41,923,152,061	48,395,448,637

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券

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

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
1. ※1 期首	2023年6月16日	2024年6月18日
期首元本額	9,843,782,869円	10,981,310,353円
期中追加設定元本額	2,203,448,196円	2,436,041,310円
期中一部解約元本額	1,065,920,712円	917,202,233円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワバランスファンド2023-01	87,906,063円	-円
（適格機関投資家専用）		
ダイワファンドラップ 外国REIT	1,955,980,762円	2,626,255,264円
インデックス（為替ヘッジなし）		
ダイワファンドラップオンライン 外国REIT	351,688,573円	270,886,617円
インデックス（為替ヘッジなし）		
D-I's グローバルREIT	1,440,421円	1,354,223円
インデックス		
DCダイワ・ターゲットイヤー	21,117,268円	21,399,314円
2050		
iFree 外国REIT	651,464,417円	614,241,119円
インデックス		
iFree 8資産バランス	2,475,793,628円	2,906,000,690円

グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成型）	365,994,567円	443,429,567円
グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）	234,273,674円	226,449,161円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	3,565,459円	6,390,038円
DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド	4,119,965,423円	4,589,495,796円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	7,703,940円	7,393,088円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	8,750,218円	8,119,780円
ダイワ海外REITインデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	4,537,854円	5,135,087円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	138,343,907円	124,495,154円
スタイル9（6資産分散・保守型）	21,229円	20,848円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	815,174円	2,093,883円
スタイル9（6資産分散・積極型）	749,411円	2,754,481円
スタイル9（8資産分散・保守型）	22,560円	33,676円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	543,086円	1,421,077円
スタイル9（8資産分散・積極型）	543,573円	3,114,298円
ダイワ・インデックスセレクトグローバルREIT	204,302,936円	171,726,759円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	64,844,404円	56,368,123円
ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）	29,208,816円	260,390,699円
ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	87,624,943円	-円
ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	83,814,309円	76,089,763円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	80,293,738円	75,090,925円

計	10,981,310,353円	12,500,149,430円
2. 期末日における受益権の総数	10,981,310,353口	12,500,149,430口

(金融商品に関する注記)

I 金融商品の状況に関する事項

区分	自2024年6月18日 至2025年6月16日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

II 金融商品の時価等に関する事項

区分	2025年6月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券

重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)デリバティブ取引
デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2024年6月17日現在	2025年6月16日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	25,600,657	13,657,467
投資証券	2,157,697,371	△3,039,547,241
合計	2,183,298,028	△3,025,889,774

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 不動産投信関連

種類	2024年6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等	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								
不動産投信								
指数先物取引								
買建	1,171,910,880	-	1,134,681,168	△37,229,712	1,329,696,037	-	1,354,101,601	24,405,564
合計	1,171,910,880	-	1,134,681,168	△37,229,712	1,329,696,037	-	1,354,101,601	24,405,564

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 不動産投信指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

2. 通貨関連

種類	2024年6月17日現在				2025年6月16日現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	311,890,156	-	311,709,920	△180,236	345,342,452	-	349,994,093	4,651,641
アメリカ・ドル	206,470,440	-	207,361,440	891,000	177,382,000	-	178,626,092	1,244,092
ユーロ	105,419,716	-	104,348,480	△1,071,236	167,960,452	-	171,368,001	3,407,549
合計	311,890,156	-	311,709,920	△180,236	345,342,452	-	349,994,093	4,651,641

（注） 1. 時価の算定方法

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

- 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6月17日現在	2025年6月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.8105円 (38,105円)	3.8700円 (38,700円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REAL ESTATE ETF	114,000	10,240,620.000	
	アメリカ・ドル 小計			10,240,620.000 (1,478,950,340)	
投資信託受益証券 合計				1,478,950,340 [1,478,950,340]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	25,585	229,241.600	
		URBAN EDGE PROPERTIES	26,860	492,612.400	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	21,380	256,132.400	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	30,397	6,267,253.460	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	65,630	10,297,347.000	
		BXP INC	31,062	2,239,570.200	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	27,100	226,014.000	
		VORNADO REALTY TRUST	35,500	1,434,200.000	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	8,259	191,856.570	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	14,956	493,248.880	
		UNITI GROUP INC	51,242	210,092.200	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	4,588	155,624.960	
		EQUITY RESIDENTIAL	73,157	5,039,054.160	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	47,698	544,234.180	
		EPR PROPERTIES	16,206	916,449.300	
		CITY OFFICE REIT INC	7,500	40,500.000	
		GLOBAL NET LEASE INC	41,594	307,379.660	
		EQUINIX INC	20,806	18,572,267.840	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	21,398	586,091.220	
		CHATHAM LODGING TRUST	9,853	68,478.350	

RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	12,743	1,209,692.990	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	5,248	87,589.120	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	10,300	24,720.000	
HOST HOTELS & RESORTS INC	149,586	2,276,698.920	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	67,889	2,471,159.600	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	29,616	81,147.840	
RLJ LODGING TRUST	31,635	223,026.750	
FARMLAND PARTNERS INC	8,636	98,623.120	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	17,053	116,983.580	
KIMCO REALTY CORP	145,485	3,030,452.550	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	13,195	82,996.550	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	75,803	1,132,496.820	
WHITESTONE REIT	9,217	114,290.800	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	58,736	2,713,603.200	
PIEDMONT REALTY TRUST INC CLASS A	26,473	198,282.770	
PARK HOTELS & RESORTS INC	44,184	437,421.600	
INVITATION HOMES INC	121,925	4,089,364.500	
OUTFRONT MEDIA INC	29,453	459,466.800	
LAMAR ADVERTISING CO-A	18,800	2,242,088.000	
JBG SMITH PROPERTIES	17,761	325,203.910	
ALEXANDER & BALDWIN INC	15,494	276,722.840	
GLADSTONE LAND CORP	6,732	68,127.840	
AMERICOLD REALTY TRUST	55,943	942,080.120	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	11,179	38,120.390	
VICI PROPERTIES INC	225,700	7,249,484.000	
BRT APARTMENTS CORP	2,049	32,107.830	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	6,039	340,297.650	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	40,095	1,299,078.000	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	8,417	136,776.250	

BROADSTONE NET LEASE INC	40,319	649,942.280	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	21,916	100,156.120	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	9,928	200,446.320	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	49,331	889,931.240	
PARAMOUNT GROUP INC	39,039	251,801.550	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	28,574	244,593.440	
NETSTREIT CORP	17,391	285,038.490	
CTO REALTY GROWTH INC	5,300	95,400.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	48,724	1,784,272.880	
STAG INDUSTRIAL INC	39,877	1,450,725.260	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	2,366	35,040.460	
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	4,425	66,330.750	
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	26,763	948,748.350	
ORION OFFICE REIT INC	9,048	17,281.680	
DIGITAL CORE REIT UNITS	181,000	92,310.000	
VENTAS INC	93,545	5,973,783.700	
CARETRUST REIT INC	40,100	1,155,281.000	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	16,500	459,030.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	65,491	1,675,914.690	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,759	1,861.380	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	50,576	920,988.960	
UMH PROPERTIES INC	15,639	262,266.030	
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	2,816	68,738.560	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C	7,508	28,680.560	
PEAKSTONE REALTY TRUST CLASS E	7,600	97,812.000	
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	3,029	96,473.650	
AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	32,700	1,157,580.000	
LINEAGE INC	12,700	554,355.000	
MODIV INDUSTRIAL INC CLASS C	1,600	22,592.000	

SILA RLTY TR INC TRUST	11,700	282,087.000	
CURLINE PROPERTIES	20,144	452,232.800	
FRONTVIEW REIT INC	2,900	32,857.000	
MILLROSE PROPERTIES INC CLASS A	25,700	699,040.000	
IRON MOUNTAIN INC	62,813	6,381,172.670	
TERRENO REALTY CORP	21,327	1,252,961.250	
SUN COMMUNITIES INC	25,607	3,165,281.270	
ACADIA REALTY TRUST	25,544	492,743.760	
ALEXANDER'S INC	393	88,425.000	
PROLOGIS INC	198,400	21,284,352.000	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	32,960	2,376,745.600	
BRANDYWINE REALTY TRUST	36,941	165,865.090	
SAUL CENTERS INC	2,561	87,611.810	
VERIS RESIDENTIAL INC	16,996	253,580.320	
CAMDEN PROPERTY TRUST	22,768	2,643,820.160	
COUSINS PROPERTIES INC	35,816	1,076,987.120	
SITE CENTERS CORP	10,022	114,351.020	
EASTGROUP PROPERTIES INC	11,042	1,888,071.580	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	13,667	3,887,714.820	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	28,342	1,400,661.640	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	16,463	1,568,759.270	
GETTY REALTY CORP	10,798	312,818.060	
WELLTOWER INC	130,435	19,878,294.000	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	149,740	2,602,481.200	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	22,974	723,451.260	
SERVICE PROPERTIES TRUST	33,681	79,150.350	
KILROY REALTY CORP	22,667	798,331.740	
LTC PROPERTIES INC	9,690	340,119.000	
LXP INDUSTRIAL TRUST	63,232	540,633.600	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	24,991	3,744,901.350	
MACERICH CO/THE	53,200	837,368.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	40,866	2,548,403.760	
NATL HEALTH INVESTORS INC	9,656	684,900.080	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	40,142	1,702,823.640	
REALTY INCOME CORP	187,316	10,796,894.240	
COPT DEFENSE PROPERTIES TRUST	24,064	688,230.400	

	PUBLIC STORAGE	33,703	9,940,699.850	
	REGENCY CENTERS CORP	34,907	2,452,216.750	
	SAFEHOLD INC	9,705	148,195.350	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	23,635	701,486.800	
	SL GREEN REALTY CORP	14,962	975,522.400	
	DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	46,467	161,705.160	
	UDR INC	64,460	2,657,685.800	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,629	107,420.940	
	WP CAREY INC	46,776	2,962,791.840	
	ELME	18,797	307,894.860	
	AGREE REALTY CORP	22,886	1,706,151.300	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	60,253	2,230,566.060	
	CUBESMART	48,411	2,081,673.000	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	42,952	364,662.480	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	67,704	11,812,316.880	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	45,321	6,780,021.600	
	CENTERSPACE	3,459	219,715.680	
	KITE REALTY GROUP TRUST	47,007	1,046,375.820	
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3,092	77,021.720	
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	9,328	135,069.440	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	44,419	332,254.120	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	128,479	566,592.390	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	16,005	27,688.650	
	DOUGLAS EMMETT INC	35,758	533,866.940	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	341,662	21,183.040	
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	171,300	32,547.000	
	EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	0.000	
	PRIME US REIT	155,920	22,764.320	
アメリカ・ドル 小計			244,233,341.120 (35,272,179,125)	
イギリス・ポンド	WAREHOUSE REIT PLC	86,763	92,662.880	
	HELICAL PLC	23,433	51,083.940	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	61,021	25,323.710	

	HAMMERSON REIT PLC	97,368	284,314.560	
	ASSURA PLC	642,860	322,072.860	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	144,983	145,562.930	
	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITE	76,976	4,048.930	
	CLS HOLDINGS PLC	29,656	19,365.360	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	112,420	91,509.880	
	REGIONAL REIT LTD	31,830	37,241.100	
	NEWRIVER REIT PLC	101,749	79,771.210	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	426,476	622,654.960	
	CUSTODIAN REIT PLC	90,504	73,217.730	
	PRS REIT PLC/THE	113,932	130,793.930	
	SOCIAL HOUSING REIT PLC	72,416	52,356.760	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	132,736	136,983.550	
	AEW UK REIT PLC	32,682	33,923.910	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	267,895	220,745.480	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	99,533	153,081.750	
	HOME REIT PLC	117,587	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	162,657	1,001,967.120	
	SEGRO PLC	295,397	2,042,965.650	
	UNITE GROUP PLC/THE	90,718	748,877.090	
	BRITISH LAND CO PLC	218,165	843,425.890	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	87,315	306,475.650	
	DERWENT LONDON PLC	24,518	483,494.960	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	287,296	297,351.360	
	WORKSPACE GROUP PLC	29,606	120,644.450	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	47,707	307,710.150	
	BIG YELLOW GROUP PLC	42,952	425,224.800	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	447,204	892,619.180	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	104,674	56,523.960	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	541,655	801,107.740	
イギリス・ポンド 小計			10,905,103.430 (2,133,365,384)	
イスラエル・ シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	169,724	315,686.640	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	50,267	448,431.900	
	REIT 1 LTD	44,595	874,062.000	

