【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9月8日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　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】	川根　浩志 連絡場所　東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス ダイワファンドラップ 日経２２５インデックス ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし） ダイワファンドラップ 日本債券インデックス ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし） ダイワファンドラップ Ｊ－ＲＥＩＴインデックス ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり） ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で120兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

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

（注1）上記の総称を「ダイワファンドラップ インデックス・シリーズ」とします。
（注2）以下「当ファンド」という場合、上記を総称して、またはそれぞれを指していうものとします。
（注3）以下、上記の略称としてそれぞれ次を用いることがあります。

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

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で120兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

各ファンドについて1万口当たり次のとおりとします。

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

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ　https://www.daiwa-am.co.jp/

(5)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。
「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

(6)【申込単位】

販売会社にお問合わせ下さい。

(7)【申込期間】

2026年9月9日から2027年3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。

一般社団法人資産運用業協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

<FW TOPIXインデックス>

商品分類表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 日経225インデックス>

商品分類表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

商品分類表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）>

商品分類表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型投信 追加型投信	国　内 海　外 内　外	株　式 債　券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 日本債券インデックス>

商品分類表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

商品分類表

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

（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 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券 （債券　公債）） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　）	グローバル （除く日本） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 （中東） エマージング	ファミリー ファンド ファンド・オブ・ ファンズ	あり （フルヘッジ） なし	日経225 TOPIX 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））

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）>

商品分類表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型投信	国　内	株　式
追加型投信	海　外	債　券
	内　外	不動産投信
		その他資産（　）
		資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル（除く日本）	ファミリーファンド	あり（　）
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	ファンド・オブ・ファンズ	なし
不動産投信	年4回	北米		
その他資産（投資信託証券（債券　一般））	年6回（隔月）	欧州		
資産複合（　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年12回（毎月）	アジア		
	日々	オセアニア		
	その他（　）	中南米		
		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。

<FW J−REITインデックス>

商品分類表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

商品分類表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FW 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

商品分類表

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

（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 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券 （不動産投信）） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　）	グローバル （除く日本） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 （中東） エマージング	ファミリー ファンド ファンド・オブ・ ファンズ	あり （　　） なし	日経225 TOPIX その他 （S&P先進国REIT 指数（除く日本） （円ベース））

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

（注1）商品分類の定義

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

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

（注2）属性区分の定義

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

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

※商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、一般社団法人資産運用業協会のホームページ（アドレスhttps://www.imaj.or.jp/）をご参照下さい。

＜信託金の限度額＞

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

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

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

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

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

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

●各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

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

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

●各ファンドの基本情報

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

※各ファンド(FW 外国株式インデックスEM+(為替ヘッジなし)、FW 外国債券インデックスEM+(為替ヘッジなし)およびFW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)を除きます。)において、マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。
※特定の指数の内容については、後掲の「特定の指数について」をご参照下さい。
*2026年10月1日付で、「RAFI ファンダメンタル・セレクト・エマージング・マーケッツ350インデックス(配当込み、円換算)」に変更します。

●各ファンドの運用方針

FW TOPIXインデックス

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

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

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

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

(c)株式の組入比率は、高位を保ちます。

◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル(注)を用います。
TOPIX（配当込み）への連動性を随時チェックし、必要があればリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行ないます。

FW 日経225インデックス

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

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

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

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

(b)株式の組入比率は、高位を保ちます。

◆指数に採用されている銘柄すべての組入れを行ないポートフォリオを構築することを基本とします（ただし、財務リスクが高いと判断される銘柄については除く場合があります。）。
指数への連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ないます。

FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

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

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

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

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

FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

FW 外国株式インデックスEM+(為替ヘッジなし)

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

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

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

*2026年10月1日付で、「RAFI ファンダメンタル・セレクト・エマージング・マーケッツ350インデックス(配当込み、円換算)」に変更します。

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

FW 日本債券インデックス

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

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

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

FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

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

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

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

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

FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

FW 外国債券インデックスEM+（為替ヘッジなし）

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

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

FW J-REITインデックス

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

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

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

FW 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）

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

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

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

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

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

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

FW 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）

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

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

※為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

●特定の指数について

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

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

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

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

◆RAFI ファンダメンタル・セレクト・エマージング・マーケッツ350インデックス
RAFI社(RAFI Indices, LLC)による基準をクリアーした新興国の上場株式の中から、4つのファンダメンタル指標(株主資本、キャッシュフロー、売上、配当)に着目し、銘柄の選定およびウェイト付けを行なう指数です。

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

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

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

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

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

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

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

〈分配方針〉

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

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

●FW 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)

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

●FW J-REITインデックス

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

●FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり／なし)

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

●基準価額の動きに関する留意点

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

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

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

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

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

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

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

*「FW 日本債券インデックス」を除きます。

FW J-REITインデックス

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

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

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

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

●各マザーファンドが連動対象とする指数の著作権等について

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

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

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

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

⑤本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

RAFIファンダメンタル・セレクト・エマージング・マーケッツ350インデックス(以下「原指数」)は、RAFI Indices, LLCまたはその関連会社(総称して「RAFI」)のサービスマークであり、大和アセットマネジメント株式会社が使用許諾を受けています。原指数の知的財産権その他の財産権は、RAFIが所有または使用許諾を受けています。本投資信託は、RAFI、その代理人およびサービス提供者(原指数の計算機関およびデータ提供者を含む(総称して「RAFIおよびその代理人」))によって後援、推奨、販売または宣伝されるものではありません。
原指数に含まれる内容は情報提供のみを目的としており、いかなる形式においても財務上または投資上のアドバイスを含むないしは構成するものではありません。原指数に有価証券その他の金融商品が含まれていることは、当該有価証券あるいはその他の金融商品の売買或いは保有の勧誘とみなすべきではありません。
RAFIおよびその代理人は、本ファンドへの投資の妥当性、または原指数が特定の市場パフォーマンスを提供する能力について、いかなる表明または保証も行いません。RAFIはお客様の投資顧問として活動するものではなく、原指数または本ファンドに関してお客様に対する受託者責任を負うものでもありません。RAFIおよびその代理人は、本ファンドの開発、販売、設定または管理に関与しておらず、また関与する予定もなく、本ファンドの所有者に対していかなる義務または責任も負いません。
RAFIおよびその代理人は、信頼できると考えられる情報源から情報を取得しますが、原指数またはそれに含まれるいかなるデータ(以下「RAFIデータ」)の正確性、適時性および／または完全性を保証するものではありません。RAFIデータは現状のままかつ利用可能な範囲で提供され、RAFIデータが中断なく提供されること、またはエラーを含まないことについて、明示的または黙示的ないかなる表明または保証も行いません。RAFIおよびその代理人は、RAFIデータに関する一切の保証および表明(商品性、特定目的または使用への適合性、権利、非侵害性に関する保証を含む)を否認します。RAFIおよびその代理人は、いかなる場合においても、直接的、間接的、特別、懲罰的、結果損害(逸失利益を含む)を含むいかなる損害についても、かかる損害の可能性について通知されていた場合であっても、一切の責任を負いません。本ファンドの購入または投資に関する決定は、すべてお客様の責任において行われるものとします。

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

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

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

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

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

(2)【ファンドの沿革】

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

(3)【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金（※3）	
お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務　　など
↑↓※1	収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※3）	
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（※2）の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成　　など
↓運用指図　↑↓※2	損益↑↓信託金（※3）	

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

損益↑↓投資

投資対象	ファミリーファンド方式で運用を行ないます。 ＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞ 東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）　など ＜FW 日経２２５インデックス＞ わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均トータルリターン・インデックスに採用された銘柄　など ＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり/為替ヘッジなし）＞ 外国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）　など ＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞ 外国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）、新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。）、新興国の企業のＤＲ（預託証券）、FTSE RAFI エマージング インデックス*との連動をめざすＥＴＦ（上場投資信託証券）　など ＊2026年10月1日付で、「RAFI ファンダメンタル・セレクト・エマージング・マーケッツ350インデックス」に変更します。 ＜FW 日本債券インデックス＞ わが国の公社債　など ＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり/為替ヘッジなし）＞ 外国の公社債　など ＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞ 外国の公社債、新興国通貨建ての債券　など ＜FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞ わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券　など ＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり/為替ヘッジなし）＞ 海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券　など

（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

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

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

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

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

＜委託会社の概況（2026年5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	%
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	2,608,525	80.00
		株	%
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	652,132	20.00

2【投資方針】

(1)【投資方針】

①　主要投資対象

ファンド名	主要投資対象
FW ＴＯＰＩＸインデックス	トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
FW 日経２２５インデックス	ストックインデックス２２５・マザーファンドの受益証券

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

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

② 投資態度

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の株式に投資し、投資成果を東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

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

ハ．株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

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

＜FW 日経２２５インデックス＞

イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の株式に投資し、投資成果を日経平均トータルリターン・インデックスの動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

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

ハ．株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

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

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

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

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

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

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

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

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

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

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

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

＜FW 日本債券インデックス＞

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

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

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

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

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

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

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

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

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

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

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

ロ．各マザーファンドの受益証券への投資にあたっては、下記の組入比率を目標に行ないます。
外国債券インデックスマザーファンドの受益証券……信託財産の純資産総額の80％程度
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券……信託財産の純資産総額の20％程度

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

＜FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

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

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

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

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

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

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

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

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

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

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

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

(2)【投資対象】

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

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

1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
   イ．有価証券
   ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)⑧、⑨、⑩および⑪に定めるものに限ります。）
   ハ．約束手形
   ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
   イ．為替手形

② 委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、「FW 日経２２５インデックス」は、みずほ信託銀行株式会社、「FW 日経２２５インデックス」以外の各ファンドは三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された各マザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

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

1. 株券または新株引受権証書

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

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

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FW 日経２２５インデックス＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 日本債券インデックス＞

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

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

18．外国法人が発行する譲渡性預金証書
19．受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
20．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
21．外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前19.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

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

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

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

2．国債証券
3．地方債証券
4．特別の法律により法人の発行する債券
5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
6．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7．コマーシャル・ペーパー
8．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
9．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
10．投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
11．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
12．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
13．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
14．外国法人が発行する譲渡性預金証書
15．受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
16．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

17．外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前15.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

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

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

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

＜FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

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

1．次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
イ．有価証券
ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)⑧に定めるものに限ります。）
ハ．約束手形
ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの
2．次に掲げる特定資産以外の資産
イ．為替手形

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

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

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

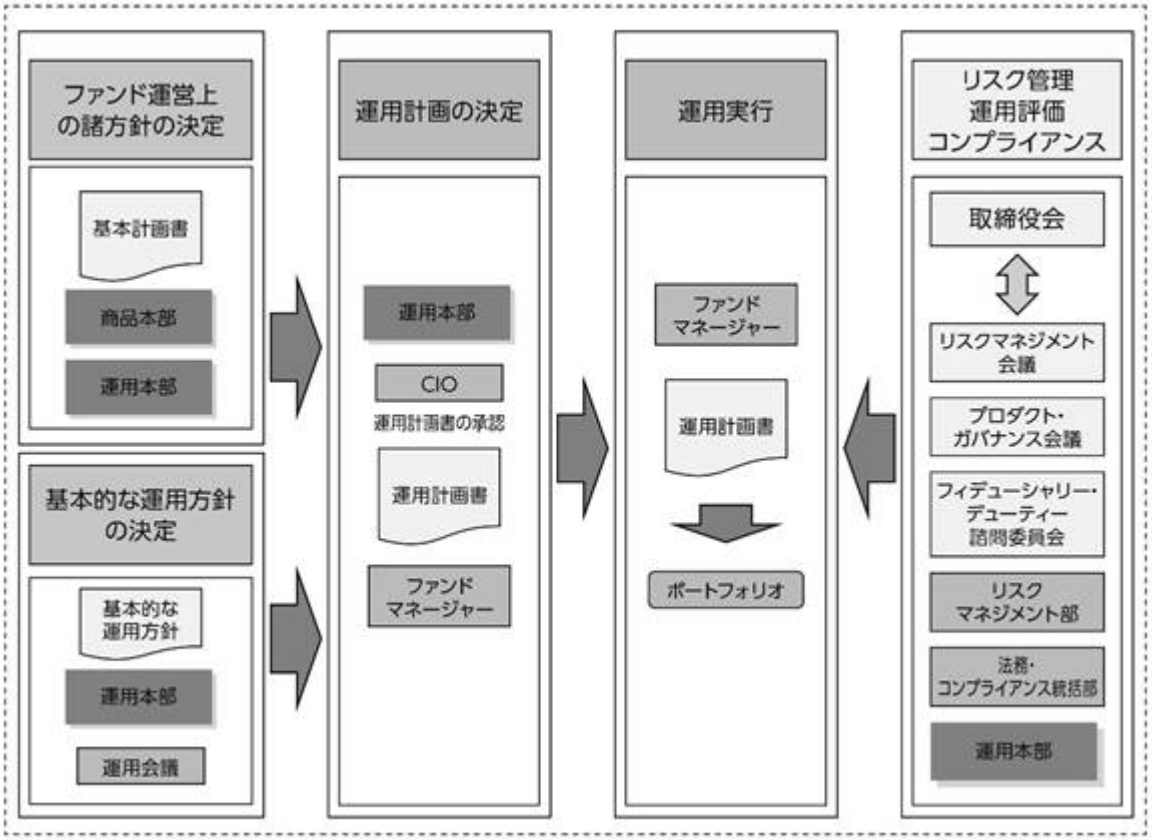
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

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

(3)【運用体制】

① 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を商品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確認します。

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フィデューシャリー・デューティー諮問委員会

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．フィデューシャリー・デューティー諮問委員会

取締役会の諮問委員会として、当社の取り組みの適切性や妥当性に関する事項、その他フィデューシャリー・デューティー遂行の観点で検討が必要な内容として取締役会から諮問された事項について、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2026年5月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

＜各ファンド共通＞

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

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

③　留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

①　マザーファンドの受益証券（信託約款）

＜各ファンド共通＞

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

②　株式（信託約款）

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FW 日経２２５インデックス＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

＜FW 日本債券インデックス＞

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

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

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

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

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

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

＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

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

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

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

＜FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

株式への直接投資は、行ないません。

③　新株引受権証券等（信託約款）

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FW 日経２２５インデックス＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 日本債券インデックス＞

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

＜上記以外の各ファンド＞

（規定なし）

④　投資信託証券（信託約款）

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FW 日経２２５インデックス＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

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

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

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

＜FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

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

⑤　投資する株式等の範囲（信託約款）

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

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

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

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

イ．委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するも

のとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

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

＜FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

（規定なし）

⑥　同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FW 日経２２５インデックス＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 日本債券インデックス＞

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

＜上記以外の各ファンド＞

（規定なし）

⑦　信用取引（信託約款）

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FW 日経２２５インデックス＞

＜FW 日本債券インデックス＞

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

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

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券

5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

＜上記以外の各ファンド＞

（規定なし）

⑧　先物取引等（信託約款）

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FW 日経２２５インデックス＞

＜FW 日本債券インデックス＞

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

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

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

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

＜FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

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

⑨　スワップ取引（信託約款）

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FW 日経２２５インデックス＞

＜FW 日本債券インデックス＞

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

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

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

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

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

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

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

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

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

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

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

＜FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

（規定なし）

⑩　金利先渡取引（信託約款）

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FW 日経２２５インデックス＞

＜FW 日本債券インデックス＞

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

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

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ．において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ．において「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が保有金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

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

＜上記以外の各ファンド＞

（規定なし）

⑪　金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

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

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

ホ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ホ．において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ホ．において「保有外貨建資産

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

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

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

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

＜上記以外の各ファンド＞

（規定なし）

⑫　直物為替先渡取引（信託約款）

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

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

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

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

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

＜上記以外の各ファンド＞

（規定なし）

⑬　デリバティブ取引等（信託約款）

＜各ファンド共通＞

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

⑭　有価証券の貸付け（信託約款）

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FW 日経２２５インデックス＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

＜FW 日本債券インデックス＞

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

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

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

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

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

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

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

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

＜FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞
（規定なし）

⑮　外貨建資産（信託約款）

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞
＜FW 日経２２５インデックス＞
＜FW 日本債券インデックス＞
外貨建資産への投資は、行ないません。
＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞
＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞
＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞
＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞
＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞
＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞
＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞
＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞
外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
＜FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞
外貨建資産への直接投資は、行ないません。

⑯　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

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

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

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

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

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

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

＜上記以外の各ファンド＞
（規定なし）

⑱　信用リスク集中回避（信託約款）
＜各ファンド共通＞
一般社団法人資産運用業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、一般社団法人資産運用業協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

⑲　資金の借入れ（信託約款）

＜各ファンド共通＞

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

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

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

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜参　考＞ マザーファンドの概要

トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

ストックインデックス２２５・マザーファンド

運用の基本方針	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、日経平均トータルリターン・インデックスをモデルとして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均トータルリターン・インデックスに採用された銘柄を主要投資対象とします。
投資態度	イ. 投資成果を日経平均トータルリターン・インデックスの動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。 1. 上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、等株数投資を行ないます。 2. 株式の組入比率は、高位を保ちます。 ロ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、日経平均トータルリターン・インデックスが改廃されたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

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

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

運用の基本方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
投資態度	① 主として海外の株式（預託証券を含みます。）に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数（配当込み、円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 ② 保有外貨建資産については、MSCIコクサイ指数（配当込み、円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして為替ヘッジを行ないます。 ③ 運用の効率化を図るため、株式指数先物取引等を利用することがあります。このため、株式等の組入総額ならびに株式指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ④ 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

主な投資制限	① 株式 株式への投資割合には、制限を設けません。 ② 新株引受権証券等 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③ 投資信託証券 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④ 同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑤ 同一銘柄の転換社債等 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものへの投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ⑥ 外貨建資産 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ⑦ 先物取引等 イ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。 ロ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。 ハ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。 ⑧ スワップ取引 イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。 ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。 ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。 ニ. スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。 ホ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。 ⑨ 金利先渡取引および為替先渡取引 イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。 ロ. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。 ハ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。 ニ. 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信

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

外国株式インデックスマザーファンド

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

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

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

＊2026年10月1日付で、「FTSE RAFI エマージング インデックス（円換算）」から「RAFI ファンダメンタル・セレクト・エマージング・マーケッツ350インデックス（配当込み、円換算）」に、「FTSE RAFI エマージング インデックス」から「RAFI ファンダメンタル・セレクト・エマージング・マーケッツ350インデックス」に変更します。

日本債券インデックスマザーファンド

運用の基本方針	投資成果をダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	イ．主としてわが国の公社債に投資し、投資成果をダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 ロ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。
主な投資制限	①　株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 ②　株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30％以下とします。 ③　同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10％以下とします。 ④　外貨建資産への投資は、行ないません。

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

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

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

外国債券インデックスマザーファンド

運用の基本方針	投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	外国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	イ．主として外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 ロ．保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。 ハ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。
主な投資制限	①　株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 ②　株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30％以下とします。 ③　同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10％以下とします。 ④　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

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

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

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

先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

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

ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

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

３【投資リスク】

(1)価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FW 日経２２５インデックス＞

①　株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

②　その他

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

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

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

①　株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

②　外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

③　その他

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

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

①　株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

② 外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

③ その他

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

＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

① 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

当ファンドの基準価額は、株価変動の影響を大きく受けます。

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

② 外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

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

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

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

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

③　その他

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

＜FW 日本債券インデックス＞

①　公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

②　その他

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

＜FW外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

①　公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

（FW 日本債券インデックスの①と同内容）

②　外国証券への投資に伴うリスク

（FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の②と同内容）

③　その他

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

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

①　公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

（FW 日本債券インデックスの①と同内容）

②　外国証券への投資に伴うリスク

（FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の②と同内容）

③　その他

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

＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

①　公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）
（FW日本債券インデックスの①と同内容）
②　外国証券への投資に伴うリスク
（FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）の②と同内容）
③　その他
（FW ＴＯＰＩＸインデックスおよびFW 日経２２５インデックスの②と同内容）

＜FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞
①　リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク
イ．リートは、株式と同様に金融商品取引所等で売買され、その価格は、不動産市況に対する見通しや市場における需給等、さまざまな要因で変動します。
・リートには資産規模が小さく、流動性が低いものもあります。このようなリートへの投資は、流動性の高い株式等に比べ、より制約を受けることが考えられます。
・金利の上昇局面においては、他の、より利回りの高い債券等との比較でリートに対する投資価値が相対的に低下し、価格が下落することも想定されます。
ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。
・リートの収益は、所有する不動産から得られる賃料収入がその大半を占めます。したがって、賃料水準や入居率の低下等により賃料収入が減少した場合には、リートの収益が悪化し、価格や配当が下落することが考えられます。
・リートの資産価値は、所有する不動産の評価等により変動します。市況の悪化、不動産の老朽化等によってリートの資産価値が低下した場合には、価格が下落することがあります。なお、実物資産である不動産には、人的災害、自然災害等に伴って大きな損害が発生する可能性もあり、このような場合、リートの価格が大幅に下落することも想定されます。
・リートでは、投資資金を調達するために金融機関等から借入れを行なうことがあります。したがって、金利上昇局面において金利負担等が増加し、収益の悪化要因となることが考えられます。
・法人形態のリートでは、経営陣の運営如何によっては収益や財務内容が著しく悪化する可能性があります。リートが倒産等に陥り、投資資金が回収できなくなることもありえます。
ハ．リートに関する法制度（税制、会計制度等）が変更となった場合、リートの価格や配当に影響を与えることが想定されます。
・その他、不動産を取巻く規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リートの価格や配当が影響を受けることが考えられます。
・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。
ニ．組入リートの市場価格が下落した場合、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。
②　その他
（FW ＴＯＰＩＸインデックスおよびFW 日経２２５インデックスの②と同内容）

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞
①　リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

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

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

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

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

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

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

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

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

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

ニ．当ファンドの基準価額は、海外のリート市場の変動の影響を大きく受けます。

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

②　外国証券への投資に伴うリスク

（FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の②と同内容）

③　その他

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

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

①　リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

（FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）の①と同内容）

②　外国証券への投資に伴うリスク

（FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の②と同内容）

③　その他

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

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

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

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

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

(3)その他の留意点

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

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

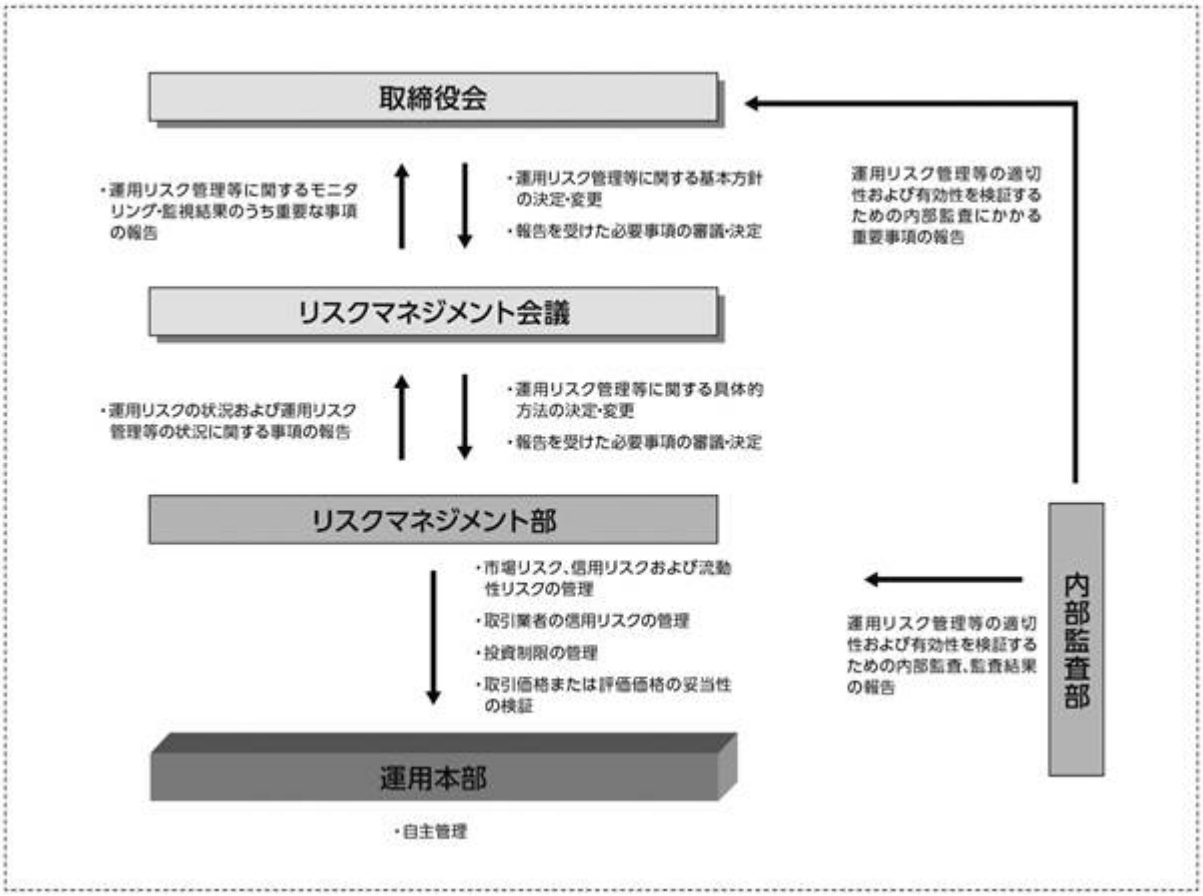
※ 流動性リスクに関する事項

・ 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が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

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

(4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※　流動性リスクに対する管理体制

・　委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行ないます。

・　取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

参考情報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

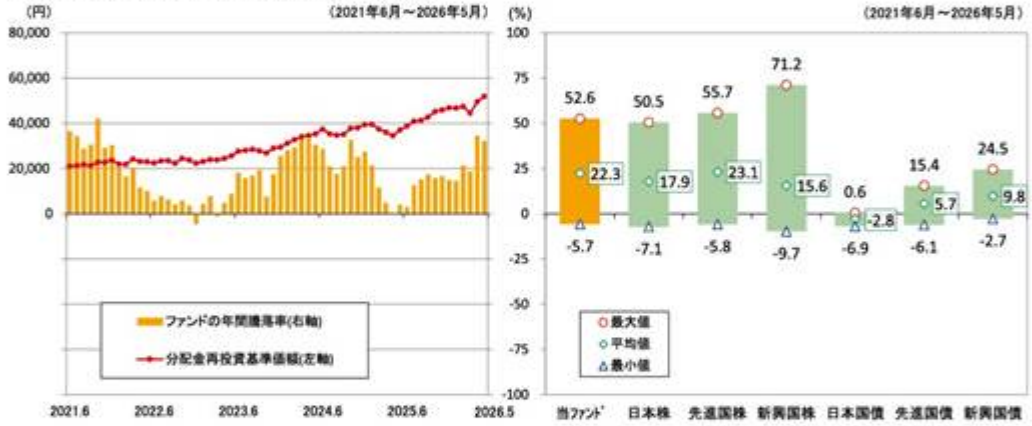
他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

[FW TOPIXインデックス]

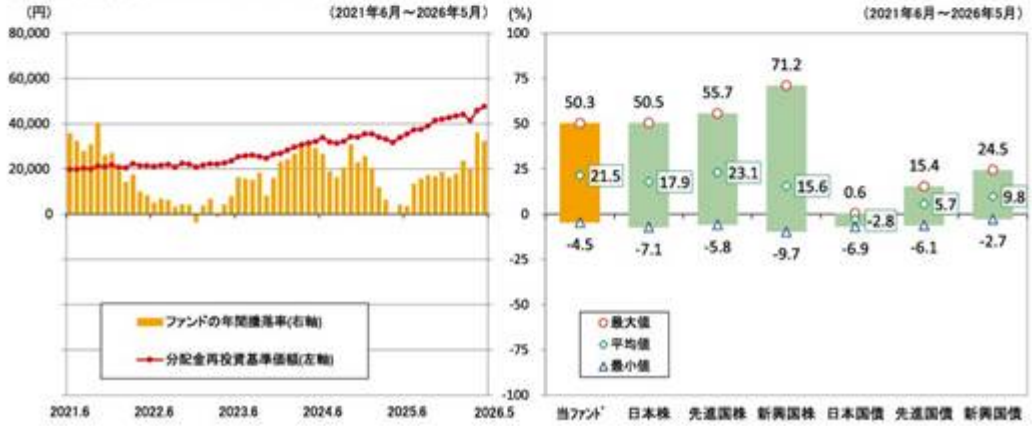
[FW 日経225インデックス]

[FW 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)]

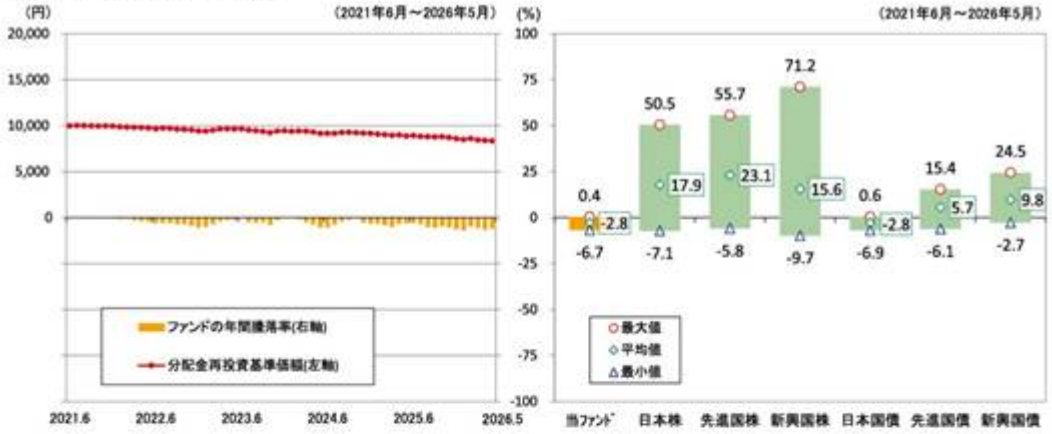
[FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)]



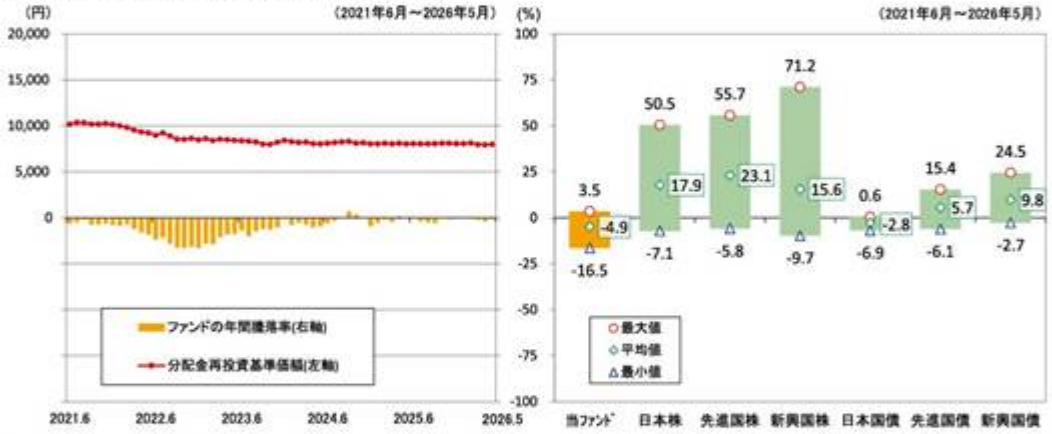
[FW 外国株式インデックスEM+(為替ヘッジなし)]



[FW 日本債券インデックス]

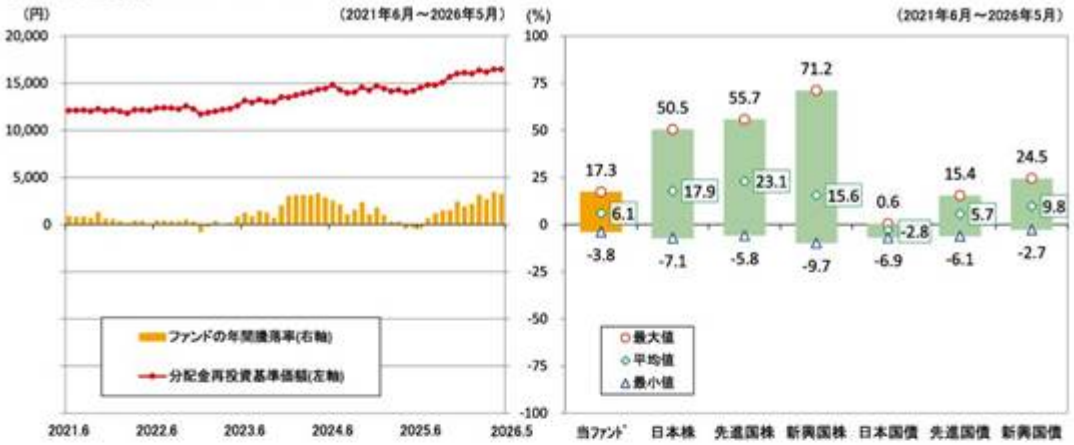


[FW 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)]

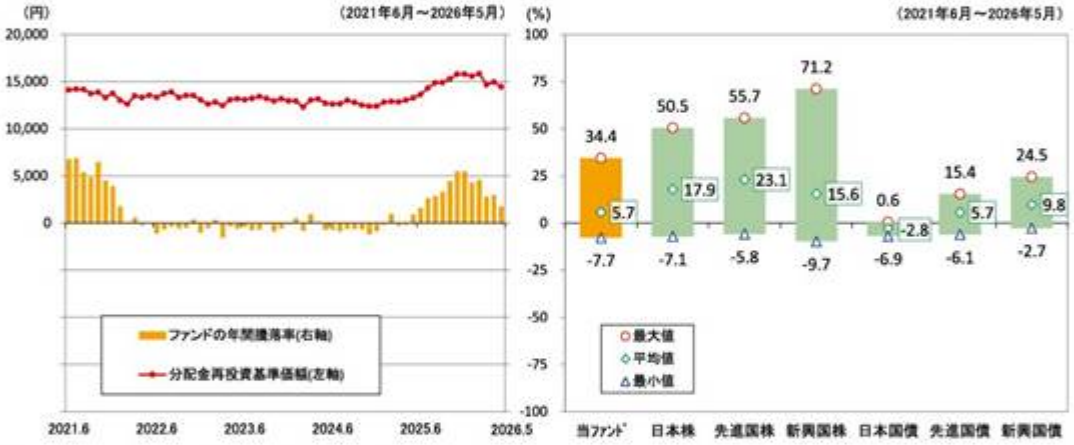


[FW 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)]

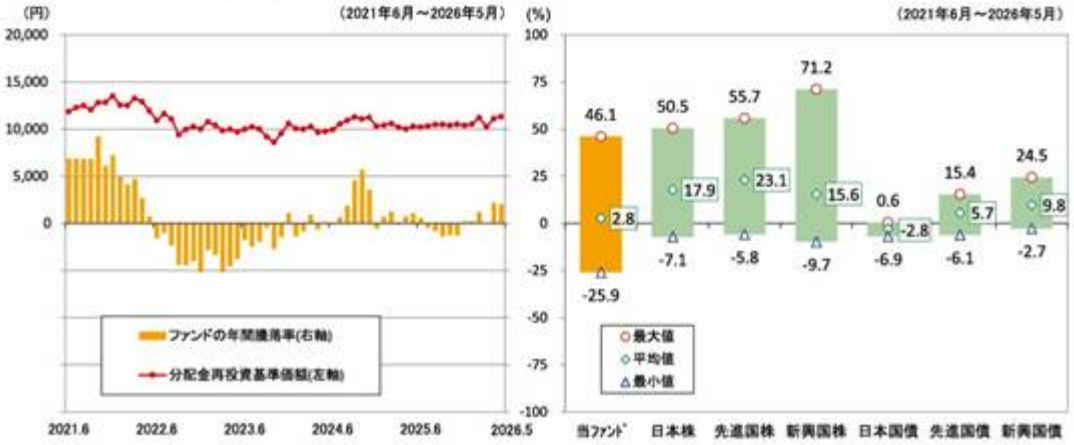
[FW 外国債券インデックスEM+(為替ヘッジなし)]



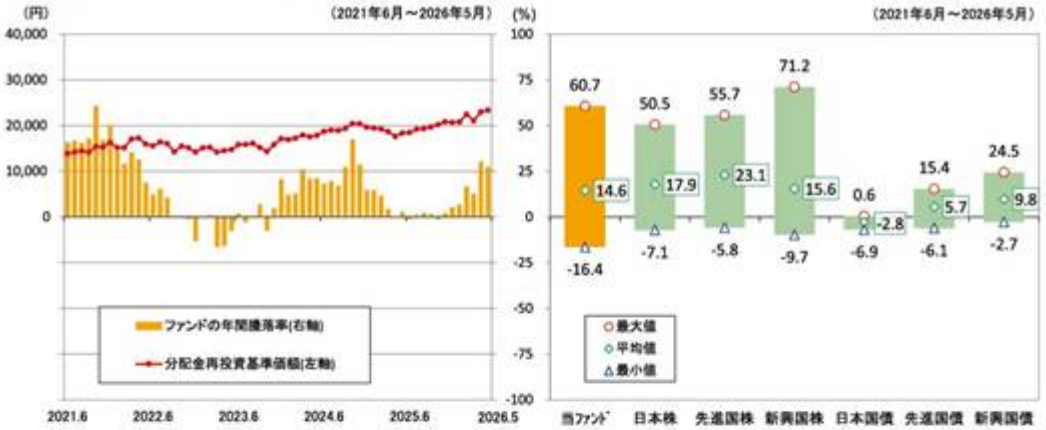
[FW J-REITインデックス]



[FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)]



[FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)]



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

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

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

4 【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

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

(2)【換金（解約）手数料】

① 換金手数料

ありません。

② 信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

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

ファンド名	信託報酬率
FW ＴＯＰＩＸインデックス	年率0.341%（税抜0.31%）
FW 日経２２５インデックス	
FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	年率0.4455%（税抜0.405%）
FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	
FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）	＜2026年9月30日まで＞ 年率0.4565%（税抜0.415%） ＜2026年10月1日以降＞ 年率0.4521%（税抜0.411%）
FW 日本債券インデックス	年率0.3355%（税抜0.305%）以内（※）
FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）	年率0.418%（税抜0.38%）
FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	
FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）	年率0.429%（税抜0.39%）
FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	年率0.341%（税抜0.31%）
FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）	年率0.4345%（税抜0.395%）
FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）	

（※）毎月10日（休業日の場合翌営業日）における新発10年国債の利回り（日本相互証券株式会社発表の終値）に応じて、純資産総額に対して以下の率とします。
（新発10年固定利付国債利回りが）
イ．1%未満の場合 …… 年率0.1485%（税抜0.135%）
ロ．1%以上の場合 …… 年率0.3355%（税抜0.305%）

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

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

＜FW ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜FW 日経２２５インデックス＞

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

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜FW 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

委託会社	販売会社	受託会社

年率0.285% （税抜）	年率0.10% （税抜）	年率0.02% （税抜）

＜FW 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

委託会社	販売会社	受託会社
＜2026年9月30日まで＞ 年率0.295% （税抜） ＜2026年10月1日以降＞ 年率0.291% （税抜）	年率0.10% （税抜）	年率0.02% （税抜）

＜FW 日本債券インデックス＞

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

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

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

＜FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

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

＜FW 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）＞

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

＜FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

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

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

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

＜FW 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

①　個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります（「FW ＴＯＰＩＸインデックス」および「FW 日経２２５インデックス」のみ。）。）を選択することもできます。

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、20.315%（所得税15.315%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。

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、15.315%（所得税15.315%）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。なお、益金不算入制度の適用はありません。

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

＜注1＞個別元本について

① 投資者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。

② 投資者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

③ 投資者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

④ 個別元本について、詳しくは販売会社にお問合せ下さい。

＜注2＞収益分配金の課税について

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

② 投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が

普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

（※）上記は、2026年5月末日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

5【運用状況】

【ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス】

(1) 【投資状況】 (2026年5月29日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		73,729,353,355	99.99
	内 日本	73,729,353,355	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		5,055,639	0.01
純資産総額		73,734,408,994	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】 (2026年5月29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	24,455,802,493	2.2593 55,253,292,116	3.0148 73,729,353,355	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	4,959,328,847	4,959,328,847	1.1964	1.1964
第2計算期間末 (2018年6月15日)	8,562,303,733	8,562,303,733	1.3726	1.3726
第3計算期間末 (2019年6月17日)	8,839,299,537	8,839,299,537	1.2045	1.2045
第4計算期間末 (2020年6月15日)	11,171,069,655	11,171,069,655	1.2246	1.2246
第5計算期間末 (2021年6月15日)	13,378,185,785	13,378,185,785	1.6103	1.6103
第6計算期間末 (2022年6月15日)	14,582,062,122	14,582,062,122	1.5446	1.5446
第7計算期間末 (2023年6月15日)	19,886,764,549	19,886,764,549	1.9542	1.9542
第8計算期間末 (2024年6月17日)	25,395,000,513	25,395,000,513	2.3450	2.3450
2025年5月末日	37,326,770,766	―	2.4861	―
第9計算期間末 (2025年6月16日)	37,389,693,695	37,389,693,695	2.4642	2.4642
6月末日	38,710,938,145	―	2.5342	―
7月末日	41,108,013,294	―	2.6138	―
8月末日	43,825,968,146	―	2.7311	―
9月末日	45,910,199,762	―	2.8116	―
10月末日	49,811,248,873	―	2.9855	―
11月末日	53,830,426,425	―	3.0268	―
12月末日	55,797,619,510	―	3.0572	―
2026年1月末日	59,780,799,345	―	3.1979	―
2月末日	67,705,439,846	―	3.5317	―
3月末日	60,977,422,010	―	3.1654	―
4月末日	68,482,875,796	―	3.3728	―
5月末日	73,734,408,994	―	3.5818	―

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

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

(4) 【設定及び解約の実績】

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

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

（参考）マザーファンド

トピックス・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（2026年5月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		696,273,727,560	97.84
	内 日本	696,273,727,560	97.84
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		15,403,388,727	2.16
純資産総額		711,677,116,287	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）		15,293,320,000	2.15
	内 日本	15,293,320,000	2.15

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

(注2) 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（2026年5月29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	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	7,817,000	2,375.51 18,569,385,253	2,999.00 23,443,183,000	3.29
2	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	6,688,200	2,963.99 19,823,773,315	3,042.00 20,345,504,400	2.86
3	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	2,418,600	4,587.10 11,094,380,148	7,491.00 18,117,732,600	2.55
4	日 立	日本	株式	電気機器	3,200,900	3,981.91 12,745,716,473	5,166.00 16,535,849,400	2.32
5	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	2,701,200	4,251.04 11,482,923,723	5,819.00 15,718,282,800	2.21
6	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	4,340,100	3,472.63 15,071,590,672	3,444.00 14,947,304,400	2.10

7	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	264,200	26,908.07 7,109,112,190	52,420.00 13,849,364,000	1.95
8	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,724,000	4,999.13 8,618,508,764	7,195.00 12,404,180,000	1.74
9	三菱商事	日本	株式	卸売業	2,444,000	3,670.49 8,970,696,145	5,065.00 12,378,860,000	1.74
10	村田製作所	日本	株式	電気機器	1,200,600	2,737.93 3,287,159,077	9,625.00 11,555,775,000	1.62
11	キーエンス	日本	株式	電気機器	125,900	55,960.56 7,045,434,623	80,110.00 10,085,849,000	1.42
12	三井物産	日本	株式	卸売業	1,886,900	3,859.53 7,282,557,874	5,290.00 9,981,701,000	1.40
13	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	378,800	15,826.22 5,994,973,888	26,170.00 9,913,196,000	1.39
14	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	900,600	7,896.62 7,111,704,833	10,570.00 9,519,342,000	1.34
15	三菱電機	日本	株式	電気機器	1,391,900	3,950.70 5,498,987,513	6,558.00 9,128,080,200	1.28
16	三菱重工業	日本	株式	機械	2,380,900	3,827.45 9,112,791,966	3,806.00 9,061,705,400	1.27
17	東京海上HD	日本	株式	保険業	1,273,900	6,293.54 8,017,349,797	7,111.00 9,058,702,900	1.27
18	信越化学	日本	株式	化学	1,120,700	4,722.26 5,292,239,039	7,758.00 8,694,390,600	1.22
19	伊 藤 忠	日本	株式	卸売業	4,474,000	1,763.62 7,890,478,619	1,935.50 8,659,427,000	1.22
20	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	89,800	47,405.50 4,257,014,550	82,330.00 7,393,234,000	1.04
21	HOYA	日本	株式	精密機器	238,800	21,091.78 5,036,717,951	27,080.00 6,466,704,000	0.91
22	武田薬品	日本	株式	医薬品	1,123,000	4,544.03 5,102,950,760	5,118.00 5,747,514,000	0.81
23	住友電工	日本	株式	非鉄金属	448,200	4,576.17 2,051,040,706	12,585.00 5,640,597,000	0.79
24	任 天 堂	日本	株式	その他製品	787,300	12,541.36 9,873,814,193	7,148.00 5,627,620,400	0.79
25	住友商事	日本	株式	卸売業	787,000	4,487.12 3,531,371,291	7,099.00 5,586,913,000	0.79
26	パナソニック ホールディンク	日本	株式	電気機器	1,501,300	1,641.58 2,464,512,811	3,700.00 5,554,810,000	0.78

27	ルネサスエレクトロニクス	日本	株式	電気機器	1,232,100	1,838.69 2,265,460,840	4,500.00 5,544,450,000	0.78
28	丸 紅	日本	株式	卸売業	1,015,800	3,771.17 3,830,755,785	5,196.00 5,278,096,800	0.74
29	NTT	日本	株式	情報･通信業	34,646,600	157.55 5,458,650,969	149.50 5,179,666,700	0.73
30	キオクシアホールディングス	日本	株式	電気機器	77,100	6,252.14 482,040,525	65,850.00 5,077,035,000	0.71

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

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	97.84%
合計	97.84%

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

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	0.34%
建設業	2.11%
食料品	2.55%
繊維製品	0.31%
パルプ・紙	0.12%
化学	4.80%
医薬品	3.22%
石油・石炭製品	0.47%
ゴム製品	0.52%
ガラス・土石製品	0.85%
鉄鋼	0.63%
非鉄金属	2.79%
金属製品	0.48%
機械	5.97%
電気機器	21.29%
輸送用機器	5.19%
精密機器	1.86%
その他製品	1.81%
電気・ガス業	1.18%
陸運業	1.76%

海運業	0.49%
空運業	0.25%
倉庫・運輸関連業	0.13%
情報・通信業	6.72%
卸売業	7.57%
小売業	3.79%
銀行業	10.60%
証券、商品先物取引業	0.84%
保険業	3.14%
その他金融業	1.19%
不動産業	1.61%
サービス業	3.19%
合計	97.84%

(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 0806月	買建	386	14,408,852,100	15,293,320,000	2.15%

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

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

（参考情報）運用実績

●FW TOPIXインデックス

2026年5月29日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	35,818円
純資産総額	737億円

当初設定日（2016年9月26日）～2026年5月29日

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	6.2%
3カ月間	1.4%
6カ月間	18.3%
1年間	44.1%
3年間	97.3%
5年間	128.5%
設定来	258.2%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：0円　　設定来分配金合計額：0円

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

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

主要な資産の状況　※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
国内株式	1,636	97.8%
国内株式先物	1	2.1%
不動産投資信託等	－	－
コール・ローン、その他		2.2%
合計	1,637	－

株式　市場・上場別構成	比率
東証プライム市場	97.6%
東証スタンダード市場	0.3%
東証グロース市場	0.0%
地方市場・その他	－
合計	97.8%

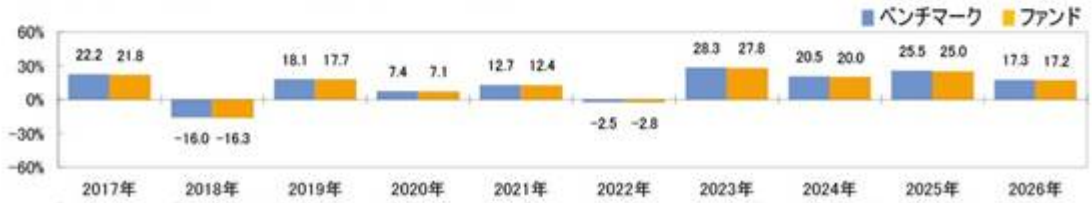
株式東証33業種別構成	比率
電気機器	21.3%
銀行業	10.6%
卸売業	7.6%
情報・通信業	6.7%
機械	6.0%
輸送用機器	5.2%
化学	4.8%
小売業	3.8%
医薬品	3.2%
その他	28.7%
合計	97.8%

組入上位10銘柄	業種名	比率
三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	3.3%
トヨタ自動車	輸送用機器	2.9%
ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.5%
日 立	電気機器	2.3%
三井住友フィナンシャルG	銀行業	2.2%
TOPIX　先物 0806月	－	2.1%
ソニーグループ	電気機器	2.1%
東京エレクトロン	電気機器	1.9%
みずほフィナンシャルG	銀行業	1.7%
三菱商事	卸売業	1.7%
合計		22.9%

※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。
・2026年は5月29日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ　日経２２５インデックス】

(1)　【投資状況】（2026年5月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	42,133,223,456	99.98

	内 日本	42,133,223,456	99.98
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		6,991,621	0.02
純資産総額		42,140,215,077	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】（2026年5月29日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ストックインデックス225・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	4,449,126,025	5.8341 25,957,070,687	9.4700 42,133,223,456	99.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

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

第1計算期間末 (2017年6月15日)	3,303,197,938	3,303,197,938	1.2007	1.2007
第2計算期間末 (2018年6月15日)	6,623,555,793	6,623,555,793	1.4057	1.4057
第3計算期間末 (2019年6月17日)	8,152,341,843	8,152,341,843	1.3227	1.3227
第4計算期間末 (2020年6月15日)	11,210,563,802	11,210,563,802	1.3749	1.3749
第5計算期間末 (2021年6月15日)	14,516,397,552	14,516,397,552	1.9054	1.9054
第6計算期間末 (2022年6月15日)	14,452,677,600	14,452,677,600	1.7300	1.7300
第7計算期間末 (2023年6月15日)	19,299,142,442	19,299,142,442	2.2421	2.2421
第8計算期間末 (2024年6月17日)	24,047,464,398	24,047,464,398	2.5884	2.5884
2025年5月末日	25,250,488,339	―	2.6178	―
第9計算期間末 (2025年6月16日)	25,375,449,225	25,375,449,225	2.6413	2.6413
6月末日	26,900,055,655	―	2.7946	―
7月末日	26,917,943,102	―	2.8344	―
8月末日	27,695,484,334	―	2.9491	―
9月末日	29,192,437,385	―	3.1219	―
10月末日	33,796,343,832	―	3.6412	―
11月末日	30,183,252,518	―	3.4894	―
12月末日	30,397,541,336	―	3.4978	―
2026年1月末日	32,559,961,121	―	3.7046	―
2月末日	36,342,951,430	―	4.0886	―
3月末日	31,799,160,357	―	3.5696	―
4月末日	37,721,887,140	―	4.1437	―
5月末日	42,140,215,077	―	4.6350	―

② 【分配の推移】

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

第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

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

(4) 【設定及び解約の実績】

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

（注） 当初設定数量は1,000,000口です。

（参考）マザーファンド
ストックインデックス２２５・マザーファンド

(1) 投資状況（2026年5月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		641,093,045,760	98.39
	内 日本	641,093,045,760	98.39

コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	10,504,650,483	1.61
純資産総額	651,597,696,243	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）		10,502,260,000	1.61
	内　日本	10,502,260,000	1.61