イスラエル・シュケル 小計			1,638,180.540 (65,356,360)	
オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	242,975	1,703,254.750	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	88,653	65,603.220	
	ABACUS STORAGE KING STAPLED UNITS	115,395	177,708.300	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	75,197	229,350.850	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	308,949	109,676.890	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	118,714	376,323.380	
	RURAL FUNDS GROUP	86,746	160,046.370	
	WAYPOINT REIT	149,546	394,801.440	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	147,596	633,186.840	
	CENTURIA OFFICE REIT	86,351	107,938.750	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	184,766	315,026.030	
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	398,406	519,919.830	
	REGION GROUP	262,693	630,463.200	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	60,426	152,273.520	
	NATIONAL STORAGE REIT	312,155	758,536.650	
	DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	48,020	140,698.600	
	SCENTRE GROUP	1,175,099	4,324,364.320	
	ARENA REIT	88,446	350,246.160	
	BWP TRUST	123,877	458,344.900	
	GPT GROUP	432,737	2,142,048.150	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	115,142	467,476.520	
	MIRVAC GROUP	891,388	2,112,589.560	
	STOCKLAND	539,273	3,025,321.530	
	ABACUS GROUP UNIT	100,940	120,118.600	
	GOODMAN GROUP	458,812	15,590,431.760	
	VICINITY CENTRES	874,123	2,220,272.420	
	CHARTER HALL GROUP	106,852	2,060,106.560	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	83,464	461,555.920	
オーストラリア・ドル 小計			39,807,685.020 (3,732,766,624)	
カナダ・ドル	NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	7,000	51,660.000	

PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	10,841	166,084.120	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,800	73,892.000	
SLATE GROCERY REIT	6,100	88,572.000	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	12,900	252,066.000	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	3,900	55,809.000	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	25,600	127,744.000	
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6,800	478,584.000	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	30,100	352,471.000	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	16,100	218,477.000	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	23,100	407,484.000	
CHOICE PROPERTIES REIT	36,200	528,520.000	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	3,800	69,654.000	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	12,000	192,000.000	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	15,700	401,763.000	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	17,700	789,951.000	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	28,566	308,512.800	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	32,800	575,968.000	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	1,650	26,301.000	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,300	368,244.000	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	11,700	173,043.000	
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	13,900	234,076.000	
カナダ・ドル 小計		5,940,875.920 (631,277,476)	

シンガポール・ドル	KEPPEL DC REIT	404,183	921,537.240	
	AIMS APAC REIT	142,200	186,282.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	662,890	543,569.800	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT	114,700	72,834.500	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	385,840	190,990.800	
	EC WORLD REIT	36,500	0.000	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	795,277	2,075,672.970	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	1,269,522	2,704,081.860	
	SUNTEC REIT	497,000	566,580.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	765,500	857,360.000	
	KEPPEL REIT	542,100	474,337.500	
	CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRUST	574,556	499,863.720	
	ESR-REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	140,550	324,670.500	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	142,400	108,224.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	305,901	666,864.180	
	STARHILL GLOBAL REIT	316,000	159,580.000	
	CAPITALAND CHINA TRUST	260,342	178,334.270	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	92,900	373,458.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	469,669	920,551.240	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	523,584	628,300.800	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	237,600	133,056.000	
	QUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	513,500	146,347.500	
シンガポール・ドル 小計			12,732,496.880 (1,433,042,524)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	232,905	456,493.800	
ニュージーランド・ドル 小計			456,493.800 (39,705,830)	
ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	8,110	205,994.000	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	5,680	199,652.000	
	HAMBORNER REIT AG	13,318	86,567.000	

	WERELDHAVE NV	6,574	114,650.560	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	19,564	1,620,681.760	
	NSI NV	3,397	78,810.400	
	ICADE	5,815	138,629.600	
	CARMILA	12,358	206,131.440	
	ALTAREA	937	99,509.400	
	GECINA SA	9,941	944,395.000	
	KLEPIERRE	42,083	1,399,680.580	
	COVIVIO	10,207	521,067.350	
	MERCIALYS	16,419	176,996.820	
	AEDIFICA	8,906	582,897.700	
	COFINIMMO	7,135	547,968.000	
	RETAIL ESTATES	2,353	142,591.800	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	33,945	703,340.400	
	CARE PROPERTY INVEST	6,928	85,491.520	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	6,861	213,034.050	
	MONTEA NV	3,966	253,030.800	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	9,559	27,768.890	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	64,542	395,642.460	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	75,181	803,684.890	
	STONEWEG EUROPEAN REAL ESTATE	64,220	98,898.800	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	98,529	104,834.850	
ユーロ 小計			9,751,950.070 (1,624,284,804)	
韓国・ウォン	SK REITS LTD	32,181	148,515,315.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT LTD	5,591	0.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	23,689	130,763,280.000	
	LOTTE REIT CO LTD	32,639	123,701,810.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	10,468	50,874,480.000	
	JR REIT XXVII	41,466	113,202,180.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	10,067	44,596,810.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	36,103	155,964,960.000	
韓国・ウォン 小計			767,618,835.000 (81,137,311)	

	香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	501,000	400,800.000	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	181,000	389,150.000	
		FORTUNE REIT	334,000	1,526,380.000	
		LINK REIT	583,300	24,527,765.000	
		CHAMPION REIT	425,000	824,500.000	
	香港・ドル 小計			27,668,595.000 (508,825,462)	
投資証券 合計			45,521,940,900 [45,521,940,900]		
合計			47,000,891,240 [47,000,891,240]		

投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	4.0%	96%	78.3%
	投資証券 142銘柄			
イギリス・ポンド	投資証券 33銘柄	-%	100%	4.5%
イスラエル・シェケル	投資証券 3銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券 28銘柄	-%	100%	7.9%
カナダ・ドル	投資証券 22銘柄	-%	100%	1.3%
シンガポール・ドル	投資証券 22銘柄	-%	100%	3.0%
ニュージーランド・ドル	投資証券 1銘柄	-%	100%	0.1%
ユーロ	投資証券 25銘柄	-%	100%	3.5%
韓国・ウォン	投資証券 8銘柄	-%	100%	0.2%
香港・ドル	投資証券 5銘柄	-%	100%	1.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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(2025年6月17日から2025年12月16日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

当中間計算期間末 2025年12月16日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	78,918,954
親投資信託受益証券	53,445,647,687
未収入金	1,600,000
流動資産合計	53,526,166,641
資産合計	53,526,166,641
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	4,879,480
未払委託者報酬	70,753,171
その他未払費用	1,099,425
流動負債合計	76,732,076
負債合計	76,732,076
純資産の部	
元本等	
元本	※ 1 23,074,109,438
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	30,375,325,127
（分配準備積立金）	1,378,076,699
元本等合計	53,449,434,565
純資産合計	53,449,434,565
負債純資産合計	53,526,166,641

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2025年6月17日 至 2025年12月16日
営業収益	
受取利息	110,170
有価証券売買等損益	9,036,118,208
営業収益合計	9,036,228,378
営業費用	
受託者報酬	4,879,480
委託者報酬	70,753,171
その他費用	1,099,425
営業費用合計	76,732,076
営業利益又は営業損失（△）	8,959,496,302
経常利益又は経常損失（△）	8,959,496,302
中間純利益又は中間純損失（△）	8,959,496,302
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（△）	1,080,848,810
期首剰余金又は期首欠損金（△）	14,474,464,513
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,999,242,193
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	11,999,242,193
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,977,029,071
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,977,029,071
中間剰余金又は中間欠損金（△）	30,375,325,127

(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2025年6月17日 至2025年12月16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 2025年12月16日現在
1. ※1 期首元本額	16,253,287,030円
期中追加設定元本額	11,097,355,937円
期中一部解約元本額	4,276,533,529円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	23,074,109,438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2025年6月17日 至2025年12月16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 2025年12月16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 2025年12月16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 2025年12月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.3164円 (23,164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

	2025年12月16日現在 金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	20,472,192,521
株式 ※2※3	563,365,264,500
派生商品評価勘定	343,350
未収配当金	52,399,366
その他未収収益 ※4	11,766,365
差入委託証拠金	78,778,850

流動資産合計	583,980,744,952
資産合計	583,980,744,952
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	46,351,950
前受金	107,705,000
未払金	630,500
未払解約金	298,215,020
未払利息	2,018,325
受入担保金	11,218,699,125
流動負債合計	11,673,619,920
負債合計	11,673,619,920
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	225,548,731,715
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	346,758,393,317
元本等合計	572,307,125,032
純資産合計	572,307,125,032
負債純資産合計	583,980,744,952

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2025年6月17日 至2025年12月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引

3. 収益及び費用の計上基準	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。 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	2025年12月16日現在
1. ※1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額 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 ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A 適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドV A 2 ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募) ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募) ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募) ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募) 国内株式ファンド（適格機関投資家専用） 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） 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） D-I's TOPIXインデックス DCダイワ・ターゲットイヤー2050 iFree TOPIXインデックス iFree 8資産バランス iFree 年金バランス DCダイワ・ターゲットイヤー2060 DCダイワ日本株式インデックス	2025年6月17日 211,826,457,370円 28,164,189,854円 14,441,915,509円 2,755,602,250円 3,383,273,991円 898,371円 6,314,008円 81,223,299円 8,264,060円 205,657,242円 1,423,147,661円 922,439,675円 156,533,865円 9,973,806円 233,916,842円 11,687,566,029円 5,526,666,419円 1,245,644,827円 6,183,632円 70,966,128,639円

ダイワ・ライフ・バランス３０	2,626,941,697円
ダイワ・ライフ・バランス５０	5,129,503,328円
ダイワ・ライフ・バランス７０	6,164,165,354円
年金ダイワ日本株式インデックス	10,505,082,539円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	37,473,616円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	75,543,301円
ダイワつみたてインデックス日本株式	8,103,521,184円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	11,518,163円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	15,557,473円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	295,812,368円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	33,503,624,107円
ダイワ世界バランスファンド４０VA	36,779,842円
ダイワ世界バランスファンド６０VA	15,785,951円
ダイワ・バランスファンド３５VA	2,182,831,944円
ダイワ・バランスファンド２５VA（適格機関投資家専用）	204,073,989円
ダイワ国内バランスファンド２５VA（適格機関投資家専用）	25,994,337円
ダイワ国内バランスファンド３０VA（適格機関投資家専用）	36,041,308円
ダイワ・ノーロード TOPIXファンド	216,987,127円
ダイワファンドラップ TOPIXインデックス	21,413,561,241円
ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）	21,063,154,287円
ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス	3,187,316,548円
スタイル９（４資産分散・保守型）	1,607,988円
スタイル９（４資産分散・バランス型）	11,150,486円
スタイル９（４資産分散・積極型）	17,839,392円
スタイル９（６資産分散・保守型）	701,494円
スタイル９（６資産分散・バランス型）	20,287,834円
スタイル９（６資産分散・積極型）	24,660,544円
スタイル９（８資産分散・保守型）	1,096,436円
スタイル９（８資産分散・バランス型）	18,694,666円
スタイル９（８資産分散・積極型）	51,430,109円
ダイワ国内株式インデックス（投資一任専用）	3,277,263,469円
ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	850,756,895円
ダイワライフスタイル２５	72,022,380円
ダイワライフスタイル５０	363,421,081円
ダイワライフスタイル７５	335,514,298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）	7,031,580,323円

計	225,548,731,715円
2. 期末日における受益権の総数	225,548,731,715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 10,586,890,810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 1,102,515,000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	2025年12月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(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	2025年12月16日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引				

株価指数 先物取引				
買建	8,548,350,000	-	8,502,480,000	△45,870,000
合計	8,548,350,000	-	8,502,480,000	△45,870,000

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2025年12月16日現在
1口当たり純資産額	2.5374円
（1万口当たり純資産額）	（25,374円）

【ダイワ日経２２５インデックス（ダイワＳＭＡ専用）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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(2025年6月17日から2025年12月16日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

当中間計算期間末 2025年12月16日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	10,307,502
親投資信託受益証券	5,773,026,195
未収入金	473,260,000
流動資産合計	6,256,593,697
資産合計	6,256,593,697
負債の部	
流動負債	
未払解約金	473,047,536
未払受託者報酬	604,646
未払委託者報酬	8,768,098
その他未払費用	151,083
流動負債合計	482,571,363
負債合計	482,571,363
純資産の部	
元本等	
元本	※1 2,204,732,547
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	3,569,289,787
（分配準備積立金）	2,884,020
元本等合計	5,774,022,334
純資産合計	5,774,022,334
負債純資産合計	6,256,593,697

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

当中間計算期間	
自 2025年6月17日	
至 2025年12月16日	
営業収益	
受取利息	18,862
有価証券売買等損益	1,364,241,007
営業収益合計	1,364,259,869
営業費用	
受託者報酬	604,646
委託者報酬	8,768,098
その他費用	151,083
営業費用合計	9,523,827
営業利益又は営業損失（△）	1,354,736,042
経常利益又は経常損失（△）	1,354,736,042
中間純利益又は中間純損失（△）	1,354,736,042
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（△）	615,885,234
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,392,835,074
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,136,397,668
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,136,397,668
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,698,793,763
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,698,793,763
中間剰余金又は中間欠損金（△）	3,569,289,787

(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2025年6月17日 至2025年12月16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 2025年12月16日現在
1. ※1 期首元本額	2,350,795,154円
期中追加設定元本額	2,293,539,102円
期中一部解約元本額	2,439,601,709円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	2,204,732,547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2025年6月17日 至2025年12月16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 2025年12月16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 2025年12月16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 2025年12月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.6189円 (26,189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

	2025年12月16日現在 金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	13,038,150,744
株式 ※2※3	459,474,357,610
前払金	44,590,000
その他未収収益	152,722
流動資産合計	472,557,251,076
資産合計	472,557,251,076

負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	160,575,250
未払解約金	2,147,225,000
未払利息	839,341
受入担保金	3,112,641,934
流動負債合計	5,421,281,525
負債合計	5,421,281,525
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	66,801,234,340
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	400,334,735,211
元本等合計	467,135,969,551
純資産合計	467,135,969,551
負債純資産合計	472,557,251,076

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2025年6月17日 至2025年12月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 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	2025年12月16日現在
1. ※1 期首	2025年6月17日
期首元本額	72,051,623,995円
期中追加設定元本額	8,517,638,116円
期中一部解約元本額	13,768,027,771円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ストック インデックス ファンド 2 2 5	21,210,938,310円
適格機関投資家専用・ダイワ・ストックインデックスファンド 2 2 5 V A	139,690,891円
大和 スtock インデックス 2 2 5 ファンド	7,442,663,383円
D－I's 日経 2 2 5 インデックス	18,293,377円
i F r e e 日経 2 2 5 インデックス	22,837,681,274円
D C ・ダイワ・ストックインデックス 2 2 5 （確定拠出年金専用ファンド）	5,313,822,049円
ダイワ・ノーロード 日経 2 2 5 ファンド	353,877,742円
ダイワファンドラップ 日経 2 2 5 インデックス	4,235,150,051円
ダイワ日経 2 2 5 インデックス（ダイワ S M A 専用）	825,555,377円
ダイワ・インデックスセレクト 日経 2 2 5	4,423,561,886円
計	66,801,234,340円
2. 期末日における受益権の総数	66,801,234,340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 2,916,201,270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 8,329,995,000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	2025年12月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(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	2025年12月16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	7,826,790,000	-	7,666,300,000	△160,490,000
合計	7,826,790,000	-	7,666,300,000	△160,490,000

(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)

	2025年12月16日現在
1口当たり純資産額	6.9929円

(1万口当たり純資産額)	(69,929円)

【ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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(2025年6月17日から2025年12月16日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

当中間計算期間末 2025年12月16日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	85,952,208
親投資信託受益証券	38,859,118,075
未収入金	59,490,000
流動資産合計	39,004,560,283
資産合計	39,004,560,283
負債の部	
流動負債	
未払解約金	62,878,293
未払受託者報酬	3,739,631
未払委託者報酬	71,988,748
その他未払費用	934,834
流動負債合計	139,541,506
負債合計	139,541,506
純資産の部	
元本等	
元本	※ 1 19,543,536,146
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	19,321,482,631
（分配準備積立金）	1,420,854,454
元本等合計	38,865,018,777
純資産合計	38,865,018,777
負債純資産合計	39,004,560,283

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

当中間計算期間	
自 2025年6月17日	
至 2025年12月16日	
営業収益	
受取利息	114,381
有価証券売買等損益	3,606,946,320
営業収益合計	3,607,060,701
営業費用	
受託者報酬	3,739,631
委託者報酬	71,988,748
その他費用	934,834
営業費用合計	76,663,213
営業利益又は営業損失（△）	3,530,397,488
経常利益又は経常損失（△）	3,530,397,488
中間純利益又は中間純損失（△）	3,530,397,488
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（△）	315,693,083
期首剰余金又は期首欠損金（△）	13,255,796,413
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,790,890,069
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,790,890,069
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,939,908,256
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,939,908,256
中間剰余金又は中間欠損金（△）	19,321,482,631

(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2025年6月17日 至2025年12月16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 2025年12月16日現在
1. ※1 期首元本額	16,859,921,911円
期中追加設定元本額	6,380,673,681円
期中一部解約元本額	3,697,059,446円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	19,543,536,146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2025年6月17日 至2025年12月16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 2025年12月16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 2025年12月16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 2025年12月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9886円 (19,886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

	2025年12月16日現在 金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,330,787,179
コール・ローン	2,271,766,358
株式	156,629,913,213
投資証券	2,550,250,121
派生商品評価勘定	516,856,560
未収入金	1,065,963

未収配当金	135,340,629
差入委託証拠金	3,773,089,679
流動資産合計	170,209,069,702
資産合計	170,209,069,702
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	341,273,445
未払解約金	59,490,300
流動負債合計	400,763,745
負債合計	400,763,745
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	45,356,906,187
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	124,451,399,770
元本等合計	169,808,305,957
純資産合計	169,808,305,957
負債純資産合計	170,209,069,702

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2025年6月17日 至2025年12月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)新株予約権証券

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
	(3)投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 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	2025年12月16日現在
1. ※1 期首	2025年6月17日
期首元本額	42,195,690,404円
期中追加設定元本額	6,875,595,044円
期中一部解約元本額	3,714,379,261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）	29,535,772,636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）	1,196,671,207円
i F r e e 外国株式インデックス（為替ヘッジ あり）	4,030,299,434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）	2,361,499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）	10,379,592,413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）	212,208,998円
計	45,356,906,187円
2. 期末日における受益権の総数	45,356,906,187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	2025年12月16日現在

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

（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	2025年12月16日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引				
株価指数				
先物取引				
買建	10,629,983,565	-	10,700,252,698	70,269,133
合計	10,629,983,565	-	10,700,252,698	70,269,133

（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	2025年12月16日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	166,384,586,370	-	166,279,272,388	105,313,982
アメリカ・ドル	128,285,127,103	-	127,883,600,820	401,526,283
イギリス・ポンド	6,449,662,249	-	6,491,321,344	△41,659,095
イスラエル・シケル	284,090,079	-	286,549,197	△2,459,118
オーストラリア・ドル	2,773,996,097	-	2,803,742,258	△29,746,161
カナダ・ドル	5,615,812,030	-	5,673,984,311	△58,172,281
シンガポール・ドル	629,583,790	-	629,740,475	△156,685
スイス・フラン	4,055,836,491	-	4,070,372,798	△14,536,307
スウェーデン・クローナ	1,389,733,852	-	1,409,266,217	△19,532,365
デンマーク・クローネ	818,710,677	-	825,551,878	△6,841,201
ニュージーランド・ドル	80,395,290	-	80,700,268	△304,978
ノルウェー・クローネ	261,794,574	-	260,164,418	1,630,156
ユーロ	14,857,904,125	-	14,984,949,554	△127,045,429
香港・ドル	881,940,013	-	879,328,850	2,611,163
合計	166,384,586,370	-	166,279,272,388	105,313,982

(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)

	2025年12月16日現在
1口当たり純資産額	3.7438円
(1万口当たり純資産額)	(37,438円)

【ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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(2025年6月17日から2025年12月16日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

当中間計算期間末 2025年12月16日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	146,854,528
親投資信託受益証券	54,850,806,391
未収入金	45,338,000
流動資産合計	55,042,998,919
資産合計	55,042,998,919
負債の部	
流動負債	
未払解約金	80,166,034
未払受託者報酬	5,205,219
未払委託者報酬	100,201,219
その他未払費用	1,088,936
流動負債合計	186,661,408
負債合計	186,661,408
純資産の部	
元本等	
元本	※ 1 15,583,459,824
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	39,272,877,687
（分配準備積立金）	1,217,817,777
元本等合計	54,856,337,511
純資産合計	54,856,337,511
負債純資産合計	55,042,998,919

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2025年6月17日 至 2025年12月16日
営業収益	
受取利息	149,430
有価証券売買等損益	8,868,688,747
営業収益合計	8,868,838,177
営業費用	
受託者報酬	5,205,219
委託者報酬	100,201,219
その他費用	1,088,936
営業費用合計	106,495,374
営業利益又は営業損失（△）	8,762,342,803
経常利益又は経常損失（△）	8,762,342,803
中間純利益又は中間純損失（△）	8,762,342,803
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（△）	1,222,068,714
期首剰余金又は期首欠損金（△）	18,934,549,898
剰余金増加額又は欠損金減少額	20,269,860,619
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	20,269,860,619
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,471,806,919
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,471,806,919
中間剰余金又は中間欠損金（△）	39,272,877,687

(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2025年6月17日 至2025年12月16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 2025年12月16日現在
1. ※1 期首元本額	9,995,953,351円
期中追加設定元本額	9,358,663,499円
期中一部解約元本額	3,771,157,026円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	15,583,459,824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2025年6月17日 至2025年12月16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 2025年12月16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 2025年12月16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 2025年12月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.5202円 (35,202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

	2025年12月16日現在 金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	2,648,192,190
コール・ローン	21,105,883,037
株式	844,180,451,718
投資証券	13,723,924,395
派生商品評価勘定	707,104,129
未収入金	5,716,921

未収配当金	728,444,265
差入委託証拠金	13,502,083,719
流動資産合計	896,601,800,374
資産合計	896,601,800,374
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	133,941,871
未払解約金	432,717,400
流動負債合計	566,659,271
負債合計	566,659,271
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	106,348,221,139
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	789,686,919,964
元本等合計	896,035,141,103
純資産合計	896,035,141,103
負債純資産合計	896,601,800,374

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2025年6月17日 至2025年12月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)投資証券