(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（2026年5月29日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	777,600	46,977.50 36,529,710,000	82,330.00 64,019,808,000	9.83
2	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	2,332,800	15,571.24 36,324,605,280	26,170.00 61,049,376,000	9.37
3	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	7,776,000	4,537.06 35,280,214,800	7,491.00 58,250,016,000	8.94
4	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	972,000	26,486.44 25,744,823,400	52,420.00 50,952,240,000	7.82
5	ＴＤＫ	日本	株式	電気機器	4,860,000	2,098.30 10,197,780,000	4,108.00 19,964,880,000	3.06
6	キオクシアホールディングス	日本	株式	電気機器	226,800	19,132.75 4,339,308,155	65,850.00 14,934,780,000	2.29
7	イビデン	日本	株式	電気機器	648,000	7,170.91 4,646,754,930	23,000.00 14,904,000,000	2.29
8	ファナック	日本	株式	電気機器	1,620,000	4,281.65 6,936,273,750	7,892.00 12,785,040,000	1.96
9	信越化学	日本	株式	化学	1,620,000	4,727.16 7,658,006,000	7,758.00 12,567,960,000	1.93
10	ＫＤＤＩ	日本	株式	情報・通信業	3,888,000	2,485.68 9,664,363,200	2,738.50 10,647,288,000	1.63

11	ﾘｸﾙｰﾄﾎｰﾙﾃﾞｨﾝｸﾞｽ	日本	株式	サービス業	972,000	7,865.94 7,645,695,900	10,570.00 10,274,040,000	1.58
12	フジクラ	日本	株式	非鉄金属	1,944,000	2,451.30 4,765,336,000	4,771.00 9,274,824,000	1.42
13	京 セ ラ	日本	株式	電気機器	2,592,000	2,049.33 5,311,874,800	3,483.00 9,027,936,000	1.39
14	中外製薬	日本	株式	医薬品	972,000	6,993.69 6,797,875,650	7,892.00 7,671,024,000	1.18
15	ダイキン工業	日本	株式	機械	324,000	17,568.70 5,692,261,500	23,285.00 7,544,340,000	1.16
16	村田製作所	日本	株式	電気機器	777,600	2,673.85 2,079,189,000	9,625.00 7,484,400,000	1.15
17	豊田通商	日本	株式	卸売業	972,000	4,254.70 4,135,573,500	6,930.00 6,735,960,000	1.03
18	テ ル モ	日本	株式	精密機器	2,592,000	2,438.33 6,320,154,800	2,401.00 6,223,392,000	0.96
19	コナミグループ	日本	株式	情報･通信業	324,000	21,388.29 6,929,808,550	18,930.00 6,133,320,000	0.94
20	ソニーグループ	日本	株式	電気機器	1,620,000	3,456.20 5,599,049,230	3,444.00 5,579,280,000	0.86
21	レーザーテック	日本	株式	電気機器	129,600	20,281.77 2,628,518,460	40,130.00 5,200,848,000	0.80
22	ﾄﾖﾀ自動車	日本	株式	輸送用機器	1,620,000	2,954.38 4,786,110,500	3,042.00 4,928,040,000	0.76
23	三菱商事	日本	株式	卸売業	972,000	3,667.62 3,564,926,700	5,065.00 4,923,180,000	0.76
24	日東電工	日本	株式	化学	1,620,000	3,413.49 5,529,857,750	2,990.50 4,844,610,000	0.74
25	太陽誘電	日本	株式	電気機器	324,000	3,191.03 1,033,893,850	14,815.00 4,800,060,000	0.74
26	HOYA	日本	株式	精密機器	162,000	20,959.25 3,395,399,375	27,080.00 4,386,960,000	0.67
27	ディスコ	日本	株式	機械	64,800	48,558.51 3,146,591,490	65,090.00 4,217,832,000	0.65
28	セコム	日本	株式	サービス業	648,000	5,594.93 3,625,520,700	6,350.00 4,114,800,000	0.63
29	住友電工	日本	株式	非鉄金属	324,000	4,531.87 1,468,327,650	12,585.00 4,077,540,000	0.63
30	大塚ホールディングス	日本	株式	医薬品	324,000	8,322.59 2,696,521,050	11,715.00 3,795,660,000	0.58

(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	98.39%
合計	98.39%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.07%
鉱業	0.07%
建設業	1.40%
食料品	2.02%
繊維製品	0.08%
パルプ・紙	0.04%
化学	4.53%
医薬品	3.84%
石油・石炭製品	0.20%
ゴム製品	0.52%
ガラス・土石製品	0.78%
鉄鋼	0.03%
非鉄金属	2.92%
金属製品	0.02%
機械	4.01%
電気機器	36.34%
輸送用機器	2.47%
精密機器	2.08%
その他製品	1.32%
電気・ガス業	0.15%
陸運業	0.56%
海運業	0.27%
空運業	0.15%
情報・通信業	12.79%
卸売業	3.43%
小売業	11.67%
銀行業	0.75%
証券、商品先物取引業	0.14%
保険業	0.97%

その他金融業	0.71%
不動産業	0.95%
サービス業	3.11%
合計	98.39%

(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 0806月	買建	158	9,349,558,700	10,502,260,000	1.61%

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

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

（参考情報）運用実績

●FW 日経225インデックス

2026年5月29日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	46,350円
純資産総額	421億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	11.9%
3カ月間	13.4%
6カ月間	32.8%
1年間	77.1%
3年間	124.1%
5年間	148.1%
設定来	363.5%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：0円　　設定来分配金合計額：0円

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

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

主要な資産の状況　※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
国内株式	225	98.4%
国内株式先物	1	1.6%
不動産投資信託等	－	－
コール・ローン、その他		1.6%
合計	226	－

株式　市場・上場別構成	比率
東証プライム市場	98.4%
東証スタンダード市場	－
東証グロース市場	－
地方市場・その他	－
合計	98.4%

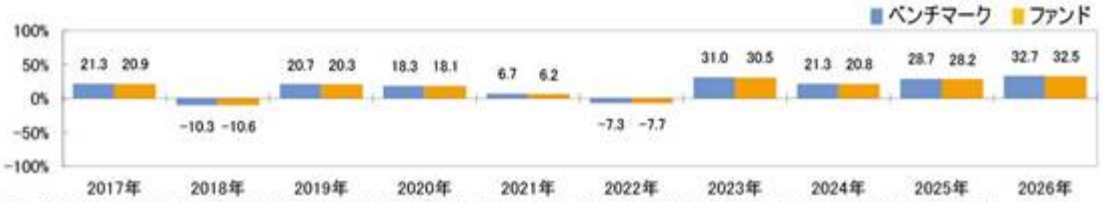
株式東証33業種別構成	比率
電気機器	36.3%
情報・通信業	12.8%
小売業	11.7%
化学	4.5%
機械	4.0%
医薬品	3.8%
卸売業	3.4%
サービス業	3.1%
非鉄金属	2.9%
その他	15.7%
合計	98.4%

組入上位10銘柄	業種名	比率
ファーストリテイリング	小売業	9.8%
アドバンテスト	電気機器	9.4%
ソフトバンクグループ	情報・通信業	8.9%
東京エレクトロン	電気機器	7.8%
ＴＤＫ	電気機器	3.1%
キオクシアホールディングス	電気機器	2.3%
イビデン	電気機器	2.3%
ファナック	電気機器	2.0%
信越化学	化学	1.9%
KDDI	情報・通信業	1.6%
合計		49.1%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは日経平均トータルリターン・インデックスです。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2026年は5月29日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）】

(1) 【投資状況】（2026年5月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	134,921,173,206	99.98

	内 日本	134,921,173,206	99.98
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		20,600,322	0.02
純資産総額		134,941,773,528	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】（2026年5月29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	33,059,191,710	3.4358 113,587,263,864	4.0812 134,921,173,206	99.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

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

第1計算期間末 (2017年6月15日)	16,740,001,185	16,740,001,185	1.1194	1.1194
第2計算期間末 (2018年6月15日)	31,820,531,530	31,820,531,530	1.2400	1.2400
第3計算期間末 (2019年6月17日)	36,065,457,483	36,065,457,483	1.2648	1.2648
第4計算期間末 (2020年6月15日)	42,369,088,321	42,369,088,321	1.2825	1.2825
第5計算期間末 (2021年6月15日)	56,165,645,906	56,165,645,906	1.7819	1.7819
第6計算期間末 (2022年6月15日)	53,716,109,956	53,716,109,956	1.5540	1.5540
第7計算期間末 (2023年6月15日)	68,296,881,791	68,296,881,791	1.7433	1.7433
第8計算期間末 (2024年6月17日)	84,165,891,249	84,165,891,249	2.0021	2.0021
2025年5月末日	93,164,062,090	―	2.1129	―
第9計算期間末 (2025年6月16日)	93,162,582,061	93,162,582,061	2.1292	2.1292
6月末日	95,930,543,451	―	2.1814	―
7月末日	98,620,387,832	―	2.2373	―
8月末日	101,571,903,176	―	2.2770	―
9月末日	105,120,682,228	―	2.3221	―
10月末日	108,689,843,313	―	2.3737	―
11月末日	111,450,201,376	―	2.3658	―
12月末日	113,418,514,745	―	2.3971	―
2026年1月末日	116,407,048,421	―	2.4207	―
2月末日	118,226,496,416	―	2.4239	―
3月末日	111,826,922,520	―	2.2221	―
4月末日	126,867,139,003	―	2.4533	―
5月末日	134,941,773,528	―	2.5790	―

② 【分配の推移】

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

第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

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

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
第1計算期間	15,911,823,542	958,970,794
第2計算期間	15,243,885,793	4,536,508,120
第3計算期間	9,938,067,643	7,085,414,359
第4計算期間	12,720,408,945	8,198,873,384
第5計算期間	7,978,557,364	9,493,197,837
第6計算期間	10,317,685,523	7,272,108,784
第7計算期間	12,181,359,226	7,570,904,254
第8計算期間	13,600,258,382	10,737,911,528
第9計算期間	12,127,063,344	10,412,415,001

（注） 当初設定数量は1,000,000口です。

（参考）マザーファンド

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

(1) 投資状況（2026年5月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		189,317,118,670	93.34
	内 香港	953,728,565	0.47

	内 シンガポール	818,180,562	0.40
	内 イスラエル	600,321,292	0.30
	内 ノルウェー	358,772,044	0.18
	内 スウェーデン	1,889,405,464	0.93
	内 デンマーク	882,619,630	0.44
	内 イギリス	7,063,258,194	3.48
	内 アイルランド	215,561,512	0.11
	内 オランダ	2,770,938,980	1.37
	内 ベルギー	545,085,579	0.27
	内 フランス	4,720,995,251	2.33
	内 ドイツ	4,389,419,771	2.16
	内 スイス	4,481,632,680	2.21
	内 ポルトガル	98,505,681	0.05
	内 スペイン	1,848,593,543	0.91
	内 イタリア	1,613,172,381	0.80
	内 フィンランド	640,752,924	0.32
	内 オーストリア	156,847,026	0.08
	内 カナダ	6,952,259,923	3.43
	内 アメリカ	145,361,039,999	71.67
	内 オーストラリア	2,856,902,650	1.41
	内 ニュージーランド	99,125,019	0.05
投資証券		3,052,350,666	1.50
	内 香港	47,666,586	0.02
	内 シンガポール	46,999,480	0.02
	内 イギリス	41,110,600	0.02
	内 フランス	66,183,097	0.03
	内 アメリカ	2,596,874,226	1.28
	内 オーストラリア	253,516,677	0.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		10,448,247,785	5.15
純資産総額		202,817,717,121	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）		13,762,716,099	6.79
	内 イギリス	582,280,959	0.29
	内 ドイツ	1,953,292,811	0.96
	内 カナダ	418,365,648	0.21
	内 アメリカ	10,513,559,653	5.18

	内　オーストラリア	295,217,028	0.15
為替予約取引(買建)		239,022,600	0.12
	内　日本	239,022,600	0.12
為替予約取引(売建)		184,147,295,094	△90.79
	内　日本	184,147,295,094	△90.79

(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（2026年5月29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	342,210	29,756.83 10,183,107,969	34,149.30 11,686,234,520	5.76
2	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	206,863	41,699.13 8,626,019,815	49,810.96 10,304,046,460	5.08
3	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	99,316	74,831.37 7,431,966,785	68,057.93 6,759,241,982	3.33
4	AMAZON COM INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	135,285	39,112.55 5,291,357,152	43,672.86 5,908,282,865	2.91
5	ALPHABET INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	81,788	53,173.77 4,348,989,858	62,182.82 5,085,808,539	2.51
6	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	63,340	56,286.34 3,565,184,356	67,992.58 4,306,650,410	2.12
7	ALPHABET INC CLASS C	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	68,380	53,259.37 3,641,884,625	61,543.66 4,208,355,936	2.07

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	30,607	101,886.07 3,118,430,697	101,258.87 3,099,230,329	1.53
9	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	39,786	71,158.39 2,831,109,688	70,466.31 2,803,572,968	1.38
10	MICRON TECHNOLOGY INC	アメリカ	株式	情報技術	15,846	58,851.72 932,566,443	147,199.85 2,332,528,867	1.15
11	ELI LILLY	アメリカ	株式	ヘルスケア	11,285	171,147.56 1,931,400,897	179,600.65 2,026,793,358	1.00
12	ADVANCED MICRO DEVICES INC	アメリカ	株式	情報技術	22,927	34,985.46 802,112,711	82,578.36 1,893,274,177	0.93
13	JPMORGAN CHASE	アメリカ	株式	金融	38,329	51,286.12 1,965,749,460	47,295.79 1,812,800,515	0.89
14	BERKSHIRE HATHAWAY INC CLASS B	アメリカ	株式	金融	19,319	79,276.28 1,531,540,564	76,095.97 1,470,098,118	0.72
15	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	5,392	205,109.55 1,105,950,843	258,253.06 1,392,500,500	0.69
16	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	59,329	20,212.40 1,199,187,619	23,423.95 1,389,719,791	0.69
17	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	33,894	33,788.60 1,145,235,126	36,787.21 1,246,865,764	0.61
18	VISA INC CLASS A	アメリカ	株式	金融	23,720	54,278.51 1,287,489,365	51,793.78 1,228,548,473	0.61
19	INTEL CORPORATION	アメリカ	株式	情報技術	63,541	7,603.06 483,112,072	19,268.65 1,224,349,741	0.60
20	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需品	61,667	18,961.83 1,169,325,284	18,951.47 1,168,680,362	0.58
21	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	55,580	12,010.51 667,545,467	18,910.02 1,051,019,445	0.52
22	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	6,280	151,402.01 950,805,469	158,624.92 996,164,548	0.49
23	MASTERCARD INC CLASS A	アメリカ	株式	金融	11,938	89,241.50 1,065,365,374	78,698.81 939,506,424	0.46
24	CATERPILLAR INC	アメリカ	株式	資本財･サービス	6,618	103,055.83 682,024,145	141,485.72 936,352,504	0.46
25	LAM RESEARCH CORP	アメリカ	株式	情報技術	17,690	35,763.45 632,655,841	50,686.02 896,635,694	0.44

26	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	24,859	34,948.80 868,794,813	34,847.43 866,272,404	0.43
27	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	59,600	14,185.55 845,461,494	13,764.92 820,389,256	0.40
28	APPLIED MATERIAL INC	アメリカ	株式	情報技術	11,118	50,198.76 558,110,002	71,674.49 796,877,038	0.39
29	ORACLE CORP	アメリカ	株式	情報技術	24,260	31,995.62 776,214,094	32,467.74 787,667,445	0.39
30	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	26,981	26,249.77 708,248,866	29,173.15 787,120,806	0.39

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	93.34%
投資証券	1.50%
合計	94.85%

(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	3.78%
素材	3.20%
資本財・サービス	9.95%
一般消費財・サービス	8.49%
生活必需品	4.87%
ヘルスケア	8.32%
金融	14.36%
情報技術	29.30%
コミュニケーション・サービス	8.42%
公益事業	2.45%
不動産	0.21%
合計	93.34%

(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 JUN 26	買建	174	10,309,014,928	10,513,559,653	5.18%
	イギリス	FTSE 100 INDEX JUN 26	買建	26	583,058,118	582,280,959	0.29%
	オーストラリア	SPI 200 JUN 26	買建	12	299,759,460	295,217,028	0.15%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX JUN 26	買建	9	415,625,986	418,365,648	0.21%
	ドイツ	SWISS MKT IX JUN 26	買建	15	405,995,945	411,652,005	0.20%
		EURO STOXX 50 JUN 26	買建	137	1,525,454,875	1,541,640,806	0.76%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2026年6月	買建	1,500,000	239,015,700	239,022,600	0.12%
		ノルウェー・クローネ売/円買 2026年6月	売建	20,839,900	352,165,407	358,419,188	△0.18%
		米ドル売/円買 2026年6月	売建	888,097,500	139,104,634,024	141,418,336,846	△69.73%
		豪ドル売/円買 2026年6月	売建	27,625,400	3,114,354,565	3,148,886,744	△1.55%
		英ポンド売/円買 2026年6月	売建	31,928,000	6,802,397,178	6,835,372,928	△3.37%
		イスラエル・シュケル売/円買 2026年6月	売建	8,278,500	440,283,744	466,304,725	△0.23%
		ユーロ売/円買 2026年6月	売建	87,538,800	16,106,992,651	16,244,688,915	△8.01%
		デンマーク・クローネ売/円買 2026年6月	売建	34,167,600	841,288,574	848,480,594	△0.42%
		シンガポール・ドル売/円買 2026年6月	売建	5,902,200	727,924,249	736,819,433	△0.36%
		スイス・フラン売/円買 2026年6月	売建	21,163,300	4,258,836,734	4,303,400,446	△2.12%
		ニュージーランド・ドル売/円買 2026年6月	売建	963,600	89,287,159	91,284,911	△0.05%
		スウェーデン・クローネ売/円買 2026年6月	売建	97,499,000	1,655,903,139	1,678,591,533	△0.83%

		香港ドル売/円買 2026年6月	売建	49,242,200	986,136,235	1,001,064,380	△0.49%
		カナダ・ドル売/円買 2026年6月	売建	60,718,800	7,012,692,489	7,015,644,451	△3.46%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●FW 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

2026年5月29日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	25,790円
純資産総額	1,349億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	5.1%
3カ月間	6.4%
6カ月間	9.0%
1年間	22.1%
3年間	52.7%
5年間	47.0%
設定来	157.9%

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

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

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

主要な資産の状況　　※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国株式・先物	1,092	100.1%
外国リート	41	1.5%
外国投資証券	3	0.1%
外国ワラント	1	0.0%
コール・ローン、その他		5.2%
合計	1,137	－

国・地域別構成	比率
アメリカ	78.1%
イギリス	3.8%
その他	19.7%
合計	101.6%

通貨別構成	比率
日本円	92.9%
米ドル	5.9%
ユーロ	0.6%
カナダ・ドル	0.2%
英ポンド	0.2%
スイス・フラン	0.1%
スウェーデン・クローネ	0.0%
デンマーク・クローネ	0.0%
シンガポール・ドル	0.0%
その他	0.0%
合計	100.0%

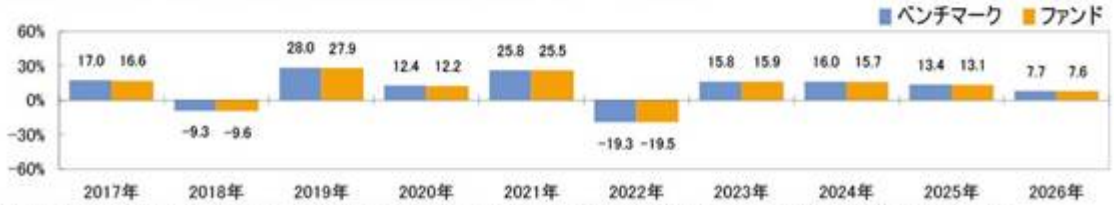
株式業種別構成	比率
情報技術	29.3%
金融	14.4%
資本財・サービス	9.9%
一般消費財・サービス	8.5%
コミュニケーション・サービス	8.4%
ヘルスケア	8.3%
生活必需品	4.9%
エネルギー	3.8%
素材	3.2%
公益事業、他	2.7%
合計	93.3%

組入上位10銘柄	国・地域名	比率
NVIDIA CORP	アメリカ	5.8%
S&P500 EMINI JUN 26	アメリカ	5.2%
APPLE INC	アメリカ	5.1%
MICROSOFT CORP	アメリカ	3.3%
AMAZON COM INC	アメリカ	2.9%
ALPHABET INC CLASS A	アメリカ	2.5%
BROADCOM INC	アメリカ	2.1%
ALPHABET INC CLASS C	アメリカ	2.1%
META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	1.5%
TESLA INC	アメリカ	1.4%
合計		31.9%

※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。
・2026年は5月29日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ　外国株式インデックス（為替ヘッジなし）】

(1)　【投資状況】　(2026年5月29日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		91,462,196,611	99.99
	内 日本	91,462,196,611	99.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		9,126,650	0.01
純資産総額		91,471,323,261	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】（2026年5月29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	9,548,198,832	7.4027 70,683,056,011	9.5790 91,462,196,611	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	1,719,851,096	1,719,851,096	1.2232	1.2232
第2計算期間末 (2018年6月15日)	3,307,440,968	3,307,440,968	1.3931	1.3931
第3計算期間末 (2019年6月17日)	4,523,386,578	4,523,386,578	1.4011	1.4011
第4計算期間末 (2020年6月15日)	5,717,881,883	5,717,881,883	1.4231	1.4231
第5計算期間末 (2021年6月15日)	9,292,062,179	9,292,062,179	2.0848	2.0848
第6計算期間末 (2022年6月15日)	10,844,781,442	10,844,781,442	2.1770	2.1770
第7計算期間末 (2023年6月15日)	17,911,076,601	17,911,076,601	2.6685	2.6685
第8計算期間末 (2024年6月17日)	34,939,206,897	34,939,206,897	3.6322	3.6322
2025年5月末日	46,590,392,049	―	3.7048	―
第9計算期間末 (2025年6月16日)	47,829,844,439	47,829,844,439	3.7633	3.7633
6月末日	49,700,506,113	―	3.8795	―
7月末日	53,526,774,802	―	4.0931	―
8月末日	54,715,611,263	―	4.1252	―
9月末日	58,431,142,393	―	4.2745	―
10月末日	62,917,551,965	―	4.5203	―
11月末日	66,546,203,297	―	4.5909	―
12月末日	69,206,324,193	―	4.6818	―
2026年1月末日	71,172,819,100	―	4.6748	―
2月末日	75,184,132,941	―	4.7431	―
3月末日	73,401,953,482	―	4.4520	―
4月末日	85,650,899,873	―	4.9548	―
5月末日	91,471,323,261	―	5.1933	―

② 【分配の推移】

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

第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

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

(4) 【設定及び解約の実績】

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

（注） 当初設定数量は1,000,000口です。

（参考）マザーファンド

外国株式インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2026年5月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		995,626,410,719	93.91
	内　香港	4,895,580,230	0.46
	内　シンガポール	4,213,694,329	0.40
	内　イスラエル	3,118,967,640	0.29
	内　ノルウェー	1,818,231,266	0.17
	内　スウェーデン	9,659,673,018	0.91
	内　デンマーク	4,547,289,284	0.43
	内　イギリス	36,762,088,855	3.47
	内　アイルランド	1,092,366,455	0.10
	内　オランダ	14,274,295,717	1.35
	内　ベルギー	2,847,776,427	0.27
	内　フランス	24,323,910,443	2.29
	内　ドイツ	22,586,302,475	2.13
	内　スイス	22,282,878,033	2.10
	内　ポルトガル	509,323,859	0.05
	内　スペイン	9,502,777,379	0.90
	内　イタリア	8,261,464,832	0.78
	内　フィンランド	3,290,000,216	0.31
	内　オーストリア	832,032,666	0.08
	内　カナダ	33,364,001,388	3.15
	内　アメリカ	772,468,538,914	72.86
	内　オーストラリア	14,481,596,701	1.37
	内　ニュージーランド	493,620,592	0.05
投資証券		16,007,099,838	1.51
	内　香港	237,595,201	0.02
	内　シンガポール	230,336,136	0.02
	内　イギリス	214,027,614	0.02
	内　フランス	346,564,316	0.03
	内　アメリカ	13,692,628,074	1.29
	内　オーストラリア	1,285,948,497	0.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		48,546,557,249	4.58
純資産総額		1,060,180,067,806	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）		48,877,495,655	4.61
	内　イギリス	2,530,682,630	0.24

	内 ドイツ	10,930,914,077	1.03
	内 カナダ	4,462,566,912	0.42
	内 アメリカ	29,305,036,963	2.76
	内 オーストラリア	1,648,295,073	0.16
為替予約取引(買建)		21,539,604,660	2.03
	内 日本	21,539,604,660	2.03

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

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

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

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

(2) 投資資産（2026年5月29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	1,824,100	28,259.36 51,548,017,856	34,149.30 62,291,751,811	5.88
2	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	1,103,000	44,348.19 48,916,074,383	49,810.96 54,941,498,697	5.18
3	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	530,060	77,735.61 41,204,621,788	68,057.93 36,074,789,609	3.40
4	AMAZON COM INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	722,300	36,945.64 26,685,924,464	43,672.86 31,544,906,778	2.98
5	ALPHABET INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	436,900	50,957.77 22,263,511,361	62,182.82 27,167,674,364	2.56
6	BROADCOM INC	アメリカ	株式	情報技術	338,180	63,618.12 21,514,392,323	67,992.58 22,993,732,801	2.17
7	ALPHABET INC CLASS C	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	365,340	50,955.86 18,616,229,328	61,543.66 22,484,363,229	2.12

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	163,520	103,286.15 16,889,373,458	101,258.87 16,557,850,929	1.56
9	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財･サービス	212,190	68,427.40 14,519,638,218	70,466.31 14,952,248,229	1.41
10	MICRON TECHNOLOGY INC	アメリカ	株式	情報技術	84,500	39,060.11 3,300,582,770	147,199.85 12,438,387,562	1.17
11	ELI LILLY	アメリカ	株式	ヘルスケア	60,325	171,186.61 10,326,837,001	179,600.65 10,834,409,332	1.02
12	ADVANCED MICRO DEVICES INC	アメリカ	株式	情報技術	122,227	34,563.56 4,224,601,237	82,578.36 10,093,305,831	0.95
13	JPMORGAN CHASE	アメリカ	株式	金融	204,270	49,838.70 10,180,584,156	47,295.79 9,661,111,983	0.91
14	BERKSHIRE HATHAWAY INC CLASS B	アメリカ	株式	金融	103,250	81,812.01 8,447,098,507	76,095.97 7,856,909,295	0.74
15	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	316,509	18,672.37 5,909,985,992	23,423.95 7,413,892,383	0.70
16	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	27,711	169,148.32 4,687,273,604	258,253.06 7,156,450,546	0.68
17	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	180,900	33,270.11 6,018,571,500	36,787.21 6,654,806,651	0.63
18	VISA INC CLASS A	アメリカ	株式	金融	126,510	53,237.05 6,735,032,356	51,793.78 6,552,431,171	0.62
19	INTEL CORPORATION	アメリカ	株式	情報技術	339,300	6,505.02 2,207,197,335	19,268.65 6,537,855,354	0.62
20	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需品	329,100	17,768.47 5,847,625,247	18,951.47 6,236,929,106	0.59
21	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	296,650	12,260.75 3,637,185,919	18,910.02 5,609,660,281	0.53
22	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	33,320	146,303.92 4,874,851,469	158,624.92 5,285,382,601	0.50
23	MASTERCARD INC CLASS A	アメリカ	株式	金融	63,580	87,586.71 5,568,771,996	78,698.81 5,003,670,499	0.47
24	CATERPILLAR INC	アメリカ	株式	資本財･サービス	35,120	93,023.35 3,266,984,314	141,485.72 4,968,978,532	0.47
25	LAM RESEARCH CORP	アメリカ	株式	情報技術	94,300	25,391.78 2,394,460,184	50,686.02 4,779,691,686	0.45

26	ABBVIE INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	132,672	36,304.26 4,816,569,814	34,847.43 4,623,278,989	0.44
27	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	318,060	16,980.29 5,400,779,287	13,764.92 4,378,070,582	0.41
28	APPLIED MATERIAL INC	アメリカ	株式	情報技術	59,500	40,798.42 2,427,507,628	71,674.49 4,264,632,464	0.40
29	ORACLE CORP	アメリカ	株式	情報技術	129,453	31,757.81 4,111,145,338	32,467.74 4,203,046,735	0.40
30	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	143,618	24,289.28 3,488,381,542	29,173.15 4,189,789,701	0.40

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	93.91%
投資証券	1.51%
合計	95.42%

(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	3.77%
素材	3.15%
資本財・サービス	9.91%
一般消費財・サービス	8.56%
生活必需品	4.88%
ヘルスケア	8.37%
金融	14.29%
情報技術	29.76%
コミュニケーション・サービス	8.57%
公益事業	2.45%
不動産	0.21%
合計	93.91%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

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 JUN 26	買建	485	27,058,452,207	29,305,036,963	2.76%
	イギリス	FTSE 100 INDEX JUN 26	買建	113	2,508,348,444	2,530,682,630	0.24%
	オーストラリア	SPI 200 JUN 26	買建	67	1,659,299,265	1,648,295,073	0.16%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX JUN 26	買建	96	4,269,434,686	4,462,566,912	0.42%
	ドイツ	SWISS MKT IX JUN 26	買建	108	2,816,726,989	2,963,894,436	0.28%
		EURO STOXX 50 JUN 26	買建	708	7,520,815,165	7,967,019,641	0.75%
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2026年6月	買建	4,800,000	541,785,540	547,364,160	0.05%
		米ドル買/円売 2026年6月	買建	85,500,000	13,427,766,790	13,619,542,950	1.28%
		ユーロ買/円売 2026年6月	買建	16,800,000	3,090,433,280	3,118,138,800	0.29%
		スイス・フラン買/円売 2026年6月	買建	7,200,000	1,448,748,510	1,463,955,120	0.14%
		英ポンド買/円売 2026年6月	買建	2,400,000	510,864,120	513,994,800	0.05%
		カナダ・ドル買/円売 2026年6月	買建	19,700,000	2,275,359,410	2,276,608,830	0.21%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●FW 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)

2026年5月29日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	51,933円
純資産総額	914億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	4.8%
3カ月間	9.5%
6カ月間	13.1%
1年間	40.2%
3年間	102.9%
5年間	153.5%
設定来	419.3%

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

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

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

主要な資産の状況　　※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国株式・先物	1,092	98.5%
外国リート	41	1.5%
外国投資証券	3	0.1%
コール・ローン、その他		4.6%
合計	1,136	－

国・地域別構成	比率
アメリカ	76.9%
イギリス	3.7%
その他	19.4%
合計	100.0%

通貨別構成	比率
米ドル	77.2%
ユーロ	8.9%
英ポンド	3.6%
カナダ・ドル	3.6%
スイス・フラン	2.4%
豪ドル	1.6%
スウェーデン・クローネ	0.8%
香港ドル	0.5%
デンマーク・クローネ	0.4%
その他	0.9%
合計	100.0%

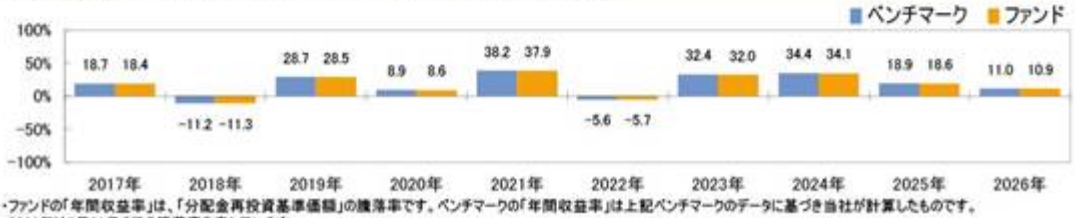
株式業種別構成	比率
情報技術	29.8%
金融	14.3%
資本財・サービス	9.9%
コミュニケーション・サービス	8.6%
一般消費財・サービス	8.6%
ヘルスケア	8.4%
生活必需品	4.9%
エネルギー	3.8%
素材	3.1%
公益事業、他	2.7%
合計	93.9%

組入上位10銘柄	国・地域名	比率
NVIDIA CORP	アメリカ	5.9%
APPLE INC	アメリカ	5.2%
MICROSOFT CORP	アメリカ	3.4%
AMAZON COM INC	アメリカ	3.0%
S&P500 EMINI JUN 26	アメリカ	2.8%
ALPHABET INC CLASS A	アメリカ	2.6%
BROADCOM INC	アメリカ	2.2%
ALPHABET INC CLASS C	アメリカ	2.1%
META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	1.6%
TESLA INC	アメリカ	1.4%
合計		30.0%

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

年間収益率の推移

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



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2026年は5月29日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

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

(1) 【投資状況】（2026年5月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	10,408,187,634	99.20

	内 日本	10,408,187,634	99.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		83,931,022	0.80
純資産総額		10,492,118,656	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】（2026年5月29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	860,490,987	7.1646 6,165,131,427	9.5790 8,242,643,164	78.56
2	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	514,882,539	3.0967 1,594,471,752	4.2059 2,165,544,470	20.64

(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
親投資信託受益証券	99.20%
合計	99.20%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	826,097,593	826,097,593	1.2158	1.2158
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,697,993,255	1,697,993,255	1.3778	1.3778
第3計算期間末 (2019年6月17日)	1,747,579,023	1,747,579,023	1.3793	1.3793
第4計算期間末 (2020年6月15日)	1,800,845,481	1,800,845,481	1.3573	1.3573
第5計算期間末 (2021年6月15日)	2,402,518,423	2,402,518,423	1.9822	1.9822
第6計算期間末 (2022年6月15日)	2,605,876,138	2,605,876,138	2.0510	2.0510
第7計算期間末 (2023年6月15日)	3,957,729,997	3,957,729,997	2.4679	2.4679
第8計算期間末 (2024年6月17日)	6,422,264,022	6,422,264,022	3.2881	3.2881
2025年5月末日	6,902,563,300	－	3.3839	－
第9計算期間末 (2025年6月16日)	7,010,796,263	7,010,796,263	3.4419	3.4419
6月末日	7,242,162,144	－	3.5417	－
7月末日	7,656,388,036	－	3.7326	－
8月末日	7,696,768,668	－	3.7544	－
9月末日	8,111,977,541	－	3.9091	－
10月末日	8,612,462,299	－	4.1446	－
11月末日	8,713,217,232	－	4.2027	－
12月末日	8,911,721,577	－	4.2766	－
2026年1月末日	9,376,720,021	－	4.3492	－
2月末日	9,615,910,533	－	4.4197	－
3月末日	9,074,794,707	－	4.1426	－
4月末日	10,205,969,692	－	4.5842	－
5月末日	10,492,118,656	－	4.7616	－

② 【分配の推移】

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

第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

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

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	702,644,049	33,190,572
第2計算期間	695,338,362	142,407,106
第3計算期間	339,152,791	304,533,894
第4計算期間	415,919,823	356,157,946
第5計算期間	193,724,602	308,457,694
第6計算期間	295,982,191	237,478,525
第7計算期間	541,659,096	208,501,672
第8計算期間	802,382,236	452,915,615
第9計算期間	415,794,997	332,050,411

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

（参考）マザーファンド

外国株式インデックスマザーファンド

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

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（2026年5月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		69,599,870,085	89.36
	内 中国	26,161,282,141	33.59
	内 台湾	17,122,922,499	21.98
	内 タイ	1,694,581,995	2.18
	内 シンガポール	50,497,927	0.06
	内 マレーシア	397,978,527	0.51
	内 インドネシア	570,383,168	0.73
	内 インド	7,595,315,410	9.75
	内 サウジアラビア	913,854,982	1.17
	内 トルコ	1,409,950,153	1.81
	内 メキシコ	1,795,137,690	2.30
	内 チリ	346,324,007	0.44
	内 ブラジル	8,965,570,241	11.51
	内 南アフリカ	2,576,071,345	3.31
投資証券		4,356,276,933	5.59
	内 アメリカ	4,356,276,933	5.59
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,934,248,807	5.05
純資産総額		77,890,395,825	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引（買建）		3,864,539,656	4.96
	内 アメリカ	3,864,539,656	4.96
為替予約取引（買建）		176,288,281	0.23
	内 日本	176,288,281	0.23
為替予約取引（売建）		1,069,050	△0.00
	内 日本	1,069,050	△0.00

(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。

(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（2026年5月29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	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	台湾	株式	情報技術	424,000	6,055.49 2,567,532,160	11,638.17 4,934,585,988	6.34
2	INVESCO RAFI EMERGING MARKETS ETF (ETF)	アメリカ	投資証券	―	940,500	4,124.21 3,878,854,711	4,631.87 4,356,276,933	5.59
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	中国	株式	一般消費財･サービス	888,000	2,358.89 2,094,705,488	2,477.41 2,199,941,856	2.82
4	VALE SA	ブラジル	株式	素材	724,290	1,865.25 1,351,004,578	2,654.21 1,922,424,340	2.47
5	MEDIATEK INC	台湾	株式	情報技術	79,003	7,057.97 557,601,421	22,363.55 1,766,787,620	2.27
6	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	株式	コミュニケーション･サービス	179,700	10,364.81 1,862,560,857	8,644.50 1,553,416,650	1.99
7	HON HAI PRECISION INDUSTRY LTD	台湾	株式	情報技術	1,125,902	872.76 982,653,280	1,333.69 1,501,614,709	1.93
8	PETROLEO BRASILEIRO PREF SA	ブラジル	株式	エネルギー	1,050,100	1,092.73 1,147,490,557	1,343.86 1,411,191,984	1.81
9	INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF	中国	株式	金融	9,861,000	126.23 1,244,927,255	134.04 1,321,774,357	1.70
10	JD.COM CLASS A INC	中国	株式	一般消費財･サービス	568,745	2,340.50 1,331,152,252	2,322.82 1,321,096,811	1.70
11	PETROLEO BRASILEIRO SA	ブラジル	株式	エネルギー	846,900	1,255.19 1,063,039,399	1,502.87 1,272,786,757	1.63
12	PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CH	中国	株式	金融	1,007,000	1,057.82 1,065,234,863	1,205.14 1,213,581,015	1.56
13	CHINA CONSTRUCTION BANK CORP H	中国	株式	金融	6,374,000	166.93 1,064,030,017	172.48 1,099,407,917	1.41
14	BANK OF CHINA LTD H	中国	株式	金融	10,123,000	93.82 949,853,595	104.34 1,056,276,337	1.36

15	UNITED MICRO ELECTRONICS CORP	台湾	株式	情報技術	1,220,000	235.02 286,726,095	720.09 878,517,364	1.13
16	PETROCHINA LTD H	中国	株式	エネルギー	3,424,000	149.35 511,456,383	219.26 750,764,045	0.96
17	HDFC BANK LTD	インド	株式	金融	556,370	1,528.24 850,269,328	1,274.53 709,111,369	0.91
18	CHINA PETROLEUM AND CHEMICAL CORP	中国	株式	エネルギー	7,261,800	87.13 632,865,655	88.27 641,039,752	0.82
19	ASE TECHNOLOGY HOLDING LTD	台湾	株式	情報技術	195,000	935.84 182,490,912	3,179.57 620,018,042	0.80
20	ITAU UNIBANCO HOLDING PREF SA	ブラジル	株式	金融	470,556	1,189.15 559,566,698	1,264.51 595,025,591	0.76
21	BAIDU CLASS A INC	中国	株式	コミュニケーション･サービス	227,100	1,877.42 426,365,499	2,554.70 580,173,278	0.74
22	AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD H	中国	株式	金融	4,919,000	115.38 567,676,471	114.92 565,296,399	0.73
23	CHINA MERCHANTS BANK LTD H	中国	株式	金融	559,500	1,032.19 577,516,342	934.01 522,580,162	0.67
24	ICICI BANK LTD	インド	株式	金融	236,052	2,265.74 534,834,645	2,138.13 504,711,279	0.65
25	INFOSYS LTD	インド	株式	情報技術	239,800	2,390.21 573,174,286	1,948.63 467,281,954	0.60
26	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	株式	エネルギー	199,330	2,536.44 505,589,420	2,268.84 452,247,877	0.58
27	MEITUAN	中国	株式	一般消費財･サービス	290,990	1,853.09 539,232,926	1,490.92 433,843,393	0.56
28	BANCO BRADESCO PREF SA	ブラジル	株式	金融	752,659	543.07 408,776,195	565.87 425,907,833	0.55
29	DELTA ELECTRONICS INC	台湾	株式	情報技術	33,000	3,113.48 102,745,080	12,119.92 399,957,657	0.51
30	PDD HOLDINGS ADS INC	中国	株式	一般消費財･サービス	30,200	15,907.44 480,407,676	13,234.15 399,671,381	0.51

（注）　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率

株式	89.36%
投資証券	5.59%
合計	94.95%

(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

業種	投資比率
エネルギー	8.70%
素材	9.47%
資本財・サービス	4.32%
一般消費財・サービス	9.31%
生活必需品	2.68%
ヘルスケア	0.88%
金融	24.66%
情報技術	20.90%
コミュニケーション・サービス	5.29%
公益事業	1.98%
不動産	0.91%
その他	0.25%
合計	89.36%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	アメリカ	MSCI EMER MKT INDEX (ICE) JUN 26	買建	277	3,318,548,653	3,864,539,656	4.96%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2026年6月	買建	1,106,690	174,423,394	176,288,281	0.23%
		サウジアラビア・リアル売/円買 2026年6月	売建	25,119	1,067,794	1,069,050	△0.00%

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●FW 外国株式インデックスEM+（為替ヘッジなし）

2026年5月29日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	47,616円
純資産総額	104億円

当初設定日（2016年9月26日）～2026年5月29日

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	3.9%
3カ月間	7.7%
6カ月間	13.3%
1年間	40.7%
3年間	101.9%
5年間	145.1%
設定来	376.2%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

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

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国株式・先物	1,524	96.9%
外国投資証券	4	1.2%
外国リート	41	1.1%
コール・ローン、その他		5.4%
合計	1,569	－

国・地域別構成	比率
アメリカ	62.6%
中国	6.9%
その他	29.7%
合計	99.2%

通貨別構成	比率
米ドル	62.6%
ユーロ	7.0%
香港ドル	6.2%
台湾ドル	4.6%
英ポンド	2.9%
カナダ・ドル	2.8%
ブラジル・レアル	2.4%
インド・ルピー	2.2%
スイス・フラン	1.9%
その他	7.5%
合計	100.0%

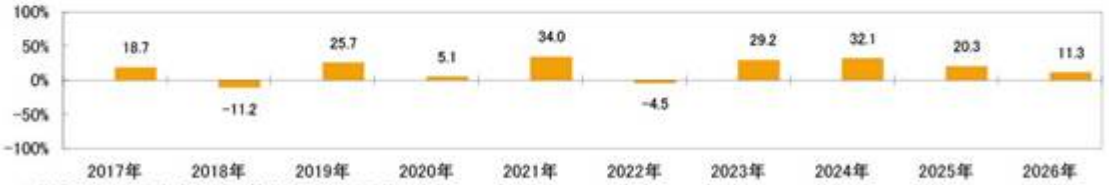
株式業種別構成	比率
情報技術	27.7%
金融	16.3%
資本財・サービス	8.7%
一般消費財・サービス	8.6%
コミュニケーション・サービス	7.8%
ヘルスケア	6.8%
エネルギー	4.8%
素材	4.4%
生活必需品	4.4%
公益事業、他	2.7%
合計	92.2%

組入上位10銘柄	国・地域名	比率
NVIDIA CORP	アメリカ	4.6%
APPLE INC	アメリカ	4.1%
MICROSOFT CORP	アメリカ	2.7%
AMAZON COM INC	アメリカ	2.3%
S&P500 EMINI JUN 26	アメリカ	2.2%
ALPHABET INC CLASS A	アメリカ	2.0%
BROADCOM INC	アメリカ	1.7%
ALPHABET INC CLASS C	アメリカ	1.7%
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	台湾	1.3%
META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	1.2%
合計		23.8%

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

年間収益率の推移

当ファンド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。
・2026年は5月29日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 日本債券インデックス】

(1) 【投資状況】 (2026年5月29日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		53,590,538,530	99.90
	内 日本	53,590,538,530	99.90
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		53,010,507	0.10
純資産総額		53,643,549,037	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】 (2026年5月29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	44,737,071,985	1.2605 56,393,058,709	1.1979 53,590,538,530	99.90

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	14,248,194,432	14,248,194,432	0.9858	0.9858
第2計算期間末 (2018年6月15日)	25,120,930,051	25,120,930,051	0.9915	0.9915
第3計算期間末 (2019年6月17日)	27,372,292,105	27,372,292,105	1.0149	1.0149
第4計算期間末 (2020年6月15日)	33,339,891,042	33,339,891,042	1.0024	1.0024
第5計算期間末 (2021年6月15日)	36,597,337,061	36,597,337,061	0.9987	0.9987
第6計算期間末 (2022年6月15日)	36,841,618,949	36,841,618,949	0.9645	0.9645
第7計算期間末 (2023年6月15日)	36,693,031,052	36,693,031,052	0.9659	0.9659
第8計算期間末 (2024年6月17日)	37,969,994,751	37,969,994,751	0.9244	0.9244
2025年5月末日	40,159,926,097	―	0.8874	―
第9計算期間末 (2025年6月16日)	40,577,855,047	40,577,855,047	0.8901	0.8901
6月末日	40,817,797,514	―	0.8919	―
7月末日	41,286,540,620	―	0.8827	―
8月末日	41,739,246,204	―	0.8798	―
9月末日	42,850,526,093	―	0.8789	―
10月末日	44,032,947,435	―	0.8802	―
11月末日	45,974,836,133	―	0.8701	―
12月末日	45,953,850,241	―	0.8593	―
2026年1月末日	46,224,475,937	―	0.8483	―
2月末日	48,394,484,630	―	0.8605	―
3月末日	50,085,420,607	―	0.8446	―
4月末日	52,339,813,410	―	0.8390	―
5月末日	53,643,549,037	―	0.8344	―

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000

第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

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

(4) 【設定及び解約の実績】

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

（注） 当初設定数量は1,000,000口です。

（参考）マザーファンド

日本債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2026年5月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		164,946,933,650	89.61
	内 日本	164,946,933,650	89.61
地方債証券		5,742,750,800	3.12
	内 日本	5,742,750,800	3.12
特殊債券		3,837,916,000	2.09
	内 日本	3,837,916,000	2.09
社債券		7,923,974,500	4.30
	内 日本	7,923,974,500	4.30
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,620,238,134	0.88
純資産総額		184,071,813,084	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（2026年5月29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	163 5年国債	日本	国債証券	3,000,000,000	97.88 2,936,590,000	97.69 2,930,730,000	0.400000 2028/09/20	1.59
2	166 5年国債	日本	国債証券	2,850,000,000	97.53 2,779,774,500	97.35 2,774,589,000	0.400000 2028/12/20	1.51
3	161 5年国債	日本	国債証券	2,410,000,000	97.96 2,360,982,600	97.81 2,357,341,500	0.300000 2028/06/20	1.28
4	365 10年国債	日本	国債証券	2,560,000,000	91.61 2,345,249,800	90.07 2,305,920,000	0.100000 2031/12/20	1.25
5	158 5年国債	日本	国債証券	2,300,000,000	97.81 2,249,761,600	97.82 2,249,860,000	0.100000 2028/03/20	1.22
6	178 5年国債	日本	国債証券	2,300,000,000	98.23 2,259,497,450	97.41 2,240,522,000	1.000000 2030/03/20	1.22
7	364 10年国債	日本	国債証券	2,370,000,000	91.90 2,178,175,800	90.69 2,149,424,100	0.100000 2031/09/20	1.17
8	370 10年国債	日本	国債証券	2,400,000,000	91.94 2,206,654,000	89.36 2,144,688,000	0.500000 2033/03/20	1.17
9	369 10年国債	日本	国債証券	2,380,000,000	92.00 2,189,833,100	89.92 2,140,286,400	0.500000 2032/12/20	1.16

10	362 10年国債	日本	国債証券	2,190,000,000	92.68 2,029,836,700	91.83 2,011,274,100	0.100000 2031/03/20	1.09
11	174 5年国債	日本	国債証券	2,060,000,000	97.61 2,010,959,400	97.11 2,000,548,400	0.700000 2029/09/20	1.09
12	363 10年国債	日本	国債証券	2,070,000,000	92.55 1,915,933,400	91.28 1,889,516,700	0.100000 2031/06/20	1.03
13	183 5年国債	日本	国債証券	1,900,000,000	99.55 1,891,629,500	98.92 1,879,651,000	1.600000 2030/12/20	1.02
14	366 10年国債	日本	国債証券	2,080,000,000	91.49 1,903,161,000	89.99 1,871,792,000	0.200000 2032/03/20	1.02
15	180 5年国債	日本	国債証券	1,920,000,000	97.77 1,877,208,200	97.42 1,870,636,800	1.100000 2030/06/20	1.02
16	377 10年国債	日本	国債証券	1,910,000,000	94.05 1,796,413,350	90.36 1,725,895,100	1.200000 2034/12/20	0.94
17	367 10年国債	日本	国債証券	1,930,000,000	91.33 1,762,708,800	89.36 1,724,744,500	0.200000 2032/06/20	0.94
18	378 10年国債	日本	国債証券	1,870,000,000	95.08 1,778,005,100	91.43 1,709,890,600	1.400000 2035/03/20	0.93
19	375 10年国債	日本	国債証券	1,870,000,000	93.99 1,757,670,300	90.64 1,695,080,200	1.100000 2034/06/20	0.92
20	372 10年国債	日本	国債証券	1,850,000,000	92.80 1,716,863,000	90.16 1,668,108,000	0.800000 2033/09/20	0.91
21	373 10年国債	日本	国債証券	1,870,000,000	90.68 1,695,849,900	88.23 1,650,013,200	0.600000 2033/12/20	0.90
22	381 10年国債	日本	国債証券	1,700,000,000	98.23 1,669,927,300	95.84 1,629,331,000	2.100000 2035/12/20	0.89
23	371 10年国債	日本	国債証券	1,840,000,000	90.80 1,670,813,800	88.12 1,621,463,200	0.400000 2033/06/20	0.88
24	181 5年国債	日本	国債証券	1,630,000,000	99.63 1,624,086,000	97.92 1,596,161,200	1.300000 2030/09/20	0.87
25	479 2年国債	日本	国債証券	1,580,000,000	99.64 1,574,313,100	99.62 1,574,059,200	1.000000 2027/12/01	0.86
26	154 5年国債	日本	国債証券	1,570,000,000	98.45 1,545,696,400	98.58 1,547,721,700	0.100000 2027/09/20	0.84
27	177 5年国債	日本	国債証券	1,570,000,000	98.72 1,550,042,100	98.10 1,540,232,800	1.100000 2029/12/20	0.84
28	18 40年国債	日本	国債証券	1,770,000,000	89.31 1,580,932,100	85.08 1,506,039,900	3.100000 2065/03/20	0.82
29	360 10年国債	日本	国債証券	1,600,000,000	94.08 1,505,421,300	93.00 1,488,064,000	0.100000 2030/09/20	0.81

30	368 10年国債	日本	国債証券	1,650,000,000	90.81 1,498,426,000	88.73 1,464,045,000	0.200000 2032/09/20	0.80

（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	89.61%
地方債証券	3.12%
特殊債券	2.09%
社債券	4.30%
合計	99.12%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（参考情報）運用実績

●FW 日本債券インデックス

2026年5月29日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	8,344円
純資産総額	536億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-0.5%
3カ月間	-3.0%
6カ月間	-4.1%
1年間	-6.0%
3年間	-13.5%
5年間	-16.3%
設定来	-16.6%

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

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

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

主要な資産の状況　　※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
国内債券	434	99.0%
国内債券先物	-	-
コール・ローン、その他		1.0%
合計	434	100.0%

債券種別構成	比率
国債	89.4%
事業債	4.8%
地方債	3.8%
政府保証債	0.8%
円建外債	0.2%
合計	99.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	1.1
最終利回り(%)	2.3
修正デュレーション	7.6
残存年数	8.8