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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	2025年12月16日現在
1. ※1 期首	2025年6月17日
期首元本額	100,214,393,190円
期中追加設定元本額	11,848,789,879円
期中一部解約元本額	5,714,961,930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	182,983,437円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	932,937円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	10,541,563円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	2,494,612円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	62,418,221円
外国株式インデックスファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	129,547,249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）	10,013,277,568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）	813,031,038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）	7,884,190,889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）	606,212,343円
D-I's 外国株式インデックス	15,385,355円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	44,912,318円

i F r e e 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	11,848,305,026円
i F r e e 8資産バランス	1,651,161,722円
i F r e e 年金バランス	373,164,081円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	31,788,225円
DCダイワ外国株式インデックス	50,787,555,507円
ダイワ・ライフ・バランス30	396,227,146円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,028,776,316円
ダイワ・ライフ・バランス70	1,026,488,511円
大和DC海外株式インデックスファンド	987,229,157円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	8,016,811円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	12,500,888円
ダイワつみたてインデックス外国株式	3,434,510,642円
ダイワつみたてインデックスバランス30	1,743,294円
ダイワつみたてインデックスバランス50	3,116,189円
ダイワつみたてインデックスバランス70	49,176,693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）	1,182,301,864円
ダイワ世界バランスファンド40VA	33,216,199円
ダイワ世界バランスファンド60VA	23,760,596円
ダイワ・バランスファンド35VA	492,656,780円
ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	26,206,283円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	100,431,384円
スタイル9（4資産分散・保守型）	637,673円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	4,525,116円
スタイル9（4資産分散・積極型）	7,311,995円
スタイル9（6資産分散・保守型）	252,497円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	8,159,890円
スタイル9（6資産分散・積極型）	9,962,112円
スタイル9（8資産分散・保守型）	347,811円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	6,584,974円
スタイル9（8資産分散・積極型）	19,071,639円
全世界株式インデックス・ファンド（オール・カンントリー）	1,517,078,110円
i F r e e 全世界株式インデックス（オール・カンントリー）	18,615,351円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,018,558,256円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	395,991,697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）	6,510,095,115円

ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,387,112,789円
ダイワライフスタイル25	5,421,479円
ダイワライフスタイル50	27,214,357円
ダイワライフスタイル75	25,213,977円
ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	61,223,038円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	60,582,419円
計	106,348,221,139円
2. 期末日における受益権の総数	106,348,221,139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	2025年12月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(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	2025年12月16日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引				
株価指数				
先物取引				

買建	39,029,453,064	-	39,580,649,632	551,196,568
合計	39,029,453,064	-	39,580,649,632	551,196,568

(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	2025年12月16日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	22,200,120,930	-	22,222,086,620	21,965,690
アメリカ・ドル	14,751,534,320	-	14,717,305,110	△34,229,210
イギリス・ポンド	1,171,879,970	-	1,179,495,300	7,615,330
オーストラリア・ドル	742,307,500	-	749,441,360	7,133,860
カナダ・ドル	2,138,022,160	-	2,159,435,520	21,413,360
スイス・フラン	1,281,153,570	-	1,286,088,540	4,934,970
ユーロ	2,115,223,410	-	2,130,320,790	15,097,380
合計	22,200,120,930	-	22,222,086,620	21,965,690

(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)

	2025年12月16日現在
1口当たり純資産額	8.4255円
(1万口当たり純資産額)	(84,255円)

【ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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(2025年6月17日から2025年12月16日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

当中間計算期間末 2025年12月16日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	52,103,561
親投資信託受益証券	19,915,255,589
流動資産合計	19,967,359,150
資産合計	19,967,359,150
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	2,134,895
未払委託者報酬	30,423,033
その他未払費用	533,639
流動負債合計	33,091,567
負債合計	33,091,567
純資産の部	
元本等	
元本	※ 1 23,000,435,995
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	※ 2 △ 3,066,168,412
元本等合計	19,934,267,583
純資産合計	19,934,267,583
負債純資産合計	19,967,359,150

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

当中間計算期間	
自 2025年6月17日	
至 2025年12月16日	
営業収益	
受取利息	93,660
有価証券売買等損益	△ 532,508,334
営業収益合計	△ 532,414,674
営業費用	
受託者報酬	2,134,895
委託者報酬	30,423,033
その他費用	533,639
営業費用合計	33,091,567
営業利益又は営業損失（△）	△ 565,506,241
経常利益又は経常損失（△）	△ 565,506,241
中間純利益又は中間純損失（△）	△ 565,506,241
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（△）	△ 26,330,600
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 2,350,565,840
剰余金増加額又は欠損金減少額	556,085,070
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	556,085,070
剰余金減少額又は欠損金増加額	732,512,001
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	732,512,001
中間剰余金又は中間欠損金（△）	△ 3,066,168,412

(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2025年6月17日 至2025年12月16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 2025年12月16日現在
1. ※1 期首元本額	21,872,634,914円
期中追加設定元本額	6,291,478,468円
期中一部解約元本額	5,163,677,387円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	23,000,435,995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3,066,168,412円です。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2025年6月17日 至2025年12月16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 2025年12月16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 2025年12月16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 2025年12月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8667円 (8,667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

	2025年12月16日現在 金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	810,209,058
国債証券	132,057,441,680
地方債証券	6,379,776,500
特殊債券	4,151,569,300

社債券	8,428,792,300
未収入金	195,092,000
未収利息	424,159,509
前払費用	64,436,896
流動資産合計	152,511,477,243
資産合計	152,511,477,243
負債の部	
流動負債	
未払金	493,890,280
未払解約金	16,002,207
流動負債合計	509,892,487
負債合計	509,892,487
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	122,679,799,468
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	29,321,785,288
元本等合計	152,001,584,756
純資産合計	152,001,584,756
負債純資産合計	152,511,477,243

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2025年6月17日 至2025年12月16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な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	2025年12月16日現在
1. ※1 期首	2025年6月17日
期首元本額	103,390,699,779円
期中追加設定元本額	26,290,809,568円
期中一部解約元本額	7,001,709,879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)	30,242,579円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	156,252,060円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	39,160,107円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	392,326,775円
DCダイワ日本債券インデックス	11,101,397,457円
ダイワ国内債券インデックス（ラップ専用）	34,746,931,975円
ダイワ・バランスファンド35VA	7,337,013,408円
ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	1,367,114,716円
ダイワ国内バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	151,056,182円
ダイワ国内バランスファンド30VA（適格機関投資家専用）	171,371,550円
ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド	40,897,907円
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	37,011,868,119円
ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）	16,073,652,615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	1,921,399,495円
スタイル9（4資産分散・保守型）	13,505,403円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	27,309,919円
スタイル9（4資産分散・積極型）	3,369,312円
スタイル9（6資産分散・保守型）	5,814,322円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	50,864,682円
スタイル9（6資産分散・積極型）	4,069,477円
スタイル9（8資産分散・保守型）	9,040,867円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	46,943,851円
スタイル9（8資産分散・積極型）	5,884,791円
ダイワ国内債券インデックス（投資一任専用）	4,262,281,946円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	575,453,753円

ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	5,693,175,335円
ダイワライフスタイル25	466,803,642円
ダイワライフスタイル50	746,008,267円
ダイワライフスタイル75	228,588,956円
計	122,679,799,468円
2. 期末日における受益権の総数	122,679,799,468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	2025年12月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(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

2025年12月16日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2025年12月16日現在
1口当たり純資産額	1.2390円
(1万口当たり純資産額)	(12,390円)

【ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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(2025年6月17日から2025年12月16日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

当中間計算期間末 2025年12月16日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	79,124,619
親投資信託受益証券	15,871,016,581
未収入金	7,686,533
流動資産合計	15,957,827,733
資産合計	15,957,827,733
負債の部	
流動負債	
未払解約金	7,482,976
未払受託者報酬	1,688,161
未払委託者報酬	30,387,771
その他未払費用	632,980
流動負債合計	40,191,888
負債合計	40,191,888
純資産の部	
元本等	
元本	※1 19,077,945,144
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	※2 △ 3,160,309,299
（分配準備積立金）	234,036,612
元本等合計	15,917,635,845
純資産合計	15,917,635,845
負債純資産合計	15,957,827,733

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

当中間計算期間	
自 2025年6月17日	
至 2025年12月16日	
営業収益	
受取利息	160,412
有価証券売買等損益	△ 61,162,710
営業収益合計	△ 61,002,298
営業費用	
受託者報酬	1,688,161
委託者報酬	30,387,771
その他費用	632,980
営業費用合計	32,708,912
営業利益又は営業損失（△）	△ 93,711,210
経常利益又は経常損失（△）	△ 93,711,210
中間純利益又は中間純損失（△）	△ 93,711,210
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（△）	△ 55,995,433
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 5,022,287,459
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,198,919,939
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,198,919,939
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,299,226,002
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,299,226,002
中間剰余金又は中間欠損金（△）	△ 3,160,309,299

(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2025年6月17日 至2025年12月16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 2025年12月16日現在
1. ※1 期首元本額	30,504,357,999円
期中追加設定元本額	8,021,059,188円
期中一部解約元本額	19,447,472,043円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	19,077,945,144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3,160,309,299円です。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	当中間計算期間 自2025年6月17日 至2025年12月16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 2025年12月16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 2025年12月16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 2025年12月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8343円 (8,343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

	2025年12月16日現在 金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,419,090,539
コール・ローン	1,934,628,361
国債証券	129,639,823,637
派生商品評価勘定	300,392,002

未収入金	675,166
未収利息	1,028,670,748
前払費用	80,961,154
差入委託証拠金	278,457,482
流動資産合計	134,682,699,089
資産合計	134,682,699,089
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	408,280,740
未払金	548,164,552
未払解約金	8,063,295
流動負債合計	964,508,587
負債合計	964,508,587
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	160,193,089,062
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△26,474,898,560
元本等合計	133,718,190,502
純資産合計	133,718,190,502
負債純資産合計	134,682,699,089

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2025年6月17日 至2025年12月16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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. 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	2025年12月16日現在
1. ※1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額 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オンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） 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）	2025年6月17日 160,646,455,421円 22,311,116,136円 22,764,482,495円 127,319,347,274円 5,274,347,077円 24,757,087円

ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	3,861,700,279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）	15,391,867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）	19,014,036,877円
ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	2,354,041,613円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	2,329,466,988円
計	160,193,089,062円
2. 期末日における受益権の総数	160,193,089,062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26,474,898,560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	2025年12月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(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	2025年12月16日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引				
債券先物取引				
買建	1,970,008,224	-	1,959,414,025	△10,594,199
合計	1,970,008,224	-	1,959,414,025	△10,594,199

(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	2025年12月16日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	133,306,028,515	-	133,403,323,054	△97,294,539
アメリカ・ドル	60,224,381,034	-	59,961,497,044	262,883,990
イギリス・ポンド	7,843,783,480	-	7,880,874,374	△37,090,894
イスラエル・シェケル	549,182,423	-	553,666,643	△4,484,220
オーストラリア・ドル	1,813,087,052	-	1,825,513,494	△12,426,442

オフショア・ 人民元	15,752,613,206	-	15,717,951,711	34,661,495
カナダ・ドル	2,790,587,795	-	2,809,325,540	△18,737,745
シンガポ ー ル・ドル	531,868,630	-	531,056,860	811,770
スウェーデン ・クローナ	287,209,767	-	290,296,137	△3,086,370
デンマーク・ クローネ	353,983,826	-	356,511,624	△2,527,798
ニュージーラ ンド・ドル	403,441,007	-	403,749,764	△308,757
ノルウェー・ クローネ	200,692,319	-	199,041,788	1,650,531
ポーランド・ ズロチ	963,030,840	-	973,180,065	△10,149,225
マレーシア・ リングット	663,898,199	-	667,098,044	△3,199,845
メキシコ・ペソ	1,238,058,365	-	1,257,065,511	△19,007,146
ユーロ	39,690,210,572	-	39,976,494,455	△286,283,883
合計	133,306,028,515	-	133,403,323,054	△97,294,539

(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)

	2025年12月16日現在

1口当たり純資産額	0.8347円
（1万口当たり純資産額）	（8,347円）

【ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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(2025年6月17日から2025年12月16日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

当中間計算期間末 2025年12月16日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	116,077,432
親投資信託受益証券	25,784,392,254
未収入金	9,577,858
流動資産合計	25,910,047,544
資産合計	25,910,047,544
負債の部	
流動負債	
未払解約金	8,249,814
未払受託者報酬	2,123,205
未払委託者報酬	38,218,574
その他未払費用	796,124
流動負債合計	49,387,717
負債合計	49,387,717
純資産の部	
元本等	
元本	※ 1 19,953,228,298
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	5,907,431,529
（分配準備積立金）	113,332,170
元本等合計	25,860,659,827
純資産合計	25,860,659,827
負債純資産合計	25,910,047,544

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2025年6月17日 至 2025年12月16日
営業収益	
受取利息	202,126
有価証券売買等損益	1,814,918,680
営業収益合計	1,815,120,806
営業費用	
受託者報酬	2,123,205
委託者報酬	38,218,574
その他費用	796,124
営業費用合計	41,137,903
営業利益又は営業損失（△）	1,773,982,903
経常利益又は経常損失（△）	1,773,982,903
中間純利益又は中間純損失（△）	1,773,982,903
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（△）	267,011,915
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,445,723,603
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,306,942,176
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,306,942,176
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,352,205,238
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,352,205,238
中間剰余金又は中間欠損金（△）	5,907,431,529

(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2025年6月17日 至2025年12月16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 2025年12月16日現在
1. ※1 期首元本額	19,152,561,385円
期中追加設定元本額	8,273,832,502円
期中一部解約元本額	7,473,165,589円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	19,953,228,298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2025年6月17日 至2025年12月16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 2025年12月16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 2025年12月16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 2025年12月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2961円 (12,961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

	2025年12月16日現在 金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	3,484,555,979
コール・ローン	2,540,405,423
国債証券	379,223,062,586
派生商品評価勘定	6,243,867
未収入金	577,153
未収利息	3,031,363,961

前払費用	196,236,333
流動資産合計	388,482,445,302
資産合計	388,482,445,302
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,786,325
未払金	1,215,714,341
未払解約金	172,088,931
流動負債合計	1,390,589,597
負債合計	1,390,589,597
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	96,388,396,857
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	290,703,458,848
元本等合計	387,091,855,705
純資産合計	387,091,855,705
負債純資産合計	388,482,445,302

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2025年6月17日 至2025年12月16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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	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	2025年12月16日現在
1. ※1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額 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 ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募) ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募) ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募) ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募) 外国債券インデックスファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用） 外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	2025年6月17日 92,889,444,303円 8,692,311,236円 5,193,358,682円 247,762,561円 3,871,011円 21,389,429円 12,269,783円 128,585,190円 1,066,062,966円 697,540,586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）	1,055,287,225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）	8,952,435,971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）	1,107,707,295円
D－I's 外国債券インデックス	1,207,634円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	28,034,880円
iFree 外国債券インデックス	1,250,308,865円
iFree 8資産バランス	3,402,947,135円
iFree 年金バランス	783,318,651円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	4,437,011円
DCダイワ外国債券インデックス	50,707,722,967円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,225,339,382円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,010,191,772円
ダイワ・ライフ・バランス70	848,064,477円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安 定コース）	803,338,598円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6 分散コース）	664,078,132円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成 長コース）	323,591,731円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	34,970,586円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	31,248,209円
ダイワつみたてインデックス外国債券	2,942,577,691円
ダイワつみたてインデックスバランス30	5,339,628円
ダイワつみたてインデックスバランス50	3,213,774円
ダイワつみたてインデックスバランス70	41,415,600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）	3,403,625,210円
ダイワ世界バランスファンド40VA	80,675,074円
ダイワ世界バランスファンド60VA	24,732,473円
ダイワ・バランスファンド35VA	2,045,553,538円
ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関 投資家専用）	128,123,750円
スタイル9（4資産分散・保守型）	399,208円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	4,931,849円
スタイル9（4資産分散・積極型）	5,688,470円
スタイル9（6資産分散・保守型）	159,844円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	4,668,928円
スタイル9（6資産分散・積極型）	2,319,473円

スタイル9（8資産分散・保守型）	235,471円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	3,096,163円
スタイル9（8資産分散・積極型）	3,432,169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）	377,573,282円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	108,434,639円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	64,153,448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）	6,420,416,398円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	6,208,390,580円
ダイワライフスタイル25	22,659,781円
ダイワライフスタイル50	57,291,946円
ダイワライフスタイル75	17,576,423円
計	96,388,396,857円
2. 期末日における受益権の総数	96,388,396,857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	2025年12月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(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	2025年12月16日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	2,584,876,391	-	2,588,333,933	3,457,542
アメリカ・ドル	400,750,217	-	400,360,179	△390,038
イギリス・ポンド	52,011,125	-	52,189,925	178,800
イスラエル・シケル	63,525,189	-	64,043,889	518,700
オーストラリア・ドル	47,723,551	-	48,050,636	327,085
オフショア・人民元	882,942,703	-	881,396,861	△1,545,842
カナダ・ドル	182,784,226	-	184,011,554	1,227,328
シンガポール・ドル	39,477,916	-	39,417,662	△60,254
ニュージーランド・ドル	163,378,414	-	163,503,449	125,035
ノルウェー・クローネ	35,011,265	-	34,723,326	△287,939
マレーシア・リンギット	90,972,000	-	90,895,440	△76,560
ユーロ	626,299,785	-	629,741,012	3,441,227
合計	2,584,876,391	-	2,588,333,933	3,457,542

(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)

	2025年12月16日現在
1口当たり純資産額	4.0160円
(1万口当たり純資産額)	(40,160円)

【ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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(2025年6月17日から2025年12月16日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワJ-REITインデックス（ダイワSMA専用）

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

当中間計算期間末 2025年12月16日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	9,410,634
親投資信託受益証券	4,754,351,350
未収入金	93,520,000
流動資産合計	4,857,281,984
資産合計	4,857,281,984
負債の部	
流動負債	
未払解約金	93,389,591
未払受託者報酬	468,511
未払委託者報酬	6,794,125
その他未払費用	117,052
流動負債合計	100,769,279
負債合計	100,769,279
純資産の部	
元本等	
元本	※1 3,804,934,225
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	951,578,480
（分配準備積立金）	22,677,898
元本等合計	4,756,512,705
純資産合計	4,756,512,705
負債純資産合計	4,857,281,984

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2025年6月17日 至 2025年12月16日
営業収益	
受取利息	15,151
有価証券売買等損益	550,720,123
営業収益合計	550,735,274
営業費用	
受託者報酬	468,511
委託者報酬	6,794,125
その他費用	117,052
営業費用合計	7,379,688
営業利益又は営業損失（△）	543,355,586
経常利益又は経常損失（△）	543,355,586
中間純利益又は中間純損失（△）	543,355,586
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（△）	19,463,259
期首剰余金又は期首欠損金（△）	369,727,028
剰余金増加額又は欠損金減少額	134,909,741
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	134,909,741
剰余金減少額又は欠損金増加額	76,950,616
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	76,950,616
中間剰余金又は中間欠損金（△）	951,578,480

(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2025年6月17日 至2025年12月16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 2025年12月16日現在
1. ※1 期首元本額	3,960,160,964円
期中追加設定元本額	647,608,686円
期中一部解約元本額	802,835,425円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	3,804,934,225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2025年6月17日 至2025年12月16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 2025年12月16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 2025年12月16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 2025年12月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2501円 (12,501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

	2025年12月16日現在 金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	8,085,336,541
投資証券 ※2	244,484,441,400
派生商品評価勘定	215,688,000
未収入金	435,652,157
未収配当金	1,788,376,431
差入委託証拠金	428,395,400

流動資産合計	255,437,889,929
資産合計	255,437,889,929
負債の部	
流動負債	
前受金	182,715,600
未払解約金	623,905,000
流動負債合計	806,620,600
負債合計	806,620,600
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	64,762,358,763
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	189,868,910,566
元本等合計	254,631,269,329
純資産合計	254,631,269,329
負債純資産合計	255,437,889,929

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2025年6月17日 至2025年12月16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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 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	2025年12月16日現在
1. ※1 期首	2025年6月17日
期首元本額	74,539,061,065円
期中追加設定元本額	2,586,807,646円
期中一部解約元本額	12,363,509,948円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワJ-REITオープン	2,644,931,419円
ダイワJ-REITオープン（毎月分配型）	43,102,167,189円
ダイワJ-REITオープン（年1回決算型）	880,998,888円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	29,049,732円
iFree J-REITインデックス	493,948,882円
iFree 8資産バランス	3,476,857,354円
ダイワJ-REITオープン（奇数月決算型）	113,920,428円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	554,184円
DC・ダイワJ-REITオープン	5,393,774,099円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	8,549,687円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	10,264,554円
ダイワ国内REITインデックス（投資一任専用）	398,134,637円
ダイワ・ノーロード J-REITファンド	62,587,052円
ダイワファンドラップ J-REITインデックス	5,689,593,015円
ダイワJ-REITインデックス（ダイワSMA専用）	1,209,204,779円
ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス	670,705,186円
スタイル9（6資産分散・保守型）	65,782円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	3,842,064円
スタイル9（6資産分散・積極型）	2,073,000円
スタイル9（8資産分散・保守型）	73,374円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	2,946,226円
スタイル9（8資産分散・積極型）	4,557,294円
ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	563,559,938円
計	64,762,358,763円
2. 期末日における受益権の総数	64,762,358,763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 852,000,000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	2025年12月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(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	2025年12月16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	9,930,884,400	-	10,147,140,000	216,255,600
合計	9,930,884,400	-	10,147,140,000	216,255,600

(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)

	2025年12月16日現在
1口当たり純資産額	3.9318円
(1万口当たり純資産額)	(39,318円)

【ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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(2025年6月17日から2025年12月16日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

当中間計算期間末 2025年12月16日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,026,734
親投資信託受益証券	5,234,182,089
未収入金	7,620,000
流動資産合計	5,252,828,823
資産合計	5,252,828,823
負債の部	
流動負債	
未払解約金	7,609,948
未払受託者報酬	537,177
未払委託者報酬	10,072,758
その他未払費用	134,209
流動負債合計	18,354,092
負債合計	18,354,092
純資産の部	
元本等	
元本	※1 5,735,165,801
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	※2 △ 500,691,070
（分配準備積立金）	22,459,380
元本等合計	5,234,474,731
純資産合計	5,234,474,731
負債純資産合計	5,252,828,823

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2025年6月17日 至 2025年12月16日
営業収益	
受取利息	12,871
有価証券売買等損益	24,227,930
営業収益合計	24,240,801
営業費用	
受託者報酬	537,177
委託者報酬	10,072,758
その他費用	134,209
営業費用合計	10,744,144
営業利益又は営業損失（△）	13,496,657
経常利益又は経常損失（△）	13,496,657
中間純利益又は中間純損失（△）	13,496,657
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（△）	2,704,569
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 571,137,112
剰余金増加額又は欠損金減少額	213,401,117
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	213,401,117
剰余金減少額又は欠損金増加額	153,747,163
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	153,747,163
中間剰余金又は中間欠損金（△）	△ 500,691,070

(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2025年6月17日 至2025年12月16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 2025年12月16日現在
1. ※1 期首元本額	6,326,943,229円
期中追加設定元本額	1,772,912,428円
期中一部解約元本額	2,364,689,856円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	5,735,165,801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500,691,070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2025年6月17日 至2025年12月16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 2025年12月16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 2025年12月16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 2025年12月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9127円 (9,127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

	2025年12月16日現在 金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	411,063,776
コール・ローン	647,594,782
投資信託受益証券	502,472,925
投資証券	30,138,526,430

派生商品評価勘定		82,253,702
未収入金		536,859
未収配当金		94,651,342
差入委託証拠金		227,635,217
流動資産合計		32,104,735,033
資産合計		32,104,735,033
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		66,108,259
未払金		112,755,797
未払解約金		8,444,500
流動負債合計		187,308,556
負債合計		187,308,556
純資産の部		
元本等		
元本	※1	36,278,154,564
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2	△4,360,728,087
元本等合計		31,917,426,477
純資産合計		31,917,426,477
負債純資産合計		32,104,735,033

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自2025年6月17日 至2025年12月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券

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

	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	2025年12月16日現在
1. ※1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額 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） 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） 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） 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） 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） 計	2025年6月17日 32,519,331,878円 7,881,037,300円 4,122,214,614円 27,634,273,547円 1,331,578,825円 2,902,916円 1,360,112,973円 5,949,286,303円 36,278,154,564円
2. 期末日における受益権の総数	36,278,154,564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4,360,728,087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	2025年12月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(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	2025年12月16日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買建	1,343,857,987	-	1,330,677,156	△13,180,831
合計	1,343,857,987	-	1,330,677,156	△13,180,831