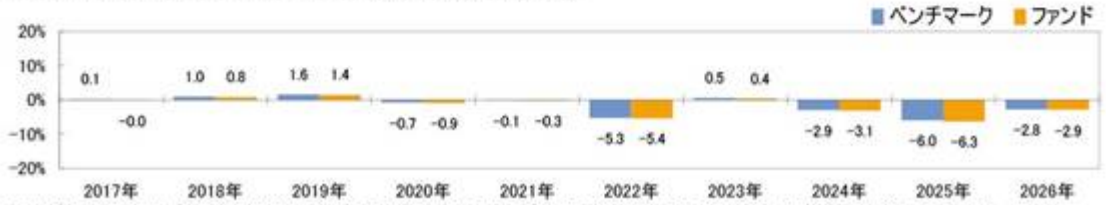
格付別構成	比率
AAA	92.1%
AA	4.9%
A	1.7%
BBB	-
BB以下・無格付	1.3%
合計	100.0%

組入上位10銘柄	利率(%)	償還日	比率
163 5年国債	0.400	2028/09/20	1.6%
166 5年国債	0.400	2028/12/20	1.5%
161 5年国債	0.300	2028/06/20	1.3%
365 10年国債	0.100	2031/12/20	1.3%
158 5年国債	0.100	2028/03/20	1.2%
178 5年国債	1.000	2030/03/20	1.2%
364 10年国債	0.100	2031/09/20	1.2%
370 10年国債	0.500	2033/03/20	1.2%
369 10年国債	0.500	2032/12/20	1.2%
362 10年国債	0.100	2031/03/20	1.1%
合計			12.6%

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を1.3%保有しております。
※格付別構成については、当社所定の基準で採用した格付けを基準に算出しています。

年間収益率の推移

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



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2026年は5月29日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）】

(1) 【投資状況】（2026年5月29日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)

親投資信託受益証券		113,073,491,128	99.70
	内　日本	113,073,491,128	99.70
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		335,412,351	0.30
純資産総額		113,408,903,479	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】（2026年5月29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	136,167,498,950	0.8343 113,606,577,103	0.8304 113,073,491,128	99.70

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.70%
合計	99.70%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

②　【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③　【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)　【運用実績】

①　【純資産の推移】

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

第1計算期間末 (2017年6月15日)	33,745,104,093	33,745,104,093	0.9710	0.9710
第2計算期間末 (2018年6月15日)	61,154,884,176	61,154,884,176	0.9475	0.9475
第3計算期間末 (2019年6月17日)	72,847,478,521	72,847,478,521	0.9905	0.9905
第4計算期間末 (2020年6月15日)	87,728,604,640	87,728,604,640	1.0451	1.0451
第5計算期間末 (2021年6月15日)	98,409,882,734	98,409,882,734	1.0198	1.0198
第6計算期間末 (2022年6月15日)	97,518,003,285	97,518,003,285	0.8787	0.8787
第7計算期間末 (2023年6月15日)	98,451,825,948	98,451,825,948	0.8378	0.8378
第8計算期間末 (2024年6月17日)	98,185,393,699	98,185,393,699	0.8148	0.8148
2025年5月末日	97,730,963,664	―	0.8044	―
第9計算期間末 (2025年6月16日)	97,637,894,820	97,637,894,820	0.8047	0.8047
6月末日	98,374,166,856	―	0.8071	―
7月末日	98,479,828,596	―	0.8027	―
8月末日	99,447,775,491	―	0.8044	―
9月末日	101,671,357,937	―	0.8060	―
10月末日	103,742,980,379	―	0.8103	―
11月末日	107,318,353,580	―	0.8108	―
12月末日	108,047,218,198	―	0.8059	―
2026年1月末日	109,038,483,345	―	0.8052	―
2月末日	111,641,293,248	―	0.8131	―
3月末日	114,823,297,496	―	0.7960	―
4月末日	112,190,562,712	―	0.7946	―
5月末日	113,408,903,479	―	0.7982	―

② 【分配の推移】

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

第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

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

(4) 【設定及び解約の実績】

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

（注） 当初設定数量は100,000,000口です。

（参考）マザーファンド

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

(1) 投資状況（2026年5月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		155,146,956,595	98.66
	内 ユーロ	44,924,617,250	28.57

	内 韓国	532,469,748	0.34
	内 中国	19,994,974,773	12.71
	内 シンガポール	479,352,677	0.30
	内 マレーシア	785,444,604	0.50
	内 イスラエル	539,704,277	0.34
	内 ノルウェー	244,894,747	0.16
	内 スウェーデン	242,211,639	0.15
	内 デンマーク	327,924,778	0.21
	内 イギリス	8,915,589,520	5.67
	内 ポーランド	986,519,646	0.63
	内 カナダ	3,261,555,046	2.07
	内 アメリカ	70,181,236,660	44.63
	内 メキシコ	1,355,672,313	0.86
	内 オーストラリア	2,037,127,173	1.30
	内 ニュージーランド	337,661,744	0.21
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,113,840,199	1.34
純資産総額		157,260,796,794	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）		1,180,352,016	0.75
	内 ドイツ	1,180,352,016	0.75
為替予約取引（買建）		304,989,369	0.19
	内 日本	304,989,369	0.19
為替予約取引（売建）		157,536,051,587	△100.18
	内 日本	157,536,051,587	△100.18

(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（2026年5月29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 1,384,517,326	98.00 1,405,920,215	2.250000 2027/08/15	0.89
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,950,000	105.08 1,331,547,088	103.08 1,306,292,778	6.125000 2027/11/15	0.83
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	94.33 1,202,933,764	95.23 1,214,347,780	0.500000 2027/10/31	0.77
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	101.35 1,130,806,800	100.46 1,120,929,301	4.250000 2029/06/30	0.71
5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,300,000	100.11 1,005,310,114	99.21 996,304,492	4.125000 2032/11/15	0.63
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,000,000	92.77 887,282,688	94.91 907,662,294	1.250000 2028/04/30	0.58
7	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,000,000	92.61 885,752,544	94.16 900,575,814	1.750000 2029/01/31	0.57
8	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	5,500,000	101.10 886,340,693	101.16 886,831,614	4.500000 2029/05/31	0.56
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	5,000,000	99.61 793,865,803	99.88 796,065,385	3.750000 2027/04/30	0.51
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,000,000	92.97 740,924,415	95.12 758,106,657	1.250000 2028/03/31	0.48
11	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,800,000	99.13 758,446,556	99.03 757,689,055	4.250000 2034/11/15	0.48
12	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	5,000,000	91.46 728,890,470	93.73 747,029,052	1.000000 2028/07/31	0.48
13	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,500,000	100.96 724,198,409	100.01 717,362,588	4.000000 2027/12/15	0.46
14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,500,000	100.62 721,709,850	99.75 715,526,415	3.875000 2028/03/15	0.45
15	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,500,000	99.43 713,216,854	99.48 713,525,274	3.750000 2028/05/15	0.45
16	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,800,000	92.09 704,608,359	92.86 710,499,414	2.875000 2032/05/15	0.45
17	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,500,000	100.73 722,506,466	98.68 707,851,786	4.250000 2035/08/15	0.45
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,000,000	84.64 674,538,480	86.80 691,752,600	0.875000 2030/11/15	0.44
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,500,000	95.50 685,000,042	96.31 690,816,980	2.625000 2029/02/15	0.44
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,500,000	92.33 662,291,749	95.12 682,260,128	0.625000 2027/11/30	0.43

21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,900,000	85.37 666,811,571	87.19 681,018,161	1.125000 2031/02/15	0.43
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,300,000	97.69 669,550,091	98.55 675,500,717	2.375000 2027/05/15	0.43
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,300,000	97.39 667,488,660	97.83 670,524,880	3.125000 2028/11/15	0.43
24	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,200,000	99.42 665,577,046	98.79 661,364,577	4.250000 2035/05/15	0.42
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,500,000	89.51 642,079,503	91.12 653,569,928	1.500000 2030/02/15	0.42
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,600,000	87.05 638,304,032	88.68 650,262,426	1.625000 2031/05/15	0.41
27	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,000,000	101.74 648,666,295	101.62 647,907,598	4.625000 2035/02/15	0.41
28	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,000,000	102.33 652,434,274	101.48 647,046,892	4.625000 2029/04/30	0.41
29	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	4,000,000	99.60 635,067,140	99.66 635,392,296	3.875000 2028/07/15	0.40
30	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,600,000	92.90 620,934,671	93.54 625,218,961	0.500000 2029/05/25	0.40

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.66%
合計	98.66%

(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	ドイツ	EURO-SCHATZ JUN 26	買建	60	1,178,540,717	1,180,352,016	0.75%

為替予約取引	日本	マレーシア・リンギット買/円売 2026年6月	買建	990,000	39,770,478	39,721,869	0.03%
		韓国ウォン買/円売 2026年6月	買建	2,500,000,000	265,350,000	265,267,500	0.17%
		韓国ウォン売/円買 2026年7月	売建	7,823,296,000	828,487,046	828,447,929	△0.53%
		デンマーク・クローネ売/円買 2026年6月	売建	13,334,000	327,753,720	331,164,557	△0.21%
		ユーロ売/円買 2026年6月	売建	244,361,000	44,903,783,309	45,356,236,186	△28.84%
		ニュージーランド・ドル売/円買 2026年6月	売建	3,884,000	357,856,224	368,043,956	△0.23%
		ノルウェー・クローネ売/円買 2026年6月	売建	16,270,000	273,316,476	279,980,668	△0.18%
		米ドル売/円買 2026年6月	売建	447,260,000	70,028,987,797	71,251,559,367	△45.31%
		ポーランド・ズロチ売/円買 2026年6月	売建	23,170,000	997,834,586	1,016,794,597	△0.65%
		豪ドル売/円買 2026年6月	売建	18,176,000	2,045,159,856	2,072,909,184	△1.32%
		オフショア人民元売/円買 2026年6月	売建	860,020,000	19,755,296,316	20,223,284,296	△12.86%
		英ポンド売/円買 2026年6月	売建	41,671,000	8,860,134,278	8,925,257,295	△5.68%
		イスラエル・シュケル売/円買 2026年6月	売建	9,746,000	516,016,589	549,212,439	△0.35%
		マレーシア・リンギット売/円買 2026年6月	売建	18,880,000	755,761,076	756,196,864	△0.48%
		シンガポール・ドル売/円買 2026年6月	売建	4,103,000	504,719,466	512,270,217	△0.33%
		カナダ・ドル売/円買 2026年6月	売建	29,111,000	3,349,074,061	3,364,329,159	△2.14%
		スウェーデン・クローネ売/円買 2026年6月	売建	14,140,000	239,289,806	243,463,934	△0.15%
		メキシコ・ペソ売/円買 2026年6月	売建	158,488,000	1,415,345,362	1,456,900,939	△0.93%

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●FW 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

2026年5月29日現在　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	7,982円
純資産総額	1,134億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.5%
3カ月間	−1.8%
6カ月間	−1.6%
1年間	−0.8%
3年間	−5.3%
5年間	−21.4%
設定来	−20.2%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

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

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

主要な資産の状況　※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国債券・先物	844	99.1%
コール・ローン、その他		1.6%
合計	844	−

債券種別構成	比率
国債	98.4%
合計	98.4%

通貨別構成	比率
日本円	99.8%
ユーロ	0.2%
英ポンド	0.1%
マレーシア・リンギット	0.0%
オフショア人民元	0.0%
カナダ・ドル	0.0%
イスラエル・シュケル	0.0%
デンマーク・クローネ	0.0%
シンガポール・ドル	0.0%
その他	−0.2%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	3.1
最終利回り(%)	3.6
修正デュレーション	6.2
残存年数	8.1

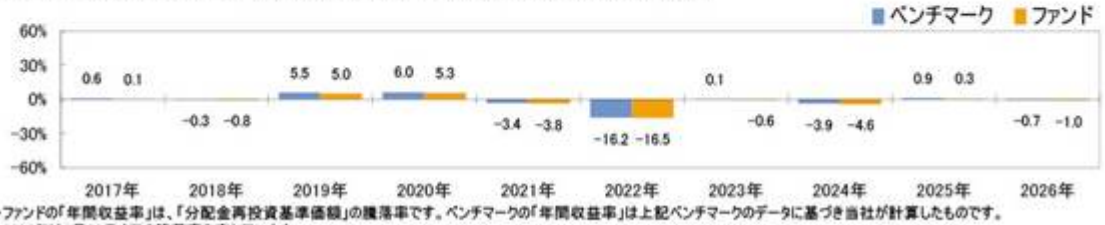
格付別構成	比率
AAA	71.6%
AA	19.4%
A	9.0%
BBB	−
BB	−
合計	100.0%

組入上位10銘柄	償還日	比率
United States Treasury Note/Bond	2027/08/15	0.9%
United States Treasury Note/Bond	2027/11/15	0.8%
United States Treasury Note/Bond	2027/10/31	0.8%
EURO-SCHATZ JUN 26	−	0.7%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2029/06/30	0.7%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2032/11/15	0.6%
United States Treasury Note/Bond	2028/04/30	0.6%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2029/01/31	0.6%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2029/05/31	0.6%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2027/04/30	0.5%
合計		6.8%

※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。
※格付別構成については、当社所定の基準で採用した格付けを基準に算出しています。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

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



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2026年は5月29日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）】

(1) 【投資状況】 (2026年5月29日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		44,892,696,643	99.71
	内 日本	44,892,696,643	99.71
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		132,679,086	0.29
純資産総額		45,025,375,729	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】 (2026年5月29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	10,766,925,685	3.7766 40,662,404,032	4.1695 44,892,696,643	99.71

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	1,404,884,490	1,404,884,490	1.0622	1.0622
第2計算期間末 (2018年6月15日)	2,405,883,300	2,405,883,300	1.0709	1.0709
第3計算期間末 (2019年6月17日)	3,676,403,565	3,676,403,565	1.0978	1.0978
第4計算期間末 (2020年6月15日)	4,949,959,877	4,949,959,877	1.1579	1.1579
第5計算期間末 (2021年6月15日)	6,651,390,787	6,651,390,787	1.2187	1.2187
第6計算期間末 (2022年6月15日)	7,620,837,859	7,620,837,859	1.2025	1.2025
第7計算期間末 (2023年6月15日)	10,267,011,957	10,267,011,957	1.2526	1.2526
第8計算期間末 (2024年6月17日)	18,536,758,820	18,536,758,820	1.4350	1.4350
2025年5月末日	25,399,616,972	－	1.3813	－
第9計算期間末 (2025年6月16日)	26,129,474,574	26,129,474,574	1.3965	1.3965
6月末日	26,803,009,816	－	1.4148	－
7月末日	28,130,631,308	－	1.4398	－
8月末日	28,616,359,563	－	1.4362	－
9月末日	30,276,620,663	－	1.4629	－
10月末日	32,602,179,656	－	1.5188	－
11月末日	36,186,386,578	－	1.5503	－
12月末日	37,280,196,987	－	1.5571	－
2026年1月末日	37,982,870,609	－	1.5429	－
2月末日	40,443,982,741	－	1.5776	－
3月末日	42,016,001,264	－	1.5681	－
4月末日	44,302,974,506	－	1.5889	－
5月末日	45,025,375,729	－	1.5894	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000

第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

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

(4) 【設定及び解約の実績】

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

（注） 当初設定数量は1,000,000口です。

（参考）マザーファンド

外国債券インデックスマザーファンド

(1) 投資状況（2026年5月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		414,908,533,409	97.91
	内 ユーロ	120,830,388,003	28.51
	内 韓国	1,696,418,691	0.40
	内 中国	53,074,116,994	12.52
	内 シンガポール	1,369,727,199	0.32
	内 マレーシア	2,188,753,282	0.52
	内 イスラエル	1,763,708,147	0.42
	内 ノルウェー	601,305,964	0.14
	内 スウェーデン	651,014,916	0.15
	内 デンマーク	782,715,986	0.18
	内 イギリス	23,405,977,482	5.52
	内 ポーランド	2,877,902,782	0.68
	内 カナダ	8,870,962,053	2.09
	内 アメリカ	186,853,397,059	44.09
	内 メキシコ	3,478,434,093	0.82
	内 オーストラリア	5,375,536,602	1.27
	内 ニュージーランド	1,088,174,156	0.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		8,856,346,361	2.09
純資産総額		423,764,879,770	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）		2,326,247,819	0.55
	内 日本	2,326,247,819	0.55

(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（2026年5月29日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率 (%)
1	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	14,700,000	100.15 2,346,671,444	99.17 2,323,796,699	3.500000 2028/01/31	0.55

2	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	85,000,000	100.69 2,012,772,012	100.68 2,012,632,087	1.850000 2027/05/15	0.47
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	11,500,000	98.56 1,806,663,335	97.83 1,793,337,534	2.875000 2028/05/15	0.42
4	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	73,000,000	101.76 1,747,070,693	102.27 1,755,722,957	2.050000 2029/04/15	0.41
5	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,800,000	104.82 1,804,423,556	101.62 1,749,350,516	4.625000 2035/02/15	0.41
6	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,500,000	99.61 1,667,084,715	96.58 1,616,508,674	3.875000 2034/08/15	0.38
7	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,200,000	102.07 1,659,464,120	99.21 1,613,064,416	4.125000 2032/11/15	0.38
8	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	104.38 1,663,840,332	101.10 1,611,448,839	4.500000 2033/11/15	0.38
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	98.31 1,614,041,361	97.48 1,600,411,400	4.125000 2036/02/15	0.38
10	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,200,000	100.81 1,639,011,832	97.76 1,589,474,377	4.000000 2034/02/15	0.38
11	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	102.26 1,630,033,713	99.03 1,578,518,865	4.250000 2034/11/15	0.37
12	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,800,000	98.97 1,546,056,620	96.64 1,509,538,060	4.000000 2035/11/15	0.36
13	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,500,000	102.08 1,545,776,174	98.79 1,495,943,687	4.250000 2035/05/15	0.35
14	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,300,000	87.58 1,437,963,503	86.37 1,418,000,224	1.250000 2031/08/15	0.33
15	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	58,000,000	102.77 1,401,791,449	102.91 1,403,660,086	2.370000 2029/01/15	0.33
16	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	9,000,000	100.21 1,437,551,161	97.31 1,395,950,371	3.875000 2033/08/15	0.33
17	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,800,000	99.98 1,402,355,209	99.33 1,393,360,602	3.500000 2027/10/31	0.33
18	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,700,000	101.72 1,410,614,037	99.60 1,381,187,828	4.000000 2030/02/28	0.33
19	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	10,000,000	87.63 1,396,830,204	86.29 1,375,471,944	1.375000 2031/11/15	0.32
20	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,700,000	101.67 1,409,955,568	98.68 1,368,513,454	4.250000 2035/08/15	0.32
21	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,500,000	103.40 1,400,987,095	100.14 1,356,711,741	4.375000 2034/05/15	0.32

22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	87.72 1,370,236,938	86.80 1,355,835,096	0.875000 2030/11/15	0.32
23	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,500,000	101.45 1,374,527,558	99.81 1,352,295,044	4.000000 2029/01/31	0.32
24	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,500,000	100.16 1,357,036,697	99.11 1,342,770,694	3.875000 2030/04/30	0.32
25	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,300,000	101.57 1,343,733,569	99.73 1,319,470,905	4.000000 2029/07/31	0.31
26	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	55,000,000	99.51 1,287,192,030	100.32 1,297,647,978	1.430000 2030/01/25	0.31
27	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	100.54 1,282,082,155	99.92 1,274,112,655	3.875000 2027/07/31	0.30
28	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	100.01 1,275,260,263	98.74 1,259,155,497	3.500000 2028/10/15	0.30
29	CHINA GOVERNMENT BOND	中国	国債証券	52,000,000	100.57 1,229,924,350	101.61 1,242,568,809	1.790000 2032/03/25	0.29
30	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	8,000,000	97.56 1,244,095,144	97.22 1,239,748,171	3.500000 2031/02/28	0.29

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.91%
合計	97.91%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

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	韓国ウォン買/円売 2026年6月	買建	9,991,200,000	1,059,167,112	1,060,136,258	0.25%

		ニュージーランド・ドル買/円売 2026年6月	買建	398,000	37,161,817	37,714,082	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2026年6月	買建	408,000	46,959,943	47,152,152	0.01%
		シンガポール・ドル買/円売 2026年6月	買建	429,000	53,194,075	53,561,765	0.01%
		デンマーク・クローネ買/円売 2026年6月	買建	887,000	21,968,329	22,029,620	0.01%
		ユーロ買/円売 2026年6月	買建	750,000	138,753,225	139,208,700	0.03%
		メキシコ・ペソ買/円売 2026年6月	買建	14,465,000	132,276,352	132,969,512	0.03%
		ノルウェー・クローネ買/円売 2026年6月	買建	1,331,000	22,845,284	22,904,380	0.01%
		米ドル買/円売 2026年6月	買建	1,055,000	167,688,056	168,077,534	0.04%
		ポーランド・ズロチ買/円売 2026年6月	買建	3,343,000	145,264,325	146,704,546	0.03%
		オフショア人民元買/円売 2026年6月	買建	1,885,000	44,122,007	44,325,586	0.01%
		英ポンド買/円売 2026年6月	買建	1,151,000	246,509,235	246,530,772	0.06%
		イスラエル・シュケル買/円売 2026年6月	買建	798,000	43,935,773	44,969,374	0.01%
		マレーシア・リンギット買/円売 2026年6月	買建	1,500,000	60,300,000	60,184,650	0.01%
		スウェーデン・クローネ買/円売 2026年6月	買建	5,795,000	98,359,977	99,778,888	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

●FW 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）

2026年5月29日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	15,894円
純資産総額	450億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.0%
3カ月間	0.7%
6カ月間	2.5%
1年間	15.1%
3年間	27.7%
5年間	31.1%
設定来	58.9%

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

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

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

主要な資産の状況　　※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国債券	1,097	97.6%
コール・ローン、その他		2.4%
合計	1,097	100.0%

債券種別構成	比率
国債	97.6%
合計	97.6%

通貨別構成	比率
米ドル	44.7%
ユーロ	28.9%
オフショア人民元	12.7%
英ポンド	5.7%
カナダ・ドル	2.1%
豪ドル	1.3%
メキシコ・ペソ	0.9%
ポーランド・ズロチ	0.7%
韓国ウォン	0.7%
その他	2.2%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	3.1
最終利回り(%)	3.6
修正デュレーション	6.2
残存年数	8.1

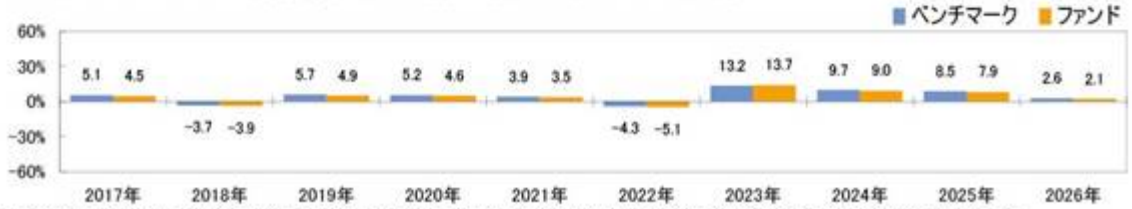
格付別構成	比率
AAA	71.4%
AA	19.5%
A	9.1%
BBB	－
BB	－
合計	100.0%

組入上位10銘柄	償還日	比率
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2028/01/31	0.5%
CHINA GOVERNMENT BOND	2027/05/15	0.5%
United States Treasury Note/Bond	2028/05/15	0.4%
CHINA GOVERNMENT BOND	2029/04/15	0.4%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2035/02/15	0.4%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2034/08/15	0.4%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2032/11/15	0.4%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2033/11/15	0.4%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2036/02/15	0.4%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2034/02/15	0.4%
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。
・2026年は5月29日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

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

(1) 【投資状況】（2026年5月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		5,894,290,454	99.71
	内 日本	5,894,290,454	99.71
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		17,394,830	0.29
純資産総額		5,911,685,284	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】（2026年5月29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	1,131,256,119	3.7027 4,188,801,923	4.1695 4,716,772,388	79.79
2	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	506,132,846	1.9763 1,000,271,806	2.3265 1,177,518,066	19.92

(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)	599,181,409	599,181,409	1.0747	1.0747
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,195,532,865	1,195,532,865	1.0746	1.0746
第3計算期間末 (2019年6月17日)	1,344,487,088	1,344,487,088	1.1026	1.1026
第4計算期間末 (2020年6月15日)	1,706,986,677	1,706,986,677	1.1508	1.1508
第5計算期間末 (2021年6月15日)	1,952,886,340	1,952,886,340	1.2204	1.2204
第6計算期間末 (2022年6月15日)	2,294,610,149	2,294,610,149	1.1993	1.1993
第7計算期間末 (2023年6月15日)	3,070,851,690	3,070,851,690	1.2748	1.2748
第8計算期間末 (2024年6月17日)	4,464,179,145	4,464,179,145	1.4566	1.4566
2025年5月末日	4,618,437,158	－	1.4175	－
第9計算期間末 (2025年6月16日)	4,702,504,909	4,702,504,909	1.4326	1.4326
6月末日	4,782,124,286	－	1.4526	－
7月末日	4,903,787,958	－	1.4805	－
8月末日	4,910,292,342	－	1.4790	－
9月末日	4,986,784,775	－	1.5081	－
10月末日	5,166,692,142	－	1.5664	－
11月末日	5,436,809,932	－	1.6009	－
12月末日	5,405,854,348	－	1.6104	－
2026年1月末日	5,508,779,804	－	1.6017	－
2月末日	5,688,129,837	－	1.6376	－
3月末日	5,769,344,568	－	1.6185	－
4月末日	5,911,322,758	－	1.6458	－
5月末日	5,911,685,284	－	1.6467	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000

第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

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

(4) 【設定及び解約の実績】

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

（注） 当初設定数量は1,000,000口です。

（参考）マザーファンド

外国債券インデックスマザーファンド

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

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（2026年5月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		75,984,629,795	96.73
	内 中国	7,735,359,321	9.85
	内 タイ	6,015,966,269	7.66
	内 マレーシア	7,437,943,679	9.47
	内 インドネシア	7,049,907,308	8.97
	内 インド	7,617,615,735	9.70
	内 ポーランド	6,332,081,060	8.06
	内 ハンガリー	1,866,565,364	2.38
	内 セルビア	182,884,398	0.23
	内 ルーマニア	2,348,057,478	2.99
	内 トルコ	673,746,907	0.86
	内 チェコ	3,641,031,868	4.64
	内 メキシコ	7,558,242,972	9.62
	内 ドミニカ共和国	182,409,281	0.23
	内 コロンビア	2,989,741,193	3.81
	内 ペルー	1,529,932,423	1.95
	内 チリ	1,343,778,657	1.71
	内 ブラジル	5,738,034,845	7.30
	内 ウルグアイ	110,120,119	0.14
	内 南アフリカ	5,631,210,918	7.17
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,570,424,989	3.27
純資産総額		78,555,054,784	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）		181,185,940	0.23
	内 日本	181,185,940	0.23

(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（2026年5月29日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率 (%)
1	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	34,000,000	87.88 944,649,662	87.32 938,613,555	10.000000 2031/01/01	1.19
2	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	85,000,000	83.65 697,580,715	96.86 807,708,802	8.750000 2048/02/28	1.03
3	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	32,000,000	65.44 662,093,685	71.52 723,586,403	— 2029/01/01	0.92
4	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	80,000,000	95.75 704,944,211	96.71 712,053,015	7.750000 2031/05/29	0.91
5	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	67,000,000	95.33 626,576,785	102.65 674,687,655	8.875000 2035/02/28	0.86
6	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	71,000,000	100.56 657,070,313	101.31 661,989,675	8.500000 2029/03/01	0.84
7	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	76,000,000	91.44 639,574,494	91.96 643,180,020	7.750000 2034/11/23	0.82
8	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	22,000,000	91.75 638,141,029	92.26 641,715,947	10.000000 2029/01/01	0.82
9	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	65,700,000	90.77 585,086,194	98.15 632,606,325	8.500000 2037/01/31	0.81
10	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	80,000,000	83.96 618,126,896	84.50 622,125,208	7.750000 2042/11/13	0.79
11	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	62,000,000	96.96 589,780,194	100.51 611,328,004	8.250000 2032/03/31	0.78
12	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	65,000,000	99.92 597,740,280	101.15 605,077,851	8.500000 2029/05/31	0.77
13	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	19,000,000	94.83 569,603,761	97.89 587,971,488	10.000000 2027/01/01	0.75
14	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	60,000,000	85.02 500,464,107	96.62 568,722,978	8.750000 2044/01/31	0.72
15	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	56,000,000	88.92 488,520,404	99.97 549,195,192	9.000000 2040/01/31	0.70
16	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	12,000,000	105.65 556,747,747	103.01 542,857,971	6.000000 2033/10/25	0.69
17	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	70,000,000	83.30 536,634,260	83.98 540,984,043	8.000000 2053/07/31	0.69

18	BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F	ブラジル	国債証券	21,000,000	82.45 547,385,694	80.63 535,279,106	10.000000 2035/01/01	0.68
19	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	12,800,000	97.81 549,809,885	95.02 534,143,113	5.000000 2035/10/25	0.68
20	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	12,400,000	98.96 538,913,845	97.90 533,095,341	4.500000 2030/07/25	0.68
21	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	18,000,000	78.80 448,453,079	86.92 494,636,930	― 2027/07/01	0.63
22	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	ブラジル	国債証券	23,000,000	64.30 467,562,759	66.96 486,900,305	― 2029/07/01	0.62
23	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	48,200,000	99.61 471,011,172	100.56 475,494,643	8.000000 2030/01/31	0.61
24	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	55,400,000	91.71 467,600,413	92.46 471,393,503	7.500000 2033/05/26	0.60
25	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	13,000,000	81.69 466,360,299	82.18 469,166,184	1.750000 2032/04/25	0.60
26	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	50,000,000	100.70 463,386,286	101.85 468,665,411	8.500000 2028/03/02	0.60
27	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	10,850,000	93.10 443,583,612	93.50 445,503,743	2.750000 2029/10/25	0.57
28	MEXICAN BONOS	メキシコ	国債証券	48,000,000	99.99 441,711,866	100.39 443,456,361	8.500000 2030/02/28	0.56
29	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	10,000,000	101.32 444,938,777	100.14 439,774,134	5.000000 2030/01/25	0.56
30	POLAND GOVERNMENT BOND	ポーランド	国債証券	9,400,000	108.71 448,738,595	105.63 436,057,839	7.500000 2028/07/25	0.56

（注）　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

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	96.73%
合計	96.73%

（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	メキシコ・ペソ買/円売 2026年6月	買建	4,500,000	40,612,626	41,358,600	0.05%
		南アフリカ・ランド買/円売 2026年6月	買建	8,000,000	76,059,924	78,389,600	0.10%
		ポーランド・ズロチ買/円売 2026年6月	買建	1,400,000	60,642,106	61,437,740	0.08%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●FW 外国債券インデックスEM+（為替ヘッジなし）

2026年5月29日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	16,467円
純資産総額	59億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.1%
3カ月間	0.6%
6カ月間	2.9%
1年間	16.2%
3年間	30.6%
5年間	35.8%
設定来	64.7%

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

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

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

主要な資産の状況　　※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国債券	1,387	97.4%
コール・ローン、その他		2.6%
合計	1,387	100.0%

債券種別構成	比率
国債	97.4%
合計	97.4%

通貨別構成	比率
米ドル	35.8%
ユーロ	23.1%
オフショア人民元	12.2%
英ポンド	4.5%
メキシコ・ペソ	2.7%
マレーシア・リンギット	2.3%
ポーランド・ズロチ	2.3%
インド・ルピー	2.0%
インドネシア・ルピア	1.8%
その他	13.3%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	3.8
最終利回り(%)	4.2
修正デュレーション	6.0
残存年数	8.0

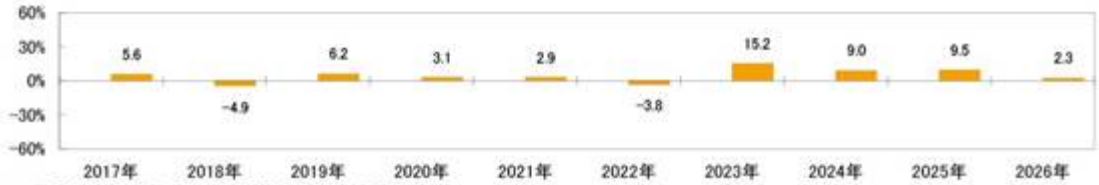
格付別構成	比率
AAA	57.2%
AA	20.6%
A	15.6%
BBB	4.9%
BB	1.7%
合計	100.0%

組入上位10銘柄	償還日	比率
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2028/01/31	0.4%
CHINA GOVERNMENT BOND	2027/05/15	0.4%
CHINA GOVERNMENT BOND	2029/04/15	0.4%
United States Treasury Note/Bond	2028/05/15	0.3%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2035/02/15	0.3%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2034/08/15	0.3%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2032/11/15	0.3%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2033/11/15	0.3%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2036/02/15	0.3%
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2034/02/15	0.3%
合計		3.4%

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

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2026年は5月29日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス】

(1)　【投資状況】　(2026年5月29日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)

親投資信託受益証券		25,150,192,433	99.96
	内 日本	25,150,192,433	99.96
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		11,245,674	0.04
純資産総額		25,161,438,107	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】（2026年5月29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	6,881,602,439	3.5723 24,583,415,606	3.6547 25,150,192,433	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)	1,224,211,506	1,224,211,506	0.9906	0.9906
第2計算期間末 (2018年6月15日)	2,355,374,969	2,355,374,969	1.0250	1.0250
第3計算期間末 (2019年6月17日)	3,254,479,810	3,254,479,810	1.1818	1.1818
第4計算期間末 (2020年6月15日)	4,081,513,165	4,081,513,165	1.0318	1.0318
第5計算期間末 (2021年6月15日)	6,102,975,985	6,102,975,985	1.4075	1.4075
第6計算期間末 (2022年6月15日)	6,943,298,664	6,943,298,664	1.2709	1.2709
第7計算期間末 (2023年6月15日)	8,364,043,604	8,364,043,604	1.3091	1.3091
第8計算期間末 (2024年6月17日)	11,714,101,865	11,714,101,865	1.2514	1.2514
2025年5月末日	16,362,940,189	―	1.3267	―
第9計算期間末 (2025年6月16日)	16,953,333,407	16,953,333,407	1.3613	1.3613
6月末日	17,106,904,599	―	1.3641	―
7月末日	18,248,465,130	―	1.4314	―
8月末日	19,079,077,040	―	1.4872	―
9月末日	19,482,541,205	―	1.4917	―
10月末日	20,748,654,893	―	1.5274	―
11月末日	22,617,361,878	―	1.5793	―
12月末日	22,961,956,903	―	1.5790	―
2026年1月末日	23,026,130,679	―	1.5574	―
2月末日	24,165,531,462	―	1.5846	―
3月末日	23,403,497,026	―	1.4672	―
4月末日	25,365,285,833	―	1.4965	―
5月末日	25,161,438,107	―	1.4446	―

② 【分配の推移】

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

第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

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

(4) 【設定及び解約の実績】

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

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

（参考）マザーファンド
ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

(1) 投資状況（2026年5月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資証券		217,305,619,700	97.19
	内 日本	217,305,619,700	97.19

コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,277,555,605	2.81
純資産総額	223,583,175,305	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）		6,275,270,000	2.81
	内　日本	6,275,270,000	2.81

(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（2026年5月29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	123,266	144,409.99 17,800,842,297	127,400.00 15,704,088,400	7.02
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	107,184	128,060.43 13,726,030,151	114,300.00 12,251,131,200	5.48
3	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	105,965	120,518.53 12,770,746,858	112,500.00 11,921,062,500	5.33
4	野村不動産マスターF	日本	投資証券	65,028	162,944.03 10,595,924,570	152,600.00 9,923,272,800	4.44
5	KDX不動産投資法人	日本	投資証券	59,506	168,716.85 10,039,665,051	159,000.00 9,461,454,000	4.23
6	GLP投資法人	日本	投資証券	67,146	137,531.79 9,234,710,243	133,700.00 8,977,420,200	4.02
7	日本プロロジスリート	日本	投資証券	105,050	92,231.07 9,688,874,134	85,300.00 8,960,765,000	4.01
8	オリックス不動産投資	日本	投資証券	81,321	102,438.99 8,330,441,128	96,100.00 7,814,948,100	3.50
9	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	63,537	130,340.97 8,281,474,307	120,600.00 7,662,562,200	3.43
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	47,048	180,485.86 8,491,499,161	162,200.00 7,631,185,600	3.41

11	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	112,648	61,897.67 6,972,649,607	61,300.00 6,905,322,400	3.09
12	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	86,978	78,097.86 6,792,796,398	76,600.00 6,662,514,800	2.98
13	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	42,020	169,186.51 7,109,217,418	154,000.00 6,471,080,000	2.89
14	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	56,585	103,715.84 5,868,761,191	95,100.00 5,381,233,500	2.41
15	産業ファンド	日本	投資証券	37,249	149,138.36 5,555,254,919	140,200.00 5,222,309,800	2.34
16	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	60,236	91,660.75 5,521,277,253	82,000.00 4,939,352,000	2.21
17	三井不ロジパーク	日本	投資証券	45,061	119,404.35 5,380,479,680	107,900.00 4,862,081,900	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	35,231	136,447.28 4,807,174,231	125,900.00 4,435,582,900	1.98
19	ＡＰ|投資法人	日本	投資証券	31,507	146,208.34 4,606,586,248	130,800.00 4,121,115,600	1.84
20	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	25,587	156,932.65 4,015,435,821	145,700.00 3,728,025,900	1.67
21	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	40,457	103,287.94 4,178,720,341	91,900.00 3,717,998,300	1.66
22	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	30,917	111,477.24 3,446,542,024	105,600.00 3,264,835,200	1.46
23	森ヒルズリート	日本	投資証券	23,620	144,042.21 3,402,277,112	129,500.00 3,058,790,000	1.37
24	イオンリート投資	日本	投資証券	24,780	134,962.49 3,344,370,702	122,800.00 3,042,984,000	1.36
25	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	29,879	114,785.03 3,429,662,197	101,400.00 3,029,730,600	1.36
26	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	35,865	89,345.31 3,204,369,881	81,600.00 2,926,584,000	1.31
27	森トラストリート投資法人	日本	投資証券	39,334	76,560.79 3,011,442,246	74,000.00 2,910,716,000	1.30
28	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	18,032	170,185.33 3,068,781,953	156,200.00 2,816,598,400	1.26
29	NTT都市開発リート投資法人	日本	投資証券	20,549	146,789.16 3,016,370,589	132,300.00 2,718,632,700	1.22
30	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	8,262	352,689.96 2,913,924,486	318,000.00 2,627,316,000	1.18

(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	97.19%
合計	97.19%

(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 0806月	買建	3,467	6,784,919,000	6,275,270,000	2.81%

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

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

（参考情報）運用実績

●FW J-REITインデックス

2026年5月29日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	14,446円
純資産総額	251億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-3.5%
3カ月間	-8.8%
6カ月間	-8.5%
1年間	8.9%
3年間	9.7%
5年間	6.5%
設定来	44.5%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

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

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

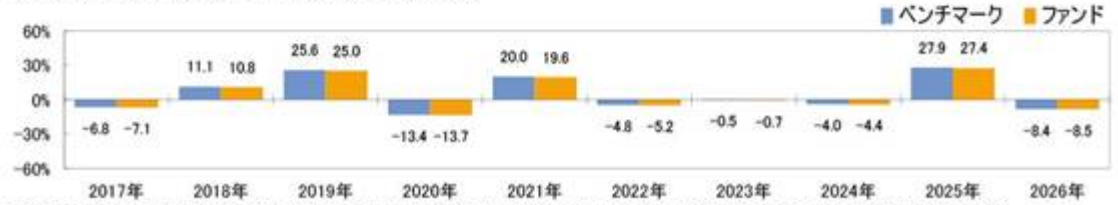
主要な資産の状況　　※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	種別構成	比率	組入上位10銘柄	種別名	比率
国内リート	58	97.1%	各種不動産投資信託	28.0%	日本ビルファンド	オフィス不動産投資信託	7.0%
国内リート 先物	1	2.8%	オフィス不動産投資信託	26.3%	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	18.1%	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	8.9%	野村不動産マスターF	各種不動産投資信託	4.4%
			集合住宅用不動産投資信託	8.2%	KDX不動産投資法人	各種不動産投資信託	4.2%
			ホテル・リゾート不動産投資信託	7.4%	GLP投資法人	工業用不動産投資信託	4.0%
			ヘルスケア不動産投資信託	0.3%	日本プロロジスリート	工業用不動産投資信託	4.0%
					オリックス不動産投資	オフィス不動産投資信託	3.5%
					大和ハウスリート投資法人	各種不動産投資信託	3.4%
コール・ローン、その他		2.9%			ユナイテッド・アーバン投資法人	各種不動産投資信託	3.4%
合計	59	-	合計	97.1%	合計		44.8%

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

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証REIT指数（配当込み）です。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2026年は5月29日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ　外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）】

(1)　【投資状況】　(2026年5月29日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		26,831,202,921	100.01
	内 日本	26,831,202,921	100.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△1,469,800	△0.01
純資産総額		26,829,733,121	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】（2026年5月29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	27,801,474,377	0.8796 24,456,022,350	0.9651 26,831,202,921	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)	5,285,588,386	5,285,588,386	0.9844	0.9844
第2計算期間末 (2018年6月15日)	8,688,426,682	8,688,426,682	0.9722	0.9722
第3計算期間末 (2019年6月17日)	10,895,667,977	10,895,667,977	1.0760	1.0760
第4計算期間末 (2020年6月15日)	12,056,922,582	12,056,922,582	0.9117	0.9117
第5計算期間末 (2021年6月15日)	17,785,453,405	17,785,453,405	1.2187	1.2187
第6計算期間末 (2022年6月15日)	16,269,529,050	16,269,529,050	1.0481	1.0481
第7計算期間末 (2023年6月15日)	18,252,096,148	18,252,096,148	1.0021	1.0021
第8計算期間末 (2024年6月17日)	20,782,102,925	20,782,102,925	0.9952	0.9952
2025年5月末日	21,196,218,021	－	1.0300	－
第9計算期間末 (2025年6月16日)	21,144,166,518	21,144,166,518	1.0312	1.0312
6月末日	21,071,176,019	－	1.0222	－
7月末日	21,463,215,899	－	1.0324	－
8月末日	22,133,489,417	－	1.0484	－
9月末日	22,646,496,553	－	1.0496	－
10月末日	23,410,704,091	－	1.0391	－
11月末日	24,543,158,313	－	1.0522	－
12月末日	24,739,125,831	－	1.0384	－
2026年1月末日	25,181,598,103	－	1.0524	－
2月末日	27,298,622,185	－	1.1204	－
3月末日	25,639,379,360	－	1.0258	－
4月末日	27,339,828,403	－	1.1110	－
5月末日	26,829,733,121	－	1.1327	－

② 【分配の推移】

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

第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

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

(4) 【設定及び解約の実績】

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

(注) 当初設定数量は10,000,000口です。

（参考）マザーファンド

先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

(1) 投資状況（2026年5月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資証券		32,095,738,389	97.38
	内 ガーンジィ	76,959,746	0.23
	内 韓国	60,650,097	0.18
	内 香港	286,842,002	0.87
	内 シンガポール	1,052,463,123	3.19
	内 イスラエル	61,198,683	0.19
	内 イギリス	1,222,737,799	3.71
	内 アイルランド	12,238,516	0.04
	内 オランダ	51,011,550	0.15
	内 ベルギー	330,587,332	1.00
	内 フランス	644,091,972	1.95
	内 ドイツ	8,245,114	0.03
	内 スペイン	182,196,528	0.55
	内 イタリア	5,631,266	0.02
	内 カナダ	397,666,657	1.21
	内 アメリカ	25,438,039,881	77.18
	内 オーストラリア	2,227,130,487	6.76
	内 ニュージーランド	38,047,636	0.12
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		865,176,963	2.62
純資産総額		32,960,915,352	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）		1,423,233,163	4.32
	内 ドイツ	151,887,518	0.46
	内 アメリカ	1,271,345,645	3.86
為替予約取引（売建）		31,368,853,027	△95.17
	内 日本	31,368,853,027	△95.17

(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（2026年5月29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 (REIT)	アメリカ	投資証券	83,251	26,271.77 2,187,155,635	33,518.12 2,790,417,266	8.47
2	PROLOGIS REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	110,909	17,111.95 1,897,876,148	23,213.55 2,574,592,682	7.81
3	EQUINIX REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	11,723	123,848.10 1,451,873,296	170,458.04 1,998,279,622	6.06
4	SIMON PROPERTY GROUP REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	38,803	27,677.91 1,073,989,066	32,957.07 1,278,833,199	3.88
5	DIGITAL REALTY TRUST REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	38,531	26,467.34 1,019,815,872	30,512.02 1,175,658,939	3.57
6	REALTY INCOME REIT CORP (REIT)	アメリカ	投資証券	109,757	9,225.65 1,012,593,415	9,832.76 1,079,215,238	3.27
7	PUBLIC STORAGE REIT (REIT)	アメリカ	投資証券	18,846	44,637.16 841,234,643	49,291.35 928,944,923	2.82
8	GOODMAN GROUP UNITS	オーストラリア	投資証券	250,702	4,027.29 1,009,653,481	3,511.47 880,333,154	2.67
9	VENTAS REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	56,670	10,928.09 619,299,222	13,674.06 774,909,439	2.35
10	IRON MOUNTAIN INC (REIT)	アメリカ	投資証券	35,297	14,584.82 514,804,802	20,215.43 713,544,163	2.16
11	EXTRA SPACE STORAGE REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	25,324	21,745.25 550,679,782	23,240.65 588,546,370	1.79
12	VICI PPTYS INC (REIT)	アメリカ	投資証券	128,673	5,157.06 663,592,668	4,515.51 581,025,338	1.76
13	AVALONBAY COMMUNITIES REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	16,894	30,081.99 508,205,303	29,460.05 497,698,147	1.51
14	EQUITY RESIDENTIAL REIT (REIT)	アメリカ	投資証券	41,020	10,109.47 414,691,836	10,561.18 433,219,661	1.31
15	ESSEX PROPERTY TRUST REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	7,689	40,878.91 314,318,322	44,061.77 338,790,962	1.03
16	INVITATION HOMES INC (REIT)	アメリカ	投資証券	67,290	4,791.58 322,429,577	4,682.87 315,110,874	0.96
17	KIMCO REALTY REIT CORP (REIT)	アメリカ	投資証券	80,428	3,369.66 271,028,944	3,852.45 309,845,355	0.94
18	W. P. CAREY REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	26,147	10,413.90 272,294,885	11,828.33 309,275,394	0.94
19	MID AMERICA APARTMENT COMMUNITIES (REIT)	アメリカ	投資証券	13,948	22,261.04 310,499,162	20,851.39 290,835,324	0.88
20	HOST HOTELS & RESORTS REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	76,307	2,565.06 195,733,113	3,710.59 283,144,693	0.86

21	SUN COMMUNITIES REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	13,870	20,263.88 281,062,202	19,923.75 276,342,413	0.84
22	SCENTRE GROUP UNIT (REIT)	オーストラリア	投資証券	639,558	437.53 279,880,236	424.52 271,509,255	0.82
23	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS REIT IN (REIT)	アメリカ	投資証券	35,265	6,544.23 230,785,010	7,497.70 264,406,588	0.80
24	LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	香港	投資証券	318,600	860.48 274,154,219	819.70 261,157,057	0.79
25	HEALTHPEAK PROPERTIES INC (REIT)	アメリカ	投資証券	82,928	2,723.01 225,820,618	3,109.69 257,881,110	0.78
26	UNIBAIL RODAMCO WE STAPLED UNITS	フランス	投資証券	14,000	15,704.60 219,867,103	18,343.20 256,804,912	0.78
27	GAMING AND LEISURE PROPERTIES REIT (REIT)	アメリカ	投資証券	33,767	7,311.21 246,878,655	7,559.86 255,274,053	0.77
28	LAMAR ADVERTISING COMPANY CLASS A (REIT)	アメリカ	投資証券	10,364	19,383.41 200,890,189	24,246.40 251,289,760	0.76
29	SEGRO REIT PLC (REIT)	イギリス	投資証券	162,322	1,381.80 224,303,646	1,540.38 250,038,925	0.76
30	REGENCY CENTERS REIT CORP (REIT)	アメリカ	投資証券	19,640	11,320.35 222,333,927	12,515.30 245,800,547	0.75

(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	97.38%
合計	97.38%

(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 JUN 26	買建	206	1,250,302,754	1,271,345,645	3.86%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE JUN 26	買建	131	152,862,563	151,887,518	0.46%
為替予約取引	日本	シンガポール・ドル売/円買 2026年6月	売建	8,237,700	1,015,803,350	1,028,474,372	△3.12%
		ユーロ売/円買 2026年6月	売建	7,118,100	1,309,411,760	1,321,144,273	△4.01%
		米ドル売/円買 2026年6月	売建	155,232,700	24,316,453,749	24,727,466,957	△75.02%
		英ポンド売/円買 2026年6月	売建	5,978,900	1,274,134,084	1,280,468,128	△3.88%
		イスラエル・シュケル売/円買 2026年6月	売建	1,337,200	71,096,255	75,348,010	△0.23%
		ニュージーランド・ドル売/円買 2026年6月	売建	456,400	42,271,037	43,245,679	△0.13%
		カナダ・ドル売/円買 2026年6月	売建	3,648,900	421,602,212	421,681,113	△1.28%
		香港ドル売/円買 2026年6月	売建	14,938,500	299,132,487	303,747,508	△0.92%
		豪ドル売/円買 2026年6月	売建	19,005,500	2,142,269,336	2,167,276,987	△6.58%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●FW 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

2026年5月29日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	11,327円
純資産総額	268億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	2.0%
3カ月間	1.1%
6カ月間	7.7%
1年間	10.0%
3年間	16.7%
5年間	-1.8%
設定来	13.3%

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額:　0円　　設定来分配金合計額:　0円

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

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

主要な資産の状況　　※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国リート・先物	279	101.7%
外国投資証券	1	0.0%
コール・ローン、その他		2.6%
合計	280	-

国・地域別構成	比率
アメリカ	81.0%
オーストラリア	6.8%
イギリス	3.7%
シンガポール	3.2%
その他	7.0%
合計	101.7%

通貨別構成	比率
日本円	95.6%
米ドル	3.4%
豪ドル	0.3%
ユーロ	0.3%
韓国ウォン	0.2%
英ポンド	0.2%
カナダ・ドル	0.0%
香港ドル	0.0%
ニュージーランド・ドル	0.0%
その他	-0.0%
合計	100.0%

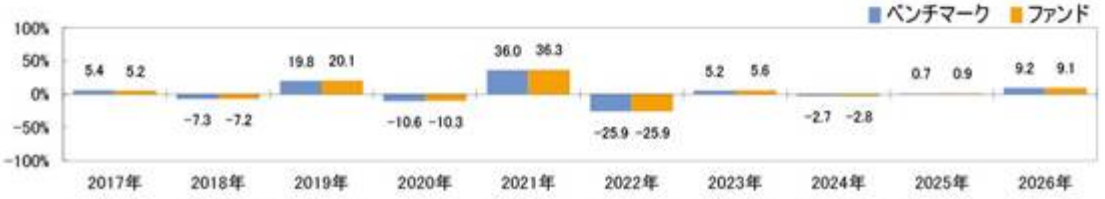
リート用途別構成	比率
小売	19.1%
産業用	16.9%
ヘルスケア	16.2%
住宅	10.4%
データセンター	10.0%
倉庫	7.9%
ダイバーシファイド	6.2%
特殊	4.3%
オフィススペース	3.8%
その他	2.5%
合計	97.3%

組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
WELLTOWER INC (REIT)	ヘルスケア	アメリカ	8.5%
PROLOGIS REIT INC (REIT)	産業用	アメリカ	7.8%
EQUINIX REIT INC (REIT)	データセンター	アメリカ	6.1%
SIMON PROPERTY GROUP REIT INC (REIT)	小売	アメリカ	3.9%
DOW JONES US REAL ESTATE JUN 26	-	アメリカ	3.9%
DIGITAL REALTY TRUST REIT INC (REIT)	データセンター	アメリカ	3.6%
REALTY INCOME REIT CORP (REIT)	小売	アメリカ	3.3%
PUBLIC STORAGE REIT (REIT)	倉庫	アメリカ	2.8%
GOODMAN GROUP UNITS	産業用	オーストラリア	2.7%
VENTAS REIT INC (REIT)	ヘルスケア	アメリカ	2.4%
合計			44.8%

※リート用途別構成の用途は、原則としてS&P Global Property Indexの分類によるものです。なお、優先リート(会社が発行する優先株に相当するリート)は、用途別の分類はしていません。
※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

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



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2026年は5月29日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）】

(1) 【投資状況】 (2026年5月29日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)

親投資信託受益証券		19,260,837,871	99.99
	内 日本	19,260,837,871	99.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,501,499	0.01
純資産総額		19,262,339,370	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】（2026年5月29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	3,925,255,838	4.0451 15,878,127,667	4.9069 19,260,837,871	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)	609,843,907	609,843,907	1.0729	1.0729
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,189,127,891	1,189,127,891	1.0864	1.0864
第3計算期間末 (2019年6月17日)	1,667,702,163	1,667,702,163	1.1931	1.1931
第4計算期間末 (2020年6月15日)	2,091,937,862	2,091,937,862	1.0120	1.0120
第5計算期間末 (2021年6月15日)	3,226,829,877	3,226,829,877	1.4252	1.4252
第6計算期間末 (2022年6月15日)	3,454,275,087	3,454,275,087	1.4737	1.4737
第7計算期間末 (2023年6月15日)	4,650,947,962	4,650,947,962	1.5400	1.5400
第8計算期間末 (2024年6月17日)	7,453,636,072	7,453,636,072	1.8320	1.8320
2025年5月末日	9,889,242,060	－	1.8373	－
第9計算期間末 (2025年6月16日)	10,164,469,940	10,164,469,940	1.8525	1.8525
6月末日	10,228,194,323	－	1.8474	－
7月末日	10,977,086,573	－	1.9218	－
8月末日	11,335,903,976	－	1.9328	－
9月末日	12,015,827,003	－	1.9675	－
10月末日	12,729,058,719	－	2.0186	－
11月末日	14,290,736,913	－	2.0829	－
12月末日	14,568,399,076	－	2.0696	－
2026年1月末日	15,189,192,187	－	2.0770	－
2月末日	17,015,526,709	－	2.2445	－
3月末日	16,542,029,857	－	2.1055	－
4月末日	18,729,135,632	－	2.3002	－
5月末日	19,262,339,370	－	2.3390	－

② 【分配の推移】

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

第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

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

(4) 【設定及び解約の実績】

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

（注） 当初設定数量は10,000,000口です。

（参考）マザーファンド

ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

(1) 投資状況（2026年5月29日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券		1,355,626,215	1.84
	内 アメリカ	1,355,626,215	1.84

投資証券		70,669,503,687	95.79
	内 ガーンジィ	161,220,487	0.22
	内 韓国	126,165,512	0.17
	内 香港	640,875,612	0.87
	内 シンガポール	2,339,502,048	3.17
	内 イスラエル	137,445,717	0.19
	内 イギリス	2,690,092,741	3.65
	内 アイルランド	26,256,089	0.04
	内 オランダ	105,329,546	0.14
	内 ベルギー	702,555,313	0.95
	内 フランス	1,377,603,416	1.87
	内 ドイツ	17,622,847	0.02
	内 スペイン	390,876,808	0.53
	内 イタリア	11,062,588	0.01
	内 カナダ	873,033,180	1.18
	内 アメリカ	56,014,684,248	75.92
	内 オーストラリア	4,975,422,981	6.74
	内 ニュージーランド	79,754,554	0.11
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,752,956,546	2.38
純資産総額		73,778,086,448	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）		1,762,805,426	2.39
	内 ドイツ	417,400,812	0.57
	内 アメリカ	1,345,404,614	1.82
為替予約取引（買建）		299,837,836	0.41
	内 日本	299,837,836	0.41

(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（2026年5月29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 (REIT)	アメリカ	投資証券	183,520	32,912.12 6,040,054,721	33,518.12 6,151,245,951	8.34
2	PROLOGIS REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	244,489	20,595.57 5,035,412,295	23,213.55 5,675,459,973	7.69
3	EQUINIX REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	25,843	122,667.34 3,170,094,927	170,458.04 4,405,147,169	5.97
4	SIMON PROPERTY GROUP REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	85,537	29,829.04 2,551,498,800	32,957.07 2,819,048,922	3.82
5	DIGITAL REALTY TRUST REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	84,939	25,706.89 2,183,528,958	30,512.02 2,591,661,121	3.51
6	REALTY INCOME REIT CORP (REIT)	アメリカ	投資証券	241,950	9,245.25 2,236,925,588	9,832.76 2,379,038,484	3.22
7	PUBLIC STORAGE REIT (REIT)	アメリカ	投資証券	41,545	43,924.53 1,824,850,032	49,291.35 2,047,809,447	2.78
8	GOODMAN GROUP UNITS	オーストラリア	投資証券	562,966	3,372.58 1,898,653,417	3,511.47 1,976,839,571	2.68
9	VENTAS REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	124,923	12,873.29 1,608,189,875	13,674.06 1,708,205,609	2.32
10	IRON MOUNTAIN INC (REIT)	アメリカ	投資証券	77,809	14,022.49 1,091,086,535	20,215.43 1,572,942,681	2.13
11	VANGUARD REAL ESTATE INDEX FUND;ET (ETF)	アメリカ	投資信託受益証券	88,090	14,842.07 1,307,459,718	15,389.10 1,355,626,215	1.84
12	VICI PPTYS INC (REIT)	アメリカ	投資証券	287,325	4,582.94 1,316,814,586	4,515.51 1,297,421,410	1.76
13	EXTRA SPACE STORAGE REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	55,825	21,325.10 1,190,474,216	23,240.65 1,297,409,616	1.76
14	AVALONBAY COMMUNITIES REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	37,242	28,909.20 1,076,639,822	29,460.05 1,097,151,320	1.49
15	EQUITY RESIDENTIAL REIT (REIT)	アメリカ	投資証券	90,426	9,859.06 891,528,715	10,561.18 955,005,389	1.29
16	ESSEX PROPERTY TRUST REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	16,949	41,923.39 710,561,737	44,061.77 746,802,967	1.01
17	INVITATION HOMES INC (REIT)	アメリカ	投資証券	148,336	4,471.36 663,266,561	4,682.87 694,639,421	0.94
18	KIMCO REALTY REIT CORP (REIT)	アメリカ	投資証券	177,297	3,317.22 588,145,896	3,852.45 683,028,945	0.93
19	W. P. CAREY REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	57,639	10,785.12 621,646,335	11,828.33 681,773,222	0.92
20	MID AMERICA APARTMENT COMMUNITIES (REIT)	アメリカ	投資証券	30,747	21,595.91 664,012,742	20,851.39 641,117,990	0.87

21	HOST HOTELS & RESORTS REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	168,212	2,846.86 478,892,037	3,710.59 624,167,313	0.85
22	SCENTRE GROUP UNIT (REIT)	オーストラリア	投資証券	1,436,167	463.09 665,215,130	424.52 609,690,806	0.83
23	SUN COMMUNITIES REIT INC (REIT)	アメリカ	投資証券	30,575	20,539.95 628,013,672	19,923.75 609,168,656	0.83
24	LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	香港	投資証券	715,574	750.83 537,276,677	819.70 586,557,439	0.80
25	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS REIT IN (REIT)	アメリカ	投資証券	77,740	7,312.97 568,520,682	7,497.70 582,871,633	0.79
26	HEALTHPEAK PROPERTIES INC (REIT)	アメリカ	投資証券	182,808	2,898.18 529,820,891	3,109.69 568,477,837	0.77
27	GAMING AND LEISURE PROPERTIES REIT (REIT)	アメリカ	投資証券	74,436	6,986.38 520,043,119	7,559.86 562,726,312	0.76
28	LAMAR ADVERTISING COMPANY CLASS A (REIT)	アメリカ	投資証券	22,846	21,125.23 482,630,242	24,246.40 553,933,410	0.75
29	SEGRO REIT PLC (REIT)	イギリス	投資証券	359,311	1,539.31 553,138,090	1,540.38 553,478,495	0.75
30	UNIBAIL RODAMCO WE STAPLED UNITS	フランス	投資証券	30,036	16,324.34 490,318,530	18,343.20 550,956,595	0.75

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	1.84%
投資証券	95.79%
合計	97.62%

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

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 JUN 26	買建	218	1,287,832,277	1,345,404,614	1.82%
	ドイツ	STOXX EUROPE 600 RE JUN 26	買建	360	418,228,261	417,400,812	0.57%
為替予約取引	日本	ユーロ買/円売 2026年6月	買建	1,490,000	278,137,853	276,549,215	0.37%
		米ドル買/円売 2026年6月	買建	146,200	23,249,557	23,288,621	0.03%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●FW 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

2026年5月29日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	23,390円
純資産総額	192億円

当初設定日(2016年9月26日)～2026年5月29日

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	1.7%
3カ月間	4.2%
6カ月間	12.3%
1年間	27.3%
3年間	58.6%
5年間	73.9%
設定来	133.9%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額:　0円　　設定来分配金合計額:　0円

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

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国リート・先物	280	98.1%
外国投資信託等	2	1.9%
コール・ローン、その他		2.4%
合計	282	－

国・地域別構成	比率
アメリカ	79.6%
オーストラリア	6.7%
イギリス	3.6%
シンガポール	3.2%
その他	6.9%
合計	100.0%

通貨別構成	比率
米ドル	79.5%
豪ドル	6.8%
ユーロ	4.2%
英ポンド	3.8%
シンガポール・ドル	3.0%
カナダ・ドル	1.2%
香港ドル	0.9%
イスラエル・シュケル	0.2%
韓国ウォン	0.2%
その他	0.1%
合計	100.0%

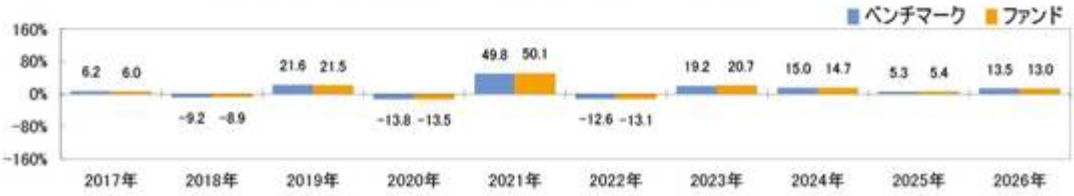
リート用途別構成	比率
小売	18.8%
産業用	16.7%
ヘルスケア	15.9%
住宅	10.2%
データセンター	9.8%
倉庫	7.8%
ダイバーシファイド	6.1%
特殊	4.2%
オフィススペース	3.7%
その他	2.4%
合計	95.7%

組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
WELLTOWER INC (REIT)	ヘルスケア	アメリカ	8.3%
PROLOGIS REIT INC (REIT)	産業用	アメリカ	7.7%
EQUINIX REIT INC (REIT)	データセンター	アメリカ	6.0%
SIMON PROPERTY GROUP REIT INC (REIT)	小売	アメリカ	3.8%
DIGITAL REALTY TRUST REIT INC (REIT)	データセンター	アメリカ	3.5%
REALTY INCOME REIT CORP (REIT)	小売	アメリカ	3.2%
PUBLIC STORAGE REIT (REIT)	倉庫	アメリカ	2.8%
GOODMAN GROUP UNITS	産業用	オーストラリア	2.7%
VENTAS REIT INC (REIT)	ヘルスケア	アメリカ	2.3%
IRON MOUNTAIN INC (REIT)	倉庫	アメリカ	2.1%
合計			42.5%

※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

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



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2026年は5月29日までの騰落率を表しています。
・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

（参考情報）ファンドの総経費率

	総経費率（①+②）	運用管理費用の比率 ①	その他費用の比率 ②
ダイワファンドラップ TOPIXインデックス	0.34%	0.34%	0.00%
ダイワファンドラップ 日経225インデックス	0.35%	0.34%	0.01%
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	0.46%	0.45%	0.02%
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	0.46%	0.45%	0.02%
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	0.51%	0.46%	0.05%
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	0.34%	0.34%	0.01%
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）	0.43%	0.42%	0.01%
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	0.44%	0.42%	0.02%
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	0.46%	0.43%	0.04%
ダイワファンドラップ J-REITインデックス	0.35%	0.34%	0.01%
ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）	0.48%	0.44%	0.05%
ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）	0.48%	0.44%	0.04%

※対象期間は2025年6月17日～2026年6月15日です。
※対象期間中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。）を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した値（年率）です。
※詳細につきましては、対象期間の運用報告書（全体版）をご覧下さい。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

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

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

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

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

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

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

＜FW 日本債券インデックス＞

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

＜「FW 日本債券インデックス」以外のファンド＞

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

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

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

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

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

2【換金（解約）手続等】

＜FW 日本債券インデックス＞

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

＜「FW 日本債券インデックス」以外のファンド＞

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

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

＜一部解約＞

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

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

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

解約価額は、各ファンドについて後掲の別表Ｂに掲げる価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

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

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

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

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

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

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

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

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

［別表Ｂ］

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

３【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

*「FW Ｊ－ＲＥＩＴインデックス」は除きます。

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・わが国の金融商品取引所上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。

・外国の株式：原則として金融商品取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場または海外店頭市場における計算時に知り得る直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。

・外国の金融商品取引所上場の投資信託証券：原則として金融商品取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場で評価します。

・わが国および外国の公社債：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。

1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）

3. 価格情報会社の提供する価額

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

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

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

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

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

(5)【その他】

① 信託の終了

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

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

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

② 信託約款の変更等

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

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

③　反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

④　運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書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。）を持分に応じて請求する権利を有します。

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

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

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

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

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

＜換金請求権＞

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

第３ 【ファンドの経理状況】

【ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間(2025年6月17日から2026年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	106,966,338	147,363,769
親投資信託受益証券	37,387,045,694	75,720,824,509
流動資産合計	37,494,012,032	75,868,188,278
資産合計	37,494,012,032	75,868,188,278
負債の部		
流動負債		
未払解約金	46,076,655	32,293,209
未払受託者報酬	3,697,851	7,019,493
未払委託者報酬	53,619,458	101,783,494
その他未払費用	924,373	1,087,536
流動負債合計	104,318,337	142,183,732
負債合計	104,318,337	142,183,732
純資産の部		
元本等		
元本	※1 15,173,066,603	※1 20,921,715,709
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	22,216,627,092	54,804,288,837
（分配準備積立金）	7,807,207,329	24,351,660,523
元本等合計	37,389,693,695	75,726,004,546
純資産合計	37,389,693,695	75,726,004,546
負債純資産合計	37,494,012,032	75,868,188,278

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 自　2024年6月18日 至　2025年6月16日	第10期 自　2025年6月17日 至　2026年6月15日
営業収益		
受取利息	171,333	554,206
有価証券売買等損益	1,920,377,761	20,839,578,815
営業収益合計	1,920,549,094	20,840,133,021
営業費用		
受託者報酬	6,816,621	11,998,742
委託者報酬	98,842,233	173,983,263
その他費用	1,703,993	2,191,902
営業費用合計	107,362,847	188,173,907
営業利益又は営業損失（△）	1,813,186,247	20,651,959,114
経常利益又は経常損失（△）	1,813,186,247	20,651,959,114
当期純利益又は当期純損失（△）	1,813,186,247	20,651,959,114
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（△）	83,273,734	2,410,907,894
期首剰余金又は期首欠損金（△）	14,565,462,154	22,216,627,092
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,901,570,417	21,176,656,275
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	8,901,570,417	21,176,656,275
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,980,317,992	6,830,045,750
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,980,317,992	6,830,045,750
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	22,216,627,092	54,804,288,837

(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10期 自2025年6月17日 至2026年6月15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 2025年6月15日が休日のため、前計算期間末日を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9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
1.　※1 期首元本額	10,829,538,359円	15,173,066,603円
期中追加設定元本額	6,553,530,642円	10,089,312,465円
期中一部解約元本額	2,210,002,398円	4,340,663,359円
2.　計算期間末日における受益権の総数	15,173,066,603口	20,921,715,709口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日	第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15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（160,581円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（1,729,751,932円）、投資信託約款に規定される収益調整金（14,409,419,763円）及び分配準備積立金（6,077,294,816円）より分配対象額は22,216,627,092円（1万口当たり14,642.15円）であり、分配を行っておりません。	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（518,075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（18,240,533,145円）、投資信託約款に規定される収益調整金（30,452,628,314円）及び分配準備積立金（6,110,609,303円）より分配対象額は54,804,288,837円（1万口当たり26,194.93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10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	第10期 2026年6月15日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,874,624,984	19,166,395,430
合計	1,874,624,984	19,166,395,430

（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9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.4642円 (24,642円)	3.6195円 (36,195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	24,850,943,390	75,720,824,509	
親投資信託受益証券 合計			75,720,824,509	
合計			75,720,824,509	

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

	2025年6月16日現在 金 額（円）	2026年6月15日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		

コール・ローン		12,954,554,845	21,414,150,314
株式	※2※3	431,296,451,840	712,654,521,850
派生商品評価勘定		2,544,500	297,872,600
未収入金		-	9,413,100
未収配当金		3,224,373,669	4,243,506,227
前払金		75,430,000	52,546,000
その他未収収益	※4	62,670,631	94,870,762
差入委託証拠金		-	122,030,864
流動資産合計		447,616,025,485	738,888,911,717
資産合計		447,616,025,485	738,888,911,717
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		12,534,400	-
未払金		1,548,700	-
未払解約金		197,661,170	85,609,950
未払利息		2,002,165	3,753,315
受入担保金		9,499,915,411	13,924,081,152
流動負債合計		9,713,661,846	14,013,444,417
負債合計		9,713,661,846	14,013,444,417
純資産の部			
元本等			
元本	※1	211,826,457,370	237,899,677,075
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）		226,075,906,269	486,975,790,225
元本等合計		437,902,363,639	724,875,467,300
純資産合計		437,902,363,639	724,875,467,300
負債純資産合計		447,616,025,485	738,888,911,717

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2026年6月15日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	株式

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的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6月16日現在	2026年6月15日現在
1.　※1 期首	2024年6月18日	2025年6月17日
期首元本額	179,077,569,301円	211,826,457,370円
期中追加設定元本額	58,539,565,430円	59,161,499,308円
期中一部解約元本額	25,790,677,361円	33,088,279,603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	2,816,144,305円	2,920,718,492円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	3,541,764,641円	3,220,521,944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	901,535円	895,259円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	8,694,234円	5,419,768円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	101,848,648円	43,641,769円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	9,684,377円	7,963,392円

ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	256,901,047円	169,279,238円
国内株式ファンド（適格機関投資家専用）	1,491,494,139円	1,370,084,000円
日本株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	935,176,883円	893,754,025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）	838,959,109円	-円
Ｄ－Ｉ's ＴＯＰＩＸインデックス	10,777,091円	9,608,823円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	238,587,466円	219,485,535円
ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	10,982,479,990円	12,028,552,068円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	5,466,222,980円	5,469,977,721円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	1,269,176,267円	1,218,480,665円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	5,613,242円	7,312,011円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	72,586,462,326円	70,402,601,148円
ダイワ・ライフ・バランス３０	2,925,579,709円	2,392,445,082円
ダイワ・ライフ・バランス５０	5,227,986,997円	4,673,963,716円
ダイワ・ライフ・バランス７０	6,287,931,709円	5,941,862,183円
年金ダイワ日本株式インデックス	10,737,241,945円	10,672,882,842円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	38,232,962円	29,489,487円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	72,797,436円	68,441,233円
ダイワつみたてインデックス日本株式	7,378,410,418円	9,684,562,851円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	12,589,096円	10,707,270円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	14,921,757円	16,443,401円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	286,160,972円	299,070,736円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	29,168,373,075円	35,521,504,464円

ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	41,004,364円	19,722,327円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	18,674,040円	14,120,598円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	2,590,382,424円	1,802,814,198円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	258,958,330円	180,713,985円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	33,642,397円	20,253,930円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	49,301,187円	28,678,487円
ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	230,161,708円	236,522,631円
ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	18,084,963,815円	24,850,943,390円
ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	15,145,711,546円	22,762,860,846円
ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	3,338,653,574円	3,198,633,588円
スタイル9（4資産分散・保守型）	1,384,065円	1,611,722円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	9,232,632円	12,942,611円
スタイル9（4資産分散・積極型）	13,684,044円	21,652,237円
スタイル9（6資産分散・保守型）	568,080円	705,435円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	17,304,656円	24,697,625円
スタイル9（6資産分散・積極型）	19,341,659円	29,527,464円
スタイル9（8資産分散・保守型）	927,097円	1,136,432円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	15,203,931円	22,369,174円
スタイル9（8資産分散・積極型）	39,473,075円	62,157,835円
ダイワ国内株式インデックス（投資一任専用）	6,099,620円	8,902,016,249円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル1（安定）	-円	371,554円

BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル2（やや安定）	-円	576,146円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル3（バランス）	-円	722,126円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル4（やや積極）	-円	723,240円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル5（積極）	-円	513,858円
ダイワ・インデックスセレクトＴＯＰＩＸ	921,304,263円	795,105,113円
ダイワライフスタイル２５	85,281,713円	58,341,874円
ダイワライフスタイル５０	413,468,231円	331,588,875円
ダイワライフスタイル７５	370,161,705円	316,572,254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）	7,410,454,858円	6,901,412,148円
計	211,826,457,370円	237,899,677,075円
2. 期末日における受益権の総数	211,826,457,370口	237,899,677,075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　9,012,751,320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　13,615,064,470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　925,595,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式　1,211,990,000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2025年6月17日 至2026年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

区分	2026年6月15日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2025年6月16日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2026年6月15日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	22,761,626,778	142,776,043,852
合計	22,761,626,778	142,776,043,852

（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	2025年6月16日現在				2026年6月15日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	6,071,360,000	-	6,061,490,000	△9,870,000	11,232,049,000	-	11,530,080,000	298,031,000
合計	6,071,360,000	-	6,061,490,000	△9,870,000	11,232,049,000	-	11,530,080,000	298,031,000

（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6月16日現在	2026年6月15日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.0673円 (20,673円)	3.0470円 (30,470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	7,500	4,270.00	32,025,000	貸付株式数 2,900株
ニッスイ	163,700	1,281.00	209,699,700	
Ｕｍｉｏｓ	86,800	1,286.00	111,624,800	
ユキグニファクトリー	15,200	1,075.00	16,340,000	貸付株式数 5,300株
カネコ種苗	5,100	1,423.00	7,257,300	貸付株式数 2,000株
サカタのタネ	21,600	4,175.00	90,180,000	
ホクト	15,900	1,869.00	29,717,100	
ショーボンドＨＤ	104,300	1,278.00	133,295,400	
ミライト・ワン	60,900	3,882.00	236,413,800	
タマホーム	11,200	2,886.00	32,323,200	貸付株式数 4,400株 (100株)
住石ホールディングス	16,000	551.00	8,816,000	貸付株式数 6,000株
日鉄鉱業	34,300	2,602.00	89,248,600	貸付株式数 13,500株
三井松島HLDGS	21,800	1,502.00	32,743,600	貸付株式数 8,600株
ＩＮＰＥＸ	599,900	3,495.00	2,096,650,500	
石油資源開発	110,200	1,655.00	182,381,000	
K&Oエナジーグループ	8,100	3,935.00	31,873,500	
リョーサン菱洋HD	25,700	2,812.00	72,268,400	貸付株式数 10,100株
第一カッター興業	4,600	1,400.00	6,440,000	
安藤・間	94,900	1,799.00	170,725,100	
東急建設	56,000	1,194.00	66,864,000	
コムシスホールディングス	56,200	5,350.00	300,670,000	
高松コンストラクションGP	13,300	3,560.00	47,348,000	貸付株式数 5,200株
東建コーポレーション	3,800	12,310.00	46,778,000	
ヤマウラ	10,100	1,398.00	14,119,800	貸付株式数 3,900株
オリエンタル白石	66,200	334.00	22,110,800	
大成建設	93,300	15,165.00	1,414,894,500	
大 林 組	395,500	3,327.00	1,315,828,500	
清水建設	341,500	2,717.00	927,855,500	
長谷工コーポレーシヨン	111,500	2,706.50	301,774,750	
松井建設	10,200	1,375.00	14,025,000	
鹿島建設	277,100	6,130.00	1,698,623,000	
不動テトラ	7,100	2,798.00	19,865,800	貸付株式数 2,500株
鉄建建設	7,800	4,570.00	35,646,000	
西松建設	19,900	5,514.00	109,728,600	

大豊建設	17,200	752.00	12,934,400	
奥 村 組	20,300	5,800.00	117,740,000	
東鉄工業	13,800	4,275.00	58,995,000	
淺沼組	50,100	823.00	41,232,300	
戸田建設	151,500	1,604.50	243,081,750	
熊 谷 組	74,300	1,438.00	106,843,400	
矢作建設	23,400	1,855.00	43,407,000	
ピーエス・コンストラクション	11,300	2,342.00	26,464,600	貸付株式数 1,700株
日本ハウスHLDGS	26,700	305.00	8,143,500	貸付株式数 10,500株
大東建託	213,400	3,074.00	655,991,600	
新日本建設	17,500	2,259.00	39,532,500	
東亜道路	19,200	1,536.00	29,491,200	
東亜建設	46,100	2,354.00	108,519,400	
日本国土開発	38,300	540.00	20,682,000	
若築建設	3,700	3,330.00	12,321,000	貸付株式数 1,300株
五洋建設	177,100	1,819.50	322,233,450	
世紀東急	19,600	1,440.00	28,224,000	貸付株式数 5,300株
福 田 組	4,300	7,570.00	32,551,000	
住友林業	324,200	1,369.00	443,829,800	貸付株式数 128,000株
大和ハウス	345,700	4,388.00	1,516,931,600	
ライト工業	22,500	4,005.00	90,112,500	
積水ハウス	372,400	3,335.00	1,241,954,000	
日特建設	11,900	1,127.00	13,411,300	
北陸電気工事	7,100	1,700.00	12,070,000	
ユアテック	26,400	2,399.00	63,333,600	
日本リーテック	9,600	2,810.00	26,976,000	貸付株式数 3,800株
四電工	15,700	1,961.00	30,787,700	
中電工	16,600	5,350.00	88,810,000	
関 電 工	68,500	6,342.00	434,427,000	
きんでん	85,700	7,304.00	625,952,800	
東京エネシス	11,100	2,408.00	26,728,800	貸付株式数 4,700株
トーエネック	24,200	2,186.00	52,901,200	
日本電設工業	23,500	4,505.00	105,867,500	
エクシオグループ	117,600	2,735.50	321,694,800	
新日本空調	16,200	3,530.00	57,186,000	
クラフティア	27,000	9,282.00	250,614,000	
三機工業	76,700	2,665.00	204,405,500	貸付株式数 30,200株
日揮ホールディングス	128,000	2,688.00	344,064,000	
中外炉工業	3,300	4,020.00	13,266,000	

太平電業	24,900	2,699.00	67,205,100	貸付株式数　9,800株
高砂熱学	66,900	4,806.00	321,521,400	
朝日工業社	13,000	4,050.00	52,650,000	
明星工業	21,000	1,758.00	36,918,000	
大 氣 社	30,200	4,620.00	139,524,000	
ダイダン	72,300	2,654.00	191,884,200	
日比谷総合設備	16,800	3,150.00	52,920,000	貸付株式数　5,900株
ニップン	44,400	2,663.00	118,237,200	
日清製粉Ｇ本社	121,000	1,948.00	235,708,000	
日東富士製粉	8,900	1,710.00	15,219,000	
昭和産業	10,600	3,315.00	35,139,000	
中部飼料	15,900	1,784.00	28,365,600	
フィード・ワン	16,500	1,193.00	19,684,500	
日本甜菜糖	5,500	4,565.00	25,107,500	貸付株式数　2,100株
DM三井製糖	10,500	3,230.00	33,915,000	
ウェルネオシュガー	7,000	2,571.00	17,997,000	
ＬＩＦＵＬＬ	44,900	194.00	8,710,600	貸付株式数　17,600株
ＭＩＸＩ	23,800	2,636.00	62,736,800	
ジェイエイシーリクルートメント	47,300	857.00	40,536,100	貸付株式数　18,600株
日本M&Aセンターホールデ	208,700	643.50	134,298,450	貸付株式数　65,800株
フィットイージー	4,000	2,579.00	10,316,000	貸付株式数　1,500株
メンバーズ	4,500	1,058.00	4,761,000	
ＵＴグループ	257,800	176.00	45,372,800	貸付株式数　97,800株
アイティメディア	7,000	1,165.00	8,155,000	貸付株式数　2,600株
E・Jホールディングス	9,600	1,601.00	15,369,600	貸付株式数　1,800株
オープンアップグループ	38,900	1,885.00	73,326,500	
コシダカホールディングス	36,100	960.00	34,656,000	貸付株式数　14,200株
パソナグループ	13,400	1,494.00	20,019,600	貸付株式数　5,200株
リンクアンドモチベーション	31,200	544.00	16,972,800	貸付株式数　12,200株
エス・エム・エス	50,100	2,008.00	100,600,800	
パーソルホールディングス	1,194,100	247.70	295,778,570	
クックパッド	18,500	116.00	2,146,000	貸付株式数　12,100株
森永製菓	49,200	2,530.00	124,476,000	
中 村 屋	3,100	3,100.00	9,610,000	
江崎グリコ	35,900	5,407.00	194,111,300	貸付株式数　14,100株
ｍｅｉｔｏ	5,300	2,957.00	15,672,100	貸付株式数　2,100株
井村屋グループ	6,900	2,301.00	15,876,900	貸付株式数　2,700株
不 二 家	8,600	2,349.00	20,201,400	貸付株式数　3,400株

山崎製パン	84,000	3,104.00	260,736,000	
モロゾフ	11,800	1,512.00	17,841,600	貸付株式数 4,600株
亀田製菓	23,900	1,250.00	29,875,000	貸付株式数 9,100株
寿スピリッツ	66,700	2,335.50	155,777,850	貸付株式数 26,300株
カルビー	57,400	2,810.00	161,294,000	
森永乳業	45,200	4,931.00	222,881,200	
六甲バター	10,200	1,042.00	10,628,400	貸付株式数 4,000株
ヤクルト	161,600	2,645.50	427,512,800	貸付株式数 63,600株
明治ホールディングス	174,800	3,664.00	640,467,200	
雪印メグミルク	30,400	3,575.00	108,680,000	貸付株式数 7,900株
プリマハム	16,800	2,368.00	39,782,400	
日本ハム	44,900	6,089.00	273,396,100	
丸大食品	12,600	2,212.00	27,871,200	貸付株式数 4,800株
Ｓ Ｆｏｏｄｓ	13,800	2,651.00	36,583,800	
柿安本店	4,900	2,526.00	12,377,400	貸付株式数 1,900株
伊藤ハム米久HLDGS	21,900	4,750.00	104,025,000	貸付株式数 8,600株
学情	5,900	1,556.00	9,180,400	貸付株式数 2,300株
スタジオアリス	6,600	1,806.00	11,919,600	貸付株式数 2,500株 (300株)
クロスキャット	7,300	931.00	6,796,300	貸付株式数 100株
システナ	182,600	402.00	73,405,200	
ＮＪＳ	3,800	4,950.00	18,810,000	貸付株式数 1,500株
デジタルアーツ	6,700	3,610.00	24,187,000	貸付株式数 1,000株
日鉄ソリューションズ	34,900	3,247.00	113,320,300	貸付株式数 300株
ＡＬＳＯＫ	218,800	1,073.00	234,772,400	
キューブシステム	7,500	1,020.00	7,650,000	
いちご	99,200	445.00	44,144,000	貸付株式数 7,300株
日本駐車場開発	149,300	249.00	37,175,700	貸付株式数 58,800株
コア	5,700	2,008.00	11,445,600	貸付株式数 2,000株
カカクコム	83,700	3,325.00	278,302,500	
ルネサンス	10,200	995.00	10,149,000	貸付株式数 4,000株 (1,600株)
ディップ	22,900	1,764.00	40,395,600	貸付株式数 9,000株
SBSホールディングス	11,400	4,545.00	51,813,000	
新日本科学	13,900	1,079.00	14,998,100	貸付株式数 5,400株
エムスリー	258,800	1,602.00	414,597,600	
ワールドホールディングス	6,000	2,389.00	14,334,000	貸付株式数 400株
ディー・エヌ・エー	52,400	2,680.00	140,432,000	貸付株式数 20,600株
博報堂ＤＹHLDGS	156,000	1,131.50	176,514,000	

ぐるなび	24,000	122.00	2,928,000	貸付株式数 9,600株
タカミヤ	17,700	391.00	6,920,700	貸付株式数 7,000株
ファンコミュニケーションズ	19,000	413.00	7,847,000	貸付株式数 7,400株
ライク	6,800	1,408.00	9,574,400	貸付株式数 2,600株 (2,000株)
エスプール	33,900	248.00	8,407,200	貸付株式数 13,300株
WDBホールディングス	5,700	1,730.00	9,861,000	貸付株式数 1,800株
手間いらず	1,500	2,237.00	3,355,500	貸付株式数 500株
アドウェイズ	13,800	269.00	3,712,200	
バリューコマース	11,500	465.00	5,347,500	貸付株式数 4,500株
インフォマート	123,600	377.00	46,597,200	貸付株式数 48,800株
サッポロホールディングス	187,700	1,667.00	312,895,900	
アサヒグループホールディン	942,100	1,510.00	1,422,571,000	
キリンＨＤ	466,500	2,682.00	1,251,153,000	
シマダヤ	5,800	1,594.00	9,245,200	貸付株式数 2,100株
宝ホールディングス	103,400	2,085.50	215,640,700	
オエノンホールディングス	37,500	484.00	18,150,000	貸付株式数 400株
飛島ホールディングス	12,800	2,034.00	26,035,200	
コカ・コーラボトラーズJHD	81,600	3,727.00	304,123,200	
ライフドリンク カンパニー	22,400	1,626.00	36,422,400	貸付株式数 1,800株
サントリービバレッジ&フー	88,300	4,288.00	378,630,400	
ダイドーグループHD	14,200	2,538.00	36,039,600	貸付株式数 5,600株
伊 藤 園	40,600	2,825.50	114,715,300	貸付株式数 16,000株
キーコーヒー	14,000	1,975.00	27,650,000	貸付株式数 5,500株
日清オイリオグループ	49,900	1,797.00	89,670,300	
不二製油	25,000	3,597.00	89,925,000	貸付株式数 2,500株
Ｊ－オイルミルズ	14,400	2,039.00	29,361,600	貸付株式数 5,600株
インターメスティック	5,800	2,310.00	13,398,000	
サンエー	30,500	3,205.00	97,752,500	
カワチ薬品	10,500	3,525.00	37,012,500	貸付株式数 700株
エービーシー・マート	70,800	2,700.50	191,195,400	
ハードオフコーポレーション	5,300	2,538.00	13,451,400	
高千穂交易	10,700	2,116.00	22,641,200	貸付株式数 4,200株
アスクル	25,700	1,171.00	30,094,700	貸付株式数 11,100株
ゲオホールディングス	15,200	2,129.00	32,360,800	貸付株式数 2,100株
アンドエスティHD	18,600	3,400.00	63,240,000	貸付株式数 7,000株
リガク・ホールディングス	75,500	2,574.00	194,337,000	貸付株式数 29,800株

くら寿司	31,600	1,550.00	48,980,000	貸付株式数 12,400株
キャンドゥ	4,800	3,265.00	15,672,000	貸付株式数 1,800株
パルグループHLDGS	52,900	1,425.00	75,382,500	
エディオン	64,000	2,449.00	156,736,000	
あらた	20,600	2,454.00	50,552,400	
サーラコーポレーション	28,300	1,021.00	28,894,300	貸付株式数 7,700株
トーメンデバイス	1,900	14,960.00	28,424,000	貸付株式数 700株
ハローズ	6,100	3,825.00	23,332,500	
JPホールディングス	33,500	591.00	19,798,500	貸付株式数 12,700株
フジオフードG本社	22,000	1,173.00	25,806,000	貸付株式数 8,600株 (100株)
あみやき亭	9,800	1,350.00	13,230,000	貸付株式数 3,600株
東京エレクトロンデバイス	13,400	4,115.00	55,141,000	貸付株式数 5,300株
円谷フィールズホールディ	24,900	1,378.00	34,312,200	
双日	130,100	5,316.00	691,611,600	
グロービング	4,100	2,093.00	8,581,300	
アルフレッサホールディングス	127,600	2,200.00	280,720,000	
大黒天物産	4,800	4,300.00	20,640,000	貸付株式数 1,900株
ハニーズホールディングス	12,000	1,382.00	16,584,000	貸付株式数 4,700株
キッコーマン	415,700	1,569.50	652,441,150	
味 の 素	605,600	5,060.00	3,064,336,000	
ブルドックソース	6,300	1,749.00	11,018,700	貸付株式数 2,400株
キユーピー	67,400	4,119.00	277,620,600	貸付株式数 2,400株
ハウス食品G本社	46,900	3,524.00	165,275,600	
カ ゴ メ	65,100	2,580.00	167,958,000	貸付株式数 25,600株
アリアケジャパン	14,100	5,010.00	70,641,000	
エバラ食品工業	3,200	2,381.00	7,619,200	
キオクシアホールディングス	78,100	90,910.00	7,100,071,000	
ニチレイ	110,200	2,091.50	230,483,300	
横浜冷凍	31,000	1,768.00	54,808,000	貸付株式数 12,500株
東洋水産	58,100	9,810.00	569,961,000	
イートアンドHLDGS	6,000	2,002.00	12,012,000	貸付株式数 2,300株
ヨシムラ・フード・HLDGS	9,200	628.00	5,777,600	貸付株式数 3,400株
日清食品ＨＤ	141,800	2,727.00	386,688,600	貸付株式数 12,400株
フジッコ	14,300	1,504.00	21,507,200	貸付株式数 5,500株
ロックフィールド	14,000	1,295.00	18,130,000	貸付株式数 5,500株
日本たばこ産業	762,300	6,070.00	4,627,161,000	
ケンコーマヨネーズ	7,800	1,979.00	15,436,200	

わらべや日洋HD	8,400	2,596.00	21,806,400	
なとり	7,900	1,900.00	15,010,000	貸付株式数 3,000株
ファーマフーズ	15,300	530.00	8,109,000	貸付株式数 6,000株
北の達人コーポ	53,800	119.00	6,402,200	貸付株式数 21,100株 (5,300株)
ユーグレナ	86,200	338.00	29,135,600	貸付株式数 33,900株 (900株)
紀文食品	10,900	1,045.00	11,390,500	貸付株式数 4,200株
ピックルスホールディングス	7,400	1,098.00	8,125,200	貸付株式数 2,600株
スター・マイカ・HLDGS	13,200	1,577.00	20,816,400	貸付株式数 100株
SREホールディングス	6,200	2,462.00	15,264,400	貸付株式数 2,400株
片倉工業	13,400	2,403.00	32,200,200	
グ ン ゼ	18,100	3,815.00	69,051,500	貸付株式数 7,100株
ヒューリック	365,800	1,739.50	636,309,100	
ラサ商事	7,100	1,827.00	12,971,700	貸付株式数 2,700株
アルペン	13,000	2,090.00	27,170,000	貸付株式数 5,100株
ラクーンホールディングス	10,100	571.00	5,767,100	貸付株式数 3,900株
クオールホールディングス	16,700	1,914.00	31,963,800	貸付株式数 6,300株
アルコニックス	20,800	2,429.00	50,523,200	貸付株式数 8,100株
神戸物産	117,300	2,606.50	305,742,450	貸付株式数 34,600株
ソリトンシステムズ	6,600	2,086.00	13,767,600	
ジンズホールディングス	10,300	8,560.00	88,168,000	貸付株式数 4,000株
ビックカメラ	80,700	1,733.00	139,853,100	
DCMホールディングス	69,800	1,492.00	104,141,600	
ペッパーフードサービス	46,800	201.00	9,406,800	貸付株式数 18,400株
ＭｏｎｏｔａＲＯ	191,100	1,811.00	346,082,100	貸付株式数 72,800株
あい ホールディングス	27,000	2,700.00	72,900,000	貸付株式数 9,600株
Ｊ．フロント リテイリング	154,700	2,437.50	377,081,250	
ドトール・日レスＨＤ	23,900	2,682.00	64,099,800	
マツキヨココカラ&カンパニー	234,600	2,337.00	548,260,200	
ブロンコビリー	7,900	4,430.00	34,997,000	貸付株式数 3,100株
ＺＯＺＯ	212,500	1,093.00	232,262,500	
トレジャー・ファクトリー	9,300	2,060.00	19,158,000	
物語コーポレーション	26,100	4,785.00	124,888,500	貸付株式数 10,300株
三越伊勢丹ＨＤ	210,100	3,699.00	777,159,900	
東洋紡	55,200	1,777.00	98,090,400	
ユニチカ	44,000	1,145.00	50,380,000	貸付株式数 17,400株
富士紡ホールディングス	17,900	3,855.00	69,004,500	貸付株式数 2,000株

日清紡ホールディングス	96,800	2,189.50	211,943,600	
倉敷紡績	8,900	9,670.00	86,063,000	貸付株式数 2,700株
ダイワボウＨＤ	50,600	3,463.00	175,227,800	
シキボウ	8,600	1,004.00	8,634,400	貸付株式数 3,300株
日東紡績	16,200	19,460.00	315,252,000	貸付株式数 6,300株
トヨタ紡織	62,600	2,242.00	140,349,200	
マクニカホールディングス	93,800	3,338.00	313,104,400	貸付株式数 23,900株
Ｈａｍｅｅ	6,100	398.00	2,427,800	貸付株式数 2,400株
ラクト・ジャパン	5,700	3,230.00	18,411,000	貸付株式数 2,200株
クリエイトＳＤＨ	19,100	3,260.00	62,266,000	
グリムス	4,500	2,402.00	10,809,000	
バイタルＫＳＫHD	18,500	1,555.00	28,767,500	
八洲電機	10,100	2,741.00	27,684,100	貸付株式数 4,000株
メディアスホールディングス	8,700	855.00	7,438,500	貸付株式数 3,300株
レスター	11,500	4,505.00	51,807,500	
TOKAIホールディングス	72,200	1,113.00	80,358,600	
三洋貿易	16,600	1,538.00	25,530,800	
シュッピン	14,300	1,099.00	15,715,700	貸付株式数 5,600株
ビューティガレージ	4,300	1,427.00	6,136,100	貸付株式数 1,600株
オイシックス・ラ・大地	19,400	1,524.00	29,565,600	貸付株式数 7,600株
ウイン・パートナーズ	9,800	1,216.00	11,916,800	貸付株式数 100株
ネクステージ	30,800	3,630.00	111,804,000	
ジョイフル本田	39,500	2,230.00	88,085,000	貸付株式数 14,600株
エターナルホスピタリティグル	5,500	2,749.00	15,119,500	貸付株式数 1,800株
ホットランドホールディング	12,300	1,617.00	19,889,100	貸付株式数 4,800株 (200株)
すかいらーくHD	184,300	2,774.00	511,248,200	貸付株式数 72,600株
SFPホールディングス	7,600	2,275.00	17,290,000	
綿半ホールディングス	10,500	1,325.00	13,912,500	貸付株式数 3,800株
日本毛織	31,900	1,736.00	55,378,400	
ヨシックスホールディングス	3,900	3,250.00	12,675,000	貸付株式数 1,400株
ユナイテッド・スーパーマーケ	66,400	823.00	54,647,200	貸付株式数 26,100株
野村不動産HLDGS	349,800	939.10	328,497,180	
三重交通グループHD	30,600	525.00	16,065,000	貸付株式数 12,000株
地主	10,300	2,934.00	30,220,200	貸付株式数 3,800株
フィル・カンパニー	2,100	642.00	1,348,200	貸付株式数 800株

ＪＰＭＣ	6,700	1,307.00	8,756,900	貸付株式数　2,500株
フージャースHD	21,900	1,175.00	25,732,500	
オープンハウスグループ	38,900	8,686.00	337,885,400	
東急不動産ＨＤ	343,000	1,349.00	462,707,000	
飯田ＧＨＤ	106,900	2,209.50	236,195,550	
帝国繊維	13,100	3,315.00	43,426,500	貸付株式数　5,100株
日本コークス工業	129,700	98.00	12,710,600	貸付株式数　51,000株
あさひ	11,300	1,291.00	14,588,300	貸付株式数　4,400株
コスモス薬品	22,900	6,150.00	140,835,000	
シップヘルスケアHD	49,400	2,124.50	104,950,300	
ソフトクリエイトHD	10,500	1,666.00	17,493,000	貸付株式数　4,100株
セブン&アイ・HLDGS	1,489,100	1,939.50	2,888,109,450	
クリエイト・レストランツ・ホール	202,800	710.00	143,988,000	貸付株式数　80,100株 (1,300株)
明治電機工業	6,700	2,113.00	14,157,100	
ツルハホールディングス	210,800	2,062.50	434,775,000	貸付株式数　34,300株
サンマルクホールディングス	12,000	2,440.00	29,280,000	貸付株式数　4,700株
トリドールホールディングス	38,000	3,740.00	142,120,000	貸付株式数　15,000株 (400株)
帝 人	113,200	1,654.50	187,289,400	
東 レ	860,200	1,197.50	1,030,089,500	
ク ラ レ	161,400	1,774.50	286,404,300	
旭 化 成	845,900	1,764.50	1,492,590,550	
TOKYO BASE	18,700	373.00	6,975,100	貸付株式数　1,800株
稲葉製作所	6,500	1,760.00	11,440,000	貸付株式数　2,800株
宮地エンジニアリングＧ	17,100	1,566.00	26,778,600	貸付株式数　6,700株
トーカロ	37,900	3,160.00	119,764,000	
ＳＵＭＣＯ	250,300	4,305.00	1,077,541,500	
川田テクノロジーズ	30,000	1,250.00	37,500,000	
RS TECHNOLOGIES	8,900	6,990.00	62,211,000	貸付株式数　3,400株
AND DOホールディングス	6,600	1,032.00	6,811,200	貸付株式数　2,600株
ケイアイスター不動産	10,600	3,855.00	40,863,000	貸付株式数　1,500株
ジェイ・エス・ビー	5,200	7,930.00	41,236,000	貸付株式数　2,000株
ロードスターキャピタル	7,100	3,105.00	22,045,500	貸付株式数　2,800株
アズーム	2,900	4,235.00	12,281,500	貸付株式数　1,100株
霞ヶ関キャピタル	12,900	6,280.00	81,012,000	貸付株式数　4,400株
JMホールディングス	21,900	1,201.00	26,301,900	貸付株式数　8,600株
コメダホールディングス	33,100	2,717.00	89,932,700	

ユニシアホールディングス	4,000	1,535.00	6,140,000	貸付株式数	1,600株
バロックジャパン	15,700	728.00	11,429,600	貸付株式数	6,200株
クスリのアオキHLDGS	31,900	3,801.00	121,251,900	貸付株式数	12,600株
力の源HD	10,100	1,521.00	15,362,100	貸付株式数	4,000株
FOOD&LIFE COMPAN	77,400	10,050.00	777,870,000		
アセンテック	16,700	405.00	6,763,500		
セーレン	27,700	3,390.00	93,903,000		
小松マテーレ	16,800	698.00	11,726,400		
ワコールホールディングス	25,000	4,445.00	111,125,000		
ＴＳＩホールディングス	33,200	1,165.00	38,678,000		
ワールド	42,200	1,534.00	64,734,800	貸付株式数	13,400株
ＴＩＳ	130,600	3,165.00	413,349,000		
グリーホールディングス	42,800	394.00	16,863,200		
ＧＭＯペパボ	1,600	1,578.00	2,524,800	貸付株式数	600株
コーエーテクモＨＤ	80,100	1,447.50	115,944,750		
三菱総合研究所	6,900	4,545.00	31,360,500		
ファインデックス	8,900	784.00	6,977,600		
ＫＬａｂ	38,200	227.00	8,671,400	貸付株式数	15,000株
ポールトゥウィンホールディン	18,200	312.00	5,678,400		
ネクソン	302,200	2,200.00	664,840,000		
アイスタイル	48,900	381.00	18,630,900	貸付株式数	19,200株
エムアップホールディングス	31,300	678.00	21,221,400		
エイチームホールディングス	9,000	928.00	8,352,000	貸付株式数	3,500株
セルシス	16,600	1,866.00	30,975,600	貸付株式数	6,500株
エニグモ	14,200	373.00	5,296,600	貸付株式数	5,600株 (4,700株)
コロプラ	43,500	370.00	16,095,000	貸付株式数	17,100株
ブロードリーフ	46,600	797.00	37,140,200	貸付株式数	16,000株
デジタルハーツHLDGS	8,000	688.00	5,504,000	貸付株式数	3,000株
メディアドゥ	4,400	1,296.00	5,702,400	貸付株式数	1,700株
じげん	36,700	383.00	14,056,100	貸付株式数	14,400株
フィックスターズ	17,600	2,127.00	37,435,200	貸付株式数	6,900株
北里コーポレーション	13,300	1,166.00	15,507,800	貸付株式数	5,200株
オプティム	13,000	431.00	5,603,000	貸付株式数	5,100株
セレス	5,800	1,845.00	10,701,000	貸付株式数	2,200株
ＳＨＩＦＴ	127,500	636.80	81,192,000	貸付株式数	50,300株
特種東海製紙	22,300	1,843.00	41,098,900	貸付株式数	8,500株

セック	3,900	3,225.00	12,577,500	貸付株式数 1,500株
テクマトリックス	25,500	1,806.00	46,053,000	貸付株式数 600株
プロシップ	10,300	1,657.00	17,067,100	貸付株式数 4,000株
ガンホー・オンライン・エンター	29,600	2,186.00	64,705,600	
GMOペイメントゲートウェイ	29,200	8,203.00	239,527,600	
システムリサーチ	9,600	1,728.00	16,588,800	貸付株式数 3,000株
インターネットイニシアティブ	69,900	2,940.00	205,506,000	
さくらインターネット	18,000	2,850.00	51,300,000	貸付株式数 7,000株
GMOグローバルサインHD	3,900	1,935.00	7,546,500	貸付株式数 800株
SRAホールディングス	7,300	4,510.00	32,923,000	貸付株式数 2,700株
朝日ネット	13,700	602.00	8,247,400	貸付株式数 5,200株
ｅＢＡＳＥ	15,700	390.00	6,123,000	貸付株式数 5,100株
アバントグループ	13,700	1,111.00	15,220,700	貸付株式数 5,200株
アドソル日進	9,900	1,373.00	13,592,700	貸付株式数 3,800株
フリービット	6,700	1,368.00	9,165,600	貸付株式数 2,600株
コムチュア	16,900	1,280.00	21,632,000	貸付株式数 6,600株
アステリア	10,000	1,440.00	14,400,000	貸付株式数 3,900株
アイル	8,300	2,200.00	18,260,000	貸付株式数 3,200株
王子ホールディングス	483,200	797.30	385,255,360	
日本製紙	72,000	1,235.00	88,920,000	
北越コーポレーション	62,100	951.00	59,057,100	貸付株式数 800株
大王製紙	64,400	945.00	60,858,000	
マークラインズ	7,600	1,275.00	9,690,000	
ｇｕｍｉ	23,100	259.00	5,982,900	貸付株式数 9,000株
テラスカイ	4,300	2,400.00	10,320,000	貸付株式数 1,700株
デジタル・インフォメーション	13,300	800.00	10,640,000	
ネオジャパン	3,400	1,451.00	4,933,400	
ＰＲ ＴＩＭＥＳ	2,600	2,208.00	5,740,800	貸付株式数 500株
ラクス	118,200	903.50	106,793,700	
ダブルスタンダード	4,500	1,186.00	5,337,000	貸付株式数 1,800株
オープンドア	7,500	261.00	1,957,500	貸付株式数 3,000株
アカツキ	6,200	2,835.00	17,577,000	
UBICOMホールディングス	4,100	937.00	3,841,700	貸付株式数 1,600株
カナミックネットワーク	16,000	496.00	7,936,000	貸付株式数 6,100株
レンゴー	129,100	1,420.50	183,386,550	
トーモク	7,400	3,810.00	28,194,000	