(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	2025年12月16日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	31,559,602,533	-	31,530,276,259	29,326,274
アメリカ・ドル	24,621,844,225	-	24,542,537,764	79,306,461
イギリス・ポンド	1,380,026,158	-	1,388,907,447	△8,881,289
イスラエル・シケル	62,356,230	-	62,895,993	△539,763
オーストラリア・ドル	2,392,359,762	-	2,418,046,882	△25,687,120
カナダ・ドル	400,774,955	-	404,927,901	△4,152,946
シンガポール・ドル	1,060,604,554	-	1,060,859,678	△255,124
ニュージーランド・ドル	42,938,253	-	43,100,364	△162,111
ユーロ	1,299,857,813	-	1,310,984,847	△11,127,034
香港・ドル	298,840,583	-	298,015,383	825,200
合計	31,559,602,533	-	31,530,276,259	29,326,274

(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)

	2025年12月16日現在
1口当たり純資産額	0.8798円
(1万口当たり純資産額)	(8,798円)

【ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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(2025年6月17日から2025年12月16日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

当中間計算期間末 2025年12月16日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,622,395
親投資信託受益証券	1,487,288,556
未収入金	20,000
流動資産合計	1,489,930,951
資産合計	1,489,930,951
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	128,222
未払委託者報酬	2,405,056
その他未払費用	31,984
流動負債合計	2,565,262
負債合計	2,565,262
純資産の部	
元本等	
元本	※1 958,364,630
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（△）	529,001,059
（分配準備積立金）	2,576,055
元本等合計	1,487,365,689
純資産合計	1,487,365,689
負債純資産合計	1,489,930,951

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

当中間計算期間	
自 2025年6月17日	
至 2025年12月16日	
営業収益	
受取利息	3,005
有価証券売買等損益	108,948,551
営業収益合計	108,951,556
営業費用	
受託者報酬	128,222
委託者報酬	2,405,056
その他費用	31,984
営業費用合計	2,565,262
営業利益又は営業損失（△）	106,386,294
経常利益又は経常損失（△）	106,386,294
中間純利益又は中間純損失（△）	106,386,294
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（△）	795,470
期首剰余金又は期首欠損金（△）	287,656,013
剰余金増加額又は欠損金減少額	151,677,985
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	151,677,985
剰余金減少額又は欠損金増加額	15,923,763
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	15,923,763
中間剰余金又は中間欠損金（△）	529,001,059

(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2025年6月17日 至2025年12月16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 2025年12月16日現在
1. ※1 期首元本額	699,837,921円
期中追加設定元本額	296,988,918円
期中一部解約元本額	38,462,209円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	958,364,630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2025年6月17日 至2025年12月16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 2025年12月16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 2025年12月16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 2025年12月16日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5520円 (15,520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

	2025年12月16日現在 金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
預金	708,437,884
コール・ローン	252,002,864
投資信託受益証券	2,177,614,659
投資証券	55,660,747,537
派生商品評価勘定	4,841,526
未収入金	984,180

未収配当金	174,200,423
差入委託証拠金	426,093,482
流動資産合計	59,404,922,555
資産合計	59,404,922,555
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,065,253
未払金	237,900,812
未払解約金	10,630,000
流動負債合計	249,596,065
負債合計	249,596,065
純資産の部	
元本等	
元本 ※1	13,866,815,605
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	45,288,510,885
元本等合計	59,155,326,490
純資産合計	59,155,326,490
負債純資産合計	59,404,922,555

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自2025年6月17日 至2025年12月16日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のない有価証券については投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。また、市場価格のある有価証券については、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

	(2)投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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	2025年12月16日現在
1. ※1 期首	2025年6月17日
期首元本額	12,500,149,430円
期中追加設定元本額	1,739,352,137円
期中一部解約元本額	372,685,962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（為替ヘッジなし）	3,316,452,920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）	287,149,734円
D-I's グローバルREITインデックス	1,342,806円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	23,142,505円
iFree 外国REITインデックス	574,396,647円
iFree 8資産バランス	3,189,534,897円
グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成型）	422,917,966円
グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）	210,762,792円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	7,901,926円
DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド	4,640,473,092円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	7,817,949円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	9,333,361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）	324,435,979円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	125,924,548円
スタイル9（6資産分散・保守型）	28,486円

スタイル9（6資産分散・バランス型）	2,740,416円
スタイル9（6資産分散・積極型）	3,943,151円
スタイル9（8資産分散・保守型）	44,536円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	1,947,899円
スタイル9（8資産分散・積極型）	4,501,432円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	155,360,879円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファン ド	55,301,475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）	348,637,730円
ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資 家専用）	76,761,976円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資 家専用）	75,960,503円
計	13,866,815,605円
2. 期末日における受益権の総数	13,866,815,605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	2025年12月16日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額 との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計 上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しておりま す。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等 しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(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	2025年12月16日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買建	1,483,895,655	-	1,486,161,108	2,265,453
合計	1,483,895,655	-	1,486,161,108	2,265,453

(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	2025年12月16日現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	408,819,564	-	410,330,384	1,510,820
アメリカ・ドル	199,194,262	-	199,119,092	△75,170
ユーロ	209,625,302	-	211,211,292	1,585,990
合計	408,819,564	-	410,330,384	1,510,820

(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)

	2025年12月16日現在
1口当たり純資産額	4.2660円
(1万口当たり純資産額)	(42,660円)

2【ファンドの現況】

ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）

【純資産額計算書】

2025年12月30日

I	資産総額	53,373,700,078円
II	負債総額	106,143,161円
III	純資産総額（I－II）	53,267,556,917円
IV	発行済数量	22,710,461,039口
V	1単位当たり純資産額（III／IV）	2.3455円

（参考）トピックス・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2025年12月30日

I	資産総額	596,196,420,962円
II	負債総額	13,902,335,623円
III	純資産総額（I－II）	582,294,085,339円
IV	発行済数量	226,611,902,237口
V	1単位当たり純資産額（III／IV）	2.5696円

ダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）

純資産額計算書

2025年12月30日

I	資産総額	6,363,672,795円
II	負債総額	809,228円
III	純資産総額（I－II）	6,362,863,567円
IV	発行済数量	2,381,108,514口
V	1単位当たり純資産額（III／IV）	2.6722円

（参考）ストックインデックス225・マザーファンド

純資産額計算書

2025年12月30日

I	資産総額	483,405,583,515円

II	負債総額	5,809,591,923円
III	純資産総額（I－II）	477,595,991,592円
IV	発行済数量	66,925,956,541口
V	1単位当たり純資産額（III／IV）	7.1362円

ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

純資産額計算書

2025年12月30日

I	資産総額	39,013,437,928円
II	負債総額	6,716,328円
III	純資産総額（I－II）	39,006,721,600円
IV	発行済数量	19,398,007,942口
V	1単位当たり純資産額（III／IV）	2.0109円

（参考）外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

純資産額計算書

2025年12月30日

I	資産総額	174,918,032,992円
II	負債総額	1,859,207,252円
III	純資産総額（I－II）	173,058,825,740円
IV	発行済数量	45,706,702,867口
V	1単位当たり純資産額（III／IV）	3.7863円

ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）

純資産額計算書

2025年12月30日

I	資産総額	55,734,518,138円
II	負債総額	9,526,310円
III	純資産総額（I－II）	55,724,991,828円
IV	発行済数量	15,476,637,585口
V	1単位当たり純資産額（III／IV）	3.6006円

（参考）外国株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2025年12月30日

I	資産総額	920,890,694,269円
II	負債総額	172,248,656円
III	純資産総額（I－II）	920,718,445,613円
IV	発行済数量	106,817,691,292口
V	1単位当たり純資産額（III／IV）	8.6195円

ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）

純資産額計算書

2025年12月30日

I	資産総額	19,199,293,887円
II	負債総額	13,231,879円
III	純資産総額（I－II）	19,186,062,008円
IV	発行済数量	22,267,526,846口
V	1単位当たり純資産額（III／IV）	0.8616円

(参考) 日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2025年12月30日

I	資産総額	152,433,263,992円
II	負債総額	195,942,315円
III	純資産総額（I－II）	152,237,321,677円
IV	発行済数量	123,579,617,210口
V	1単位当たり純資産額（III／IV）	1.2319円

ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

純資産額計算書

2025年12月30日

I	資産総額	15,622,132,325円
II	負債総額	2,570,674円
III	純資産総額（I－II）	15,619,561,651円
IV	発行済数量	18,672,438,372口
V	1単位当たり純資産額（III／IV）	0.8365円

(参考) 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド**純資産額計算書**

2025年12月30日

I	資産総額	136,767,759,202円
II	負債総額	1,845,891,901円
III	純資産総額（I－II）	134,921,867,301円
IV	発行済数量	161,193,740,373口
V	1単位当たり純資産額（III／IV）	0.8370円

ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）**純資産額計算書**

2025年12月30日

I	資産総額	25,779,490,425円
II	負債総額	4,198,626円
III	純資産総額（I－II）	25,775,291,799円
IV	発行済数量	19,591,972,391口
V	1単位当たり純資産額（III／IV）	1.3156円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド**純資産額計算書**

2025年12月30日

I	資産総額	393,781,029,381円
II	負債総額	42,214,925円
III	純資産総額（I－II）	393,738,814,456円
IV	発行済数量	96,567,012,315口
V	1単位当たり純資産額（III／IV）	4.0774円

ダイワJ－REITインデックス（ダイワSMA専用）**純資産額計算書**

2025年12月30日

I	資産総額	4,360,841,724円
II	負債総額	599,444円
III	純資産総額（I－II）	4,360,242,280円
IV	発行済数量	3,438,249,380口
V	1単位当たり純資産額（III／IV）	1.2682円

(参考) ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド**純資産額計算書**

2025年12月30日

I	資産総額	256,464,727,683円
II	負債総額	899,598,600円
III	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	255,565,129,083円
IV	発行済数量	64,063,977,774口
V	1単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.9892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）**純資産額計算書**

2025年12月30日

I	資産総額	5,148,057,821円
II	負債総額	869,572円
III	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	5,147,188,249円
IV	発行済数量	5,618,770,716口
V	1単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9161円

(参考) 先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド**純資産額計算書**

2025年12月30日

I	資産総額	32,620,623,363円
II	負債総額	346,302,840円
III	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	32,274,320,523円
IV	発行済数量	36,540,509,340口
V	1単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8832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）**純資産額計算書**

2025年12月30日

I	資産総額	1,483,923,104円
II	負債総額	248,377円

Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,483,674,727円
Ⅳ 発行済数量	941,192,007口
Ⅴ 1単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5764円

（参考）ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2025年12月30日

Ⅰ 資産総額	60,935,468,399円
Ⅱ 負債総額	391,835,871円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	60,543,632,528円
Ⅳ 発行済数量	13,970,089,281口
Ⅴ 1単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.3338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します。）に支払います。

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2025年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審議・決定します。

ロ. 商品本部長

商品本部長は、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

運用チームまたは運用チームの戦略における基本的な運用方針を審議・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ます。

ホ. リスクマネジメント会議

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2025年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	84	399,990
追加型株式投資信託	768	37,412,564
株式投資信託 合計	852	37,812,554
単位型公社債投資信託	69	145,956
追加型公社債投資信託	14	1,529,368
公社債投資信託 合計	83	1,675,324
総合計	935	39,487,878

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66期事業年度（2024年4月1日から2025年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第67期事業年度に係る中間会計期間（2025年4月1日から2025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 (2024年3月31日)	当事業年度 (2025年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	4,813	13,153
有価証券	503	1,194
前払費用	481	513
未収委託者報酬	16,513	19,097
未収収益	78	110
関係会社短期貸付金	23,400	70,000
その他	88	94
流動資産計	45,878	104,164
固定資産		
有形固定資産	※1 176	※1 61
建物	2	0
器具備品	174	59
建設仮勘定	0	0
無形固定資産	1,342	1,160
ソフトウェア	1,063	1,062

ソフトウェア仮勘定	279	97
その他	-	0
投資その他の資産	13,660	14,856
投資有価証券	8,448	9,348
関係会社株式	3,475	3,414
出資金	177	34
長期差入保証金	1,021	1,049
繰延税金資産	524	995
その他	12	13
固定資産計	15,180	16,077
資産合計	61,058	120,241