ザ・パック	25,600	1,334.00	34,150,400	貸付株式数 10,100株
チェンジホールディングス	24,600	942.00	23,173,200	
オークネット	22,900	1,420.00	32,518,000	貸付株式数 9,000株
オロ	5,200	2,026.00	10,535,200	貸付株式数 2,000株
ユーザーローカル	5,400	1,775.00	9,585,000	貸付株式数 2,100株
PKSHA TECHNOLOGY	13,700	2,675.00	36,647,500	貸付株式数 5,600株
マネーフォワード	29,100	4,063.00	118,233,300	貸付株式数 11,500株
レゾナック・ホールディング	123,300	18,395.00	2,268,103,500	貸付株式数 46,900株
住友化学	1,026,900	576.50	592,007,850	
住友精化	26,600	1,329.00	35,351,400	
日産化学	64,200	7,800.00	500,760,000	
ラサ工業	20,800	2,170.00	45,136,000	
クレハ	19,000	3,890.00	73,910,000	貸付株式数 7,200株
多木化学	5,000	5,110.00	25,550,000	貸付株式数 1,900株
テイカ	9,100	2,269.00	20,647,900	
石原産業	21,200	3,090.00	65,508,000	
日本曹達	26,300	3,595.00	94,548,500	
東ソー	185,900	3,037.00	564,578,300	
トクヤマ	44,700	5,100.00	227,970,000	
セントラル硝子	16,100	4,130.00	66,493,000	
東亜合成	51,400	1,766.00	90,772,400	
大阪ソーダ	44,600	1,931.00	86,122,600	
関東電化	24,700	3,885.00	95,959,500	貸付株式数 9,700株
GMOフィナンシャルゲート	2,400	6,020.00	14,448,000	貸付株式数 900株
SUN ASTERISK	11,300	430.00	4,859,000	貸付株式数 4,000株 (200株)
デンカ	50,600	4,227.00	213,886,200	
イビデン	161,100	22,750.00	3,665,025,000	
信越化学	1,134,900	7,564.00	8,584,383,600	
日本カーバイド	6,300	3,670.00	23,121,000	
プラスアルファ・コンサルティン	18,200	2,555.00	46,501,000	
電算システムＨＤ	5,700	2,878.00	16,404,600	貸付株式数 2,200株
堺 化 学	9,900	4,815.00	47,668,500	
第一稀元素化学工	12,800	1,951.00	24,972,800	貸付株式数 5,000株
日本酸素HLDGS	144,400	5,628.00	812,683,200	
日本化学工業	5,100	5,020.00	25,602,000	貸付株式数 2,000株
日本パーカライジング	63,200	1,807.00	114,202,400	
高圧ガス	18,500	1,100.00	20,350,000	貸付株式数 7,300株

四国化成ホールディンク	14,400	6,690.00	96,336,000	貸付株式数 5,600株
オリオンビール	28,300	1,195.00	33,818,500	貸付株式数 11,100株
戸田工業	2,900	1,735.00	5,031,500	貸付株式数 1,100株
ステラ ケミファ	6,800	7,230.00	49,164,000	貸付株式数 2,600株
保土谷化学	8,000	2,280.00	18,240,000	
日本触媒	78,600	2,115.50	166,278,300	
大日精化	34,500	1,068.00	36,846,000	貸付株式数 13,600株
カネカ	30,000	5,666.00	169,980,000	
協和キリン	150,300	2,388.50	358,991,550	
ブルーゾーンホールディンク	79,900	1,755.50	140,264,450	
APPIER GROUP	48,900	805.00	39,364,500	貸付株式数 19,300株
三菱瓦斯化学	90,800	5,043.00	457,904,400	
三井化学	229,700	2,185.50	502,009,350	
東京応化工業	60,900	10,590.00	644,931,000	
大阪有機化学	10,700	5,700.00	60,990,000	
三菱ケミカルグループ	892,800	1,128.50	1,007,524,800	
ＫＨネオケム	21,200	2,751.00	58,321,200	貸付株式数 8,400株
ビジョナル	17,200	7,284.00	125,284,800	貸付株式数 5,800株
ダイセル	139,900	1,355.50	189,634,450	
住友ベ－クライト	42,000	6,793.00	285,306,000	
積水化学	266,600	2,434.50	649,037,700	
日本ゼオン	89,700	2,334.00	209,359,800	貸付株式数 35,400株
アイカ工業	32,200	3,516.00	113,215,200	貸付株式数 7,100株
ＵＢＥ	65,800	3,203.00	210,757,400	
積水樹脂	15,200	2,375.00	36,100,000	
旭有機材	8,500	7,230.00	61,455,000	貸付株式数 3,200株
ニチバン	7,900	1,841.00	14,543,900	貸付株式数 3,000株
リケンテクノス	22,000	1,708.00	37,576,000	
大倉工業	6,500	4,895.00	31,817,500	
積水化成品	20,200	572.00	11,554,400	
群栄化学	3,000	4,945.00	14,835,000	貸付株式数 1,100株
ダイキョーニシカワ	27,000	1,039.00	28,053,000	
森六	6,900	2,368.00	16,339,200	貸付株式数 2,500株
恵和	8,300	1,248.00	10,358,400	
日本化薬	91,500	2,130.00	194,895,000	
カーリット	10,900	2,215.00	24,143,500	貸付株式数 300株
CLホールディングス	3,800	1,102.00	4,187,600	貸付株式数 1,400株
プレステージ・インター	48,500	651.00	31,573,500	
ハイマックス	3,500	1,174.00	4,109,000	貸付株式数 1,400株

テクセンドフォトマスク	47,300	4,070.00	192,511,000	
アミューズ	7,100	1,813.00	12,872,300	
野村総合研究所	249,200	4,565.00	1,137,598,000	
ドリームインキュベータ	4,100	2,774.00	11,373,400	貸付株式数 1,500株
クイック	32,300	725.00	23,417,500	貸付株式数 12,700株
日本システム技術	11,800	1,599.00	18,868,200	貸付株式数 4,600株
電通グループ	126,600	3,101.00	392,586,600	
インテージホールディングス	9,600	1,701.00	16,329,600	貸付株式数 3,300株
テイクアンドギヴニーズ	6,200	668.00	4,141,600	貸付株式数 800株
ぴあ	6,000	2,595.00	15,570,000	貸付株式数 1,400株
イオンファンタジー	5,700	2,492.00	14,204,400	貸付株式数 2,200株
ソースネクスト	66,200	103.00	6,818,600	貸付株式数 25,900株
シーティーエス	16,000	827.00	13,232,000	
メディカルシステムネットワーク	13,100	479.00	6,274,900	
日本精化	7,900	2,493.00	19,694,700	
扶桑化学工業	40,600	4,085.00	165,851,000	
トリケミカル	15,500	3,800.00	58,900,000	貸付株式数 6,000株
シンプレクスＨＤ	101,700	967.00	98,343,900	
ＨＥＲＯＺ	5,000	788.00	3,940,000	貸付株式数 2,000株 (300株)
メルカリ	55,000	3,720.00	204,600,000	貸付株式数 4,300株
ＩＰＳ	3,700	3,605.00	13,338,500	貸付株式数 1,400株
システムサポートホールディン	10,900	978.00	10,660,200	貸付株式数 4,200株
ＡＤＥＫＡ	49,400	4,125.00	203,775,000	
日油	146,500	2,734.00	400,531,000	
ハリマ化成グループ	9,900	1,138.00	11,266,200	貸付株式数 200株
ボードルア	9,200	2,443.00	22,475,600	貸付株式数 3,600株
ＮＥ	13,200	221.00	2,917,200	貸付株式数 4,900株
イーソル	8,600	772.00	6,639,200	
ウイングアーク1ST	13,400	2,343.00	31,396,200	
ヒト・コミュニケーションズHD	4,200	834.00	3,502,800	貸付株式数 1,900株
サーバーワークス	2,600	1,975.00	5,135,000	
Ｓａｎｓａｎ	42,300	1,476.00	62,434,800	貸付株式数 16,700株
ギフティ	9,900	1,039.00	10,286,100	
花 王	302,600	6,055.00	1,832,243,000	
第一工業製薬	5,100	11,500.00	58,650,000	貸付株式数 500株

石原ケミカル	5,400	3,645.00	19,683,000	
三洋化成	7,800	5,310.00	41,418,000	
メドレー	15,600	2,016.00	31,449,600	貸付株式数　4,000株
ベース	5,400	2,880.00	15,552,000	貸付株式数　2,100株
ＪＭＤＣ	18,700	2,729.00	51,032,300	貸付株式数　7,400株
武田薬品	1,137,200	5,088.00	5,786,073,600	
アステラス製薬	1,120,800	2,152.50	2,412,522,000	
住友ファーマ	128,400	1,418.50	182,135,400	貸付株式数　42,200株
塩野義製薬	466,200	2,787.00	1,299,299,400	
日本新薬	33,500	3,997.00	133,899,500	
中外製薬	400,000	7,428.00	2,971,200,000	
科研製薬	18,900	3,830.00	72,387,000	
エーザイ	166,700	3,821.00	636,960,700	
理研ビタミン	11,000	2,992.00	32,912,000	
ロート製薬	135,000	2,279.00	307,665,000	
小野薬品	285,100	2,265.00	645,751,500	
持田製薬	15,600	3,150.00	49,140,000	
参天製薬	215,000	1,902.50	409,037,500	
扶桑薬品	4,900	2,057.00	10,079,300	
ツムラ	43,900	3,723.00	163,439,700	
テ ル モ	846,500	2,237.00	1,893,620,500	
ＨＵグループＨＤ	41,100	3,244.00	133,328,400	貸付株式数　16,200株
キッセイ薬品工業	20,000	3,950.00	79,000,000	
生化学工業	21,600	717.00	15,487,200	
栄研化学	18,100	2,658.00	48,109,800	
ＪＣＲファーマ	55,600	455.00	25,298,000	貸付株式数　21,200株
東和薬品	17,200	3,915.00	67,338,000	
富士製薬工業	10,100	2,210.00	22,321,000	
ゼリア新薬工業	16,700	2,108.00	35,203,600	
ネクセラファーマ	56,000	956.00	53,536,000	貸付株式数　22,100株
第一三共	1,173,300	2,546.00	2,987,221,800	
杏林製薬	25,700	1,142.00	29,349,400	
大幸薬品	26,500	260.00	6,890,000	貸付株式数　10,400株
ダイト	15,800	1,207.00	19,070,600	
大塚ホールディングス	284,600	10,230.00	2,911,458,000	
ペプチドリーム	61,900	925.10	57,263,690	貸付株式数　24,400株
大日本塗料	14,200	1,335.00	18,957,000	貸付株式数　5,400株
日本ペイントHOLD	677,600	1,068.00	723,676,800	
関西ペイント	101,700	2,575.00	261,877,500	貸付株式数　40,000株
中国塗料	26,200	3,555.00	93,141,000	

藤倉化成	14,700	1,119.00	16,449,300	
太陽ホールディングス	61,200	5,326.00	325,951,200	
ＤＩＣ	45,300	5,030.00	227,859,000	貸付株式数　17,900株
サカタインクス	28,400	2,393.00	67,961,200	
ARTIENCE	24,000	4,255.00	102,120,000	
アルプス技研	10,900	2,328.00	25,375,200	
サニックスホールディングス	16,100	226.00	3,638,600	貸付株式数　6,400株
日本空調サービス	14,100	1,553.00	21,897,300	
オリエンタルランド	772,000	2,263.00	1,747,036,000	
フォーカスシステムズ	8,500	1,560.00	13,260,000	貸付株式数　2,700株
ダスキン	29,700	4,226.00	125,512,200	貸付株式数　11,700株
パーク２４	89,600	1,864.50	167,059,200	
明光ネットワークジャパン	16,000	681.00	10,896,000	貸付株式数　6,500株
ファルコホールディングス	5,100	2,565.00	13,081,500	
クレスコ	22,000	1,451.00	31,922,000	貸付株式数　2,900株
フジ・メディア・HD	100,400	4,065.00	408,126,000	貸付株式数　26,800株
ラウンドワン	124,000	1,056.00	130,944,000	
リゾートトラスト	124,100	1,705.00	211,590,500	
オービック	237,300	3,852.00	914,079,600	
ジャストシステム	18,400	3,825.00	70,380,000	
ＴＤＣソフト	23,900	903.00	21,581,700	貸付株式数　9,400株
ＬＩＮＥヤフー	1,968,000	410.90	808,651,200	
ビー・エム・エル	17,500	3,625.00	63,437,500	貸付株式数　2,100株
トレンドマイクロ	73,800	5,865.00	432,837,000	
IDホールディングス	16,400	1,067.00	17,498,800	
リソー教育グループ	41,000	192.00	7,872,000	
日本オラクル	24,500	8,699.00	213,125,500	
早稲田アカデミー	6,300	2,537.00	15,983,100	貸付株式数　2,400株 (200株)
アルファシステムズ	4,000	3,150.00	12,600,000	
NSグループ	22,400	1,406.00	31,494,400	貸付株式数　2,400株
フューチャー	27,200	1,499.00	40,772,800	
CAC HOLDINGS	7,800	1,781.00	13,891,800	
ユー・エス・エス	248,400	1,861.00	462,272,400	
オービックビジネスＣ	21,600	5,888.00	127,180,800	
アイティフォー	13,300	1,604.00	21,333,200	
東計電算	3,600	4,200.00	15,120,000	
サイバーエージェント	289,900	1,295.00	375,420,500	
楽天グループ	1,036,000	739.70	766,329,200	

クリーク・アンド・リバー社	7,700	1,274.00	9,809,800	貸付株式数 3,000株
SBIグローバルアセット	24,500	581.00	14,234,500	
テー・オー・ダブリュー	25,700	347.00	8,917,900	貸付株式数 10,100株
大塚商会	144,800	2,798.00	405,150,400	
サイボウズ	17,600	2,359.00	41,518,400	貸付株式数 6,900株
GMOインターネット	3,500	444.00	1,554,000	貸付株式数 1,400株
山田コンサルティングGP	5,700	1,640.00	9,348,000	貸付株式数 2,100株
セントラルスポーツ	5,500	2,361.00	12,985,500	貸付株式数 2,000株
パラカ	4,500	1,946.00	8,757,000	貸付株式数 1,700株
電通総研	46,600	2,027.00	94,458,200	
デジタルガレージ	18,200	1,823.00	33,178,600	
イーエムシステムズ	16,800	493.00	8,282,400	貸付株式数 6,600株
ウェザーニューズ	18,100	2,069.00	37,448,900	貸付株式数 6,800株
ＣＩＪ	30,900	501.00	15,480,900	貸付株式数 12,100株
ビジネスエンジニアリング	15,000	1,016.00	15,240,000	貸付株式数 5,900株
WOWOW	9,600	1,041.00	9,993,600	貸付株式数 3,800株
スカラ	11,700	335.00	3,919,500	貸付株式数 500株
フルキャストホールディングス	10,100	1,543.00	15,584,300	貸付株式数 3,600株
エン	21,300	1,185.00	25,240,500	貸付株式数 8,100株
セルソース	7,400	296.00	2,190,400	貸付株式数 2,900株
あすか製薬ＨＤ	12,300	2,362.00	29,052,600	貸付株式数 3,300株
サワイグループHD	66,000	1,674.00	110,484,000	
富士フイルムHLDGS	770,400	3,439.00	2,649,405,600	
コニカミノルタ	287,400	589.70	169,479,780	
資 生 堂	247,700	2,597.00	643,276,900	
ライオン	146,600	1,656.50	242,842,900	
高砂香料	48,000	1,142.00	54,816,000	貸付株式数 12,600株
ミルボン	20,000	2,700.00	54,000,000	
コーセーホールディングス	28,900	5,184.00	149,817,600	貸付株式数 11,400株
コタ	13,900	1,140.00	15,846,000	
ポーラ・オルビスHD	65,500	1,257.50	82,366,250	貸付株式数 24,900株
ノエビアホールディングス	11,400	4,275.00	48,735,000	貸付株式数 4,400株
新日本製薬	7,300	1,939.00	14,154,700	
Ｉ－ｎｅ	3,400	1,339.00	4,552,600	貸付株式数 1,300株
アクシージア	6,800	332.00	2,257,600	貸付株式数 3,000株
エステー	12,000	1,462.00	17,544,000	貸付株式数 4,600株
コ ニ シ	40,300	1,443.00	58,152,900	貸付株式数 15,900株

長谷川香料	24,400	3,205.00	78,202,000	
小林製薬	33,500	5,468.00	183,178,000	
荒川化学工業	10,800	1,904.00	20,563,200	貸付株式数 4,000株
メック	9,300	10,800.00	100,440,000	
日本高純度化学	3,200	5,190.00	16,608,000	貸付株式数 1,200株
ＪＣＵ	13,700	7,320.00	100,284,000	貸付株式数 800株
ＯＡＴアグリオ	4,700	2,645.00	12,431,500	
デクセリアルズ	108,200	4,285.00	463,637,000	
アース製薬	11,600	4,650.00	53,940,000	貸付株式数 4,600株
北興化学	9,200	2,079.00	19,126,800	
大成ラミックグループ	3,700	2,297.00	8,498,900	貸付株式数 1,400株
クミアイ化学	57,100	746.00	42,596,600	貸付株式数 15,400株
日本農薬	19,500	1,023.00	19,948,500	
ニチレキグループ	13,600	2,091.00	28,437,600	貸付株式数 2,800株
ユシロ	6,600	3,295.00	21,747,000	貸付株式数 2,500株
ＪＸ金属	503,200	3,766.00	1,895,051,200	
出光興産	524,500	1,331.50	698,371,750	
ENEOSホールディングス	1,805,500	1,246.00	2,249,653,000	
コスモエネルギーHLDGS	70,800	3,684.00	260,827,200	
ＡＮＹＣＯＬＯＲ	20,400	2,271.00	46,328,400	貸付株式数 8,000株
日本ビジネスシステムズ	13,800	1,507.00	20,796,600	
テスホールディングス	33,700	868.00	29,251,600	貸付株式数 13,200株
インフロニアＨＤ	130,900	2,716.00	355,524,400	
横浜ゴム	71,400	7,751.00	553,421,400	
TOYO TIRE	80,800	3,924.00	317,059,200	
ブリヂストン	699,200	3,513.00	2,456,289,600	
住友ゴム	137,900	2,277.50	314,067,250	
藤倉コンポジット	10,500	2,580.00	27,090,000	貸付株式数 3,700株
オカモト	6,700	5,770.00	38,659,000	貸付株式数 1,400株
アキレス	7,000	1,197.00	8,379,000	貸付株式数 2,100株
フ コ ク	6,100	1,802.00	10,992,200	
ニッタ	12,600	6,110.00	76,986,000	貸付株式数 4,900株
三ツ星ベルト	16,300	3,970.00	64,711,000	
バンドー化学	19,000	2,231.00	42,389,000	
ＡＧＣ	124,300	7,382.00	917,582,600	
日本板硝子	67,800	473.00	32,069,400	
有沢製作所	22,400	2,451.00	54,902,400	
日本電気硝子	42,700	6,220.00	265,594,000	
オハラ	4,900	1,522.00	7,457,800	貸付株式数 1,800株
住友大阪セメント	21,400	5,804.00	124,205,600	

太平洋セメント	78,800	4,407.00	347,271,600	
日本ヒユーム	22,400	1,040.00	23,296,000	貸付株式数　8,800株
日本コンクリート	24,800	330.00	8,184,000	貸付株式数　9,700株
三谷セキサン	21,000	1,426.00	29,946,000	貸付株式数　8,200株
アジアパイルＨＤ	20,000	1,566.00	31,320,000	貸付株式数　7,100株
東海カーボン	128,600	1,822.00	234,309,200	
日本カーボン	7,300	4,780.00	34,894,000	
東洋炭素	11,000	8,380.00	92,180,000	貸付株式数　4,300株
ノリタケ	26,800	4,020.00	107,736,000	
ＴＯＴＯ	79,300	8,190.00	649,467,000	
ＮＧＫ	139,200	6,635.00	923,592,000	
日本特殊陶業	104,400	10,235.00	1,068,534,000	
ＭＡＲＵＷＡ	5,300	68,900.00	365,170,000	貸付株式数　2,000株
品川リフラ	15,700	1,911.00	30,002,700	貸付株式数　5,900株
ヨータイ	7,500	1,735.00	13,012,500	
フジミインコーポレーテッド	38,200	4,265.00	162,923,000	貸付株式数　15,000株
ニチアス	100,100	3,778.00	378,177,800	
日本製鉄	3,584,300	574.20	2,058,105,060	
神戸製鋼所	264,400	1,997.00	528,006,800	
中山製鋼所	27,000	634.00	17,118,000	貸付株式数　400株
合同製鐵	7,400	2,637.00	19,513,800	貸付株式数　2,800株
ＪＦＥホールディングス	426,500	1,647.50	702,658,750	
東京製鐵	36,700	1,760.00	64,592,000	
ARCHION	191,600	299.00	57,288,400	貸付株式数　75,600株
共英製鋼	15,000	1,782.00	26,730,000	貸付株式数　5,900株
大和工業	23,600	12,310.00	290,516,000	貸付株式数　9,300株
東京鐵鋼	14,500	1,850.00	26,825,000	貸付株式数　6,000株
大阪製鐵	6,000	2,401.00	14,406,000	貸付株式数　2,400株
GMSグループ	17,000	361.00	6,137,000	
ヨドコウ	74,400	1,271.00	94,562,400	貸付株式数　29,400株
トランヴィア	7,500	817.00	6,127,500	貸付株式数　2,900株
中部鋼鈑	12,000	2,066.00	24,792,000	貸付株式数　4,700株
丸一鋼管	132,100	1,681.00	222,060,100	
モリ工業	14,800	946.00	14,000,800	貸付株式数　1,500株
MIRAINIホールディング	20,300	1,811.00	36,763,300	
大同特殊鋼	93,200	2,460.00	229,272,000	
ムニノバホールディングス	207,800	421.00	87,483,800	
日本冶金工	8,900	4,560.00	40,584,000	

愛知製鋼	24,600	3,115.00	76,629,000	貸付株式数 9,700株
大平洋金属	11,200	2,325.00	26,040,000	貸付株式数 4,400株
新日本電工	72,000	479.00	34,488,000	
栗本鉄工所	30,500	1,425.00	43,462,500	貸付株式数 12,000株
日本製鋼所	39,000	7,640.00	297,960,000	
三菱製鋼	9,000	2,196.00	19,764,000	貸付株式数 2,500株
日本精線	10,400	1,526.00	15,870,400	
エンビプロＨＤ	11,600	850.00	9,860,000	貸付株式数 4,500株
大紀アルミニウム	18,700	1,829.00	34,202,300	
日本軽金属ＨＤ	38,400	3,105.00	119,232,000	
三井金属	32,800	44,690.00	1,465,832,000	
東邦亜鉛	11,600	894.00	10,370,400	貸付株式数 4,400株
三菱マテリアル	87,700	5,005.00	438,938,500	
住友鉱山	180,100	9,200.00	1,656,920,000	
DOWAホールディングス	35,400	9,870.00	349,398,000	
古河機金	14,000	4,125.00	57,750,000	貸付株式数 5,500株
大阪チタニウム	22,800	2,739.00	62,449,200	貸付株式数 9,000株 (400株)
ＵＡＣＪ	79,500	3,040.00	241,680,000	
ＣＫサンエツ	3,200	4,895.00	15,664,000	
前澤ホールディングス	9,100	1,452.00	13,213,200	
古河電工	43,800	43,970.00	1,925,886,000	
住友電工	453,900	11,530.00	5,233,467,000	
フジクラ	1,014,900	4,346.00	4,410,755,400	
ＳＷＣＣ	19,100	12,820.00	244,862,000	
平河ヒューテック	7,900	3,650.00	28,835,000	
いよぎんホールディンク	164,300	3,165.00	520,009,500	貸付株式数 56,300株
しずおかフィナンシャルク	276,400	3,121.00	862,644,400	
ちゅうぎんフィナンシャ	105,700	3,153.00	333,272,100	
楽天銀行	66,500	5,119.00	340,413,500	貸付株式数 10,000株
京都フィナンシャルＧ	172,300	4,500.00	775,350,000	
リョービ	15,200	2,691.00	40,903,200	
AREホールディングス	57,900	3,215.00	186,148,500	
JAPAN EYEWEAR HO	5,800	2,417.00	14,018,600	貸付株式数 1,600株
東洋製罐グループHD	65,700	3,979.00	261,420,300	
ホッカンホールディングス	7,100	2,322.00	16,486,200	貸付株式数 2,600株
コロナ	7,300	928.00	6,774,400	貸付株式数 2,700株
横河ブリッジHLDGS	22,600	2,830.00	63,958,000	
三和ホールディングス	126,400	3,747.00	473,620,800	
文化シヤツター	41,300	1,860.00	76,818,000	

三協立山	16,500	633.00	10,444,500	
アルインコ	10,000	1,032.00	10,320,000	貸付株式数 3,100株
ＬＩＸＩＬ	205,500	1,736.00	356,748,000	貸付株式数 78,400株
ノーリツ	23,100	2,246.00	51,882,600	
長府製作所	13,100	2,011.00	26,344,100	
リンナイ	67,200	3,479.00	233,788,800	
ユニプレス	23,600	1,224.00	28,886,400	
日東精工	17,200	776.00	13,347,200	
岡 部	22,600	902.00	20,385,200	貸付株式数 8,600株
ジーテクト	16,700	2,093.00	34,953,100	
東 プ レ	23,200	2,757.00	63,962,400	
高周波熱錬	18,700	1,302.00	24,347,400	貸付株式数 7,200株
東京製綱	7,800	2,082.00	16,239,600	貸付株式数 3,000株
サンコール	13,000	1,491.00	19,383,000	貸付株式数 5,200株
パイオラックス	14,100	1,577.00	22,235,700	貸付株式数 5,500株
エイチワン	13,500	1,510.00	20,385,000	
日本発条	99,100	3,756.00	372,219,600	
中央発條	8,500	3,840.00	32,640,000	貸付株式数 3,200株
三浦工業	59,700	3,190.00	190,443,000	
タ ク マ	36,100	3,445.00	124,364,500	
弁護士ドットコム	6,500	2,081.00	13,526,500	貸付株式数 2,600株
アイ・アールジャパンHD	6,800	712.00	4,841,600	貸付株式数 2,400株
ＫｅｅＰｅｒ技研	8,100	2,787.00	22,574,700	貸付株式数 3,200株
Ｇｕｎｏｓｙ	10,400	442.00	4,596,800	貸付株式数 4,000株
イー・ガーディアン	4,000	1,661.00	6,644,000	
ジャパンマテリアル	40,100	2,470.00	99,047,000	
ベクトル	17,900	1,492.00	26,706,800	
チャームケアコーポレーション	10,900	1,307.00	14,246,300	貸付株式数 100株
キャリアリンク	4,800	2,173.00	10,430,400	貸付株式数 1,800株
ＩＢＪ	10,000	786.00	7,860,000	貸付株式数 3,900株
アサンテ	6,500	1,388.00	9,022,000	貸付株式数 2,500株
バリューＨＲ	11,700	1,389.00	16,251,300	貸付株式数 4,600株 (700株)
M&Aキャピタルパートナー	10,600	3,580.00	37,948,000	
ライドオンエクスプレスHD	5,200	970.00	5,044,000	
シグマクシス・ホールディンク	36,900	530.00	19,557,000	
ウィルグループ	12,100	1,017.00	12,305,700	貸付株式数 4,500株

リクルートホールディングス	912,000	10,720.00	9,776,640,000	※
エラン	11,500	725.00	8,337,500	貸付株式数　4,400株
ツ ガ ミ	27,400	7,140.00	195,636,000	
オークマ	22,500	4,335.00	97,537,500	
芝浦機械	15,400	3,880.00	59,752,000	
アマダ	181,500	3,090.00	560,835,000	
アイダエンジニア	22,700	1,109.00	25,174,300	
ＦＵＪＩ	51,300	8,283.00	424,917,900	
牧野フライス	13,000	14,170.00	184,210,000	
オーエスジー	45,800	3,490.00	159,842,000	貸付株式数　18,000株
旭ダイヤモンド	30,000	1,315.00	39,450,000	貸付株式数　11,800株
DMG森精機	88,200	3,671.00	323,782,200	貸付株式数　34,700株
ソディツク	31,300	2,017.00	63,132,100	
ディスコ	62,000	85,250.00	5,285,500,000	
日東工器	4,600	1,618.00	7,442,800	
日進工具	10,700	868.00	9,287,600	
冨士ダイス	9,500	970.00	9,215,000	貸付株式数　3,600株
日本郵政	1,077,400	2,285.50	2,462,397,700	
ベルシステム24HLDGS	17,800	1,367.00	24,332,600	貸付株式数　7,000株
鎌倉新書	13,000	477.00	6,201,000	貸付株式数　5,100株
エアトリ	11,900	795.00	9,460,500	貸付株式数　4,700株
アトラエ	10,600	701.00	7,430,600	貸付株式数　4,200株
ストライクグループ	22,000	1,269.00	27,918,000	貸付株式数　8,600株
ソラスト	8,900	1,111.00	9,887,900	
セラク	3,900	1,124.00	4,383,600	貸付株式数　900株
インソース	32,500	584.00	18,980,000	
リケンＮＰＲ	14,800	3,985.00	58,978,000	
島精機製作所	19,900	934.00	18,586,600	貸付株式数　7,800株
オプトラン	21,100	3,895.00	82,184,500	
イワキポンプ	8,600	3,270.00	28,122,000	貸付株式数　3,400株
フリュー	13,500	1,364.00	18,414,000	
ヤマシンフィルタ	26,700	526.00	14,044,200	貸付株式数　10,500株
日阪製作所	15,100	1,608.00	24,280,800	
やまびこ	21,000	3,720.00	78,120,000	
野村マイクロ・サイエンス	23,200	4,565.00	105,908,000	貸付株式数　7,000株 (100株)
平田機工	18,400	2,859.00	52,605,600	貸付株式数　400株
ＰＥＧＡＳＵＳ	14,200	531.00	7,540,200	貸付株式数　400株
マルマエ	13,400	2,660.00	35,644,000	貸付株式数　4,700株

タツモ	8,500	4,175.00	35,487,500	
ナブテスコ	73,100	5,040.00	368,424,000	
三井海洋開発	32,600	9,916.00	323,261,600	
レオン自動機	14,900	1,439.00	21,441,100	
ＳＭＣ	36,500	70,130.00	2,559,745,000	
ホソカワミクロン	9,700	5,140.00	49,858,000	貸付株式数　3,200株
ユニオンツール	5,700	26,430.00	150,651,000	貸付株式数　2,200株
瑞 光	11,000	895.00	9,845,000	貸付株式数　4,300株 (3,500株)
オイレス工業	15,900	2,730.00	43,407,000	
日精エーエスビー	5,000	9,240.00	46,200,000	
サトー	17,700	2,299.00	40,692,300	
技研製作所	11,600	1,811.00	21,007,600	貸付株式数　4,500株
日本エアーテック	6,000	1,285.00	7,710,000	
ワイエイシイホールディングス	11,200	1,360.00	15,232,000	貸付株式数　4,400株
小松製作所	620,500	6,817.00	4,229,948,500	
住友重機械	76,100	5,474.00	416,571,400	
日立建機	51,300	5,559.00	285,176,700	
日 工	24,800	850.00	21,080,000	
巴工業	14,300	1,793.00	25,639,900	貸付株式数　5,600株
井関農機	12,000	1,772.00	21,264,000	貸付株式数　4,700株
ＴＯＷＡ	46,600	3,000.00	139,800,000	貸付株式数　500株
北川鉄工所	5,100	1,643.00	8,379,300	
ローツェ	75,600	4,505.00	340,578,000	貸付株式数　7,900株
ハーモニック・ドライブ・シス	34,400	6,860.00	235,984,000	貸付株式数　13,500株
クボタ	651,000	2,843.00	1,850,793,000	
荏原実業	13,600	2,396.00	32,585,600	
東洋エンジニア	28,000	2,079.00	58,212,000	貸付株式数　8,900株
三菱化工機	13,600	3,840.00	52,224,000	
月島ホールディングス	17,200	2,674.00	45,992,800	
ＴＥＩＫＯＫＵ	8,300	3,060.00	25,398,000	貸付株式数　3,200株
新東工業	26,000	1,172.00	30,472,000	貸付株式数　9,900株
渋谷工業	12,100	4,110.00	49,731,000	貸付株式数　3,200株
アイチ コーポレーション	18,500	1,369.00	25,326,500	
小森コーポレーション	30,600	1,464.00	44,798,400	
鶴見製作所	18,200	2,170.00	39,494,000	貸付株式数　7,100株
酒井重工業	5,100	2,059.00	10,500,900	貸付株式数　1,900株
荏原製作所	261,400	6,204.00	1,621,725,600	

酉島製作所	9,500	2,995.00	28,452,500	貸付株式数 100株
ＡＩＲＭＡＮ	12,900	1,757.00	22,665,300	貸付株式数 5,000株
ダイキン工業	167,600	23,360.00	3,915,136,000	
オルガノ	17,700	16,245.00	287,536,500	
トーヨーカネツ	10,700	2,201.00	23,550,700	
栗田工業	77,500	8,696.00	673,940,000	
椿本チエイン	55,700	2,614.00	145,599,800	
日 機 装	29,700	3,705.00	110,038,500	貸付株式数 4,900株
木村化工機	9,800	1,198.00	11,740,400	貸付株式数 3,800株
レイズネクスト	18,100	2,286.00	41,376,600	貸付株式数 7,100株
アネスト岩田	23,900	1,634.00	39,052,600	
ダイフク	217,200	6,944.00	1,508,236,800	
サムコ	3,400	15,200.00	51,680,000	貸付株式数 1,300株
タダノ	67,900	1,339.00	90,918,100	
ＣＫＤ	38,800	7,390.00	286,732,000	
平和	38,000	2,076.00	78,888,000	
理想科学工業	20,600	998.00	20,558,800	
ＳＡＮＫＹＯ	120,500	1,594.00	192,077,000	
日本金銭機械	15,600	976.00	15,225,600	貸付株式数 6,100株
マースグループHLDGS	10,800	2,977.00	32,151,600	貸付株式数 4,200株
ガリレイ	18,900	3,405.00	64,354,500	
ダイコク電機	6,400	2,109.00	13,497,600	貸付株式数 2,500株
竹内製作所	23,300	7,610.00	177,313,000	
ア マ ノ	33,900	3,577.00	121,260,300	
ＪＵＫＩ	19,900	540.00	10,746,000	
ジャノメ	9,500	1,309.00	12,435,500	貸付株式数 3,600株
ブラザー工業	159,600	3,824.00	610,310,400	
マックス	70,900	1,636.00	115,992,400	貸付株式数 19,400株
モリタホールディングス	19,500	2,445.00	47,677,500	
グローリー	33,700	3,998.00	134,732,600	
新晃工業	34,600	1,240.00	42,904,000	
大和冷機工業	19,700	1,704.00	33,568,800	貸付株式数 7,700株
セガサミーホールディングス	101,700	2,137.50	217,383,750	
ＴＰＲ	28,500	1,434.00	40,869,000	
ツバキ・ナカシマ	29,700	374.00	11,107,800	
ホシザキ	82,800	5,264.00	435,859,200	
大豊工業	9,700	1,136.00	11,019,200	
日本精工	238,200	1,206.00	287,269,200	
Ｎ Ｔ Ｎ	341,600	436.20	149,005,920	

ジェイテクト	121,400	2,068.00	251,055,200	
不 二 越	9,500	5,770.00	54,815,000	
ミネベアミツミ	223,800	4,476.00	1,001,728,800	
日本トムソン	35,000	1,989.00	69,615,000	
ＴＨＫ	68,100	7,448.00	507,208,800	
ＹＵＳＨＩＮ	10,200	700.00	7,140,000	
前澤給装工業	9,200	1,440.00	13,248,000	
イーグル工業	14,200	2,921.00	41,478,200	
ＰＩＬＬＡＲ	11,900	9,670.00	115,073,000	
キッツ	45,900	2,541.00	116,631,900	
日 立	3,241,300	4,737.00	15,354,038,100	※
三菱電機	1,409,500	5,858.00	8,256,851,000	
富士電機	92,500	14,360.00	1,328,300,000	
安川電機	139,800	6,655.00	930,369,000	
シンフォニア テクノロジー	14,200	13,740.00	195,108,000	
明 電 舎	23,900	9,310.00	222,509,000	
山洋電気	14,800	6,550.00	96,940,000	
デンヨー	9,400	3,725.00	35,015,000	貸付株式数 3,600株
PHCホールディングス	24,100	1,059.00	25,521,900	貸付株式数 9,500株
KOKUSAI ELECTRIC	147,500	9,958.00	1,468,805,000	
ソシオネクスト	111,500	2,404.00	268,046,000	
ベイカレント	96,300	5,484.00	528,109,200	
ORCHESTRA HLDGS	2,800	960.00	2,688,000	貸付株式数 1,100株
アイモバイル	19,400	507.00	9,835,800	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	8,300	945.00	7,843,500	貸付株式数 3,000株
ジャパンエレベーターSHD	110,700	1,572.00	174,020,400	
エル・ティー・エス	1,800	1,672.00	3,009,600	貸付株式数 600株
ミダックホールディングス	6,600	1,975.00	13,035,000	貸付株式数 2,600株
キュービーネットHLDGS	6,400	1,258.00	8,051,200	貸付株式数 2,500株
オープングループ	17,800	201.00	3,577,800	貸付株式数 7,100株
三桜工業	19,500	1,015.00	19,792,500	貸付株式数 7,600株
マキタ	160,100	5,705.00	913,370,500	
東芝テック	16,500	3,220.00	53,130,000	
芝浦メカトロニクス	39,900	4,730.00	188,727,000	
マブチモーター	124,200	1,558.50	193,565,700	貸付株式数 47,300株
ユーエムシーエレクトロニクス	7,700	228.00	1,755,600	
トレックス・セミコンダクター	5,000	2,406.00	12,030,000	貸付株式数 1,900株
東光高岳	7,000	7,560.00	52,920,000	貸付株式数 2,400株

ダブル・スコープ	46,200	203.00	9,378,600	
宮越ホールディングス	5,700	603.00	3,437,100	貸付株式数　2,200株
ダイヘン	11,900	16,220.00	193,018,000	
ヤーマン	25,000	717.00	17,925,000	貸付株式数　9,800株 (200株)
ＪＶＣケンウッド	100,100	1,097.50	109,859,750	貸付株式数　37,500株
ミマキエンジニアリング	10,700	1,811.00	19,377,700	貸付株式数　4,200株
大崎電気	24,600	1,458.00	35,866,800	
オムロン	108,100	5,812.00	628,277,200	
日東工業	15,400	4,555.00	70,147,000	
ＩＤＥＣ	16,400	3,125.00	51,250,000	
ジーエス・ユアサ コーポ	52,600	6,318.00	332,326,800	
ＢＵＦＦＡＬＯ	6,900	2,591.00	17,877,900	貸付株式数　2,700株
テクノメディカ	2,500	2,001.00	5,002,500	貸付株式数　200株
ダイヤモンドエレクトリクHD	6,800	469.00	3,189,200	貸付株式数　2,700株
日本電気	845,000	3,847.00	3,250,715,000	
富 士 通	1,184,200	3,260.00	3,860,492,000	
沖 電 気	62,300	3,055.00	190,326,500	
電気興業	4,700	3,285.00	15,439,500	
サンケン電気	13,200	8,900.00	117,480,000	
アイホン	6,700	2,696.00	18,063,200	
ルネサスエレクトロニクス	1,247,700	4,488.00	5,599,677,600	
セイコーエプソン	160,200	2,835.50	454,247,100	
ワコム	77,200	865.00	66,778,000	貸付株式数　4,700株
アルバック	32,900	9,257.00	304,555,300	
アクセル	5,900	1,145.00	6,755,500	
ＥＩＺＯ	18,100	2,546.00	46,082,600	
ジャパンディスプレイ	61,700	49.00	3,023,300	
日本信号	32,600	1,550.00	50,530,000	
京三製作所	30,000	961.00	28,830,000	
能美防災	17,400	4,200.00	73,080,000	
ホーチキ	30,200	1,930.00	58,286,000	貸付株式数　11,800株
エレコム	30,800	1,759.00	54,177,200	貸付株式数　3,200株
パナソニック ホールディンク	1,520,200	4,010.00	6,096,002,000	
シャープ	155,000	614.20	95,201,000	貸付株式数　61,200株
アンリツ	84,200	3,934.00	331,242,800	
ソニーグループ	4,394,900	3,320.00	14,591,068,000	
Ｔ Ｄ Ｋ	1,111,300	3,906.00	4,340,737,800	

帝国通信工業	5,600	2,917.00	16,335,200	貸付株式数 2,000株
タムラ製作所	51,300	967.00	49,607,100	
アルプスアルパイン	99,200	2,107.00	209,014,400	
日本電波工業	15,400	3,820.00	58,828,000	貸付株式数 6,000株
鈴木	7,500	3,280.00	24,600,000	
メイコー	11,500	30,400.00	349,600,000	
日本トリム	2,900	4,585.00	13,296,500	貸付株式数 1,000株
フオスター電機	11,900	2,814.00	33,486,600	
ＳＭＫ	3,100	3,365.00	10,431,500	
ヨコオ	11,400	5,530.00	63,042,000	
ホシデン	25,100	2,764.00	69,376,400	貸付株式数 8,500株
ヒロセ電機	18,700	28,460.00	532,202,000	
日本航空電子	30,100	2,354.00	70,855,400	
ＴＯＡ	13,000	1,571.00	20,423,000	
マクセル	26,800	2,157.00	57,807,600	
古野電気	16,700	5,830.00	97,361,000	貸付株式数 4,400株
スミダコーポレーション	22,100	1,433.00	31,669,300	貸付株式数 8,700株
アイコム	5,000	3,040.00	15,200,000	貸付株式数 800株
リオン	5,300	3,640.00	19,292,000	
横河電機	134,800	5,162.00	695,837,600	
新電元工業	5,400	3,225.00	17,415,000	
アズビル	309,500	1,580.00	489,010,000	
日本光電工業	105,900	1,337.50	141,641,250	
チノー	10,600	1,636.00	17,341,600	貸付株式数 4,100株
日本電子材料	8,900	8,330.00	74,137,000	
堀場製作所	24,100	26,605.00	641,180,500	
アドバンテスト	383,600	29,420.00	11,285,512,000	
エスペック	12,500	4,290.00	53,625,000	貸付株式数 4,900株
キーエンス	127,500	75,650.00	9,645,375,000	
日置電機	6,700	12,380.00	82,946,000	
シスメックス	329,900	1,421.50	468,952,850	貸付株式数 33,600株
日本マイクロニクス	21,000	15,900.00	333,900,000	
メガチップス	8,200	11,570.00	94,874,000	
OBARA GROUP	6,000	5,970.00	35,820,000	貸付株式数 2,600株
デンソー	1,248,200	1,906.50	2,379,693,300	
コーセル	15,700	1,496.00	23,487,200	貸付株式数 6,200株
イリソ電子工業	10,500	3,010.00	31,605,000	
オプテックスグループ	21,600	4,020.00	86,832,000	
千代田インテグレ	3,200	3,200.00	10,240,000	
レーザーテック	53,900	48,300.00	2,603,370,000	

スタンレー電気	54,000	3,679.00	198,666,000	
ウシオ電機	47,700	4,235.00	202,009,500	貸付株式数　9,500株
日本セラミック	10,400	3,845.00	39,988,000	貸付株式数　4,000株
山一電機	12,500	9,740.00	121,750,000	
図 研	10,600	4,475.00	47,435,000	
日本電子	29,500	6,606.00	194,877,000	
カ シ オ	100,500	1,796.50	180,548,250	
ファナック	608,500	7,344.00	4,468,824,000	
日本シイエムケイ	40,800	740.00	30,192,000	貸付株式数　11,300株
エンプラス	3,700	12,300.00	45,510,000	貸付株式数　1,400株
大真空	18,400	967.00	17,792,800	貸付株式数　7,200株
ロ ー ム	250,100	5,257.00	1,314,775,700	
浜松ホトニクス	197,700	2,635.50	521,038,350	
三井ハイテック	65,800	958.00	63,036,400	貸付株式数　25,900株
京 セ ラ	791,600	3,837.00	3,037,369,200	
太陽誘電	68,200	19,285.00	1,315,237,000	
村田製作所	1,215,800	10,060.00	12,230,948,000	
双葉電子工業	26,300	602.00	15,832,600	貸付株式数　9,500株
日東電工	388,000	3,099.00	1,202,412,000	
東海理化電機	34,000	2,970.00	100,980,000	貸付株式数　13,400株
ニチコン	33,300	4,070.00	135,531,000	
日本ケミコン	17,700	4,790.00	84,783,000	
Ｋ Ｏ Ａ	23,200	2,730.00	63,336,000	
三井Ｅ＆Ｓ	63,900	4,426.00	282,821,400	
カナデビア	105,400	1,363.00	143,660,200	
三菱重工業	2,411,000	3,659.00	8,821,849,000	
川崎重工業	480,000	2,905.50	1,394,640,000	
ＩＨＩ	670,600	2,705.00	1,813,973,000	
名村造船所	39,700	3,765.00	149,470,500	
マネジメントソリューションズ	7,200	1,343.00	9,669,600	貸付株式数　2,800株
プロレド・パートナーズ	3,100	370.00	1,147,000	
フロンティア・マネジメント	5,000	607.00	3,035,000	貸付株式数　1,800株
アンビスホールディングス	28,100	335.00	9,413,500	貸付株式数　11,000株
カーブスホールディングス	35,800	874.00	31,289,200	貸付株式数　2,100株
MACBEE PLANET	5,600	1,006.00	5,633,600	貸付株式数　2,200株
日本車輌	4,900	3,240.00	15,876,000	
ユニソルホールディングス	11,600	2,053.00	23,814,800	貸付株式数　4,500株 (200株)

ヤマエグループHD	13,200	2,894.00	38,200,800	貸付株式数　2,000株
ＦＰＧ	43,900	1,503.00	65,981,700	貸付株式数　17,300株
ライフネット生命保険	26,800	1,647.00	44,139,600	貸付株式数　2,900株
全国保証	72,200	2,853.00	205,986,600	貸付株式数　1,000株
めぶきフィナンシャルG	586,700	1,413.50	829,300,450	
ジャパンインベストメントA	20,400	2,050.00	41,820,000	貸付株式数　8,000株
東京きらぼしFG	16,100	11,700.00	188,370,000	
九州フィナンシャルG	242,900	1,468.50	356,698,650	貸付株式数　95,900株
かんぽ生命保険	425,200	1,564.50	665,225,400	
ゆうちょ銀行	1,363,000	3,198.00	4,358,874,000	
富山第一銀行	39,800	2,530.00	100,694,000	貸付株式数　15,400株
横浜フィナンシャルグループ	654,500	1,761.00	1,152,574,500	
ジェイリース	9,500	1,294.00	12,293,000	
西日本フィナンシャルHD	76,800	4,227.00	324,633,600	
ＳＢＩアルヒ	12,800	803.00	10,278,400	貸付株式数　5,000株
プレミアグループ	21,300	1,913.00	40,746,900	
日産自動車	1,946,400	356.90	694,670,160	貸付株式数　727,500株
いすゞ自動車	328,200	2,294.00	752,890,800	
トヨタ自動車	6,772,700	2,902.50	19,657,761,750	※
三菱自動車工業	487,100	337.00	164,152,700	貸付株式数　192,400株
武蔵精密工業	28,100	4,645.00	130,524,500	
日産車体	19,400	964.00	18,701,600	
新明和工業	36,700	2,177.00	79,895,900	
極東開発工業	21,000	2,150.00	45,150,000	
トピー工業	9,200	2,782.00	25,594,400	貸付株式数　3,500株
ティラド	2,200	14,400.00	31,680,000	
タチエス	23,500	2,176.00	51,136,000	
ＮＯＫ	46,000	2,947.50	135,585,000	
フタバ産業	34,200	971.00	33,208,200	
カヤバ	21,600	3,955.00	85,428,000	貸付株式数　4,700株
市光工業	27,600	535.00	14,766,000	貸付株式数　10,400株
大同メタル工業	24,900	1,284.00	31,971,600	
プレス工業	51,400	835.00	42,919,000	
アイシン	325,500	2,373.00	772,411,500	
マツダ	421,400	1,182.50	498,305,500	
本田技研	2,375,700	1,458.00	3,463,770,600	
スズキ	936,000	1,933.00	1,809,288,000	
SUBARU	376,000	2,568.00	965,568,000	
ヤマハ発動機	630,600	1,232.00	776,899,200	貸付株式数　223,700株

小糸製作所	132,000	2,789.00	368,148,000	
エクセディ	20,800	5,830.00	121,264,000	
ミツバ	24,200	1,100.00	26,620,000	
豊田合成	39,200	4,815.00	188,748,000	
愛三工業	21,200	1,869.00	39,622,800	
ヨ ロ ズ	11,900	878.00	10,448,200	貸付株式数 4,700株
エフ・シー・シー	24,800	3,380.00	83,824,000	貸付株式数 9,700株
シマノ	53,600	16,375.00	877,700,000	
テイ・エス テック	47,300	1,755.50	83,035,150	
３３ＦＧ	48,600	1,791.00	87,042,600	
第四北越フィナンシャルG	118,200	2,132.00	252,002,400	貸付株式数 40,900株
ひろぎんHLDGS	174,600	2,113.00	368,929,800	
おきなわＦＧ	10,700	6,600.00	70,620,000	
ダイレクトマケティングミクス	13,400	312.00	4,180,800	
ポピンズ	1,900	1,338.00	2,542,200	
LITALICO	11,900	1,597.00	19,004,300	貸付株式数 500株
十六ＦＧ	88,100	2,261.00	199,194,100	
ＣＣＩグループ	131,000	1,004.00	131,524,000	
ネットプロＨＤ	37,900	361.00	13,681,900	貸付株式数 14,900株
プロクレアホールディングス	15,400	3,610.00	55,594,000	貸付株式数 1,000株
ＦＰパートナー	5,600	2,039.00	11,418,400	貸付株式数 2,200株
あいちフィナンシャルグル	128,700	1,366.00	175,804,200	
小 野 建	14,400	1,325.00	19,080,000	
ノ ジ マ	132,000	1,482.00	195,624,000	
カッパ・クリエイト	21,200	1,435.00	30,422,000	貸付株式数 8,300株
伯東	8,100	4,525.00	36,652,500	貸付株式数 3,100株
コンドーテック	11,300	1,466.00	16,565,800	貸付株式数 4,200株
ナガイレーベン	14,700	1,649.00	24,240,300	貸付株式数 5,300株
良品計画	294,300	3,629.00	1,068,014,700	
松田産業	10,300	6,400.00	65,920,000	
第一興商	44,600	1,665.50	74,281,300	
メディパルHD	144,100	2,609.50	376,028,950	
アドヴァングループ	8,300	917.00	7,611,100	貸付株式数 3,300株
ＳＰＫ	11,000	1,229.00	13,519,000	
アルビス	4,400	2,460.00	10,824,000	
アズワン	42,900	2,126.50	91,226,850	貸付株式数 8,200株
スズデン	7,000	2,151.00	15,057,000	
シモジマ	10,100	1,313.00	13,261,300	

ドウシシャ	16,000	2,878.00	46,048,000	
高速	9,000	3,035.00	27,315,000	貸付株式数 3,500株
G-7ホールディングス	14,700	1,347.00	19,800,900	
たけびし	5,200	2,325.00	12,090,000	
イオン北海道	39,900	840.00	33,516,000	貸付株式数 15,600株
コ ジ マ	26,000	1,429.00	37,154,000	貸付株式数 10,200株
コーナン商事	14,900	4,110.00	61,239,000	
エコス	5,000	2,264.00	11,320,000	貸付株式数 1,900株
ワタミ	16,300	926.00	15,093,800	
リックス	3,400	3,505.00	11,917,000	
システムソフト	51,700	46.00	2,378,200	貸付株式数 20,600株
パンパシフィックHD	1,362,400	837.20	1,140,601,280	
丸文	12,000	1,653.00	19,836,000	
西松屋チェーン	29,800	1,942.00	57,871,600	貸付株式数 11,400株
ゼンショーホールディングス	68,900	8,169.00	562,844,100	
ハピネット	18,300	2,716.00	49,702,800	
幸楽苑	12,900	1,089.00	14,048,100	貸付株式数 5,000株
橋本総業HLDGS	4,600	1,387.00	6,380,200	貸付株式数 1,800株
日本ライフライン	34,000	1,313.00	44,642,000	
サイゼリヤ	19,900	5,440.00	108,256,000	
タカショー	10,900	391.00	4,261,900	貸付株式数 4,100株
ＶＴホールディングス	52,600	440.00	23,144,000	
アルゴグラフィックス	45,700	1,210.00	55,297,000	
魚力	4,700	2,211.00	10,391,700	貸付株式数 1,800株
ＩＤＯＭ	40,700	1,332.00	54,212,400	貸付株式数 16,000株
日本エム・ディ・エム	10,100	817.00	8,251,700	貸付株式数 3,800株
ユナイテッドアローズ	14,400	2,467.00	35,524,800	貸付株式数 5,600株
進和	7,900	3,155.00	24,924,500	
ダイトロン	11,100	3,595.00	39,904,500	貸付株式数 3,800株
ハイデイ日高	21,800	2,590.00	56,462,000	貸付株式数 8,600株
シークス	21,600	1,403.00	30,304,800	
コロワイド	76,100	1,825.00	138,882,500	貸付株式数 29,700株 (1,100株)
オーハシテクニカ	12,300	1,129.00	13,886,700	貸付株式数 4,500株
壱番屋	53,200	893.00	47,507,600	貸付株式数 20,300株
白銅	3,800	3,580.00	13,604,000	貸付株式数 1,000株
スギホールディングス	72,400	2,921.00	211,480,400	
薬王堂ホールディングス	7,500	1,692.00	12,690,000	貸付株式数 2,100株

ダブルエー	5,500	1,409.00	7,749,500	貸付株式数　1,700株
島津製作所	169,300	3,758.00	636,229,400	
ＪＭＳ	11,600	432.00	5,011,200	
長野計器	8,100	3,975.00	32,197,500	貸付株式数　2,800株
ブイ・テクノロジー	6,200	6,340.00	39,308,000	貸付株式数　2,400株
東京計器	10,600	5,220.00	55,332,000	貸付株式数　900株
愛知時計	6,100	2,895.00	17,659,500	
インターアクション	6,600	1,940.00	12,804,000	貸付株式数　2,600株
東京精密	24,200	19,760.00	478,192,000	
マニー	56,100	1,682.00	94,360,200	
ニコン	158,900	2,070.50	329,002,450	
オリンパス	690,300	1,686.00	1,163,845,800	
理研計器	18,000	3,520.00	63,360,000	
SCREENホールディングス	90,900	14,860.00	1,350,774,000	
タムロン	65,100	1,025.00	66,727,500	
ＨＯＹＡ	241,800	26,630.00	6,439,134,000	
ノーリツ鋼機	36,300	2,017.00	73,217,100	
A&Dホロンホールディングス	17,200	2,737.00	47,076,400	
朝日インテック	151,700	3,554.00	539,141,800	
キヤノン	571,900	4,327.00	2,474,611,300	
リ コ ー	298,600	1,465.50	437,598,300	
シチズン時計	105,500	2,208.00	232,944,000	
メニコン	47,500	1,641.00	77,947,500	貸付株式数　18,700株
トランザクション	21,900	1,332.00	29,170,800	貸付株式数　8,200株
ニホンフラッシュ	12,000	710.00	8,520,000	貸付株式数　4,700株
前田工繊	26,000	1,775.00	46,150,000	貸付株式数　10,200株
アートネイチャー	11,500	851.00	9,786,500	
フルヤ金属	12,100	8,970.00	108,537,000	貸付株式数　4,700株
バンダイナムコHLDGS	338,000	3,594.00	1,214,772,000	
ＳＨＯＥＩ	29,900	1,830.00	54,717,000	
フランスベッドHLDGS	18,200	1,250.00	22,750,000	貸付株式数　7,100株
マーベラス	23,700	447.00	10,593,900	
パイロットコーポレーション	17,800	4,930.00	87,754,000	
萩原工業	8,500	1,715.00	14,577,500	貸付株式数　3,300株
エイベックス	21,900	1,197.00	26,214,300	
フジシールインターナショナル	25,800	2,709.00	69,892,200	
タカラトミー	62,400	2,947.00	183,892,800	
広済堂ホールディングス	47,000	475.00	22,325,000	貸付株式数　18,500株

レック	12,700	942.00	11,963,400	貸付株式数　5,800株
三光合成	16,100	795.00	12,799,500	
プロネクサス	13,200	1,037.00	13,688,400	貸付株式数　4,300株
TOPPANホールディングス	154,400	4,408.00	680,595,200	
大日本印刷	274,900	2,671.00	734,257,900	
共同印刷	12,900	1,516.00	19,556,400	
ＮＩＳＳＨＡ	22,900	1,433.00	32,815,700	
ＺＡＣＲＯＳ	40,400	1,306.00	52,762,400	
TAKARA & COMPANY	7,500	3,070.00	23,025,000	貸付株式数　2,900株
未来工業	6,100	3,095.00	18,879,500	貸付株式数　2,400株
アシックス	489,900	4,493.00	2,201,120,700	
ツ ツ ミ	3,000	2,717.00	8,151,000	
ジェイ エス ピー	7,500	2,641.00	19,807,500	
ニ チ ハ	14,800	3,010.00	44,548,000	貸付株式数　4,300株
ローランド	10,100	4,345.00	43,884,500	
エフピコ	24,200	2,513.00	60,814,600	
小松ウオール工業	9,400	2,472.00	23,236,800	貸付株式数　2,300株
ヤマハ	198,600	1,119.50	222,332,700	
河合楽器	3,400	3,150.00	10,710,000	貸付株式数　1,300株
クリナップ	13,900	895.00	12,440,500	貸付株式数　1,800株
ピジョン	75,300	1,980.00	149,094,000	
キングジム	11,300	813.00	9,186,900	貸付株式数　4,400株 (200株)
象印マホービン	34,600	1,452.00	50,239,200	貸付株式数　12,800株
リンテック	27,600	5,980.00	165,048,000	
信越ポリマー	27,600	2,333.00	64,390,800	
イトーキ	28,000	2,449.00	68,572,000	貸付株式数　10,100株
任 天 堂	797,300	7,110.00	5,668,803,000	
三菱鉛筆	17,200	2,597.00	44,668,400	貸付株式数　6,500株
松 風	15,300	2,057.00	31,472,100	
タカラスタンダード	27,200	3,035.00	82,552,000	
コ ク ヨ	252,100	815.00	205,461,500	
ナカバヤシ	13,700	555.00	7,603,500	
ニ フ コ	47,800	4,435.00	211,993,000	
立川ブラインド	6,700	2,474.00	16,575,800	貸付株式数　2,600株
グローブライド	12,000	2,421.00	29,052,000	貸付株式数　4,300株
オカムラ	38,400	2,230.00	85,632,000	
バルカー	10,700	7,750.00	82,925,000	貸付株式数　4,200株
伊 藤 忠	4,530,600	1,907.00	8,639,854,200	

丸 紅	1,028,600	5,042.00	5,186,201,200	
スクロール	23,100	1,619.00	37,398,900	
ヨンドシーホールディングス	12,800	1,885.00	24,128,000	貸付株式数 4,900株
三陽商会	6,000	3,820.00	22,920,000	
長瀬産業	230,400	1,223.50	281,894,400	
蝶 理	7,200	3,950.00	28,440,000	
豊田通商	404,800	6,505.00	2,633,224,000	
オンワードホールディングス	74,400	725.00	53,940,000	
三共生興	17,500	860.00	15,050,000	貸付株式数 2,800株
兼 松	112,700	2,161.50	243,601,050	
美 津 濃	34,200	3,405.00	116,451,000	
ルックホールディングス	4,100	2,666.00	10,930,600	貸付株式数 100株
三井物産	1,910,700	4,838.00	9,243,966,600	
日本紙パルプ	71,500	1,109.00	79,293,500	貸付株式数 28,200株
東京エレクトロン	267,600	72,760.00	19,470,576,000	
カメイ	12,600	3,500.00	44,100,000	
スターゼン	30,700	1,177.00	36,133,900	
セイコーグループ	35,500	7,380.00	261,990,000	
山 善	40,900	1,809.00	73,988,100	貸付株式数 16,100株
椿本興業	9,300	2,683.00	24,951,900	
住友商事	796,900	6,567.00	5,233,242,300	
ＢＩＰＲＯＧＹ	42,400	4,341.00	184,058,400	
内田洋行	27,300	1,957.00	53,426,100	
三菱商事	2,474,900	4,728.00	11,701,327,200	※
第一実業	12,500	3,060.00	38,250,000	貸付株式数 200株
キヤノンマーケティングJPN	63,500	3,393.00	215,455,500	
西華産業	19,400	2,951.00	57,249,400	
佐藤商事	9,300	3,235.00	30,085,500	貸付株式数 3,600株
東京産業	13,700	810.00	11,097,000	
ＹＵＡＳＡ	11,600	5,370.00	62,292,000	貸付株式数 3,500株
神鋼商事	10,100	2,442.00	24,664,200	
阪和興業	110,900	1,759.00	195,073,100	
正栄食品	9,000	4,435.00	39,915,000	貸付株式数 3,500株 (1,100株)
カナデン	10,700	2,486.00	26,600,200	貸付株式数 1,300株
ＲＹＯＤＥＮ	10,300	4,070.00	41,921,000	
ニプロ	106,200	1,658.00	176,079,600	
岩谷産業	133,900	1,874.50	250,995,550	貸付株式数 49,100株

極東貿易	7,500	1,743.00	13,072,500	貸付株式数 2,900株
アステナホールディングス	25,500	491.00	12,520,500	
三愛オブリ	30,000	2,093.00	62,790,000	貸付株式数 5,400株
稲畑産業	30,700	3,890.00	119,423,000	
ＧＳＩクレオス	7,800	2,356.00	18,376,800	
明和産業	19,200	886.00	17,011,200	貸付株式数 7,500株
ゴールドウイン	74,600	2,162.00	161,285,200	
ユニ・チャーム	798,600	928.40	741,420,240	
ワ キ タ	22,300	1,689.00	37,664,700	貸付株式数 7,900株
東邦ホールディングス	38,300	4,024.00	154,119,200	貸付株式数 1,000株
サンゲツ	33,800	2,895.00	97,851,000	
ミツウロコグループ	16,300	1,865.00	30,399,500	貸付株式数 6,400株
シナネンホールディングス	2,600	7,670.00	19,942,000	貸付株式数 700株
伊藤忠エネクス	33,400	1,998.00	66,733,200	
サンリオ	669,300	845.50	565,893,150	貸付株式数 264,300株
サンワ テクノス	7,600	3,710.00	28,196,000	貸付株式数 3,000株
新光商事	16,000	1,577.00	25,232,000	
トーホー	15,700	1,294.00	20,315,800	貸付株式数 6,000株
三信電気	7,800	2,756.00	21,496,800	
東陽テクニカ	11,200	2,014.00	22,556,800	貸付株式数 4,700株
モスフード サービス	19,800	3,625.00	71,775,000	貸付株式数 7,800株
加賀電子	25,000	4,555.00	113,875,000	
都築電気	8,100	3,995.00	32,359,500	
ソーダニツカ	13,200	1,120.00	14,784,000	貸付株式数 5,000株
立花エレテック	8,000	3,085.00	24,680,000	
木曽路	20,400	2,318.00	47,287,200	貸付株式数 8,000株 (200株)
SRSホールディングス	22,200	1,189.00	26,395,800	貸付株式数 8,700株
千 趣 会	26,900	118.00	3,174,200	貸付株式数 10,700株 (400株)
リテールパートナーズ	20,000	1,337.00	26,740,000	貸付株式数 7,800株
Ｊｏｓｈｉｎ	14,700	3,690.00	54,243,000	
日本瓦斯	64,500	2,774.50	178,955,250	
ロイヤルホールディングス	52,300	1,240.00	64,852,000	貸付株式数 20,600株
チヨダ	13,100	971.00	12,720,100	
ライフコーポレーション	25,900	2,629.00	68,091,100	
リンガーハット	18,600	2,110.00	39,246,000	貸付株式数 7,300株
ＭｒＭａｘＨＤ	11,300	748.00	8,452,400	貸付株式数 6,000株
AOKIホールディングス	28,900	1,623.00	46,904,700	貸付株式数 11,400株

オークワ	18,000	783.00	14,094,000	貸付株式数 6,600株
コメリ	17,900	3,515.00	62,918,500	
青山商事	86,400	694.00	59,961,600	貸付株式数 34,000株
しまむら	95,000	3,320.00	315,400,000	
高 島 屋	189,000	2,160.00	408,240,000	貸付株式数 72,400株
松 屋	25,400	1,527.00	38,785,800	貸付株式数 10,000株
エイチ・ツー・オーリテイリング	65,600	2,615.00	171,544,000	
近鉄百貨店	7,700	1,810.00	13,937,000	貸付株式数 2,900株
丸井グループ	78,800	2,824.00	222,531,200	
クレディセゾン	70,700	4,304.00	304,292,800	
アクシアル リテイリング	36,800	1,098.00	40,406,400	
イオン	1,591,400	1,382.50	2,200,110,500	
イ ズ ミ	71,700	952.00	68,258,400	
フオーバル	5,300	992.00	5,257,600	貸付株式数 100株
平 和 堂	22,100	2,541.00	56,156,100	貸付株式数 8,700株
フ ジ	20,700	1,968.00	40,737,600	貸付株式数 8,000株
ゼビオホールディングス	16,000	1,072.00	17,152,000	貸付株式数 700株
ケーズホールディングス	88,000	2,010.50	176,924,000	
ＰＡＬＴＡＣ	20,400	6,645.00	135,558,000	
三谷産業	23,500	629.00	14,781,500	
SBI新生銀行	213,300	1,491.50	318,136,950	貸付株式数 58,700株
あおぞら銀行	79,900	2,790.50	222,960,950	貸付株式数 31,400株
三菱UFJフィナンシャルG	7,915,500	3,242.00	25,662,051,000	
りそなホールディングス	1,538,600	2,203.00	3,389,535,800	
三井住友トラストグルー	432,700	6,061.00	2,622,594,700	
三井住友フィナンシャルG	2,735,100	6,519.00	17,830,116,900	
千葉銀行	369,500	2,521.00	931,509,500	
群馬銀行	226,400	2,358.00	533,851,200	
武蔵野銀行	52,600	2,527.00	132,920,200	
千葉興業銀行	23,700	2,428.00	57,543,600	
筑波銀行	55,100	718.00	39,561,800	貸付株式数 700株
七十七銀行	120,600	3,321.00	400,512,600	
秋田銀行	8,400	6,390.00	53,676,000	
山形銀行	16,100	3,550.00	57,155,000	貸付株式数 6,300株
岩手銀行	31,700	2,074.00	65,745,800	
東邦銀行	144,400	789.00	113,931,600	
ふくおかフィナンシャルG	100,200	6,953.00	696,690,600	
スルガ銀行	63,000	2,395.00	150,885,000	
八十二長野銀行	258,800	2,380.00	615,944,000	

山梨中央銀行	15,200	6,250.00	95,000,000	
大垣共立銀行	25,600	7,460.00	190,976,000	
福井銀行	12,100	5,450.00	65,945,000	貸付株式数　4,300株
清水銀行	5,000	2,461.00	12,305,000	
滋賀銀行	85,900	2,283.00	196,109,700	
南都銀行	94,400	1,804.00	170,297,600	
百五銀行	118,100	2,014.00	237,853,400	貸付株式数　15,700株
紀陽銀行	41,700	4,550.00	189,735,000	
ほくほくフィナンシャルG	75,000	6,527.00	489,525,000	
山陰合同銀行	78,600	2,197.00	172,684,200	
百十四銀行	49,100	2,556.00	125,499,600	貸付株式数　5,800株
四国銀行	19,700	2,909.00	57,307,300	
阿波銀行	18,600	7,030.00	130,758,000	
大分銀行	39,300	2,433.00	95,616,900	
宮崎銀行	36,800	2,128.00	78,310,400	
佐賀銀行	7,900	5,550.00	43,845,000	貸付株式数　2,000株
琉球銀行	26,700	2,624.00	70,060,800	
セブン銀行	393,500	287.40	113,091,900	貸付株式数　145,700株
みずほフィナンシャルG	1,745,600	7,793.00	13,603,460,800	
山口フィナンシャルG	123,100	2,926.00	360,190,600	
芙蓉総合リース	34,600	4,311.00	149,160,600	
みずほリース	94,300	1,290.00	121,647,000	
東京センチュリー	93,800	2,423.00	227,277,400	
SBIホールディングス	441,000	2,949.00	1,300,509,000	
日本証券金融	43,500	2,376.00	103,356,000	
名古屋銀行	23,500	5,980.00	140,530,000	
北洋銀行	162,100	1,048.00	169,880,800	
愛媛銀行	18,400	2,064.00	37,977,600	貸付株式数　1,300株
京葉銀行	54,200	2,524.00	136,800,800	
栃木銀行	67,900	1,008.00	68,443,200	
北日本銀行	3,900	5,460.00	21,294,000	
東和銀行	23,900	1,503.00	35,921,700	
リコーリース	11,900	6,240.00	74,256,000	貸付株式数　4,600株
イオンフィナンシャルサービス	71,800	1,515.50	108,812,900	
ア コ ム	223,900	453.20	101,471,480	
ジャックス	15,000	3,555.00	53,325,000	貸付株式数　5,500株
オ リ コ	49,100	858.00	42,127,800	貸付株式数　19,400株
オリックス	749,800	6,170.00	4,626,266,000	
三菱HCキャピタル	629,000	1,334.50	839,400,500	

ジャフコ グループ	33,600	2,235.50	75,112,800	貸付株式数　11,300株
トモニホールディングス	120,000	908.00	108,960,000	
大和証券Ｇ本社	897,300	1,595.00	1,431,193,500	
野村ホールディングス	2,060,200	1,414.00	2,913,122,800	
岡三証券グループ	99,200	956.00	94,835,200	貸付株式数　19,500株
丸三証券	41,800	1,069.00	44,684,200	貸付株式数　16,400株
東洋証券	38,700	623.00	24,110,100	貸付株式数　12,100株
東海東京ＨＤ	148,600	744.00	110,558,400	
水戸証券	34,500	669.00	23,080,500	
いちよし証券	23,500	1,392.00	32,712,000	貸付株式数　9,200株
松井証券	86,500	948.00	82,002,000	
SOMPOホールディングス	623,200	6,242.00	3,890,014,400	
日本取引所グループ	688,200	2,204.00	1,516,792,800	
マネックスＧ	131,900	648.00	85,471,200	
極東証券	17,200	1,565.00	26,918,000	貸付株式数　6,800株
岩井コスモホールディング	13,100	3,995.00	52,334,500	
アイザワ証券グループ	13,200	1,474.00	19,456,800	貸付株式数　5,200株
フィデアホール	13,000	2,020.00	26,260,000	貸付株式数　4,900株
池田泉州ＨＤ	174,100	1,027.00	178,800,700	
アニコム ホールディングス	39,300	1,235.00	48,535,500	
ＭＳ＆ＡＤ	782,300	4,673.00	3,655,687,900	
ソニーフィナンシャルグループ	4,161,800	143.60	597,634,480	
スパークス・グループ	13,900	2,166.00	30,107,400	貸付株式数　5,400株
第一ライフグループ	2,415,500	1,776.00	4,289,928,000	
東京海上ＨＤ	1,290,000	7,301.00	9,418,290,000	
イー・ギャランティ	19,400	1,692.00	32,824,800	貸付株式数　7,600株
NECキャピタルソリューション	6,200	4,145.00	25,699,000	
T&Dホールディングス	279,000	4,802.00	1,339,758,000	
アドバンスクリエイト	10,800	125.00	1,350,000	貸付株式数　4,300株
三井不動産	1,838,200	1,570.50	2,886,893,100	
三菱地所	753,900	4,277.00	3,224,430,300	
平和不動産	23,700	2,383.00	56,477,100	
東京建物	118,900	3,371.00	400,811,900	
京阪神ビルディング	18,600	2,133.00	39,673,800	貸付株式数　3,300株
住友不動産	356,800	3,685.00	1,314,808,000	
テーオーシー	22,300	968.00	21,586,400	貸付株式数　8,800株
スターツコーポレーション	23,200	4,525.00	104,980,000	
フジ住宅	15,800	766.00	12,102,800	貸付株式数　6,200株

空港施設	17,300	914.00	15,812,200	貸付株式数	6,800株
明和地所	10,100	795.00	8,029,500	貸付株式数	1,800株
ゴールドクレスト	6,800	3,340.00	22,712,000		
リログループ	58,300	1,800.00	104,940,000		
エスリード	5,900	4,975.00	29,352,500	貸付株式数	700株
日神グループHLDGS	20,100	650.00	13,065,000	貸付株式数	200株
エスコン	28,200	1,110.00	31,302,000	貸付株式数	1,600株
MIRARTHホールディング	80,200	412.00	33,042,400	貸付株式数	31,600株
ランド	809,400	10.00	8,094,000	貸付株式数	318,900株
カチタス	33,700	3,445.00	116,096,500		
東祥	10,900	765.00	8,338,500		
トーセイ	37,100	1,591.00	59,026,100	貸付株式数	14,600株
サンフロンティア不動産	19,700	2,385.00	46,984,500		
グランディハウス	11,600	516.00	5,985,600	貸付株式数	1,300株
東武鉄道	131,600	2,859.50	376,310,200		
相鉄ホールディングス	49,100	2,451.00	120,344,100		
東急	327,500	1,693.00	554,457,500		
京浜急行	144,500	1,484.00	214,438,000		
小田急電鉄	193,100	1,659.50	320,449,450		
京王電鉄	279,200	729.40	203,648,480		
京成電鉄	221,800	1,103.50	244,756,300		
富士急行	15,700	2,475.00	38,857,500	貸付株式数	6,200株
東日本旅客鉄道	702,600	3,377.00	2,372,680,200		
西日本旅客鉄道	303,900	2,565.00	779,503,500		
東海旅客鉄道	524,700	3,350.00	1,757,745,000		
東京地下鉄	202,900	1,348.00	273,509,200	貸付株式数	97,400株
西武ホールディングス	131,100	3,035.00	397,888,500		
鴻池運輸	21,700	2,668.00	57,895,600	貸付株式数	8,500株
西日本鉄道	36,900	2,840.00	104,796,000		
ハマキョウレックス	39,800	1,862.00	74,107,600		
サカイ引越センター	16,100	2,845.00	45,804,500		
近鉄グループHLDGS	136,300	3,543.00	482,910,900		
阪急阪神HLDGS	167,800	4,530.00	760,134,000		
ＮＡＮＫＡＩ	58,100	2,754.50	160,036,450		
京阪ホールディングス	66,200	3,157.00	208,993,400	貸付株式数	10,700株
神戸電鉄	3,500	2,397.00	8,389,500	貸付株式数	1,000株
名古屋鉄道	140,600	1,821.50	256,102,900	貸付株式数	6,600株
山陽電鉄	9,600	1,911.00	18,345,600	貸付株式数	3,500株
ヤマトホールディングス	154,600	1,785.00	275,961,000		
山 九	27,700	8,590.00	237,943,000		

丸全昭和運輸	7,900	7,560.00	59,724,000	
センコーグループHLDGS	92,100	1,964.00	180,884,400	
ニッコンホールディングス	54,200	5,975.00	323,845,000	貸付株式数　25,600株
福山通運	13,100	6,300.00	82,530,000	
セイノーホールディングス	62,600	2,670.50	167,173,300	
神奈川中央交通	3,600	3,495.00	12,582,000	
AZ-COM丸和ホールディ	39,400	756.00	29,786,400	貸付株式数　8,500株
日本郵船	253,200	5,524.00	1,398,676,800	
商船三井	242,100	5,686.00	1,376,580,600	
川崎汽船	274,100	2,637.00	722,801,700	貸付株式数　107,900株
NSユナイテッド海運	8,000	7,190.00	57,520,000	貸付株式数　1,400株
飯野海運	46,700	1,458.00	68,088,600	貸付株式数　1,800株
九州旅客鉄道	95,800	3,507.00	335,970,600	
SGホールディングス	213,600	1,476.00	315,273,600	貸付株式数　79,600株
NIPPON EXPRESS	127,300	5,051.00	642,992,300	
日本航空	291,600	2,823.50	823,332,600	
ANAホールディングス	346,100	3,010.00	1,041,761,000	
ビーウィズ	5,400	1,450.00	7,830,000	貸付株式数　2,100株
サンウェルズ	9,600	145.00	1,392,000	
TREホールディングス	30,100	1,784.00	53,698,400	
人・夢・技術グループ	5,000	1,528.00	7,640,000	
シルバーライフ	3,600	646.00	2,325,600	貸付株式数　700株
GENKY DRUGSTORES	11,800	3,440.00	40,592,000	貸付株式数　4,600株
コーア商事HLDGS	12,000	758.00	9,096,000	貸付株式数　4,100株
KPPグループホールディン	35,200	976.00	34,355,200	
ブックオフＧＨＤ	9,800	1,951.00	19,119,800	貸付株式数　2,900株
ギフトホールディングス	7,600	4,195.00	31,882,000	貸付株式数　3,000株
三菱倉庫	138,000	1,447.00	199,686,000	
三井倉庫HOLD	39,300	3,873.00	152,208,900	
住友倉庫	36,500	3,845.00	140,342,500	
渋沢倉庫	20,300	1,485.00	30,145,500	貸付株式数　7,700株
ヤマタネ	10,800	2,025.00	21,870,000	貸付株式数　4,000株
乾汽船	16,100	1,540.00	24,794,000	貸付株式数　5,900株
日本トランスシティ	31,600	1,115.00	35,234,000	貸付株式数　12,400株
中央倉庫	6,800	1,768.00	12,022,400	貸付株式数　2,600株
安田倉庫	8,700	2,301.00	20,018,700	貸付株式数　1,900株
ＮＩＳＳＯＨＤ	11,400	580.00	6,612,000	貸付株式数　4,300株
大栄環境	28,600	3,780.00	108,108,000	貸付株式数　11,200株
GENOVA	7,600	560.00	4,256,000	貸付株式数　2,900株

日本管財ホールディンク	13,700	2,684.00	36,770,800	貸付株式数　5,400株
上 組	55,800	4,711.00	262,873,800	
キユーソー流通システム	7,200	3,125.00	22,500,000	貸付株式数　600株
エーアイテイー	8,000	2,243.00	17,944,000	
TBSホールディングス	63,100	6,013.00	379,420,300	
日本テレビHLDS	112,000	2,828.50	316,792,000	
朝日放送グループHD	15,900	800.00	12,720,000	貸付株式数　5,600株
テレビ朝日ＨＤ	31,000	3,290.00	101,990,000	
スカパーＪＳＡＴ	85,100	3,220.00	274,022,000	貸付株式数　19,100株
テレビ東京ＨＤ	7,900	3,585.00	28,321,500	貸付株式数　2,300株
ビジョン	26,700	1,022.00	27,287,400	貸付株式数　10,500株
U-NEXT HOLDINGS	43,000	1,592.00	68,456,000	貸付株式数　16,900株
日本通信	103,300	113.00	11,672,900	貸付株式数　39,300株
ＮＴＴ	35,084,600	146.60	5,143,402,360	
ＫＤＤＩ	1,795,700	2,718.00	4,880,712,600	
ソフトバンク	20,575,100	210.20	4,324,886,020	
光通信	12,600	35,910.00	452,466,000	
エムティーアイ	8,600	564.00	4,850,400	貸付株式数　2,000株
GMOインターネットグループ	40,900	3,101.00	126,830,900	
ファイバーゲート	5,800	753.00	4,367,400	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	71,000	3,150.00	223,650,000	
学研ホールディングス	21,200	962.00	20,394,400	
ゼンリン	19,100	850.00	16,235,000	貸付株式数　7,500株
東京電力ＨＤ	1,148,500	531.30	610,198,050	貸付株式数　256,800株
中部電力	469,500	2,861.00	1,343,239,500	
関西電力	690,600	2,367.50	1,634,995,500	
中国電力	221,300	913.20	202,091,160	貸付株式数　23,500株
北陸電力	130,300	887.90	115,693,370	
東北電力	335,400	1,066.00	357,536,400	
四国電力	118,600	1,497.50	177,603,500	
九州電力	293,700	1,682.50	494,150,250	
北海道電力	143,600	950.40	136,477,440	貸付株式数　56,700株
沖縄電力	32,500	927.00	30,127,500	貸付株式数　7,200株
電源開発	95,900	3,991.00	382,736,900	
エフオン	9,100	341.00	3,103,100	
イーレックス	26,100	737.00	19,235,700	貸付株式数　10,200株
レノバ	34,800	895.00	31,146,000	貸付株式数　13,700株
東京瓦斯	207,500	6,261.00	1,299,157,500	
大阪瓦斯	227,500	5,500.00	1,251,250,000	

東邦瓦斯	174,500	1,261.00	220,044,500	
北海道瓦斯	38,000	760.00	28,880,000	貸付株式数 5,000株
広島ガス	26,900	393.00	10,571,700	貸付株式数 8,400株
西部ガスHLDGS	14,600	2,263.00	33,039,800	貸付株式数 5,400株
静岡ガス	29,000	1,265.00	36,685,000	
メタウォーター	16,900	3,330.00	56,277,000	
クオンツ総研ホールディンク	15,500	1,064.00	16,492,000	貸付株式数 6,000株
松 竹	7,300	10,270.00	74,971,000	貸付株式数 2,800株
東 宝	324,000	1,289.00	417,636,000	貸付株式数 127,900株
エイチ・アイ・エス	38,100	913.00	34,785,300	貸付株式数 15,000株
東 映	21,100	5,720.00	120,692,000	
ラックランド	5,900	1,240.00	7,316,000	貸付株式数 2,300株
共立メンテナンス	52,200	2,725.00	142,245,000	貸付株式数 20,000株
イチネンホールディングス	12,400	2,182.00	27,056,800	
建設技術研究所	13,500	2,631.00	35,518,500	
スペース	9,500	1,413.00	13,423,500	
アインホールディングス	15,200	5,745.00	87,324,000	
燦ホールディングス	11,000	1,349.00	14,839,000	
ピー・シー・エー	8,400	1,290.00	10,836,000	貸付株式数 3,300株
スバル興業	4,400	3,630.00	15,972,000	
タナベコンサルティンググル	10,900	727.00	7,924,300	貸付株式数 2,300株 (2,100株)
ビジネスＢ太田昭和	13,700	1,001.00	13,713,700	貸付株式数 5,400株
ナ ガ ワ	3,500	4,795.00	16,782,500	貸付株式数 1,400株
東京都競馬	9,400	4,735.00	44,509,000	貸付株式数 3,400株
カナモト	18,500	5,500.00	101,750,000	
ＤＴＳ	101,500	975.00	98,962,500	
スクウェア・エニックス・HD	210,200	2,450.50	515,095,100	
シーイーシー	15,100	2,080.00	31,408,000	
カプコン	253,900	2,796.00	709,904,400	
ニシオホールディングス	10,800	3,960.00	42,768,000	
アイ・エス・ビー	6,000	2,335.00	14,010,000	貸付株式数 2,200株
日本空港ビルデング	44,400	4,839.00	214,851,600	
トランス・コスモス	16,700	3,765.00	62,875,500	
乃村工藝社	57,100	1,103.00	62,981,300	
藤田観光	26,200	1,818.00	47,631,600	貸付株式数 10,300株
KNT-CTホールディングス	6,500	1,934.00	12,571,000	貸付株式数 1,000株
トーカイ	9,500	2,295.00	21,802,500	

セコム	244,500	6,409.00	1,567,000,500	
ＮＳＷ	5,700	2,476.00	14,113,200	
セントラル警備保障	6,400	2,674.00	17,113,600	貸付株式数　2,400株
アイネス	10,000	2,089.00	20,890,000	
丹青社	27,700	1,317.00	36,480,900	貸付株式数　10,900株
メイテックグループホールデ	48,300	3,048.00	147,218,400	
ＴＫＣ	21,500	3,405.00	73,207,500	
応用地質	11,600	2,799.00	32,468,400	貸付株式数　4,500株
船井総研ホールディン	52,400	1,077.00	56,434,800	貸付株式数　20,700株
ＮＳＤ	45,100	2,516.50	113,494,150	
コナミグループ	54,700	18,960.00	1,037,112,000	
学 究 社	5,200	2,511.00	13,057,200	貸付株式数　1,900株
ナック	13,300	492.00	6,543,600	貸付株式数　5,200株
福井コンピュータHLDS	6,900	3,090.00	21,321,000	貸付株式数　3,000株
ダイセキ	25,200	3,970.00	100,044,000	
ステップ	4,800	2,236.00	10,732,800	貸付株式数　1,700株
泉州電業	8,600	6,990.00	60,114,000	貸付株式数　3,400株
GENKI GLOBAL DIN	7,600	2,856.00	21,705,600	貸付株式数　3,000株
トラスコ中山	28,300	2,242.00	63,448,600	
ヤマダホールディングス	414,600	673.70	279,316,020	
オートバックスセブン	46,900	1,460.00	68,474,000	貸付株式数　18,500株
モリト	9,600	1,758.00	16,876,800	
アークランズ	40,100	1,898.00	76,109,800	貸付株式数　400株
ニトリホールディングス	218,100	2,603.00	567,714,300	
グルメ杵屋	10,900	949.00	10,344,100	貸付株式数　4,100株
ケーユーホールディングス	9,500	1,151.00	10,934,500	
吉野家ホールディングス	49,600	3,122.00	154,851,200	貸付株式数　19,500株 (4,400株)
加藤産業	16,700	5,910.00	98,697,000	
イノテック	8,500	4,105.00	34,892,500	
イエローハット	32,800	1,732.00	56,809,600	
松屋フーズHLDGS	6,800	4,720.00	32,096,000	貸付株式数　2,400株
JBCCホールディングス	33,900	1,184.00	40,137,600	
JKホールディングス	8,900	1,475.00	13,127,500	
サガミホールディングス	21,600	1,616.00	34,905,600	貸付株式数　8,500株
日 伝	7,500	2,544.00	19,080,000	貸付株式数　2,900株
ミロク情報サービス	10,800	1,733.00	18,716,400	
杉本商事	10,900	1,166.00	12,709,400	貸付株式数　4,200株
因幡電機産業	70,400	2,713.00	190,995,200	

王将フードサービス	27,800	2,783.00	77,367,400	貸付株式数　11,000株
ミニストップ	9,800	1,819.00	17,826,200	貸付株式数　3,800株 (1,200株)
アークス	22,700	3,295.00	74,796,500	
バローホールディングス	25,700	3,600.00	92,520,000	
東 テ ク	15,000	3,960.00	59,400,000	貸付株式数　5,400株
ミスミグループ本社	190,300	3,811.00	725,233,300	
ベ ル ク	6,000	6,330.00	37,980,000	貸付株式数　2,300株
大 庄	8,100	1,107.00	8,966,700	貸付株式数　3,400株 (300株)
ファーストリテイリング	91,000	81,080.00	7,378,280,000	
ソフトバンクグループ	2,449,200	7,139.00	17,484,838,800	
スズケン	44,700	5,056.00	226,003,200	
サンドラッグ	39,800	3,810.00	151,638,000	
サックスバーホールディング	11,400	738.00	8,413,200	貸付株式数　4,400株
ジェコス	9,700	1,521.00	14,753,700	
ベルーナ	32,400	950.00	30,780,000	貸付株式数　12,700株
合計			712,654,521,850	

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

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

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワファンドラップ 日経２２５インデックス】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間(2025年6月17日から2026年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 日経２２５インデックス

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	51,520,975	84,417,554
親投資信託受益証券	25,371,148,300	41,995,809,586
未収入金	57,900,000	-
流動資産合計	25,480,569,275	42,080,227,140
資産合計	25,480,569,275	42,080,227,140
負債の部		
流動負債		
未払解約金	63,260,458	17,494,293
未払受託者報酬	2,657,715	3,814,471
未払委託者報酬	38,537,532	55,310,588
その他未払費用	664,345	953,538
流動負債合計	105,120,050	77,572,890
負債合計	105,120,050	77,572,890
純資産の部		
元本等		
元本	※1 9,607,039,766	※1 8,673,031,147
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	15,768,409,459	33,329,623,103
（分配準備積立金）	6,199,762,914	20,404,297,780
元本等合計	25,375,449,225	42,002,654,250
純資産合計	25,375,449,225	42,002,654,250
負債純資産合計	25,480,569,275	42,080,227,140

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 自　2024年6月18日 至　2025年6月16日	第10期 自　2025年6月17日 至　2026年6月15日
営業収益		
受取利息	112,914	300,480
有価証券売買等損益	667,995,743	20,265,061,286
営業収益合計	668,108,657	20,265,361,766
営業費用		
受託者報酬	5,335,710	6,963,682
委託者報酬	77,369,083	100,974,815
その他費用	1,333,759	1,740,753
営業費用合計	84,038,552	109,679,250
営業利益又は営業損失（△）	584,070,105	20,155,682,516
経常利益又は経常損失（△）	584,070,105	20,155,682,516
当期純利益又は当期純損失（△）	584,070,105	20,155,682,516
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	37,138,836	3,728,954,766
期首剰余金又は期首欠損金（△）	14,756,864,993	15,768,409,459
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,088,739,120	8,022,350,140
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,088,739,120	8,022,350,140
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,624,125,923	6,887,864,246
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,624,125,923	6,887,864,246
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	15,768,409,459	33,329,623,103

(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10期 自2025年6月17日 至2026年6月15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 2025年6月15日が休日のため、前計算期間末日を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9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
1.　※1 期首元本額	9,290,599,405円	9,607,039,766円
期中追加設定元本額	1,965,081,837円	3,019,153,527円
期中一部解約元本額	1,648,641,476円	3,953,162,146円
2.　計算期間末日における受益権の総数	9,607,039,766口	8,673,031,147口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日	第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15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（96,062円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（546,835,207円）、投資信託約款に規定される収益調整金（9,568,646,545円）及び分配準備積立金（5,652,831,645円）より分配対象額は15,768,409,459円（1万口当たり16,413.39円）であり、分配を行っておりません。	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（258,439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（16,426,469,311円）、投資信託約款に規定される収益調整金（12,925,325,323円）及び分配準備積立金（3,977,570,030円）より分配対象額は33,329,623,103円（1万口当たり38,429.04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10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	第10期 2026年6月15日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	630,460,911	17,002,661,708
合計	630,460,911	17,002,661,708

（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9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.6413円 (26,413円)	4.8429円 (48,429円)

(4)【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	ストックインデックス２２５・マザーファンド	4,243,501,196	41,995,809,586	
親投資信託受益証券 合計			41,995,809,586	
合計			41,995,809,586	

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

	2025年6月16日現在 金 額（円）	2026年6月15日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		

コール・ローン		9,495,893,684	17,976,909,005
株式	※2※3	381,245,909,230	669,972,866,760
派生商品評価勘定		1,157,800	1,176,269,200
未収入金		-	121,073,700
未収配当金		2,001,730,100	2,318,712,000
前払金		107,200,000	-
その他未収収益	※4	12,645,563	9,333,803
流動資産合計		392,864,536,377	691,575,164,468
資産合計		392,864,536,377	691,575,164,468
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		14,488,000	-
前受金		-	385,900,000
未払解約金		811,101,000	2,228,178,000
未払利息		682,337	335,354
受入担保金		4,508,265,509	1,159,754,421
流動負債合計		5,334,536,846	3,774,167,775
負債合計		5,334,536,846	3,774,167,775
純資産の部			
元本等			
元本	※1	72,051,623,995	69,499,179,592
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）		315,478,375,536	618,301,817,101
元本等合計		387,529,999,531	687,800,996,693
純資産合計		387,529,999,531	687,800,996,693
負債純資産合計		392,864,536,377	691,575,164,468

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2026年6月15日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	株式

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的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6月16日現在	2026年6月15日現在
1.　※1 期首	2024年6月18日	2025年6月17日
期首元本額	62,582,339,693円	72,051,623,995円
期中追加設定元本額	26,408,350,814円	20,513,430,077円
期中一部解約元本額	16,939,066,512円	23,065,874,480円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ストック インデックス ファンド２２５	25,666,912,776円	21,030,573,368円
適格機関投資家専用・ダイワ・ストックインデックスファンド２２５ＶＡ	158,940,517円	131,111,840円
大和 ストック インデックス ２２５ ファンド	8,508,877,888円	8,225,426,440円
Ｄ－Ｉ's 日経２２５インデックス	20,260,477円	16,451,599円
ｉＦｒｅｅ 日経２２５インデックス	21,238,515,348円	24,972,021,823円

ＤＣ・ダイワ・ストックインデックス２２５（確定拠出年金専用ファンド）	5,526,738,710円	5,405,377,448円
ダイワ・ノーロード 日経２２５ファンド	466,535,909円	384,205,456円
ダイワファンドラップ 日経２２５インデックス	4,717,142,010円	4,243,501,196円
ダイワ日経２２５インデックス（ダイワＳＭＡ専用）	894,486,416円	928,603,810円
ダイワ・インデックスセレクト 日経２２５	4,853,213,944円	4,161,906,612円
計	72,051,623,995円	69,499,179,592円
2. 期末日における受益権の総数	72,051,623,995口	69,499,179,592口
3. ※2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 4,442,472,220円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 1,111,431,860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 5,243,094,000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 12,027,300,000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2025年6月17日 至2026年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	2026年6月15日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2025年6月16日現在	2026年6月15日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）

株式	13,072,573,499	228,678,368,508
合計	13,072,573,499	228,678,368,508

（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	2025年6月16日現在				2026年6月15日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	6,304,280,000	-	6,291,040,000	△13,240,000	16,589,990,000	-	17,766,400,000	1,176,410,000
合計	6,304,280,000	-	6,291,040,000	△13,240,000	16,589,990,000	-	17,766,400,000	1,176,410,000

（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6月16日現在	2026年6月15日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	5.3785円 (53,785円)	9.8965円 (98,965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	324,000	1,281.00	415,044,000	
ＩＮＰＥＸ	129,600	3,495.00	452,952,000	
コムシスホールディングス	324,000	5,350.00	1,733,400,000	
大成建設	64,800	15,165.00	982,692,000	
大 林 組	324,000	3,327.00	1,077,948,000	
清水建設	324,000	2,717.00	880,308,000	
長谷工コーポレーシヨン	64,800	2,706.50	175,381,200	
鹿島建設	162,000	6,130.00	993,060,000	
大和ハウス	324,000	4,388.00	1,421,712,000	
積水ハウス	324,000	3,335.00	1,080,540,000	
日揮ホールディングス	324,000	2,688.00	870,912,000	
日清製粉Ｇ本社	324,000	1,948.00	631,152,000	
明治ホールディングス	129,600	3,664.00	474,854,400	
日本ハム	162,000	6,089.00	986,418,000	
エムスリー	777,600	1,602.00	1,245,715,200	
ディー・エヌ・エー	97,200	2,680.00	260,496,000	貸付株式数　23,000株
サッポロホールディングス	324,000	1,667.00	540,108,000	
アサヒグループホールディン	972,000	1,510.00	1,467,720,000	
キリンＨＤ	324,000	2,682.00	868,968,000	
双日	32,400	5,316.00	172,238,400	
キッコーマン	1,620,000	1,569.50	2,542,590,000	
味 の 素	648,000	5,060.00	3,278,880,000	
キオクシアホールディングス	226,800	90,910.00	20,618,388,000	
ニチレイ	324,000	2,091.50	677,646,000	
日本たばこ産業	324,000	6,070.00	1,966,680,000	
Ｊ．フロント リテイリング	162,000	2,437.50	394,875,000	
ＺＯＺＯ	972,000	1,093.00	1,062,396,000	
三越伊勢丹ＨＤ	324,000	3,699.00	1,198,476,000	
東急不動産ＨＤ	324,000	1,349.00	437,076,000	
セブン&アイ・HLDGS	972,000	1,939.50	1,885,194,000	
帝 人	64,800	1,654.50	107,211,600	
東 レ	324,000	1,197.50	387,990,000	
ク ラ レ	324,000	1,774.50	574,938,000	
旭 化 成	324,000	1,764.50	571,698,000	
ＳＵＭＣＯ	32,400	4,305.00	139,482,000	
ネクソン	648,000	2,200.00	1,425,600,000	貸付株式数　259,200株
ＳＨＩＦＴ	324,000	636.80	206,323,200	貸付株式数　131,600株

王子ホールディングス	324,000	797.30	258,325,200	
レゾナック・ホールディング	32,400	18,395.00	595,998,000	
住友化学	324,000	576.50	186,786,000	
日産化学	324,000	7,800.00	2,527,200,000	
東ソー	162,000	3,037.00	491,994,000	
トクヤマ	64,800	5,100.00	330,480,000	
デンカ	64,800	4,227.00	273,909,600	
イビデン	648,000	22,750.00	14,742,000,000	
信越化学	1,620,000	7,564.00	12,253,680,000	
協和キリン	324,000	2,388.50	773,874,000	
三井化学	129,600	2,185.50	283,240,800	
三菱ケミカルグループ	162,000	1,128.50	182,817,000	
ＵＢＥ	32,400	3,203.00	103,777,200	
野村総合研究所	324,000	4,565.00	1,479,060,000	
電通グループ	324,000	3,101.00	1,004,724,000	貸付株式数　20,000株
メルカリ	324,000	3,720.00	1,205,280,000	
花 王	324,000	6,055.00	1,961,820,000	
武田薬品	324,000	5,088.00	1,648,512,000	※
アステラス製薬	1,620,000	2,152.50	3,487,050,000	
住友ファーマ	324,000	1,418.50	459,594,000	貸付株式数　120,800株
塩野義製薬	972,000	2,787.00	2,708,964,000	
中外製薬	972,000	7,428.00	7,220,016,000	※
エーザイ	324,000	3,821.00	1,238,004,000	
テ ル モ	2,592,000	2,237.00	5,798,304,000	
第一三共	972,000	2,546.00	2,474,712,000	
大塚ホールディングス	324,000	10,230.00	3,314,520,000	
オリエンタルランド	324,000	2,263.00	733,212,000	
ＬＩＮＥヤフー	129,600	410.90	53,252,640	
トレンドマイクロ	324,000	5,865.00	1,900,260,000	
サイバーエージェント	259,200	1,295.00	335,664,000	
楽天グループ	324,000	739.70	239,662,800	
富士フイルムHLDGS	972,000	3,439.00	3,342,708,000	
コニカミノルタ	324,000	589.70	191,062,800	
資 生 堂	324,000	2,597.00	841,428,000	
出光興産	648,000	1,331.50	862,812,000	
ENEOSホールディングス	324,000	1,246.00	403,704,000	
横浜ゴム	162,000	7,751.00	1,255,662,000	
ブリヂストン	648,000	3,513.00	2,276,424,000	
ＡＧＣ	64,800	7,382.00	478,353,600	

日本電気硝子	97,200	6,220.00	604,584,000	
太平洋セメント	32,400	4,407.00	142,786,800	
東海カーボン	324,000	1,822.00	590,328,000	
ＴＯＴＯ	162,000	8,190.00	1,326,780,000	
ＮＧＫ	324,000	6,635.00	2,149,740,000	
日本製鉄	162,000	574.20	93,020,400	貸付株式数　65,800株
神戸製鋼所	32,400	1,997.00	64,702,800	
ＪＦＥホールディングス	32,400	1,647.50	53,379,000	
ARCHION	324,000	299.00	96,876,000	貸付株式数　131,600株
日本製鋼所	64,800	7,640.00	495,072,000	
三井金属	32,400	44,690.00	1,447,956,000	
三菱マテリアル	32,400	5,005.00	162,162,000	
住友鉱山	162,000	9,200.00	1,490,400,000	
DOWAホールディングス	64,800	9,870.00	639,576,000	
古河電工	32,400	43,970.00	1,424,628,000	
住友電工	324,000	11,530.00	3,735,720,000	
フジクラ	1,944,000	4,346.00	8,448,624,000	
しずおかフィナンシャルク	324,000	3,121.00	1,011,204,000	
リクルートホールディングス	972,000	10,720.00	10,419,840,000	
オークマ	129,600	4,335.00	561,816,000	
アマダ	324,000	3,090.00	1,001,160,000	
ディスコ	64,800	85,250.00	5,524,200,000	
日本郵政	324,000	2,285.50	740,502,000	
ＳＭＣ	32,400	70,130.00	2,272,212,000	
小松製作所	324,000	6,817.00	2,208,708,000	
住友重機械	64,800	5,474.00	354,715,200	
日立建機	324,000	5,559.00	1,801,116,000	
クボタ	324,000	2,843.00	921,132,000	
荏原製作所	324,000	6,204.00	2,010,096,000	
ダイキン工業	324,000	23,360.00	7,568,640,000	※
日本精工	324,000	1,206.00	390,744,000	
Ｎ Ｔ Ｎ	324,000	436.20	141,328,800	
ジェイテクト	324,000	2,068.00	670,032,000	
ミネベアミツミ	324,000	4,476.00	1,450,224,000	
日 立	324,000	4,737.00	1,534,788,000	
三菱電機	324,000	5,858.00	1,897,992,000	
富士電機	64,800	14,360.00	930,528,000	
安川電機	324,000	6,655.00	2,156,220,000	
ソシオネクスト	324,000	2,404.00	778,896,000	

ベイカレント	324,000	5,484.00	1,776,816,000	
オムロン	324,000	5,812.00	1,883,088,000	
日本電気	162,000	3,847.00	623,214,000	
富 士 通	324,000	3,260.00	1,056,240,000	
ルネサスエレクトロニクス	324,000	4,488.00	1,454,112,000	
セイコーエプソン	648,000	2,835.50	1,837,404,000	
パナソニック ホールディンク	324,000	4,010.00	1,299,240,000	
シャープ	324,000	614.20	199,000,800	貸付株式数　131,600株
ソニーグループ	1,620,000	3,320.00	5,378,400,000	
Ｔ Ｄ Ｋ	4,860,000	3,906.00	18,983,160,000	※
アルプスアルパイン	324,000	2,107.00	682,668,000	
横河電機	324,000	5,162.00	1,672,488,000	
アドバンテスト	2,332,800	29,420.00	68,630,976,000	※
キーエンス	32,400	75,650.00	2,451,060,000	
デンソー	1,296,000	1,906.50	2,470,824,000	
レーザーテック	129,600	48,300.00	6,259,680,000	
ファナック	1,620,000	7,344.00	11,897,280,000	※
ロ ー ム	324,000	5,257.00	1,703,268,000	
京 セ ラ	2,592,000	3,837.00	9,945,504,000	
太陽誘電	324,000	19,285.00	6,248,340,000	
村田製作所	777,600	10,060.00	7,822,656,000	
日東電工	1,620,000	3,099.00	5,020,380,000	
カナデビア	64,800	1,363.00	88,322,400	
三菱重工業	324,000	3,659.00	1,185,516,000	
川崎重工業	162,000	2,905.50	470,691,000	
ＩＨＩ	226,800	2,705.00	613,494,000	
横浜フィナンシャルグループ	324,000	1,761.00	570,564,000	
日産自動車	324,000	356.90	115,635,600	
いすゞ自動車	162,000	2,294.00	371,628,000	
トヨタ自動車	1,620,000	2,902.50	4,702,050,000	
三菱自動車工業	32,400	337.00	10,918,800	貸付株式数　13,100株
マ ツ ダ	64,800	1,182.50	76,626,000	
本田技研	1,944,000	1,458.00	2,834,352,000	
スズキ	1,296,000	1,933.00	2,505,168,000	
SUBARU	324,000	2,568.00	832,032,000	
ヤマハ発動機	972,000	1,232.00	1,197,504,000	
良品計画	648,000	3,629.00	2,351,592,000	
パンパシフィックHD	324,000	837.20	271,252,800	