(単位:百万円)

	前事業年度 (2024年3月31日)	当事業年度 (2025年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	158	134
未払金	6,187	6,757
未払収益分配金	39	62
未払償還金	12	12
未払手数料	5,849	6,660
その他未払金	※2 285	22
未払費用	5,035	5,997
未払法人税等	3,842	4,121
未払消費税等	872	763
賞与引当金	1,048	1,456
その他	1	0
流動負債計	17,146	19,233
固定負債		
退職給付引当金	2,227	2,300
役員退職慰労引当金	62	58
固定負債計	2,289	2,358
負債合計	19,435	21,592
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	41,424
資本剰余金		

資本準備金	11,495	37,745
資本剰余金合計	11,495	37,745
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,048	17,743
利益剰余金合計	13,422	18,117
株主資本合計	40,092	97,287
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,530	1,361
評価・換算差額等合計	1,530	1,361
純資産合計	41,623	98,649
負債・純資産合計	61,058	120,241

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	76,221	91,634
その他営業収益	717	1,233
営業収益計	76,939	92,868
営業費用		
支払手数料	31,497	37,180
広告宣伝費	947	1,124
調査費	10,709	13,135
調査費	1,700	1,954
委託調査費	9,009	11,180
委託計算費	1,783	1,957
営業雑経費	2,285	3,114
通信費	163	167
印刷費	514	483
協会費	51	57
諸会費	18	18
その他営業雑経費	1,538	2,388
営業費用計	47,224	56,512
一般管理費		
給料	6,601	7,599
役員報酬	483	453
給料・手当	4,543	5,116

賞与	527	572
賞与引当金繰入額	1,048	1,456
福利厚生費	969	1,070
交際費	96	108
旅費交通費	192	247
租税公課	508	1,004
不動産賃借料	1,269	1,298
退職給付費用	334	349
役員退職慰労引当金繰入額	6	6
固定資産減価償却費	478	444
諸経費	1,888	2,164
一般管理費計	12,346	14,293
営業利益	17,368	22,061

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	32	959
投資有価証券売却益	220	387
有価証券償還益	40	183
受取利息	4	95
その他	89	76
営業外収益計	388	1,703
営業外費用		
投資有価証券売却損	1	176
有価証券償還損	196	4
その他	18	54
営業外費用計	215	235
経常利益	17,540	23,528
特別利益		
投資有価証券売却益	-	※ 1 380
固定資産売却益	-	※ 2 110
特別利益計	-	491
特別損失		
固定資産売却損	-	※ 3 101
システム刷新関連費用	153	-
投資有価証券評価損	132	-
特別損失計	286	101
税引前当期純利益	17,253	23,918
法人税、住民税及び事業税	5,533	7,763

法人税等調整額	△139	△ 397
法人税等合計	5,394	7,366
当期純利益	11,859	16,552

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本 合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	11,505	11,879	38,549
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 10,316	△ 10,316	△ 10,316
当期純利益	-	-	-	11,859	11,859	11,859
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,543	1,543	1,543
当期末残高	15,174	11,495	374	13,048	13,422	40,092

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	534	534	39,084
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 10,316
当期純利益	-	-	11,859
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	995	995	995
当期変動額合計	995	995	2,538
当期末残高	1,530	1,530	41,623

当事業年度(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,048	13,422	40,092
当期変動額						
新株の発行	26,250	26,250	-	-	-	52,500
剰余金の配当	-	-	-	△ 11,858	△ 11,858	△ 11,858
当期純利益	-	-	-	16,552	16,552	16,552
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	26,250	26,250	-	4,694	4,694	57,195
当期末残高	41,424	37,745	374	17,743	18,117	97,287

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,530	1,530	41,623
当期変動額			
新株の発行	-	-	52,500
剰余金の配当	-	-	△ 11,858
当期純利益	-	-	16,552
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	△ 168	△ 168	△ 168
当期変動額合計	△ 168	△ 168	57,026
当期末残高	1,361	1,361	98,649

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

（２）無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

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

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

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

４．収益及び費用の計上基準

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

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

５．その他財務諸表の作成のための基本となる重要な事項

当社は株式会社大和証券グループ本社を通算親法人とするグループ通算制度を適用しておりましたが、2024年10月1日の第三者割当増資により、株式会社大和証券グループ本社の100%子会社ではなくなったため、株式会社大和証券グループ本社を通算親法人とするグループ通算制度から離脱しています。

（重要な会計上の見積り）

該当事項はありません。

（未適用の会計基準等）

リースに関する会計基準等

- ・「リースに関する会計基準」（企業会計基準第34号 2024年9月13日 企業会計基準委員会）等

- ・「リースに関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第33号 2024年9月13日 企業会計基準委員会）等

（１）概要

IFRS第16号の主要な定めを採り入れた新リース会計基準であります。借手の会計処理として、全てのリースについて使用権資産に係る減価償却費及びリース負債に係る利息相当額を計上する単一の会計処理モデルが適用されます。

（２）適用予定日

2028年3月期の期首から適用予定であります。

（３）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

（表示方法の変更）

（損益計算書関係）

前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「受取利息」は、金額的重要性が増したため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」の「その他」に表示していた93百万円は、「受取利息」4百万円、「その他」89百万円として組替えております。

（貸借対照表関係）

※１ 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2024年3月31日)	当事業年度 (2025年3月31日)
建物	39百万円	40百万円
器具備品	308百万円	269百万円

※２ 関係会社項目

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

	前事業年度 (2024年3月31日)	当事業年度 (2025年3月31日)
未払金	236百万円	－ 百万円

３ 保証債務

前事業年度(2024年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,354百万円に対して保証を行っております。

当事業年度(2025年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,341百万円に対して保証を行っております。

(損益計算書関係)

※ 1 投資有価証券売却益の項目

	前事業年度 (自 2023年 4 月 1 日 至 2024年 3 月31日)	当事業年度 (自 2024年 4 月 1 日 至 2025年 3 月31日)
投資有価証券売却益		
非上場株式	－ 百万円	380百万円

※ 2 固定資産売却益の項目

	前事業年度 (自 2023年 4 月 1 日 至 2024年 3 月31日)	当事業年度 (自 2024年 4 月 1 日 至 2025年 3 月31日)
固定資産売却益		
美術品	－ 百万円	83百万円
ゴルフ会員権	－ 百万円	26百万円

※ 3 固定資産売却損の項目

	前事業年度 (自 2023年 4 月 1 日 至 2024年 3 月31日)	当事業年度 (自 2024年 4 月 1 日 至 2025年 3 月31日)
固定資産売却損		
美術品	－ 百万円	85百万円
ゴルフ会員権	－ 百万円	15百万円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2023年 4 月 1 日 至 2024年 3 月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日

2023年6月26日 定時株主総会	普通株式	10,316	3,955	2023年 3月31日	2023年 6月27日

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

2024年6月19日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

① 剰余金の配当の総額	11,858百万円
② 配当の原資	利益剰余金
③ 1株当たり配当額	4,546円
④ 基準日	2024年3月31日
⑤ 効力発生日	2024年6月20日

当事業年度(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	652	—	3,260
合 計	2,608	652	—	3,260

2024年10月1日付で株式会社かんぽ生命保険より第三者割当増資に係る払込を受け、株式を発行しております。

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2024年6月19日 定時株主総会	普通株式	11,858	4,546	2024年 3月31日	2024年 6月20日

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

2025年6月19日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

① 剰余金の配当の総額	16,551百万円
② 配当の原資	利益剰余金
③ 1株当たり配当額	5,076円
④ 基準日	2025年3月31日
⑤ 効力発生日	2025年6月20日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に係る業務を委託したことにより発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

(i) 為替変動リスクの管理

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

(ii) 価格変動リスクの管理

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

②信用リスクの管理

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

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

前事業年度(2024年3月31日)

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券及び投資有価証券	144	8,141	—	8,285
資産合計	144	8,141	—	8,285

当事業年度(2025年3月31日)

(1)時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券及び投資有価証券	2,230	7,968	—	10,199
資産合計	2,230	7,968	—	10,199

(2)時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

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

(注1)時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

市場で取得した株式及び上場投資信託は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。当社が保有している証券投資信託のうちレベル1の時価を採用しているもの以外は基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル2に分類しております。

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

(単位：百万円)

区分	前事業年度	当事業年度
非上場株式	666	342
子会社株式	1,448	1,386
関連会社株式	2,027	2,027

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(2024年3月31日)

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

当事業年度(2025年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 1,386百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額 2,027百万円)は、市場価格がないことから、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度(2024年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)

貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1)株式	144	55	89
(2)その他	6,597	4,268	2,329
小計	6,742	4,323	2,419
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	1,543	1,756	△213
小計	1,543	1,756	△213
合計	8,285	6,079	2,205

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

当事業年度(2025年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1)株式	120	55	65
(2)その他	7,230	5,161	2,068
小計	7,350	5,216	2,134
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,848	3,020	△172
小計	2,848	3,020	△172
合計	10,199	8,236	1,962

(注)非上場株式(貸借対照表計上額 342百万円)については、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1)株式	-	-	-
(2)その他 証券投資信託	1,455	220	1
合計	1,455	220	1

当事業年度(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1)株式	704	380	-
(2)その他 証券投資信託	3,039	387	176
合計	3,744	767	176

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、証券投資信託について132百万円の減損処理を行っております。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,276百万円	2,227百万円
勤務費用	138	149
退職給付の支払額	△ 266	△ 166
その他	78	89
退職給付債務の期末残高	2,227	2,300

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

	前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,227百万円	2,300百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,227	2,300
退職給付引当金	2,227	2,300
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,227	2,300

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
勤務費用	138百万円	149百万円
その他	9	8
確定給付制度に係る退職給付費用	147	158

(注)その他には、臨時に支払った割増退職金等を含んでおります。

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度187百万円、当事業年度191百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

	前事業年度 (2024年 3月31日)	当事業年度 (2025年 3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	681	724
賞与引当金	262	340
未払事業税	197	260
投資有価証券評価損	204	171
株式報酬費用	115	150
関係会社株式評価損	155	87
出資金評価損	94	14
システム関連費用	25	-
その他	173	157
繰延税金資産小計	1,910	1,907
評価性引当額	△ 486	△ 277
繰延税金資産合計	1,424	1,629
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	△ 740	△ 633
連結法人間取引(譲渡益)	△ 159	-
繰延税金負債合計	△ 899	△ 633
繰延税金資産の純額	524	995

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

前事業年度(2024年 3月31日)

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

当事業年度(2025年 3月31日)

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

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（令和7年法律第13号）が2025年 3月31日に国会で成立し、2026年 4月 1日以後に開始する事業年度から防衛特別法人税の創設に伴う法人税率等の引上げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の30.62%から2026年 4月 1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については31.52%となります。

この税率変更により、繰延税金資産が22百万円増加、法人税等調整額が22百万円減少しております。

(収益認識関係)

(1) 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当社は、証券投資信託に関する運用その他の業務を行っております。営業収益の内訳は、証券投資信託に関する運用に係る業務が91,634百万円、その他1,233百万円であります。

（２）収益を理解するための基礎となる情報

（重要な会計方針）の４．収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

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

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

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

〔関連情報〕

１．サービスごとの情報

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

２．地域ごとの情報

（１）営業収益

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

（２）有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

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

〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

前事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

該当事項はありません。

〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

(ア)財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

前事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

属性	会社等の 名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有(被 所有)割合 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の 兼任等	事業上 の関係				
親会社	(株)大和証券 グループ 本社	東京都 千代田 区	247,397	証券持 株会社 業	被所有 100.0	あり	経営管 理	資金の貸付	11,100	関係会 社 短期貸 付金	23,400
								利息の受取 (注)	0	—	—

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

属性	会社等の 名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合(%)	関係内容		取引の内 容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の 兼任等	事業上 の関係				
親会社	(株)大和証券 グループ 本社	東京都 千代田 区	247,397	証券持 株会社 業	被所有 80.0	あり	経営管 理	資金の貸付	63,600	関係会 社 短期貸 付金	70,000
								利息の受取 (注1)	89	—	—
その他の 関係 会社	(株)かんぼ 生命保険	東京都 千代田 区	500,000	生命保 険業	被所有 20.0	あり	投資顧 問契約 の締結	投資顧問 報酬 (注2)	215	—	—