ニコン	324,000	2,070.50	670,842,000	
オリンパス	1,296,000	1,686.00	2,185,056,000	
SCREENホールディングス	259,200	14,860.00	3,851,712,000	
ＨＯＹＡ	162,000	26,630.00	4,314,060,000	
キヤノン	486,000	4,327.00	2,102,922,000	
リ コ ー	324,000	1,465.50	474,822,000	
バンダイナムコHLDGS	972,000	3,594.00	3,493,368,000	
TOPPANホールディングス	162,000	4,408.00	714,096,000	
大日本印刷	324,000	2,671.00	865,404,000	
ヤマハ	972,000	1,119.50	1,088,154,000	
任 天 堂	324,000	7,110.00	2,303,640,000	
伊 藤 忠	1,620,000	1,907.00	3,089,340,000	
丸 紅	324,000	5,042.00	1,633,608,000	
豊田通商	972,000	6,505.00	6,322,860,000	
三井物産	648,000	4,838.00	3,135,024,000	
東京エレクトロン	972,000	72,760.00	70,722,720,000	※
住友商事	324,000	6,567.00	2,127,708,000	
三菱商事	972,000	4,728.00	4,595,616,000	
高 島 屋	324,000	2,160.00	699,840,000	
丸井グループ	324,000	2,824.00	914,976,000	
クレディセゾン	324,000	4,304.00	1,394,496,000	
イオン	972,000	1,382.50	1,343,790,000	
あおぞら銀行	32,400	2,790.50	90,412,200	
三菱UFJフィナンシャルG	324,000	3,242.00	1,050,408,000	
りそなホールディングス	32,400	2,203.00	71,377,200	
三井住友トラストグルー	64,800	6,061.00	392,752,800	
三井住友フィナンシャルG	97,200	6,519.00	633,646,800	
千葉銀行	324,000	2,521.00	816,804,000	
ふくおかフィナンシャルG	64,800	6,953.00	450,554,400	
みずほフィナンシャルＧ	32,400	7,793.00	252,493,200	
オリックス	324,000	6,170.00	1,999,080,000	
大和証券Ｇ本社	324,000	1,595.00	516,780,000	
野村ホールディングス	324,000	1,414.00	458,136,000	
SOMPOホールディングス	194,400	6,242.00	1,213,444,800	
日本取引所グループ	648,000	2,204.00	1,428,192,000	
ＭＳ＆ＡＤ	291,600	4,673.00	1,362,646,800	
第一ライフグループ	129,600	1,776.00	230,169,600	
東京海上ＨＤ	486,000	7,301.00	3,548,286,000	
T&Dホールディングス	64,800	4,802.00	311,169,600	
三井不動産	972,000	1,570.50	1,526,526,000	

三菱地所	324,000	4,277.00	1,385,748,000	
東京建物	162,000	3,371.00	546,102,000	
住友不動産	648,000	3,685.00	2,387,880,000	
東武鉄道	64,800	2,859.50	185,295,600	
東急	162,000	1,693.00	274,266,000	
小田急電鉄	162,000	1,659.50	268,839,000	
京王電鉄	324,000	729.40	236,325,600	
京成電鉄	486,000	1,103.50	536,301,000	
東日本旅客鉄道	97,200	3,377.00	328,244,400	
西日本旅客鉄道	64,800	2,565.00	166,212,000	
東海旅客鉄道	162,000	3,350.00	542,700,000	
ヤマトホールディングス	324,000	1,785.00	578,340,000	
日本郵船	97,200	5,524.00	536,932,800	
商船三井	97,200	5,686.00	552,679,200	
川崎汽船	291,600	2,637.00	768,949,200	
NIPPON EXPRESS	97,200	5,051.00	490,957,200	
日本航空	324,000	2,823.50	914,814,000	
ANAホールディングス	32,400	3,010.00	97,524,000	
ＮＴＴ	3,240,000	146.60	474,984,000	
ＫＤＤＩ	3,888,000	2,718.00	10,567,584,000	※
ソフトバンク	3,240,000	210.20	681,048,000	
東京電力ＨＤ	32,400	531.30	17,214,120	
中部電力	32,400	2,861.00	92,696,400	
関西電力	32,400	2,367.50	76,707,000	
東京瓦斯	64,800	6,261.00	405,712,800	
大阪瓦斯	64,800	5,500.00	356,400,000	
東 宝	162,000	1,289.00	208,818,000	
セコム	648,000	6,409.00	4,153,032,000	
コナミグループ	324,000	18,960.00	6,143,040,000	
ニトリホールディングス	810,000	2,603.00	2,108,430,000	
ファーストリテイリング	777,600	81,080.00	63,047,808,000	※
ソフトバンクグループ	7,776,000	7,139.00	55,512,864,000	
合計			669,972,866,760	

（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
中外製薬	65,000株
ダイキン工業	26,000株
Ｔ Ｄ Ｋ	300,000株

アドバンテスト	100,000株
ファナック	100,000株
東京エレクトロン	17,000株
ＫＤＤＩ	200,000株
ファーストリテイリング	50,000株

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間(2025年6月17日から2026年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	319,000,045	353,999,984
親投資信託受益証券	93,148,628,870	134,406,802,006
未収入金	24,890,000	-
流動資産合計	93,492,518,915	134,760,801,990
資産合計	93,492,518,915	134,760,801,990
負債の部		
流動負債		
未払解約金	125,817,834	68,376,837
未払受託者報酬	10,025,462	13,112,609
未払委託者報酬	192,990,998	252,418,402
その他未払費用	1,102,560	1,105,092
流動負債合計	329,936,854	335,012,940
負債合計	329,936,854	335,012,940
純資産の部		
元本等		
元本	※1 43,753,805,701	※1 52,721,421,895
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	49,408,776,360	81,704,367,155
（分配準備積立金）	18,951,680,093	34,188,941,140
元本等合計	93,162,582,061	134,425,789,050
純資産合計	93,162,582,061	134,425,789,050
負債純資産合計	93,492,518,915	134,760,801,990

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 自　2024年6月18日 至　2025年6月16日	第10期 自　2025年6月17日 至　2026年6月15日
営業収益		
受取利息	622,520	1,387,731
有価証券売買等損益	5,882,538,598	20,537,889,136
営業収益合計	5,883,161,118	20,539,276,867
営業費用		
受託者報酬	19,972,473	24,435,487
委託者報酬	384,471,965	470,384,734
その他費用	2,194,005	2,191,197
営業費用合計	406,638,443	497,011,418
営業利益又は営業損失（△）	5,476,522,675	20,042,265,449
経常利益又は経常損失（△）	5,476,522,675	20,042,265,449
当期純利益又は当期純損失（△）	5,476,522,675	20,042,265,449
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（△）	640,320,636	1,648,534,418
期首剰余金又は期首欠損金（△）	42,126,733,891	49,408,776,360
剰余金増加額又は欠損金減少額	12,974,208,672	23,743,483,581
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	12,974,208,672	23,743,483,581
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,528,368,242	9,841,623,817
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	10,528,368,242	9,841,623,817
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	49,408,776,360	81,704,367,155

(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10期 自2025年6月17日 至2026年6月15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 2025年6月15日が休日のため、前計算期間末日を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9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
1.　※1 期首元本額	42,039,157,358円	43,753,805,701円
期中追加設定元本額	12,127,063,344円	17,486,967,119円
期中一部解約元本額	10,412,415,001円	8,519,350,925円
2.　計算期間末日における受益権の総数	43,753,805,701口	52,721,421,895口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日	第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15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（577,797円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（4,835,624,242円）、投資信託約款に規定される収益調整金（30,457,096,267円）及び分配準備積立金（14,115,478,054円）より分配対象額は49,408,776,360円（1万口当たり11,292.45円）であり、分配を行っておりません。	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（1,315,100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（18,392,415,931円）、投資信託約款に規定される収益調整金（47,515,426,015円）及び分配準備積立金（15,795,210,109円）より分配対象額は81,704,367,155円（1万口当たり15,497.38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10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	第10期 2026年6月15日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	5,449,141,104	19,727,637,824
合計	5,449,141,104	19,727,637,824

（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9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.1292円 (21,292円)	2.5497円 (25,497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	33,304,458,212	134,406,802,006	
親投資信託受益証券 合計			134,406,802,006	
合計			134,406,802,006	

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

	2025年6月16日現在 金 額（円）	2026年6月15日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		

預金	1,317,930,736	885,679,412
コール・ローン	4,032,670,944	6,898,353,203
株式	132,137,357,958	188,273,131,748
投資証券	2,470,068,827	3,090,571,888
派生商品評価勘定	286,869,439	244,918,749
未収入金	3,845,546	6,705,116
未収配当金	140,409,863	174,373,046
差入委託証拠金	2,503,539,813	4,947,193,847
流動資産合計	142,892,693,126	204,520,927,009
資産合計	142,892,693,126	204,520,927,009
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,234,407,518	1,035,366,264
未払解約金	88,200,070	86,044,890
流動負債合計	1,322,607,588	1,121,411,154
負債合計	1,322,607,588	1,121,411,154
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	42,195,690,404	50,400,463,440
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	99,374,395,134	152,999,052,415
元本等合計	141,570,085,538	203,399,515,855
純資産合計	141,570,085,538	203,399,515,855
負債純資産合計	142,892,693,126	204,520,927,009

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2026年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (3)投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の１口当たり純資産額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。	
2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引	

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2025年6月16日現在	2026年6月15日現在
1.　※1 期首	2024年6月18日	2025年6月17日
期首元本額	38,512,369,700円	42,195,690,404円
期中追加設定元本額	15,192,083,833円	17,302,790,492円
期中一部解約元本額	11,508,763,129円	9,098,017,456円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	27,763,294,349円	33,304,458,212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）	1,180,553,479円	1,196,853,869円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	3,929,629,899円	4,138,205,578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）	621,682円	7,755,016円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル1（安定）	-円	435円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル2（やや安定）	-円	793円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル3（バランス）	-円	69,156円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル4（やや積極）	-円	87,827円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル5（積極）	-円	16,173円
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）	9,095,282,929円	11,550,410,417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）	226,308,066円	202,605,964円
計	42,195,690,404円	50,400,463,440円
2. 期末日における受益権の総数	42,195,690,404口	50,400,463,440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2025年6月17日 至2026年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。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	2026年6月15日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2025年6月16日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2026年6月15日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	2,906,142,354	9,942,317,852
新株予約権証券	0	0
投資証券	84,095,059	313,245,524
合計	2,990,237,413	10,255,563,376

（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	2025年6月16日現在				2026年6月15日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	7,028,050,976	-	7,298,509,513	270,458,537	12,780,796,738	-	12,781,956,969	1,160,231
合計	7,028,050,976	-	7,298,509,513	270,458,537	12,780,796,738	-	12,781,956,969	1,160,231

（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6月16日現在				2026年6月15日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	135,923,571,413	-	137,141,568,029	△1,217,996,616	198,338,876,796	-	199,130,484,542	△791,607,746
アメリカ・ドル	103,712,228,720	-	104,418,262,215	△706,033,495	153,010,667,517	-	153,890,869,605	△880,202,088
イギリス・ポンド	5,429,552,602	-	5,489,671,105	△60,118,503	7,135,171,467	-	7,178,853,149	△43,681,682
イスラエル・シュケル	209,420,539	-	204,897,117	4,523,422	551,916,826	-	533,056,544	18,860,282
オーストラリア・ドル	2,463,090,235	-	2,493,700,312	△30,610,077	3,250,673,974	-	3,218,699,634	31,974,340
カナダ・ドル	4,354,200,481	-	4,420,364,928	△66,164,447	7,380,861,509	-	7,334,456,000	46,405,509
シンガポール・ドル	514,808,339	-	520,170,570	△5,362,231	792,028,363	-	793,782,689	△1,754,326
スイス・フラン	3,514,319,718	-	3,572,142,987	△57,823,269	4,609,916,441	-	4,562,461,952	47,454,489
スウェーデン・クローナ	1,176,599,002	-	1,189,730,456	△13,131,454	1,745,908,668	-	1,735,180,186	10,728,482
デンマーク・クローネ	888,262,439	-	905,968,489	△17,706,050	914,025,096	-	915,293,347	△1,268,251
ニュージーランド・ドル	72,083,475	-	72,881,744	△798,269	100,528,289	-	98,890,062	1,638,227
ノルウェー・クローネ	240,799,415	-	248,856,824	△8,057,409	368,262,065	-	361,308,457	6,953,608
ユーロ	12,642,252,280	-	12,895,869,086	△253,616,806	17,480,190,226	-	17,503,832,992	△23,642,766
香港・ドル	705,954,168	-	709,052,196	△3,098,028	998,726,355	-	1,003,799,925	△5,073,570
合計	135,923,571,413	-	137,141,568,029	△1,217,996,616	198,338,876,796	-	199,130,484,542	△791,607,746

（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6月16日現在	2026年6月15日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.3551円 (33,551円)	4.0357円 (40,357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 SOLUTIONS INC	1,766	144.870	255,840.420	
	PALO ALTO NETWORKS INC	11,676	279.620	3,264,843.120	
	FIRST SOLAR INC	1,458	267.310	389,737.980	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	2,456	350.670	861,245.520	
	SYNCHRONY FINANCIAL	5,106	73.360	374,576.160	
	ABBOTT LABORATORIES	24,962	88.180	2,201,149.160	
	HOWMET AEROSPACE INC	5,751	264.670	1,522,117.170	
	VERISK ANALYTICS INC	1,935	183.800	355,653.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	4,259	50.670	215,803.530	
	AMPHENOL CORP CLASS A	17,630	153.800	2,711,494.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	669	1,577.320	1,055,227.080	
	FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERV	7,323	39.200	287,061.600	
	AFLAC INC	6,641	117.800	782,309.800	
	DARDEN RESTAURANTS INC	1,670	211.470	353,154.900	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	2,295	172.510	395,910.450	

ADOBE INC	5,794	204.020	1,182,091.880	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,224	109.480	243,483.520	
LULULEMON ATHLETICA INC	1,473	118.770	174,948.210	
GARMIN LTD	2,384	238.100	567,630.400	
AIR PRODUCTS AND CHEMICALS INC	3,040	281.620	856,124.800	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	9,161	220.310	2,018,259.910	
WR BERKLEY CORP	3,068	68.270	209,452.360	
AUTOZONE INC	239	3,116.300	744,795.700	
DOLLAR TREE INC	2,680	114.000	305,520.000	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES ADR	17,865	34.630	618,664.950	
D R HORTON INC	3,756	154.090	578,762.040	
AUTODESK INC	3,079	198.430	610,965.970	
MOODYS CORP	2,170	447.850	971,834.500	
DEVON ENERGY CORP	15,559	45.310	704,978.290	
ATMOS ENERGY CORP	2,383	169.960	405,014.680	
ALLIANT ENERGY CORP	3,669	73.110	268,240.590	
CITIGROUP INC	24,336	139.830	3,402,902.880	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	5,809	226.210	1,314,053.890	
AMERICAN ELECTRIC POWER INC	7,835	129.230	1,012,517.050	
DOMINOS PIZZA INC	487	323.880	157,729.560	
DANAHER CORP	9,149	180.100	1,647,734.900	
FORTIVE CORP	4,057	60.140	243,987.980	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	8,135	140.530	1,143,211.550	
ARCHER DANIELS MIDLAND	6,806	80.240	546,113.440	
APPLE INC	209,823	291.130	61,085,769.990	
BOEING	10,642	219.050	2,331,130.100	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,313	169.010	390,920.130	
BECTON DICKINSON	4,077	146.240	596,220.480	
LEIDOS HOLDINGS INC	1,782	122.160	217,689.120	
NISOURCE INC	6,711	47.210	316,826.310	
CH ROBINSON WORLDWIDE INC	1,704	193.740	330,132.960	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	9,884	143.980	1,423,098.320	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	59,767	48.110	2,875,390.370	
BERKSHIRE HATHAWAY INC CLASS B	19,919	489.250	9,745,370.750	
TRUIST FINANCIAL CORP	17,986	51.660	929,156.760	
BLACKSTONE INC	10,632	122.790	1,305,503.280	

BRISTOL MYERS SQUIBB	29,275	57.130	1,672,480.750	
JPMORGAN CHASE	38,329	320.720	12,292,876.880	
T ROWE PRICE GROUP INC	3,255	109.640	356,878.200	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	3,968	384.960	1,527,521.280	
AMERIPRISE FINANCE INC	1,292	459.130	593,195.960	
DOLLAR GENERAL CORP	3,277	114.800	376,199.600	
SERVICENOW INC	14,970	102.150	1,529,185.500	
CATERPILLAR INC	6,658	910.570	6,062,575.060	
BROWN & BROWN INC	4,373	59.990	262,336.270	
CMS ENERGY CORP	4,333	73.570	318,778.810	
DELTA AIR LINES INC	2,319	83.060	192,616.140	
CORNING INC	11,370	179.200	2,037,504.000	
CISCO SYSTEMS INC	56,480	121.100	6,839,728.000	
MORGAN STANLEY	16,988	214.040	3,636,111.520	
DECKERS OUTDOOR CORP	2,100	113.830	239,043.000	
MSCI INC	1,040	599.120	623,084.800	
FAIR ISAAC CORP	329	1,179.190	387,953.510	
LENNOX INTERNATIONAL INC	450	512.150	230,467.500	
SS AND C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	3,098	67.680	209,672.640	
BROADCOM INC	64,300	382.070	24,567,101.000	
UNITED THERAPEUTICS CORP	560	545.960	305,737.600	
CNH INDUSTRIAL N.V. NV	11,900	10.600	126,140.000	
DICKS SPORTING INC	900	220.990	198,891.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,885	282.850	533,172.250	
DTE ENERGY	2,990	147.420	440,785.800	
CENTENE CORP	6,964	65.190	453,983.160	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,502	294.910	442,954.820	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	6,065	67.650	410,297.250	
ARTHUR J GALLAGHER	3,760	218.690	822,274.400	
DOMINION ENERGY INC	12,628	67.910	857,567.480	
MONSTER BEVERAGE CORP	10,156	92.830	942,781.480	
DEERE	3,469	577.480	2,003,278.120	
QUANTA SERVICES INC	2,166	707.740	1,532,964.840	
GLOBAL PAYMENTS INC	3,394	67.710	229,807.740	
BURLINGTON STORES INC	906	338.450	306,635.700	
NASDAQ INC	6,441	88.980	573,120.180	
TARGA RESOURCES CORP	3,031	272.600	826,250.600	
CONSOLIDATED EDISON INC	5,276	107.740	568,436.240	

JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	1,128	289.360	326,398.080	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC	1,094	328.820	359,729.080	
VEEVA SYSTEMS INC CLASS A	2,086	159.540	332,800.440	
CARLISLE COMPANIES INC	600	343.770	206,262.000	
IDEX CORP	1,060	218.490	231,599.400	
COLGATE-PALMOLIVE	10,981	89.450	982,250.450	
ROLLINS INC	4,360	47.190	205,748.400	
WATSCO INC	500	380.460	190,230.000	
GRACO INC	2,400	74.600	179,040.000	
AMETEK INC	3,365	227.120	764,258.800	
CHURCH AND DWIGHT INC	3,447	97.560	336,289.320	
CURTISS WRIGHT CORP	560	758.000	424,480.000	
HEICO CORP	675	331.610	223,836.750	
XPO INC	1,800	228.330	410,994.000	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES CLASS A	3,706	64.580	239,333.480	
TYLER TECHNOLOGIES INC	654	298.840	195,441.360	
COSTCO WHOLESALE CORP	6,360	982.350	6,247,746.000	
RPM INTERNATIONAL INC	1,836	107.050	196,543.800	
RELIANCE INC	740	413.430	305,938.200	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	18,600	32.230	599,478.000	
COMFORT SYSTEMS USA INC	510	1,877.610	957,581.100	
CUMMINS INC	1,975	659.580	1,302,670.500	
CDW CORP	1,987	132.190	262,661.530	
COSTAR GROUP INC	5,963	32.840	195,824.920	
OLD DOMINION FREIGHT LINE INC	2,756	245.750	677,287.000	
INTERACTIVE BROKERS GROUP INC CLAS	6,100	90.810	553,941.000	
MERCADOLIBRE INC	659	1,589.600	1,047,546.400	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	3,267	345.950	1,130,218.650	
DEXCOM INC	5,535	75.370	417,172.950	
NORDSON CORP	772	288.210	222,498.120	
COPART INC	12,936	30.750	397,782.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	2,750	192.130	528,357.500	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	1,118	295.660	330,547.880	
TRANSDIGM GROUP INC	810	1,256.050	1,017,400.500	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	1,426	159.760	227,817.760	

CASEYS GENERAL STORES INC	560	895.140	501,278.400	
KINDER MORGAN INC	26,943	31.940	860,559.420	
HCA HEALTHCARE INC	2,265	387.180	876,962.700	
T MOBILE US INC	7,116	189.100	1,345,635.600	
EMCOR GROUP INC	640	823.050	526,752.000	
COCA-COLA	55,233	82.620	4,563,350.460	
COCA COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	2,875	99.340	285,602.500	
EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHIN	1,925	166.620	320,743.500	
CSX CORP	26,631	47.570	1,266,836.670	
EXPEDIA GROUP INC	1,696	224.890	381,413.440	
AMAZON COM INC	138,485	238.550	33,035,596.750	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,244	85.110	701,646.840	
EXXON MOBIL CORP	59,429	147.010	8,736,657.290	
EVEREST GROUP LTD	596	339.400	202,282.400	
EOG RESOURCES INC	7,652	136.650	1,045,645.800	
EQT CORP	8,503	51.940	441,645.820	
FIRST CITIZENS BANCSHARES INC CLAS	114	2,108.610	240,381.540	
CENCORA INC	2,642	281.670	744,172.140	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	4,015	129.840	521,307.600	
FORD MOTOR	56,078	14.840	832,197.520	
ENTEGRIS INC	2,193	150.520	330,090.360	
STRATEGY INC CLASS A	3,800	123.970	471,086.000	
AERCAP HOLDINGS NV	2,301	140.000	322,140.000	
FORTINET INC	9,069	146.300	1,326,794.700	
MARKEL GROUP INC	180	1,846.000	332,280.000	
NEXTERA ENERGY INC	29,893	85.990	2,570,499.070	
FREEPORT MCMORAN INC	20,550	68.410	1,405,825.500	
INSULET CORP	989	149.700	148,053.300	
US BANCORP	22,220	58.940	1,309,646.800	
UNITED RENTALS INC	916	1,074.240	984,003.840	
F5 INC	839	396.160	332,378.240	
SUPER MICRO COMPUTER INC	7,300	30.460	222,358.000	
PINNACLE FINANCIAL PARTNERS INC	2,300	96.360	221,628.000	
FASTENAL	16,484	46.570	767,659.880	
FISERV INC	7,603	53.780	408,889.340	

GE AEROSPACE	14,952	335.300	5,013,405.600	
AXON ENTERPRISE INC	1,120	441.730	494,737.600	
INSMED INC	3,000	97.850	293,550.000	
GENERAL MOTORS	12,942	81.500	1,054,773.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	3,302	360.220	1,189,446.440	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	4,249	1,062.750	4,515,624.750	
ALPHABET INC CLASS A	83,228	359.680	29,935,447.040	
ALPHABET INC CLASS C	65,860	358.160	23,588,417.600	
GENERAL MILLS INC	7,535	34.510	260,032.850	
FIRSTENERGY CORP	7,803	47.030	366,975.090	
GENUINE PARTS	1,954	103.750	202,727.500	
FIFTH THIRD BANCORP	13,020	54.730	712,584.600	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,673	307.790	822,722.670	
HALLIBURTON	11,833	39.600	468,586.800	
HOME DEPOT INC	14,254	328.390	4,680,871.060	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	28,548	17.520	500,160.960	
HERSHEY FOODS	2,115	181.660	384,210.900	
HUMANA INC	1,788	379.220	678,045.360	
NXP SEMICONDUCTORS NV	3,609	304.860	1,100,239.740	
HP INC	12,905	25.240	325,722.200	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	18,838	48.170	907,426.460	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	4,963	91.660	454,908.580	
KRAFT HEINZ	12,498	24.390	304,826.220	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CO	13,413	272.240	3,651,555.120	
HUBBELL INC	779	476.890	371,497.310	
INTERNATIONAL PAPER	7,424	36.150	268,377.600	
ZOETIS INC CLASS A	5,998	79.570	477,260.860	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	3,192	458.250	1,462,734.000	
CHENIERE ENERGY INC	2,938	241.280	708,880.640	
HYATT HOTELS CORP CLASS A	600	199.360	119,616.000	
ALLEGION PLC	1,242	133.970	166,390.740	
WASTE CONNECTIONS INC	3,742	156.110	584,163.620	
JOHNSON & JOHNSON	34,494	240.870	8,308,569.780	
FABRINET	560	611.010	342,165.600	
NEBIUS NV CLASS A	2,900	232.360	673,844.000	
ABBVIE INC	25,359	227.730	5,775,005.070	
KIMBERLY CLARK CORP	4,677	102.290	478,410.330	
KROGER	7,892	64.710	510,691.320	

KLA CORP	18,780	254.540	4,780,261.200	
LOCKHEED MARTIN CORP	2,981	540.330	1,610,723.730	
CORPAY INC	920	356.110	327,621.200	
LOWES COMPANIES INC	8,033	220.780	1,773,525.740	
ELI LILLY	11,485	1,133.000	13,012,505.000	
LAM RESEARCH CORP	17,890	366.810	6,562,230.900	
MASTEC INC	960	362.970	348,451.200	
LOEWS CORP	2,428	108.120	262,515.360	
MCDONALDS CORP	10,189	284.810	2,901,929.090	
3M	7,608	158.320	1,204,498.560	
META PLATFORMS INC CLASS A	31,447	566.980	17,829,820.060	
S&P GLOBAL INC	4,326	418.910	1,812,204.660	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	875	577.330	505,163.750	
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	1,500	93.770	140,655.000	
PHILLIPS 66	5,733	179.450	1,028,786.850	
ATLASSIAN CORP CLASS A	2,389	88.520	211,474.280	
TECHNIPFMC PLC	6,200	70.790	438,898.000	
MCCORMICK & CO NON-VOTING INC	3,788	48.950	185,422.600	
METLIFE INC	7,921	88.840	703,701.640	
MARVELL TECHNOLOGY INC	12,268	279.700	3,431,359.600	
ARISTA NETWORKS INC	15,340	163.240	2,504,101.600	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,381	412.250	981,567.250	
METTLER TOLEDO INC	292	1,131.490	330,395.080	
BAKER HUGHES CLASS A	14,217	63.140	897,661.380	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,620	459.340	744,130.800	
MERCK & CO INC	35,371	119.050	4,210,917.550	
DUPONT DE NEMOURS INC	5,919	48.260	285,650.940	
MASCO CORP	2,887	74.030	213,724.610	
M&T BANK CORP	2,143	231.880	496,918.840	
MARSH INC	6,954	168.680	1,173,000.720	
HEICO CORP CLASS A	1,147	247.090	283,412.230	
MARRIOTT INTERNATIONAL INC CLASS A	3,149	402.540	1,267,598.460	
WORKDAY INC CLASS A	3,000	130.800	392,400.000	
BLOCK INC CLASS A	7,370	69.520	512,362.400	
TRANSUNION	2,757	66.130	182,320.410	
VISTRA CORP	4,857	148.020	718,933.140	
NETAPP INC	2,897	161.610	468,184.170	

NIKE INC CLASS B	17,153	44.930	770,684.290	
NORFOLK SOUTHERN CORP	3,219	313.910	1,010,476.290	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	7,672	95.240	730,681.280	
RAYMOND JAMES INC	2,596	154.400	400,822.400	
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,933	550.330	1,063,787.890	
NEWMONT	15,404	100.230	1,543,942.920	
MCKESSON CORP	1,756	784.050	1,376,791.800	
XYLEM INC	3,466	110.080	381,537.280	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	22,345	184.300	4,118,183.500	
NUCOR CORP	3,179	266.350	846,726.650	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	2,260	482.000	1,089,320.000	
LUMENTUM HOLDINGS INC	1,060	921.560	976,853.600	
EVERGY INC	3,423	83.850	287,018.550	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	10,424	56.540	589,372.960	
ERIE INDEMNITY CLASS A	449	226.670	101,774.830	
OKTA INC CLASS A	2,395	116.290	278,514.550	
KKR AND CO INC	8,854	96.240	852,108.960	
PAYCHEX INC	4,623	100.630	465,212.490	
O REILLY AUTOMOTIVE INC	11,885	91.020	1,081,772.700	
ALTRIA GROUP INC	23,902	71.940	1,719,509.880	
PG&E CORP	30,948	16.950	524,568.600	
PFIZER INC	81,311	26.210	2,131,161.310	
CIGNA	3,753	298.000	1,118,394.000	
DELL TECHNOLOGIES INC CLASS C	4,376	395.570	1,731,014.320	
XCEL ENERGY INC	9,020	79.220	714,564.400	
STERIS	1,493	207.560	309,887.080	
SEA ADS REPRESENTING LTD CLASS A	5,947	82.940	493,244.180	
FOX CORP CLASS B	2,130	58.920	125,499.600	
FOX CORP CLASS A	2,895	65.850	190,635.750	
STRYKER CORP	4,886	312.200	1,525,409.200	
DOW INC	10,060	33.850	340,531.000	
TRADEWEB MARKETS INC CLASS A	1,767	101.190	178,802.730	
ZOOM COMMUNICATIONS INC CLASS A	3,413	93.680	319,729.840	
PARKER-HANNIFIN CORP	1,826	903.480	1,649,754.480	
UBER TECHNOLOGIES INC	25,324	68.850	1,743,557.400	
PROCTER & GAMBLE	33,248	149.610	4,974,233.280	

EXELON CORP	14,653	46.210	677,115.130	
INGERSOLL RAND INC	5,626	74.000	416,324.000	
NVR INC	39	6,374.930	248,622.270	
CONOCOPHILLIPS	17,402	116.980	2,035,685.960	
TWILIO INC CLASS A	2,053	204.080	418,976.240	
EVERPURE INC CLASS A	4,500	72.310	325,395.000	
PEPSICO INC	19,550	144.270	2,820,478.500	
MONGODB INC CLASS A	1,136	342.800	389,420.800	
CORTEVA INC	9,549	76.140	727,060.860	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,996	108.500	542,066.000	
AMCOR PLC	6,569	40.600	266,701.400	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC CLASS A	3,541	682.800	2,417,794.800	
AMERICAN WATER WORKS INC	2,790	126.310	352,404.900	
ACCENTURE PLC CLASS A	8,798	170.280	1,498,123.440	
PENTAIR PLC	2,322	73.800	171,363.600	
QUALCOMM INC	15,351	211.720	3,250,113.720	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC	3,095	111.115	343,900.920	
DATADOG INC CLASS A	4,490	229.900	1,032,251.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS INC	1,522	612.140	931,677.080	
REPUBLIC SERVICES INC	2,918	209.910	612,517.380	
BOOKING HOLDINGS INC	11,180	164.940	1,844,029.200	
ROSS STORES INC	4,501	240.130	1,080,825.130	
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,298	228.230	296,242.540	
RESMED INC	2,177	194.780	424,036.060	
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,627	203.060	330,378.620	
CARRIER GLOBAL CORP	10,728	69.910	749,994.480	
OTIS WORLDWIDE CORP	5,559	70.750	393,299.250	
CARLYLE GROUP INC	3,573	45.750	163,464.750	
REGIONS FINANCIAL CORP	12,397	29.270	362,860.190	
ROYALTY PHARMA PLC CLASS A	5,730	54.870	314,405.100	
CHEVRON CORP	26,381	187.220	4,939,050.820	
ZSCALER INC	1,518	129.520	196,611.360	
EDISON INTERNATIONAL	5,411	72.950	394,732.450	
TESLA INC	40,226	406.430	16,349,053.180	
BLOOM ENERGY CLASS A CORP	4,000	260.220	1,040,880.000	
SNOWFLAKE INC	4,756	232.780	1,107,101.680	
GEN DIGITAL INC	7,805	24.320	189,817.600	
SYNOPSYS INC	2,619	453.890	1,188,737.910	

CARVANA CLASS A	9,180	64.100	588,438.000	
CLOUDFLARE INC CLASS A	4,452	228.480	1,017,192.960	
CHARTER COMMUNICATIONS INC CLASS A	1,196	145.820	174,400.720	
DOORDASH INC CLASS A	5,278	150.580	794,761.240	
ROBLOX CORP CLASS A	8,370	43.310	362,504.700	
AIRBNB INC CLASS A	6,097	132.280	806,511.160	
CBRE GROUP INC CLASS A	4,273	133.410	570,060.930	
SOUTHERN	16,174	94.000	1,520,356.000	
SYSCO CORP	6,774	79.190	536,433.060	
TRAVELERS COMPANIES INC	3,041	304.460	925,862.860	
FUTU HOLDINGS ADR LTD	900	97.540	87,786.000	
REVOLUTION MEDICINES INC	2,400	153.870	369,288.000	
STEEL DYNAMICS INC	2,027	282.760	573,154.520	
SLB NV	21,464	56.180	1,205,847.520	
AFFIRM HOLDINGS INC CLASS A	3,900	66.170	258,063.000	
AT&T INC	99,723	23.580	2,351,468.340	
ON SEMICONDUCTOR CORP	5,683	116.790	663,717.570	
SHERWIN WILLIAMS	3,389	317.300	1,075,329.700	
SEMPRA	9,378	92.290	865,495.620	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC CLASS A	31,048	127.990	3,973,833.520	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	3,158	931.040	2,940,224.320	
COINBASE GLOBAL INC CLASS A	3,064	159.780	489,565.920	
TEXAS INSTRUMENT INC	13,028	301.120	3,922,991.360	
SALESFORCE INC	11,274	165.890	1,870,243.860	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	5,986	133.880	801,405.680	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	8,792	144.960	1,274,488.320	
TERADYNE INC	2,266	403.200	913,651.200	
UNION PACIFIC CORP	8,509	272.700	2,320,404.300	
MARATHON PETROLEUM CORP	4,250	263.580	1,120,215.000	
RTX CORP	19,271	183.530	3,536,806.630	
UNITED PARCEL SERVICE INC CLASS B	10,724	108.100	1,159,264.400	
IQVIA HOLDINGS INC	2,453	181.460	445,121.380	
AMEREN CORP	4,019	109.000	438,071.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	13,009	408.520	5,314,436.680	

APPLOVIN CORP CLASS A	3,300	496.770	1,639,341.000	
TOAST INC CLASS A	6,872	24.820	170,563.040	
VERISIGN INC	1,196	279.890	334,748.440	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A	11,797	16.760	197,717.720	
ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A	10,800	93.190	1,006,452.000	
VALERO ENERGY CORP	4,288	258.670	1,109,176.960	
SOFI TECHNOLOGIES INC	18,000	16.580	298,440.000	
ULTA BEAUTY INC	653	467.740	305,434.220	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC	3,608	47.920	172,895.360	
ELEVANCE HEALTH INC	3,156	404.070	1,275,244.920	
WALT DISNEY	25,375	100.040	2,538,515.000	
WELLS FARGO	43,805	83.730	3,667,792.650	
WASTE MANAGEMENT INC	5,844	219.450	1,282,465.800	
WILLIAMS INC	17,502	72.080	1,261,544.160	
TRACTOR SUPPLY	7,490	31.250	234,062.500	
WALMART INC	62,767	121.040	7,597,317.680	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,839	88.570	251,450.230	
GRAB HOLDINGS LTD CLASS A	35,300	3.300	116,490.000	
WESTINGHOUSE AIR BRAKE TECHNOLOGIE	2,469	265.200	654,778.800	
TJX INC	15,865	168.410	2,671,824.650	
WATERS CORP	1,423	355.530	505,919.190	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	1,200	115.520	138,624.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,374	262.630	360,853.620	
WILLIAMS SONOMA INC	1,700	223.540	380,018.000	
WESTERN DIGITAL CORP	4,964	562.925	2,794,359.700	
WEC ENERGY GROUP INC	4,620	113.440	524,092.800	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP IN	7,086	79.700	564,754.200	
VISA INC CLASS A	24,040	322.390	7,750,255.600	
PPL CORP	10,476	35.850	375,564.600	
CONSTELLATION ENERGY CORP	4,380	253.760	1,111,468.800	
PULTEGROUP INC	2,762	123.170	340,195.540	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	33,748	26.980	910,521.040	
PPG INDUSTRIES INC	3,158	119.340	376,875.720	
NORTHERN TRUST CORP	2,567	174.340	447,530.780	
NVIDIA CORP	330,210	205.190	67,755,789.900	

PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC	5,763	237.660	1,369,634.580	
TYSON FOODS INC CLASS A	4,033	57.430	231,615.190	
NETFLIX INC	60,200	80.340	4,836,468.000	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	5,317	469.340	2,495,480.780	
NRG ENERGY INC	2,911	125.470	365,243.170	
TEXTRON INC	2,488	92.820	230,936.160	
NEWS CORP CLASS A	5,349	25.680	137,362.320	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	851	378.910	322,452.410	
OMNICOM GROUP INC	4,111	76.680	315,231.480	
JACOBS SOLUTIONS INC	1,745	127.000	221,615.000	
ORACLE CORP	24,760	184.130	4,559,058.800	
MASTERCARD INC CLASS A	11,698	489.980	5,731,786.040	
ONEOK INC	8,925	90.590	808,515.750	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,506	334.970	504,464.820	
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	3,028	134.900	408,477.200	
EXPAND ENERGY CORP	3,413	88.780	303,006.140	
YUM BRANDS INC	4,018	154.310	620,017.580	
TAKE TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	2,574	211.750	545,044.500	
BANK OF AMERICA CORP	97,049	56.020	5,436,684.980	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	684	626.020	428,197.680	
AMERICAN EXPRESS	7,588	325.440	2,469,438.720	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	6,447	65.180	420,215.460	
LINDE PLC	6,617	523.570	3,464,462.690	
ANALOG DEVICES INC	6,980	417.790	2,916,174.200	
ADVANCED MICRO DEVICES INC	23,327	511.570	11,933,393.390	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	3,400	28.740	97,716.000	
NATERA INC	2,000	212.070	424,140.000	
LIBERTY MEDIA FORMULA ONE SERIES C	3,169	88.930	281,819.170	
KENVUE INC	26,996	18.140	489,707.440	
VERALTO CORP	3,532	83.360	294,427.520	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC	7,628	75.740	577,744.720	
BUNGE GLOBAL SA	1,784	127.170	226,871.280	
VERTIV HOLDINGS CLASS A	5,220	302.870	1,580,981.400	
ROYAL CARIBBEAN GROUP LTD	3,643	294.380	1,072,426.340	

AVERY DENNISON CORP	1,170	159.250	186,322.500	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS COR	6,882	52.170	359,033.940	
EMERSON ELECTRIC	8,070	143.070	1,154,574.900	
AON PLC	2,921	335.310	979,440.510	
AMGEN INC	7,724	355.200	2,743,564.800	
SAMSARA INC CLASS A	5,200	33.660	175,032.000	
IREN LTD	4,900	59.770	292,873.000	
TAPESTRY INC	2,900	147.420	427,518.000	
EATON PLC	5,556	391.390	2,174,562.840	
COOPER INC	2,992	67.880	203,096.960	
CONSTELLATION BRANDS INC CLASS A	2,051	148.510	304,594.010	
APPLIED MATERIAL INC	11,358	567.250	6,442,825.500	
CME GROUP INC CLASS A	5,217	269.530	1,406,138.010	
ECOLAB INC	3,664	265.410	972,462.240	
EQUIFAX INC	1,776	163.710	290,748.960	
GILEAD SCIENCES INC	17,793	125.590	2,234,622.870	
KEURIG DR PEPPER INC	18,146	31.710	575,409.660	
STATE STREET CORP	4,052	167.630	679,236.760	
ECHOSTAR CORP CLASS A	2,000	114.080	228,160.000	
GE VERNOVA INC	3,863	940.660	3,633,769.580	
CHARLES SCHWAB CORP	23,596	91.100	2,149,595.600	
COHERENT CORP	2,720	385.030	1,047,281.600	
CRH PUBLIC LIMITED PLC	9,500	106.480	1,011,560.000	
LABCORP HOLDINGS INC	1,231	266.160	327,642.960	
SMURFIT WESTROCK PLC	7,440	43.320	322,300.800	
SHARKNINJA INC	1,400	133.800	187,320.000	
FERGUSON ENTERPRISES INC	2,871	230.080	660,559.680	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,060	110.650	227,939.000	
REDDIT INC CLASS A	1,700	162.100	275,570.000	
TE CONNECTIVITY PLC	4,211	210.380	885,910.180	
BLACKROCK INC	2,142	1,032.000	2,210,544.000	
ASTERA LABS INC	2,000	367.150	734,300.000	
ROCKET COMPANIES INC CLASS A	12,800	13.070	167,296.000	
CARDINAL HEALTH INC	3,373	223.850	755,046.050	
APTIV PLC	3,076	68.050	209,321.800	
FTAI AVIATION LTD	1,500	241.960	362,940.000	
FEDEX CORP	3,122	338.310	1,056,203.820	

CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	8,602	184.730	1,589,047.460	
FLEX LTD	5,300	149.710	793,463.000	
ROCKET LAB CORP	7,500	102.390	767,925.000	
CIRCLE INTERNET GROUP INC CLASS A	2,300	77.840	179,032.000	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES	3,594	78.270	281,302.380	
CREDO TECHNOLOGY GROUP HOLDING LTD	2,400	250.810	601,944.000	
INTEL CORPORATION	62,741	124.570	7,815,646.370	
COREWEAVE INC CLASS A	4,000	100.550	402,200.000	
QNITY ELECTRONICS INC	3,059	150.650	460,838.350	
IONQ INC	4,900	57.850	283,465.000	
AMRIZE AG	7,000	53.170	372,190.000	
HARTFORD INSURANCE GROUP INC	3,928	129.620	509,147.360	
ILLINOIS TOOL INC	3,903	257.430	1,004,749.290	
MEDLINE INC CLASS A	5,700	36.610	208,677.000	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	2,066	166.450	343,885.700	
ILLUMINA INC	2,193	160.970	353,007.210	
INTUITIVE SURGICAL INC	5,096	411.060	2,094,761.760	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	1,239	124.060	153,710.340	
SNAP ON INC	763	387.480	295,647.240	
CIENA CORP	2,020	445.980	900,879.600	
DUKE ENERGY CORP	11,207	124.970	1,400,538.790	
TARGET CORP	6,569	135.230	888,325.870	
DOVER CORP	1,984	217.430	431,381.120	
WW GRAINGER INC	626	1,315.870	823,734.620	
JABIL INC	1,520	384.820	584,926.400	
CINTAS CORP	4,896	176.280	863,066.880	
CLOROX	1,727	96.820	167,208.140	
ENTERGY CORP	6,646	111.110	738,437.060	
MICROSOFT CORP	100,836	390.740	39,400,658.640	
INCYTE CORP	2,369	108.530	257,107.570	
CVS HEALTH CORP	18,264	101.960	1,862,197.440	
MEDTRONIC PLC	18,389	80.200	1,474,797.800	
MICRON TECHNOLOGY INC	16,126	981.610	15,829,442.860	
CENTERPOINT ENERGY INC	9,272	42.900	397,768.800	

	KEYCORP	13,065	22.700	296,575.500	
	MONDELEZ INTERNATIONAL INC CLASS A	18,205	62.990	1,146,732.950	
	CHUBB	4,998	328.140	1,640,043.720	
	ALLSTATE CORP	3,764	221.630	834,215.320	
	EBAY INC	6,102	108.610	662,738.220	
	PAYPAL HOLDINGS INC	12,210	41.530	507,081.300	
	ESTEE LAUDER INC CLASS A	3,531	89.680	316,660.080	
	TRIMBLE INC	3,599	50.420	181,461.580	
	LENNAR A CORP CLASS A	2,958	90.300	267,107.400	
	AST SPACEMOBILE INC CLASS A	3,500	82.410	288,435.000	
	COMPASS GROUP PLC	23,810	34.180	813,825.800	
	PROGRESSIVE CORP	8,396	203.110	1,705,311.560	
	PACCAR INC	7,617	118.520	902,766.840	
	BIOGEN INC	2,119	200.050	423,905.950	
	IDEXX LABORATORIES INC	1,158	560.880	649,499.040	
	STARBUCKS CORP	16,362	103.040	1,685,940.480	
	PTC INC	1,784	113.680	202,805.120	
	EVERSOURCE ENERGY	5,318	68.690	365,293.420	
	INTUIT INC	3,920	276.730	1,084,781.600	
	BEST BUY INC	2,816	78.530	221,140.480	
	BALL CORP	3,850	56.980	219,373.000	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	21,274	46.910	997,963.340	
	ELECTRONIC ARTS INC	3,280	203.270	666,725.600	
	VULCAN MATERIALS	1,856	286.470	531,688.320	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3,664	444.925	1,630,205.200	
	CARNIVAL CORP LTD	17,974	29.180	524,481.320	
	COEUR MINING INC	15,000	17.200	258,000.000	
	COMCAST CORP CLASS A	51,135	24.500	1,252,807.500	
	FEDEX FREIGHT HOLDING COMPANY INC	1,561	174.760	272,800.360	
	JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	2,500	63.250	158,125.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	16,000	7.330	117,280.000	
アメリカ・ドル 小計				904,257,159.280 (144,843,911,773)	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	79,603	32.205	2,563,614.610	
	AIRTEL AFRICA PLC	10,612	3.710	39,370.520	
	HALEON PLC	124,444	3.368	419,127.390	

WISE PLC CLASS A	9,413	8.040	75,680.520	
SUNBELT RENTALS HOLDINGS INC	5,772	62.240	359,249.280	
BP PLC	222,027	5.345	1,186,734.310	
UNILEVER PLC	30,914	43.860	1,355,888.040	
BARCLAYS PLC	193,478	4.728	914,860.720	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	118,799	13.080	1,553,890.920	
MARKS AND SPENCER GROUP PLC	28,299	3.763	106,489.130	
PRUDENTIAL PLC	35,544	9.812	348,757.720	
NATWEST GROUP PLC	111,737	6.142	686,288.650	
BAE SYSTEMS PLC	41,363	19.110	790,446.930	
AVIVA PLC	42,704	6.278	268,095.710	
GLAXOSMITHKLINE	56,924	19.840	1,129,372.160	
INFORMA PLC	17,882	8.162	145,952.880	
MELROSE INDUSTRIES PLC	18,157	4.625	83,976.120	
SPIRAX GROUP PLC	1,098	68.100	74,773.800	
HALMA PLC	5,339	38.980	208,114.220	
STANDARD LIFE PLC	9,871	7.910	78,079.610	
M&G PLC	31,263	3.216	100,541.800	
ENDEAVOUR MINING	3,044	38.300	116,585.200	
RELX PLC	25,410	24.920	633,217.200	
DIAGEO PLC	31,112	15.145	471,191.240	
RIO TINTO PLC	15,023	78.140	1,173,897.220	
STANDARD CHARTERED PLC	25,022	19.280	482,424.160	
TESCO PLC	89,250	4.730	422,152.500	
FRESNILLO PLC	2,569	30.020	77,121.380	
SMITH AND NEPHEW PLC	11,184	11.330	126,714.720	
GLENCORE PLC	132,113	5.889	778,013.450	
SMITHS GROUP PLC	4,266	25.230	107,631.180	
PEARSON PLC	6,539	11.470	75,002.330	
SAINSBURY(J) PLC	25,605	3.138	80,348.490	
NEXT PLC	1,668	144.250	240,609.000	
BUNZL	4,444	25.380	112,788.720	
VODAFONE GROUP PLC	259,990	1.157	300,938.420	
KINGFISHER PLC	24,703	2.883	71,218.740	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	11,079	13.140	145,578.060	
SEVERN TRENT PLC	3,938	29.260	115,225.880	
RENTOKIL INITIAL PLC	35,703	4.536	161,948.800	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	8,967	46.380	415,889.460	
SCHRODERS PLC	10,596	5.830	61,774.680	

	SSE PLC	16,897	24.000	405,528.000	
	ASTRAZENECA PLC	21,342	134.620	2,873,060.040	
	LEGAL AND GENERAL GROUP PLC	73,555	2.807	206,468.880	
	3I GROUP PLC	13,928	23.090	321,597.520	
	THE SAGE GROUP PLC	12,954	8.184	106,015.530	
	NATIONAL GRID PLC	70,352	12.090	850,555.680	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	822,863	1.023	842,200.280	
	IMPERIAL BRANDS PLC	10,568	27.970	295,586.960	
	CENTRICA PLC	64,634	1.858	120,089.970	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO	28,211	46.310	1,306,451.410	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	3,950	19.460	76,867.000	
	HSBC HOLDINGS PLC	243,058	13.728	3,336,700.220	
	ANGLO AMERICAN PLC	14,931	40.020	597,538.620	
	BT GROUP PLC	83,622	2.095	175,188.090	
	COCA COLA HBC AG	2,794	45.860	128,132.840	
	INTERTEK GROUP PLC	2,128	56.600	120,444.800	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	6,392	90.100	575,919.200	
	ADMIRAL GROUP PLC	3,740	34.640	129,553.600	
	ANTOFAGASTA PLC	4,831	40.440	195,365.640	
	EXPERIAN PLC	12,804	25.690	328,934.760	
イギリス・ポンド 小計				31,651,774.910 (6,819,691,421)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	17,851	29.930	534,280.430	
	AZRIELI GROUP LTD	634	439.400	278,579.600	
	PHOENIX FINANCIAL LTD	3,415	175.000	597,625.000	
	ENLIGHT RENEWABLE ENERGY LTD	2,130	278.700	593,631.000	
	HAREL INSURANCE INVESTMENTS & FINA	1,810	170.000	307,700.000	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	1,667	764.400	1,274,254.800	
	NOVA LTD	470	1,665.000	782,550.000	
	OPC ENERGY LTD	2,610	106.000	276,660.000	
	ICL GROUP LTD	10,646	16.500	175,659.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	425	2,575.000	1,094,375.000	
	BANK HAPOALIM BM	20,039	70.690	1,416,556.910	
	BANK LEUMI LE ISRAEL	22,597	68.290	1,543,149.130	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	2,264	206.000	466,384.000	
イスラエル・シュケル 小計				9,341,404.870 (512,449,854)	