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

なお、担保は受け入れておりません。

(注2) 投資顧問報酬については市場実勢を勘案して合理的に決定しております。

(イ)財務諸表提出会社の子会社

前事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

属性	会社等の 名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有(被 所有)割合 (%)	関係内容		取引の内 容	取引金額 (百万円)	科目	期末残 高 (百万 円)
						役員 の 兼任等	事業上 の関係				
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商 品取引 業	所有 直接100.0	なし	経営管 理	債務保証 (注)	2,354	—	—

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

属性	会社等の 名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有(被 所有)割合 (%)	関係内容		取引の内 容	取引金額 (百万円)	科目	期末残 高 (百万 円)
						役員 の 兼任等	事業上 の関係				
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商 品取引 業	所有 直接100.0	なし	経営管 理	債務保証 (注)	2,341	—	—

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(ウ)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

属性	会社等 の 名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有(被 所有)割合 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の 兼任等	事業上 の関係				
同一の 親会社 をもつ 会社	大和証 券(株)	東京都 千代田 区	100,000	金融商品 取引業	—	なし	証券投資 信託受益 証券の募 集販売	証券投資信 託の代行手 数料 (注2)	13,749	未払手 数料	3,491
							本社ビル の管理	不動産の賃 借料(注3)	1,030	長期差 入保証 金	1,010

同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	—	なし	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守 (注4)	902	未払費用	87

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度(自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の 兼任等	事業上の関係				
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	—	なし	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料 (注2)	15,779	未払手数料	3,657
							本社ビルの管理	不動産の賃借料(注3)	1,038	長期差入保証金	1,037
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	—	なし	ソフトウェアの開発・保守	ソフトウェアの購入・保守 (注4)	857	未払費用	77

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社(東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)		当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)	
1株当たり純資産額	15,956.63円	1株当たり純資産額	30,254.44円
1株当たり当期純利益	4,546.57円	1株当たり当期純利益	5,642.31円

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

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	当事業年度 (自 2024年4月1日 至 2025年3月31日)
当期純利益(百万円)	11,859	16,552
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,933,697

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

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 (2025年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金・預金	4,296
有価証券	551
未収委託者報酬	20,930
関係会社短期貸付金	44,100
金銭の信託	19,355
その他	2,027
流動資産計	91,260

固定資産		
有形固定資産	※ 1	54
無形固定資産		
ソフトウェア		955
その他		165
無形固定資産計		1,121
投資その他の資産		
投資有価証券		10,809
関係会社株式		5,556
繰延税金資産		765
その他		1,096
投資その他の資産合計		18,226
固定資産計		19,403
資産合計		110,663

(単位:百万円)

当中間会計期間
(2025年9月30日)

負債の部		
流動負債		
未払金		7,198
未払費用		4,757
未払法人税等		3,921
賞与引当金		969
その他	※ 2	1,065
流動負債計		17,912
固定負債		
退職給付引当金		2,338
役員退職慰労引当金		27
固定負債計		2,365
負債合計		20,278
純資産の部		
株主資本		
資本金		41,424
資本剰余金		
資本準備金		37,745
資本剰余金合計		37,745

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	9,323
利益剰余金合計	9,697
株主資本合計	88,868
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,517
評価・換算差額等合計	1,517
純資産合計	90,385
負債・純資産合計	110,663

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間 (自 2025年4月1日 至 2025年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	48,780
その他営業収益	1,431
営業収益計	50,212
営業費用	
支払手数料	19,431
その他営業費用	11,139
営業費用計	30,571
一般管理費	※ 1 7,725
営業利益	11,915
営業外収益	※ 2 598
営業外費用	※ 3 707
経常利益	11,806
特別利益	—
特別損失	—
税引前中間純利益	11,806
法人税、住民税及び事業税	3,540
法人税等調整額	134
中間純利益	8,131

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2025年4月1日 至 2025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	41,424	37,745	374	17,743	18,117	97,287
当中間期変動額						
新株の発行	-	-	-	-	-	-
剰余金の配当	-	-	-	△16,551	△16,551	△16,551
中間純利益	-	-	-	8,131	8,131	8,131
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	-	-	-	△8,419	△8,419	△8,419
当中間期末残高	41,424	37,745	374	9,323	9,697	88,868

	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	1,361	1,361	98,649
当中間期変動額			
新株の発行	-	-	-
剰余金の配当	-	-	△ 16,551
中間純利益	-	-	8,131
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	155	155	155
当中間期変動額合計	155	155	△ 8,263
当中間期末残高	1,517	1,517	90,385

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. 金銭の信託

時価法を採用しております。

3. 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。

4. 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。

5. 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。

（中間貸借対照表関係）

※ 1 減価償却累計額

当中間会計期間 (2025年9月30日現在)	
有形固定資産	317百万円

※ 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（2025年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,421百万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 2025年4月 1日 至 2025年9月30日)
有形固定資産	7百万円
無形固定資産	237百万円

※ 2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2025年4月 1日 至 2025年9月30日)
投資有価証券売却益	255百万円
有価証券償還益	138百万円
受取利息	125百万円

※ 3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2025年4月 1日 至 2025年9月30日)
金銭の信託運用損	644百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 2025年4月1日 至 2025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	3,260	—	—	3,260
合計	3,260	—	—	3,260

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
2025年6月19日 定時株主総会	普通株式	16,551	5,076	2025年 3月31日	2025年 6月20日

（金融商品関係）

当中間会計期間（2025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			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
有価証券及び投資有価証券	2,489	8,527	—	11,017
金銭の信託	—	19,355	—	19,355
資産合計	2,489	27,883	—	30,372

（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。

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、市場における無調整の相場価格が存在しない投資信託については、解約又は買取請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限が無い場合には基準価額等を時価としていることから、その時価をレベル2に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸等の取引先金融機関が提供する価格に基づき算定する資産の価格は、活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価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	3,528
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2025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 3,528百万円）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	126	55	71
(2) その他	7,470	4,868	2,601
小計	7,596	4,923	2,673
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	3,420	3,879	△ 458
小計	3,420	3,879	△ 458
合計	11,017	8,802	2,214

（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。

（金銭の信託関係）

当中間会計期間（2025年9月30日）

運用目的の金銭の信託

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額	当中間会計期間の損益 に含まれた評価差額
運用目的の金銭の信託	19,355	△ 644

（企業結合等関係）

（取得による企業結合）

当社は、2025年6月19日開催の当社取締役会において、投資商品の開発・運用・助言サービスを提供する三井物産オルタナティブインベストメンツ株式会社を子会社化するための資金拠出を行うことを決議し、2025年7月1日付で同社の株式を取得いたしました。

1. 企業結合の概要

（1）被取得企業の名称及び事業内容

名称：三井物産オルタナティブインベストメンツ株式会社

事業内容：投資商品開発・運用・助言事業

（2）企業結合を行った主な理由

オルタナティブ投資に関わる知見やゲートキーパー機能を獲得することで、同領域におけるビジネス展開の足掛かりとするとともに、本件を契機により付加価値の高い事業領域への本格参入に向けて探索を進めるためです。

（3）企業結合日

2025年7月1日（株式取得日）

2025年6月30日（みなし取得日）

（4）企業結合の法的形式

現金による株式の取得

（5）結合後企業の名称

大和かんぼオルタナティブインベストメンツ株式会社

（6）取得した議決権比率

51%

（7）取得企業を決定するに至った主な根拠

当社が現金を対価として株式を取得したためです。

2. 被取得企業の取得原価及び対価の種類ごとの内訳

現金 2,142百万円

3. 主要な取得関連費用の内容及び金額

アドバイザー費用等 30百万円

（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48,780百万円、その他1,431百万円であります。

（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 2025年4月1日 至 2025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 2025年4月1日 至 2025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 2025年4月1日 至 2025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 2025年4月1日 至 2025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 2025年4月1日 至 2025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 2025年4月1日 至 2025年9月30日）	
1株当たり純資産額	27,720.07円
1株当たり中間純利益	2,493.87円

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

（注２） 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 （自 2025年4月1日 至 2025年9月30日）	
中間純利益(百万円)	8,131
普通株式に係る中間純利益(百万円)	8,131
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)	3,260,657

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

- ① 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- ② 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- ③ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。
- ④ 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- ⑤ 上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2025年3月31日、株式会社大和証券グループ本社、株式会社かんぽ生命保険、三井物産株式会社、三井物産かんぽアセットマネジメント株式会社及び三井物産オルタナティブインベストメンツ株式会社と、オルタナティブ資産運用分野における資本業務提携を締結いたしました。

2025年7月1日、株式譲渡取引により大和かんぽオルタナティブインベストメンツ株式会社（旧商号：三井物産オルタナティブインベストメンツ株式会社）を子会社化いたしました。

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

	① 名 称	② 資本金の額 (2025年03月末日現在)	③ 事業の内容	④ 備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	(注6)	
	みずほ信託銀行株式会社	247,369百万円	(注6)	
再信託受託会社	株式会社日本カストディ銀行	51,000百万円	(注6)	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	(注1)	

(注1) 金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

(注4) 全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。

(注5) 協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

(注6) 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(注7) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注8) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注9) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

(注10) 全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。

(注11) 労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

(注12) 農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでいます。

(注13) 資産運用業務を行なっています。

(注14) 資産運用業務、投資助言業務および情報提供業務を行なっています。

2【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

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

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

第3【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、使用することがあります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

2025年5月26日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士

渡部 啓太

公認会計士

松田 好弘

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2024年4月1日から2025年3月31日までの第66期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2025年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2025年8月1日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）の2024年6月18日から2025年6月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）の2025年6月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2025年8月1日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）の2024年6月18日から2025年6月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）の2025年6月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2025年8月1日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）の2024年6月18日から2025年6月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）の2025年6月16日現在の信託財産の状況及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2025年8月1日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワJ－REITインデックス（ダイワSMA専用）の2024年6月18日から2025年6月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワJ－REITインデックス（ダイワSMA専用）の2025年6月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2025年8月1日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2024年6月18日から2025年6月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2025年6月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2025年8月1日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2024年6月18日から2025年6月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2025年6月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2025年8月1日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2024年6月18日から2025年6月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2025年6月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2025年8月1日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2024年6月18日から2025年6月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2025年6月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2025年8月1日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2024年6月18日から2025年6月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2025年6月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2025年8月1日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2024年6月18日から2025年6月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2025年6月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2025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

公認会計士 渡部 啓太

業務執行社員

指定有限責任社員

公認会計士 松田 好弘

業務執行社員

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2025年4月1日から2026年3月31日までの第67期事業年度の中間会計期間（2025年4月1日から2025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2025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（2025年4月1日から2025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（社会的影響度の高い事業体の財務諸表監査に適用される規定を含む。）に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2026年2月13日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）の2025年6月17日から2025年12月16日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）の2025年12月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2025年6月17日から2025年12月16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

2026年2月13日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）の2025年6月17日から2025年12月16日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）の2025年12月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2025年6月17日から2025年12月16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

2026年2月13日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）の2025年6月17日から2025年12月16日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）の2025年12月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2025年6月17日から2025年12月16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

2026年2月13日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）の2025年6月17日から2025年12月16日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）の2025年12月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2025年6月17日から2025年12月16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

2026年2月13日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2025年6月17日から2025年12月16日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2025年12月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2025年6月17日から2025年12月16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

2026年2月13日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2025年6月17日から2025年12月16日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2025年12月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2025年6月17日から2025年12月16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

2026年2月13日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2025年6月17日から2025年12月16日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2025年12月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2025年6月17日から2025年12月16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

2026年2月13日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2025年6月17日から2025年12月16日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2025年12月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2025年6月17日から2025年12月16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

2026年2月13日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2025年6月17日から2025年12月16日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）の2025年12月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2025年6月17日から2025年12月16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

2026年2月13日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

秋山 範之

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

竹内 知明

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2025年6月17日から2025年12月16日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）の2025年12月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2025年6月17日から2025年12月16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。