オーストラリア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	32,740	5.680	185,963.200	
	TELSTRA GROUP LTD	54,432	5.200	283,046.400	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	41,653	34.170	1,423,283.010	
	SGH LTD	2,833	41.510	117,597.830	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & COMP	4,624	44.360	205,120.640	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	40,516	4.970	201,364.520	
	BHP GROUP LTD	71,042	62.930	4,470,673.060	
	SOUTH32 LTD	62,620	4.520	283,042.400	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	26,246	31.230	819,662.580	
	FORTESCUE LTD	22,497	20.210	454,664.370	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	42,889	36.500	1,565,448.500	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	47,817	35.000	1,673,595.000	
	SANTOS LTD	45,733	8.070	369,065.310	
	RIO TINTO LTD	5,147	184.320	948,695.040	
	ORIGIN ENERGY LTD	24,239	11.090	268,810.510	
	PLS GROUP LTD	48,040	6.520	313,220.800	
	XERO LTD	2,244	73.500	164,934.000	
	PRO MEDICUS LTD	812	164.000	133,168.000	
	COLES GROUP LTD	18,568	24.010	445,817.680	
	WISETECH GLOBAL LTD	2,603	37.500	97,612.500	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	18,732	19.260	360,778.320	
	EVOLUTION MINING LTD	28,062	11.750	329,728.500	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	23,397	159.510	3,732,055.470	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	20,764	24.060	499,581.840	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	16,915	38.330	648,351.950	
	QANTAS AIRWAYS LTD	11,139	9.350	104,149.650	
	MACQUARIE GROUP LTD DEF	5,005	242.440	1,213,412.200	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	7,622	53.910	410,902.020	
	CSL LTD	6,713	107.510	721,714.630	
	WESFARMERS LTD	15,734	86.470	1,360,518.980	
	COCHLEAR LTD	905	103.750	93,893.750	
	SUNCORP GROUP LTD	14,965	18.730	280,294.450	
	ASX LTD	2,592	49.200	127,526.400	
	COMPUTERSHARE LTD	7,645	36.850	281,718.250	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	30,842	8.000	246,736.000	
	SONIC HEALTHCARE LTD	6,925	20.200	139,885.000	

	BRAMBLES LTD	18,802	19.010	357,426.020	
	LYNAS RARE EARTHS LTD	12,774	17.770	226,993.980	
	CAR GROUP LTD	5,460	26.370	143,980.200	
	SIGMA HEALTHCARE LTD	72,681	2.640	191,877.840	
	REA GROUP LTD	733	143.000	104,819.000	
オーストラリア・ドル 小計				26,001,129.800 (2,945,407,984)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	9,913	84.310	835,765.030	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	4,676	65.940	308,335.440	
	BROOKFIELD RENEWABLE SUBORDINATE V	2,032	50.980	103,591.360	
	CELESTICA INC	1,700	550.220	935,374.000	
	BOMBARDIER INC CLASS B	1,300	310.490	403,637.000	
	ATKINSREALIS GROUP INC	2,400	82.210	197,304.000	
	IMPERIAL OIL LTD	2,095	169.770	355,668.150	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	361	2,924.000	1,055,564.000	
	RESTAURANTS BRANDS INTERNATIONAL I	4,704	104.840	493,167.360	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	6,569	162.320	1,066,280.080	
	INTACT FINANCIAL CORP	2,631	277.880	731,102.280	
	BCE INC	4,768	34.370	163,876.160	
	FRANCO NEVADA CORP	2,856	293.330	837,750.480	
	SUNCOR ENERGY INC	17,087	86.010	1,469,652.870	
	METRO INC	2,750	93.210	256,327.500	
	NATIONAL BANK OF CANADA	5,589	209.800	1,172,572.200	
	BANK OF NOVA SCOTIA	17,803	117.430	2,090,606.290	
	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	13,180	158.710	2,091,797.800	
	TORONTO DOMINION	24,037	164.010	3,942,308.370	
	GREAT WEST LIFECO INC	3,635	83.390	303,122.650	
	ROYAL BANK OF CANADA	20,190	278.930	5,631,596.700	
	TOURMALINE OIL CORP	5,256	63.200	332,179.200	
	TC ENERGY CORP	15,054	97.040	1,460,840.160	
	PEMBINA PIPELINE CORP	8,294	67.590	560,591.460	
	BARRICK MINING CORP	24,052	56.250	1,352,925.000	
	CAE INC	4,452	35.390	157,556.280	
	THOMSON REUTERS CORP	1,964	114.090	224,072.760	
	EMPIRE LTD CLASS A	1,800	49.330	88,794.000	

CCL INDUSTRIES INC CLASS B	2,160	83.940	181,310.400	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	5,800	26.570	154,106.000	
HYDRO ONE LTD	4,766	56.690	270,184.540	
LOBLAW COMPANIES LTD	8,044	65.000	522,860.000	
STANTEC INC	1,700	101.090	171,853.000	
WSP GLOBAL INC	1,957	182.950	358,033.150	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	1,274	209.490	266,890.260	
EMERA INC	4,324	73.500	317,814.000	
TFI INTERNATIONAL INC	1,224	224.370	274,628.880	
CANADIAN UTILITIES LTD CLASS A	1,993	51.740	103,117.820	
WHITECAP RESOURCES INC	17,300	16.340	282,682.000	
ROGERS COMMUNICATIONS NON-VOTING I	5,243	53.920	282,702.560	
IVANHOE MINES LTD CLASS A	10,202	11.780	120,179.560	
AGNICO EAGLE MINES LTD	7,283	227.410	1,656,227.030	
ALAMOS GOLD INC CLASS A	6,000	49.190	295,140.000	
KINROSS GOLD CORP	17,157	35.760	613,534.320	
BANK OF MONTREAL	9,935	235.250	2,337,208.750	
POWER CORPORATION OF CANADA	7,872	86.620	681,872.640	
LUNDIN GOLD INC	1,400	76.810	107,534.000	
SHOPIFY SUBORDINATE VOTING INC CLA	17,761	151.470	2,690,258.670	
NUTRIEN LTD	6,874	94.610	650,349.140	
CAMECO CORP	6,202	141.030	874,668.060	
FIRSTSERVICE SUBORDINATE VOTING CO	622	200.250	124,555.500	
GFL ENVIRONMENTAL SUBORDINATE VOTI	3,482	50.300	175,144.600	
TELUS	600	16.640	9,984.000	
EQUINOX GOLD CORP	11,500	14.740	169,510.000	
LUNR ROYALTIES CORP	294	23.700	6,967.800	
TECK RESOURCES SUBORDINATE VOTING	6,674	90.610	604,731.140	
CANADIAN TIRE LTD CLASS A	723	186.770	135,034.710	
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	30,118	63.400	1,909,481.200	
FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS SUB VOT	274	2,263.690	620,251.060	
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,847	93.210	358,578.870	

	GEORGE WESTON LTD	2,200	104.010	228,822.000	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	6,023	67.400	405,950.200	
	DESCARTES SYSTEMS GROUP INC	1,300	102.020	132,626.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	7,920	107.040	847,756.800	
	ENBRIDGE INC	31,508	78.980	2,488,501.840	
	BROOKFIELD CORP CLASS A	28,863	63.200	1,824,141.600	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	24,267	56.320	1,366,717.440	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	12,926	125.880	1,627,124.880	
	IA FINANCIAL INC	1,209	178.830	216,205.470	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	2,564	85.130	218,273.320	
	CANADIAN NATIONAL RAILWAY	7,499	166.470	1,248,358.530	
	CGI INC CLASS A	2,806	93.200	261,519.200	
	IGM FINANCIAL INC	1,318	80.510	106,112.180	
	TMX GROUP LTD	3,990	50.480	201,415.200	
	SAPUTO INC	3,500	42.010	147,035.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	10,181	43.390	441,753.590	
	FORTIS INC	7,238	79.610	576,217.180	
	RB GLOBAL INC	2,696	150.530	405,828.880	
	LUNDIN MINING CORP	9,700	37.860	367,242.000	
	CENOVUS ENERGY	19,031	39.470	751,153.570	
	DOLLARAMA INC	3,934	190.940	751,157.960	
	ALTAGAS LTD	4,501	55.200	248,455.200	
	KEYERA CORP	3,370	59.010	198,863.700	
	ARC RESOURCES LTD	8,234	31.760	261,511.840	
カナダ・ドル 小計				61,272,495.820 (7,027,342,545)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	36,400	2.560	93,184.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	18,600	38.160	709,776.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	31,610	63.240	1,999,016.400	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	24,550	7.000	171,850.000	
	KEPPEL LTD	22,700	10.650	241,755.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING (HOLDINGS	40,200	3.450	138,690.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING LTD	50,200	23.500	1,179,700.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LTD	110,200	4.270	470,554.000	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	24,300	10.570	256,851.000	

	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	13,900	6.130	85,207.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	12,300	22.580	277,734.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	24,500	3.570	87,465.000	
シンガポール・ドル 小計				5,711,782.400 (714,087,035)	
スイス・フラン	SANDOZ GROUP AG	5,773	67.040	387,021.920	
	BELIMO N AG	135	875.000	118,125.000	
	GALDERMA GROUP N AG	2,577	172.150	443,630.550	
	ROCHE PS PAR AG	9,865	330.000	3,255,450.000	
	AVOLTA AG	1,251	50.400	63,050.400	
	UBS GROUP AG	44,535	38.900	1,732,411.500	
	ROCHE HOLDING AG	412	334.000	137,608.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG	89	698.500	62,166.500	
	SIKA AG	2,118	155.150	328,607.700	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SPRUENGL	2	94,300.000	188,600.000	
	ABB LTD	21,992	81.620	1,794,987.040	
	SWISS RE AG	4,142	120.750	500,146.500	
	NESTLE SA	36,157	79.810	2,885,690.170	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	297	697.800	207,246.600	
	SCHINDLER HOLDING PAR AG	590	262.600	154,934.000	
	JULIUS BAER GRUPPE AG	2,800	64.700	181,160.000	
	SGS SA	2,403	89.480	215,020.440	
	SCHINDLER HOLDING AG	272	251.000	68,272.000	
	HELVETIA BALOISE HOLDING N AG	1,055	204.200	215,431.000	
	VAT GROUP AG	377	663.400	250,101.800	
	BKW N AG	250	139.000	34,750.000	
	ALCON AG	6,855	53.160	364,411.800	
	THE SWATCH GROUP AG	427	209.300	89,371.100	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	2,104	563.800	1,186,235.200	
	NOVARTIS AG	25,608	122.080	3,126,224.640	
	BARRY CALLEBAUT AG	50	1,144.000	57,200.000	
	COMPAGNIE FINANCIERE RICHEMONT SA	7,543	178.900	1,349,442.700	
	SWISSCOM AG	359	656.500	235,683.500	
	BC VAUD N	447	118.900	53,148.300	
	GEBERIT AG	443	509.200	225,575.600	
	GIVAUDAN SA	126	3,182.000	400,932.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	1,569	93.620	146,889.780	

	SONOVA HOLDING AG	684	200.600	137,210.400	
	LOGITECH INTERNATIONAL SA	2,010	88.400	177,684.000	
	LONZA GROUP AG	987	490.300	483,926.100	
	HOLCIM LTD AG	7,154	74.560	533,402.240	
	SWISS LIFE HOLDING AG	388	857.000	332,516.000	
	KUEHNE UND NAGEL INTERNATIONAL AG	709	195.550	138,644.950	
	SWISS PRIME SITE AG	1,070	129.700	138,779.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SPRUENGL	13	9,190.000	119,470.000	
スイス・フラン 小計				22,521,158.430 (4,541,616,809)	
スウェーデン・クローナ	SAGAX CLASS B	3,411	159.200	543,031.200	
	OCTAVE INTELLIGENCE SDR PLC	3,075	173.400	533,205.000	
	ERICSSON CLASS B	40,419	116.600	4,712,855.400	
	VOLVO CLASS B	23,586	315.100	7,431,948.600	
	SKF CLASS B	5,300	237.900	1,260,870.000	
	TELE2 CLASS B	8,509	186.950	1,590,757.550	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN CLAS	22,420	188.900	4,235,138.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN CLASS A	21,656	138.350	2,996,107.600	
	SWEDBANK CLASS A	12,592	347.900	4,380,756.800	
	HENNES & MAURITZ CLASS B	6,470	171.250	1,107,987.500	
	SVENSKA CELLULOSA AKTIEBOLAGET SCA	9,450	100.050	945,472.500	
	SKANSKA CLASS B	5,284	240.200	1,269,216.800	
	SANDVIK	15,761	378.600	5,967,114.600	
	INVESTOR CLASS B	26,472	379.100	10,035,535.200	
	ATLAS COPCO CLASS A	38,504	185.950	7,159,818.800	
	SECURITAS CLASS B	7,645	157.100	1,201,029.500	
	TELIA COMPANY	36,651	51.680	1,894,123.680	
	ALFA LAVAL	4,500	530.800	2,388,600.000	
	ATLAS COPCO CLASS B	23,145	164.200	3,800,409.000	
	ASSA ABLOY CLASS B	14,867	332.400	4,941,790.800	
	TRELLEBORG CLASS B	3,153	407.200	1,283,901.600	
	SAAB CLASS B	4,972	521.600	2,593,395.200	
	INDUSTRIVARDEN CLASS A	1,710	517.000	884,070.000	
	FASTIGHETS BALDER CLASS B	11,089	51.420	570,196.380	
	INDUTRADE	4,243	188.900	801,502.700	

	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM	2,735	439.200	1,201,212.000	
	LUNDBERGFORETAGEN CLASS B	1,178	542.000	638,476.000	
	LATOUR INVESTMENT CLASS B	2,298	192.150	441,560.700	
	LIFCO CLASS B	3,626	307.800	1,116,082.800	
	NIBE INDUSTRIER CLASS B	23,543	36.290	854,375.470	
	BEIJER REF CLASS B	6,356	133.700	849,797.200	
	ESSITY CLASS B	8,747	265.100	2,318,829.700	
	BOLIDEN	4,417	533.600	2,356,911.200	
	EPIROC CLASS A	9,739	266.500	2,595,443.500	
	EPIROC CLASS B	6,063	227.600	1,379,938.800	
	EQT	6,613	287.500	1,901,237.500	
	EVOLUTION	1,873	726.200	1,360,172.600	
	HEXAGON CLASS B	30,757	79.000	2,429,803.000	
	ADDTECH CLASS B	4,038	321.800	1,299,428.400	
	INDUSTRIVARDEN CLASS C	2,430	501.200	1,217,916.000	
スウェーデン・クローナ 小計				96,490,019.280 (1,649,014,430)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK CLASS B	49,247	287.250	14,146,200.750	
	DANSKE BANK	9,575	339.400	3,249,755.000	
	A P MOLLER MAERSK CLASS A	35	17,250.000	603,750.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS	14,992	166.100	2,490,171.200	
	CARLSBERG CLASS B	1,359	844.000	1,146,996.000	
	NOVOZYMES CLASS B	5,471	387.000	2,117,277.000	
	COLOPLAST CLASS B	1,959	382.900	750,101.100	
	DSV	2,943	1,611.000	4,741,173.000	
	ROCKWOOL CLASS B	1,510	211.200	318,912.000	
	DEMANT	1,492	251.200	374,790.400	
	A P MOLLER MAERSK CLASS B	49	17,715.000	868,035.000	
	TRYG	4,679	151.100	706,996.900	
	PANDORA	1,233	643.800	793,805.400	
	GENMAB	947	1,619.000	1,533,193.000	
	OERSTED	7,070	156.300	1,105,041.000	
デンマーク・クローネ 小計				34,946,197.750 (868,762,477)	
ニュージーランド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	20,497	5.950	121,957.150	
	INFRATIL LTD	14,749	14.810	218,432.690	
	AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT LTD	26,329	8.230	216,687.670	

	CONTACT ENERGY LTD	13,812	9.550	131,904.600	
	FISHER AND PAYKEL HEALTHCARE CORPO	9,127	39.450	360,060.150	
ニュージーランド・ドル 小計				1,049,042.260 (98,263,789)	
ノルウェー・クローネ	DNB BANK	12,426	291.000	3,615,966.000	
	VAR ENERGI	14,320	47.020	673,326.400	
	NORSK HYDRO	19,667	109.800	2,159,436.600	
	ORKLA	10,886	99.750	1,085,878.500	
	TELENOR	9,568	151.600	1,450,508.800	
	EQUINOR	10,754	348.400	3,746,693.600	
	YARA INTERNATIONAL	2,571	470.100	1,208,627.100	
	MOWI	6,648	195.400	1,299,019.200	
	GJENSIDIGE FORSIKRING	3,106	258.600	803,211.600	
	AKER BP	4,908	343.400	1,685,407.200	
	KONGSBERG GRUPPEN	6,386	294.200	1,878,761.200	
	SALMAR	1,053	538.000	566,514.000	
ノルウェー・クローネ 小計				20,173,350.200 (340,526,152)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	14,098	17.760	250,380.480	
	DAIMLER TRUCK HOLDING E AG	6,333	41.840	264,972.720	
	EXOR NV	1,311	66.900	87,705.900	
	DR ING HC F PORSCHE PRF AG	1,527	49.100	74,975.700	
	DSM FIRMENICH AG	2,399	73.800	177,046.200	
	FERROVIAL NV	6,610	58.300	385,363.000	
	LOTUS BAKERIES NV	5	11,700.000	58,500.000	
	SYENSQO NV	902	66.400	59,892.800	
	CVC CAPITAL PARTNERS PLC	2,933	12.950	37,982.350	
	HENSOLDT AG	873	75.620	66,016.260	
	FINANCIERE DE TUBIZE SA	282	241.800	68,187.600	
	MAGNUM ICE CREAM NV	6,908	15.464	106,825.310	
	CSG CLASS A NV	2,034	14.488	29,468.590	
	VERISURE PLC	4,020	11.000	44,220.000	
	ABIVAX SA	820	85.050	69,741.000	
	BAYER AG	13,596	36.190	492,039.240	
	EVONIK INDUSTRIES AG	3,791	15.870	60,163.170	
	DEUTSCHE BANK AG	25,489	28.740	732,553.860	
	COMMERZBANK AG	9,007	36.830	331,727.810	
	VOLKSWAGEN NON-VOTING PREF AG	2,824	88.420	249,698.080	

SIEMENS N AG	10,410	264.500	2,753,445.000	
E.ON N	30,999	18.410	570,691.590	
BMW AG	3,916	67.000	262,372.000	
GEA GROUP AG	2,160	55.900	120,744.000	
CONTINENTAL AG	1,511	72.300	109,245.300	
BASF N	12,377	49.500	612,661.500	
ALLIANZ	5,342	386.400	2,064,148.800	
HENKEL & KGAA PREF AG	2,237	69.440	155,337.280	
RHEINMETALL AG	649	1,205.600	782,434.400	
RWE AG	8,019	57.460	460,771.740	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	8,607	8.446	72,694.720	
BRENNTAG	1,739	56.100	97,557.900	
FRESENIUS SE AND CO KGAA	5,795	37.670	218,297.650	
HOCHTIEF AG	219	485.400	106,302.600	
SAP	14,665	140.260	2,056,912.900	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESE	1,813	458.900	831,985.700	
ZALANDO	3,091	24.630	76,131.330	
HEIDELBERG MATERIALS AG	1,869	182.150	340,438.350	
RATIONAL AG	78	650.500	50,739.000	
CTS EVENTIM AG	887	50.450	44,749.150	
SARTORIUS PREF AG	359	231.200	83,000.800	
TALANX AG	824	101.200	83,388.800	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING PREF	2,057	30.840	63,437.880	
DELIVERY HERO	2,550	37.640	95,982.000	
NEMETSCHEK	794	56.300	44,702.200	
SCOUT24 N	1,040	74.450	77,428.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	4,975	34.630	172,284.250	
KNORR BREMSE AG	886	101.800	90,194.800	
SIEMENS ENERGY N AG	10,888	153.580	1,672,179.040	
BEIERSDORF AG	1,290	70.540	90,996.600	
MERCK	1,792	133.250	238,784.000	
ADIDAS N AG	2,261	176.350	398,727.350	
HENKEL AG	1,251	64.750	81,002.250	
DEUTSCHE TELEKOM N AG	47,917	28.320	1,357,009.440	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	2,639	39.670	104,689.130	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	9,989	48.015	479,621.830	
QIAGEN NV	2,798	31.980	89,480.040	

INFINEON TECHNOLOGIES AG	18,338	80.060	1,468,140.280	
HANNOVER RUECK	856	228.200	195,339.200	
DEUTSCHE POST AG	12,926	51.720	668,532.720	
DEUTSCHE BOERSE AG	2,557	249.500	637,971.500	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	765	312.000	238,680.000	
SYMRISE AG	1,956	82.200	160,783.200	
BMW PREF AG	733	67.250	49,294.250	
VONOVIA	10,511	20.390	214,319.290	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	10,604	22.810	241,877.240	
NN GROUP NV	3,657	73.280	267,984.960	
ARCELORMITTAL SA	5,924	60.600	358,994.400	
HEINEKEN NV	4,024	70.520	283,772.480	
AEGON LTD	18,115	7.294	132,130.810	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	12,260	36.370	445,896.200	
AKZO NOBEL NV	2,129	57.780	123,013.620	
WOLTERS KLUWER NV	3,213	61.100	196,314.300	
ING GROEP NV	41,013	25.960	1,064,697.480	
KONINKLIJKE KPN NV	52,893	4.456	235,691.200	
ASML HOLDING NV	5,452	1,629.600	8,884,579.200	
ABN AMRO BANK NV	8,714	34.670	302,114.380	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	969	317.000	307,173.000	
ASR NEDERLAND NV	2,307	65.440	150,970.080	
ADYEN NV	371	828.400	307,336.400	
PROSUS NV CLASS N	18,372	39.295	721,927.740	
INPOST SA	3,436	15.320	52,639.520	
ASM INTERNATIONAL NV	651	1,015.000	660,765.000	
HEINEKEN HOLDING NV	1,735	64.150	111,300.250	
TOTALENERGIES	27,647	76.380	2,111,677.860	
MICHELIN	8,640	33.140	286,329.600	
LAIR LIQUIDE SOCIETE ANONYME POUR	8,947	168.300	1,505,780.100	
KERING SA	992	268.350	266,203.200	
SCHNEIDER ELECTRIC	7,701	265.300	2,043,075.300	
BOUYGUES SA	3,154	50.300	158,646.200	
BNP PARIBAS SA	13,932	96.690	1,347,085.080	
THALES SA	1,307	234.700	306,752.900	
DANONE SA	8,988	67.180	603,813.840	
CARREFOUR SA	8,647	16.725	144,621.070	

LOREAL SA	3,374	390.250	1,316,703.500	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN SA	6,134	75.760	464,711.840	
LEGRAND SA	3,645	133.550	486,789.750	
PERNOD RICARD SA	2,814	63.440	178,520.160	
REXEL SA	3,113	36.420	113,375.460	
SOCIETE GENERALE SA	8,909	73.400	653,920.600	
LVMH	3,493	510.600	1,783,525.800	
ACCOR SA	2,614	47.390	123,877.460	
CAPGEMINI	2,132	96.720	206,207.040	
PUBLICIS GROUPE SA	3,154	89.660	282,787.640	
BUREAU VERITAS SA	4,678	25.460	119,101.880	
EIFFAGE SA	945	126.500	119,542.500	
SODEXO SA	1,085	50.400	54,684.000	
IPSEN SA	460	157.800	72,588.000	
AMUNDI SA	911	82.550	75,203.050	
EURONEXT NV	1,087	148.200	161,093.400	
EUROFINS SCIENTIFIC	1,741	64.080	111,563.280	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH SA	369	175.600	64,796.400	
ESSILORLUXOTTICA SA	4,230	182.700	772,821.000	
DASSAULT AVIATION SA	234	297.000	69,498.000	
AYVENS SA	5,226	11.760	61,457.760	
AXA SA	21,893	40.860	894,547.980	
RENAULT SA	2,649	27.770	73,562.730	
HERMES INTERNATIONAL	350	1,697.000	593,950.000	
STMICROELECTRONICS NV	8,819	67.750	597,487.250	
DASSAULT SYSTEMES	9,353	17.210	160,965.130	
ORANGE SA	25,694	17.835	458,252.490	
ALSTOM SA	4,483	16.190	72,579.770	
SANOFI SA	15,193	76.590	1,163,631.870	
VINCI SA	6,501	125.900	818,475.900	
AIRBUS	8,348	179.280	1,496,629.440	
VEOLIA ENVIRON. SA	8,284	35.460	293,750.640	
CREDIT AGRICOLE SA	12,555	16.725	209,982.370	
BIOMERIEUX SA	578	67.750	39,159.500	
ENGIE SA	25,269	27.510	695,150.190	
SAFRAN SA	4,836	306.100	1,480,299.600	
AEROPORTS DE PARIS SA	470	106.300	49,961.000	
GETLINK	3,414	18.410	62,851.740	
BOLLORE	8,529	5.435	46,355.110	

UCB SA	1,697	274.900	466,505.300	
KBC GROEP NV	3,163	114.600	362,479.800	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	1,067	80.400	85,786.800	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA	12,501	71.280	891,071.280	
AGEAS SA	2,194	66.600	146,120.400	
DIETEREN GROUP SA	296	169.500	50,172.000	
ELIA GROUP SA	640	135.900	86,976.000	
SOFINA SA	210	216.800	45,528.000	
ARGENX	871	783.600	682,515.600	
BUZZI	1,087	46.190	50,208.530	
PRYSMIAN	3,924	143.900	564,663.600	
GENERALI	11,379	41.170	468,473.430	
TENARIS SA	4,418	27.120	119,816.160	
UNICREDIT	24,520	73.300	1,797,316.000	
UNIPOL ASSICURAZIONI SPA	5,276	24.200	127,679.200	
TELECOM ITALIA	335,261	0.788	264,386.820	
INTESA SANPAOLO	195,638	5.840	1,142,525.920	
POSTE ITALIANE	6,337	28.230	178,893.510	
MONCLER	3,056	53.860	164,596.160	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA E FARM	1,602	50.800	81,381.600	
ENI	25,232	23.220	585,887.040	
BPER BANCA	21,608	13.044	281,854.750	
DAVIDE CAMPARI MILANO NV	7,862	5.436	42,737.830	
BANCO BPM	15,673	14.440	226,318.120	
BANCA MEDIOLANUM	3,210	20.590	66,093.900	
LEONARDO	5,633	53.480	301,252.840	
BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SP	27,270	10.716	292,225.320	
ENEL	106,450	9.794	1,042,571.300	
SNAM	29,583	6.432	190,277.850	
ITALGAS	9,029	10.650	96,158.850	
TERNA RETE ELETTRICA NAZIONALE	19,446	10.280	199,904.880	
FINECOBANK BANCA FINECO	8,979	21.930	196,909.470	
STELLANTIS NV	27,855	5.892	164,121.660	
FERRARI NV	1,692	306.850	519,190.200	
TELEFONICA SA	50,860	3.945	200,642.700	
ENDESA SA	4,398	38.210	168,047.580	

BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	78,806	20.090	1,583,212.540	
IBERDROLA SA	84,973	20.320	1,726,651.360	
BANCO DE SABADELL SA	69,388	2.946	204,417.040	
BANKINTER SA	8,726	14.440	126,003.440	
REPSOL SA	15,556	22.720	353,432.320	
BANCO SANTANDER	200,675	11.026	2,212,642.550	
AMADEUS IT GROUP SA	6,211	50.960	316,512.560	
NATURGY ENERGY GROUP SA	3,735	29.440	109,958.400	
MAPFRE SA	13,028	4.118	53,649.300	
CAIXABANK SA	48,893	11.890	581,337.770	
INTERNATIONAL AIRLINES GROUP SA	17,844	5.050	90,112.200	
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y	2,499	125.500	313,624.500	
AENA SME SA	10,399	25.940	269,750.060	
CELLNEX TELECOM	6,779	28.870	195,709.730	
ACCIONA SA	347	259.600	90,081.200	
INDRA SISTEMAS SA	1,178	56.040	66,015.120	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	15,322	55.940	857,112.680	
REDEIA CORPORACION SA	5,772	15.150	87,445.800	
UPM-KYMMENE	7,361	24.700	181,816.700	
NOKIA	70,216	12.965	910,350.440	
WARTSILA	6,976	33.060	230,626.560	
STORA ENSO CLASS R	7,978	9.652	77,003.650	
ELISA	2,022	40.320	81,527.040	
SAMPO CLASS A	33,170	9.014	298,994.380	
FORTUM	6,269	20.350	127,574.150	
KESKO CLASS B	4,020	21.400	86,028.000	
KONE CORP CLASS B	4,684	48.720	228,204.480	
NESTE	5,816	27.710	161,161.360	
ORION CLASS B	1,543	68.350	105,464.050	
METSO CORPORATION	8,939	14.800	132,297.200	
NORDEA BANK	42,725	16.350	698,553.750	
VERBUND AG	876	57.650	50,501.400	
OMV AG	2,041	58.700	119,806.700	
ERSTE GROUP BANK AG	4,330	109.000	471,970.000	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	1,855	50.350	93,399.250	

	BAWAG GROUP AG	1,041	161.400	168,017.400	
	RYANAIR HOLDINGS PLC	5,337	25.090	133,905.330	
	AIB GROUP PLC	29,474	10.355	305,203.270	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	13,174	17.540	231,071.960	
	KINGSPAN GROUP PLC	2,250	84.050	189,112.500	
	JERONIMO MARTINS SA	4,171	17.760	74,076.960	
	EDP ENERGIAS DE PORTUGAL SA	43,291	4.467	193,380.890	
	BANCO COMERCIAL PORTUGUES SA	115,719	0.950	109,933.050	
	GALP ENERGIA SGPS SA CLASS B	5,978	19.120	114,299.360	
	EDP RENEWABLES SA	4,084	13.630	55,664.920	
	KERRY GROUP PLC	2,362	75.800	179,039.600	
ユーロ 小計				91,812,557.790 (17,060,609,489)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	21,000	55.800	1,171,800.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	31,000	31.340	971,540.000	
	MTR CORPORATION CORP LTD	24,500	31.720	777,140.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	20,000	117.000	2,340,000.000	
	SINO LAND LTD	58,000	11.300	655,400.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	40,052	69.450	2,781,611.400	
	SWIRE PACIFIC LTD A	5,500	82.950	456,225.000	
	CLP HOLDINGS LTD	24,500	73.400	1,798,300.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT LTD	22,565	26.940	607,901.100	
	HONG KONG AND CHINA GAS LTD	174,027	6.820	1,186,864.140	
	WH GROUP LTD	118,000	8.820	1,040,760.000	
	HONG KONG EXCHANGES AND CLEARING L	18,500	380.600	7,041,100.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	27,052	46.280	1,251,966.560	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE HOLDING	10,000	57.650	576,500.000	
	AIA GROUP LTD	160,800	74.550	11,987,640.000	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	21,000	34.480	724,080.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT COMPA	26,000	22.480	584,480.000	
	SANDS CHINA LTD	37,800	14.700	555,660.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES LTD	21,000	118.700	2,492,700.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	55,000	48.260	2,654,300.000	

香港・ドル 小計			41,655,968.200 (851,447,990)	
合計			188,273,131,748 [188,273,131,748]	

(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 REIT INC (REIT)	2,060	385,281.800	
		SIMON PROPERTY GROUP REIT INC (REIT)	4,692	1,027,735.680	
		SBA COMMUNICATIONS REIT CORP CLASS (REIT)	1,565	320,496.350	
		EQUITY RESIDENTIAL REIT (REIT)	4,826	324,982.840	
		EQUINIX REIT INC (REIT)	1,426	1,505,642.100	
		AMERICAN TOWER REIT CORP (REIT)	6,657	1,246,057.260	
		KIMCO REALTY REIT CORP (REIT)	10,071	260,939.610	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES REIT (REIT)	3,900	185,133.000	
		INVITATION HOMES INC (REIT)	7,688	228,179.840	
		VICI PPTYS INC (REIT)	15,388	438,865.760	
		VENTAS REIT INC (REIT)	6,894	583,232.400	
		WEYERHAEUSER REIT (REIT)	10,711	266,168.350	
		CROWN CASTLE INC (REIT)	6,183	569,825.280	
		IRON MOUNTAIN INC (REIT)	4,272	543,569.280	
		SUN COMMUNITIES REIT INC (REIT)	1,787	226,859.650	
		PROLOGIS REIT INC (REIT)	13,336	1,983,596.640	
		ESSEX PROPERTY TRUST REIT INC (REIT)	1,008	286,020.000	
		WELLTOWER INC (REIT)	10,155	2,175,505.650	

	MID AMERICA APARTMENT COMMUNITIES (REIT)	1,726	239,793.180	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT REIT INC (REIT)	10,313	226,886.000	
	REALTY INCOME REIT CORP (REIT)	13,386	839,569.920	
	PUBLIC STORAGE REIT (REIT)	2,241	730,431.540	
	REGENCY CENTERS REIT CORP (REIT)	2,461	197,569.080	
	W. P. CAREY REIT INC (REIT)	3,262	250,228.020	
	DIGITAL REALTY TRUST REIT INC (REIT)	4,923	906,816.600	
	EXTRA SPACE STORAGE REIT INC (REIT)	3,089	465,203.400	
アメリカ・ドル 小計			16,414,589.230 (2,629,288,903)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP REIT PLC (REIT)	9,796	64,359.720	
	SEGRO REIT PLC (REIT)	17,980	134,957.880	
イギリス・ポンド 小計			199,317.600 (42,944,970)	
オーストラリア・ドル	TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS	42,991	671,089.510	
	APA GROUP UNITS	18,610	202,290.700	
	SCENTRE GROUP UNIT (REIT)	71,825	277,244.500	
	STOCKLAND STAPLED UNITS LTD	35,691	150,972.930	
	GOODMAN GROUP UNITS	28,290	891,700.800	
	VICINITY CENTRES (REIT)	50,371	129,957.180	
オーストラリア・ドル 小計			2,323,255.620 (263,178,396)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	64,000	161,920.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL T	94,626	221,424.840	
シンガポール・ドル 小計			383,344.840 (47,925,772)	
ユーロ	UNIBAIL RODAMCO WE STAPLED UNITS	1,492	150,244.400	
	GECINA SA (REIT)	578	42,540.800	
	KLEPIERRE REIT SA (REIT)	2,896	105,704.000	

		COVIVIO SA (REIT)	652	35,892.600	
	ユーロ 小計			334,381.800 (62,134,826)	
	香港・ドル	LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	40,700	1,493,690.000	
		HKT TRUST AND HKT UNITS LTD	59,000	712,720.000	
	香港・ドル 小計			2,206,410.000 (45,099,021)	
投資証券 合計				3,090,571,888 [3,090,571,888]	
合計				3,090,571,888 [3,090,571,888]	

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 513銘柄 投資証券 26銘柄	98.2%	-%	1.8%	76.8%
イギリス・ポンド	株式 62銘柄 投資証券 2銘柄	99.4%	-%	0.6%	3.6%
イスラエル・シュケル	株式 13銘柄	100%	-%	-%	0.3%
オーストラリア・ドル	株式 41銘柄 投資証券 6銘柄	91.8%	-%	8.2%	1.7%
カナダ・ドル	株式 84銘柄 新株予約権証券 1銘柄	100%	0%	-%	3.7%
シンガポール・ドル	株式 12銘柄 投資証券 2銘柄	93.7%	-%	6.3%	0.4%
スイス・フラン	株式 40銘柄	100%	-%	-%	2.4%
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%	-%	-%	0.5%

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 12銘柄	100%	-%	-%	0.2%
ユーロ	株式 215銘柄 投資証券 4銘柄	99.6%	-%	0.4%	8.9%
香港・ドル	株式 20銘柄 投資証券 2銘柄	95.0%	-%	5.0%	0.5%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間(2025年6月17日から2026年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	179,533,239	206,442,915
親投資信託受益証券	47,825,044,345	92,296,678,593
流動資産合計	48,004,577,584	92,503,121,508
資産合計	48,004,577,584	92,503,121,508
負債の部		
流動負債		
未払解約金	76,810,305	24,525,444
未払受託者報酬	4,778,715	8,479,032
未払委託者報酬	91,991,115	163,222,230
その他未払費用	1,153,010	1,089,472
流動負債合計	174,733,145	197,316,178
負債合計	174,733,145	197,316,178
純資産の部		
元本等		
元本	※1 12,709,688,633	※1 17,894,850,536
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	35,120,155,806	74,410,954,794
（分配準備積立金）	10,387,838,059	27,535,203,730
元本等合計	47,829,844,439	92,305,805,330
純資産合計	47,829,844,439	92,305,805,330
負債純資産合計	48,004,577,584	92,503,121,508

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 自　2024年6月18日 至　2025年6月16日	第10期 自　2025年6月17日 至　2026年6月15日
営業収益		
受取利息	274,605	811,260
有価証券売買等損益	1,798,938,908	20,945,866,748
営業収益合計	1,799,213,513	20,946,678,008
営業費用		
受託者報酬	8,940,053	14,774,617
委託者報酬	172,097,681	284,413,466
その他費用	2,193,268	2,193,750
営業費用合計	183,231,002	301,381,833
営業利益又は営業損失（△）	1,615,982,511	20,645,296,175
経常利益又は経常損失（△）	1,615,982,511	20,645,296,175
当期純利益又は当期純損失（△）	1,615,982,511	20,645,296,175
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（△）	159,960,725	1,706,783,196
期首剰余金又は期首欠損金（△）	25,319,867,012	35,120,155,806
剰余金増加額又は欠損金減少額	14,165,662,796	28,246,322,923
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	14,165,662,796	28,246,322,923
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,821,395,788	7,894,036,914
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,821,395,788	7,894,036,914
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	35,120,155,806	74,410,954,794

(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10期 自2025年6月17日 至2026年6月15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 2025年6月15日が休日のため、前計算期間末日を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9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
1.　※1 期首元本額	9,619,339,885円	12,709,688,633円
期中追加設定元本額	5,294,473,327円	7,925,148,297円
期中一部解約元本額	2,204,124,579円	2,739,986,394円
2.　計算期間末日における受益権の総数	12,709,688,633口	17,894,850,536口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日	第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15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（237,774円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（1,455,784,012円）、投資信託約款に規定される収益調整金（24,732,317,747円）及び分配準備積立金（8,931,816,273円）より分配対象額は35,120,155,806円（1万口当たり27,632.59円）であり、分配を行っておりません。	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（784,518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（18,937,728,461円）、投資信託約款に規定される収益調整金（46,875,751,064円）及び分配準備積立金（8,596,690,751円）より分配対象額は74,410,954,794円（1万口当たり41,582.33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10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	第10期 2026年6月15日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,678,241,720	20,072,278,794
合計	1,678,241,720	20,072,278,794

（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9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.7633円 (37,633円)	5.1582円 (51,582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	9,698,900,674	92,296,678,593	
親投資信託受益証券 合計			92,296,678,593	
合計			92,296,678,593	

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

	2025年6月16日現在 金 額（円）	2026年6月15日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		

預金	1,931,267,490	7,280,666,201
コール・ローン	6,016,732,896	29,891,028,181
株式	659,045,294,969	988,201,865,721
投資証券	12,370,196,711	16,198,244,273
派生商品評価勘定	915,727,801	3,034,315,147
未収入金	19,010,700	34,306,104
未収配当金	678,769,379	902,577,377
差入委託証拠金	11,917,877,863	15,626,597,629
流動資産合計	692,894,877,809	1,061,169,600,633
資産合計	692,894,877,809	1,061,169,600,633
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	107,927,544	169,849,249
未払解約金	142,631,200	623,138,100
流動負債合計	250,558,744	792,987,349
負債合計	250,558,744	792,987,349
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	100,214,393,190	111,428,066,088
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	592,429,925,875	948,948,547,196
元本等合計	692,644,319,065	1,060,376,613,284
純資産合計	692,644,319,065	1,060,376,613,284
負債純資産合計	692,894,877,809	1,061,169,600,633

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2026年6月15日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2025年6月16日現在	2026年6月15日現在
1.　※1 期首	2024年6月18日	2025年6月17日
期首元本額	87,815,492,483円	100,214,393,190円
期中追加設定元本額	22,464,610,843円	24,305,852,422円
期中一部解約元本額	10,065,710,136円	13,092,179,524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	202,501,703円	156,360,951円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	1,294,757円	870,142円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	13,002,845円	5,884,210円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	2,898,468円	2,441,474円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	79,141,486円	53,228,001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）	132,624,384円	132,538,579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）	9,833,826,354円	10,992,126,667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）	801,703,799円	849,822,969円

	ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	6,919,533,009円	9,698,900,674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）	630,101,185円	659,439,405円
	Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	16,195,205円	13,119,135円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	46,218,358円	42,011,161円
	ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	10,941,106,395円	12,712,998,111円
	ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,662,950,033円	1,714,652,100円
	ｉＦｒｅｅ 年金バランス	384,329,560円	390,136,909円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	28,736,837円	34,863,183円
	ＤＣダイワ外国株式インデックス	51,421,990,357円	48,000,877,239円
	ダイワ・ライフ・バランス３０	448,451,441円	375,782,624円
	ダイワ・ライフ・バランス５０	1,058,751,948円	1,002,857,495円
	ダイワ・ライフ・バランス７０	1,050,740,402円	1,067,667,991円
	大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,035,513,077円	957,972,770円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	8,244,466円	6,405,847円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	12,252,822円	11,881,279円
	ダイワつみたてインデックス外国株式	3,188,082,289円	3,926,032,327円
	ダイワつみたてインデックスバランス３０	1,936,492円	1,728,871円
	ダイワつみたてインデックスバランス５０	3,052,509円	3,408,715円
	ダイワつみたてインデックスバランス７０	47,820,292円	51,967,393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）	19,045,605円	3,385,769,006円
	ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	37,716,041円	18,632,408円

ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	28,624,114円	22,231,307円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	581,067,180円	426,584,775円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	32,496,251円	24,582,580円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	105,554,382円	89,423,932円
スタイル9（4資産分散・保守型）	549,705円	644,672円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	3,716,390円	5,246,350円
スタイル9（4資産分散・積極型）	5,558,711円	8,909,710円
スタイル9（6資産分散・保守型）	208,338円	281,924円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	6,948,523円	10,128,566円
スタイル9（6資産分散・積極型）	7,743,551円	12,114,302円
スタイル9（8資産分散・保守型）	294,819円	422,980円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	5,369,709円	8,267,607円
スタイル9（8資産分散・積極型）	14,734,328円	23,575,975円
全世界株式インデックス・ファンド（オール・カントリー）	104,771,525円	3,074,849,337円
ｉＦｒｅｅ 全世界株式インデックス（オール・カントリー）	-円	152,943,102円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル1（安定）	-円	87,627円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル2（やや安定）	-円	155,074円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル3（バランス）	-円	233,435円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル4（やや積極）	-円	400,165円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル5（積極）	-円	615,021円
ダイワ・インデックスセレクト外国株式	1,108,583,684円	945,002,104円

ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	404,953,530円	392,350,277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）	4,227,306,361円	6,342,680,014円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,352,711,410円	3,452,333,089円
ダイワライフスタイル２５	6,398,214円	4,558,458円
ダイワライフスタイル５０	31,141,882円	26,030,774円
ダイワライフスタイル７５	27,721,857円	24,662,506円
ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	64,513,249円	54,476,491円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	63,663,358円	53,896,298円
計	100,214,393,190円	111,428,066,088円
2.　期末日における受益権の総数	100,214,393,190口	111,428,066,088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2025年6月17日 至2026年6月15日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。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	2026年6月15日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2025年6月16日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2026年6月15日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	5,816,042,911	76,053,039,685
投資証券	△685,665,949	1,458,989,310
合計	5,130,376,962	77,512,028,995

（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	2025年6月16日現在				2026年6月15日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								

株価指数先物取引								
買建	20,056,087,739	-	20,776,975,256	720,887,517	52,798,983,312	-	55,600,266,680	2,801,283,368
合計	20,056,087,739	-	20,776,975,256	720,887,517	52,798,983,312	-	55,600,266,680	2,801,283,368

（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6月16日現在				2026年6月15日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	6,109,954,260	-	6,196,867,000	86,912,740	29,240,594,890	-	29,303,777,420	63,182,530
アメリカ・ドル	2,449,786,520	-	2,478,004,000	28,217,480	20,989,597,550	-	21,089,055,730	99,458,180
イギリス・ポンド	366,614,770	-	370,859,100	4,244,330	192,696,480	-	193,544,370	847,890
オーストラリア・ドル	508,265,450	-	514,657,000	6,391,550	1,003,593,140	-	994,540,800	△9,052,340
カナダ・ドル	1,211,739,650	-	1,230,992,000	19,252,350	2,559,474,530	-	2,543,838,060	△15,636,470
スイス・フラン	839,659,670	-	853,622,400	13,962,730	1,751,847,560	-	1,735,159,220	△16,688,340
ユーロ	733,888,200	-	748,732,500	14,844,300	2,743,385,630	-	2,747,639,240	4,253,610
合計	6,109,954,260	-	6,196,867,000	86,912,740	29,240,594,890	-	29,303,777,420	63,182,530

（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6月16日現在	2026年6月15日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	6.9116円 (69,116円)	9.5162円 (95,162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 SOLUTIONS INC	8,900	144.870	1,289,343.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	61,673	279.620	17,245,004.260	
	FIRST SOLAR INC	7,800	267.310	2,085,018.000	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,060	350.670	4,579,750.200	
	SYNCHRONY FINANCIAL	26,400	73.360	1,936,704.000	
	ABBOTT LABORATORIES	132,366	88.180	11,672,033.880	
	HOWMET AEROSPACE INC	30,483	264.670	8,067,935.610	
	VERISK ANALYTICS INC	9,900	183.800	1,819,620.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	22,800	50.670	1,155,276.000	
	AMPHENOL CORP CLASS A	93,500	153.800	14,380,300.000	

MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,540	1,577.320	5,583,712.800	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERV	38,900	39.200	1,524,880.000	
AFLAC INC	35,200	117.800	4,146,560.000	
DARDEN RESTAURANTS INC	8,700	211.470	1,839,789.000	
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	11,900	172.510	2,052,869.000	
ADOBE INC	30,680	204.020	6,259,333.600	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	11,700	109.480	1,280,916.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,500	118.770	890,775.000	
GARMIN LTD	12,400	238.100	2,952,440.000	
AIR PRODUCTS AND CHEMICALS INC	16,020	281.620	4,511,552.400	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	48,300	220.310	10,640,973.000	
WR BERKLEY CORP	16,313	68.270	1,113,688.510	
AUTOZONE INC	1,250	3,116.300	3,895,375.000	
DOLLAR TREE INC	14,171	114.000	1,615,494.000	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES ADR	91,700	34.630	3,175,571.000	
D R HORTON INC	19,816	154.090	3,053,447.440	
AUTODESK INC	16,040	198.430	3,182,817.200	
MOODYS CORP	11,420	447.850	5,114,447.000	
DEVON ENERGY CORP	83,340	45.310	3,776,135.400	
ATMOS ENERGY CORP	12,600	169.960	2,141,496.000	
ALLIANT ENERGY CORP	19,600	73.110	1,432,956.000	
CITIGROUP INC	129,473	139.830	18,104,209.590	
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	30,580	226.210	6,917,501.800	
AMERICAN ELECTRIC POWER INC	41,400	129.230	5,350,122.000	
DOMINOS PIZZA INC	2,290	323.880	741,685.200	
DANAHER CORP	48,450	180.100	8,725,845.000	
FORTIVE CORP	21,500	60.140	1,293,010.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	43,100	140.530	6,056,843.000	
ARCHER DANIELS MIDLAND	36,600	80.240	2,936,784.000	
APPLE INC	1,116,160	291.130	324,947,660.800	
BOEING	56,700	219.050	12,420,135.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,815	169.010	1,996,853.150	
BECTON DICKINSON	21,699	146.240	3,173,261.760	
LEIDOS HOLDINGS INC	9,100	122.160	1,111,656.000	
NISOURCE INC	36,500	47.210	1,723,165.000	
CH ROBINSON WORLDWIDE INC	9,000	193.740	1,743,660.000	

BANK OF NEW YORK MELLON CORP	52,171	143.980	7,511,580.580	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	317,704	48.110	15,284,739.440	
BERKSHIRE HATHAWAY INC CLASS B	105,770	489.250	51,747,972.500	
TRUIST FINANCIAL CORP	94,317	51.660	4,872,416.220	
BLACKSTONE INC	56,400	122.790	6,925,356.000	
BRISTOL MYERS SQUIBB	155,200	57.130	8,866,576.000	
JPMORGAN CHASE	203,830	320.720	65,372,357.600	
T ROWE PRICE GROUP INC	16,400	109.640	1,798,096.000	
CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	21,020	384.960	8,091,859.200	
AMERIPRISE FINANCE INC	6,880	459.130	3,158,814.400	
DOLLAR GENERAL CORP	16,700	114.800	1,917,160.000	
SERVICENOW INC	79,500	102.150	8,120,925.000	
CATERPILLAR INC	35,360	910.570	32,197,755.200	
BROWN & BROWN INC	21,800	59.990	1,307,782.000	
CMS ENERGY CORP	23,400	73.570	1,721,538.000	
DELTA AIR LINES INC	12,500	83.060	1,038,250.000	
CORNING INC	60,400	179.200	10,823,680.000	
CISCO SYSTEMS INC	300,350	121.100	36,372,385.000	
MORGAN STANLEY	90,052	214.040	19,274,730.080	
DECKERS OUTDOOR CORP	10,800	113.830	1,229,364.000	
MSCI INC	5,380	599.120	3,223,265.600	
FAIR ISAAC CORP	1,760	1,179.190	2,075,374.400	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,420	512.150	1,239,403.000	
SS AND C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	16,000	67.680	1,082,880.000	
BROADCOM INC	341,980	382.070	130,660,298.600	
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,980	545.960	1,626,960.800	
CNH INDUSTRIAL N.V. NV	66,000	10.600	699,600.000	
DICKS SPORTING INC	4,600	220.990	1,016,554.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,080	282.850	2,851,128.000	
DTE ENERGY	15,800	147.420	2,329,236.000	
CENTENE CORP	37,407	65.190	2,438,562.330	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,980	294.910	2,353,381.800	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	32,200	67.650	2,178,330.000	
ARTHUR J GALLAGHER	19,500	218.690	4,264,455.000	
DOMINION ENERGY INC	66,941	67.910	4,545,963.310	
MONSTER BEVERAGE CORP	53,800	92.830	4,994,254.000	
DEERE	18,440	577.480	10,648,731.200	

QUANTA SERVICES INC	11,420	707.740	8,082,390.800	
GLOBAL PAYMENTS INC	17,884	67.710	1,210,925.640	
BURLINGTON STORES INC	4,780	338.450	1,617,791.000	
NASDAQ INC	34,600	88.980	3,078,708.000	
TARGA RESOURCES CORP	15,900	272.600	4,334,340.000	
CONSOLIDATED EDISON INC	28,000	107.740	3,016,720.000	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,800	289.360	1,678,288.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC	5,520	328.820	1,815,086.400	
VEEVA SYSTEMS INC CLASS A	11,220	159.540	1,790,038.800	
CARLISLE COMPANIES INC	3,140	343.770	1,079,437.800	
IDEX CORP	5,600	218.490	1,223,544.000	
COLGATE-PALMOLIVE	57,900	89.450	5,179,155.000	
ROLLINS INC	21,807	47.190	1,029,072.330	
WATSCO INC	2,620	380.460	996,805.200	
GRACO INC	12,600	74.600	939,960.000	
AMETEK INC	17,400	227.120	3,951,888.000	
CHURCH AND DWIGHT INC	18,000	97.560	1,756,080.000	
CURTISS WRIGHT CORP	2,800	758.000	2,122,400.000	
HEICO CORP	3,240	331.610	1,074,416.400	
XPO INC	9,000	228.330	2,054,970.000	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES CLASS A	19,600	64.580	1,265,768.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,260	298.840	974,218.400	
COSTCO WHOLESALE CORP	33,720	982.350	33,124,842.000	
RPM INTERNATIONAL INC	9,700	107.050	1,038,385.000	
RELIANCE INC	3,880	413.430	1,604,108.400	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	99,000	32.230	3,190,770.000	
COMFORT SYSTEMS USA INC	2,680	1,877.610	5,031,994.800	
CUMMINS INC	10,520	659.580	6,938,781.600	
CDW CORP	9,700	132.190	1,282,243.000	
COSTAR GROUP INC	31,800	32.840	1,044,312.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE INC	14,300	245.750	3,514,225.000	
INTERACTIVE BROKERS GROUP INC CLAS	32,100	90.810	2,915,001.000	
MERCADOLIBRE INC	3,470	1,589.600	5,515,912.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	17,416	345.950	6,025,065.200	
DEXCOM INC	29,300	75.370	2,208,341.000	

NORDSON CORP	3,990	288.210	1,149,957.900	
COPART INC	67,700	30.750	2,081,775.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	14,400	192.130	2,766,672.000	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,100	295.660	1,803,526.000	
TRANSDIGM GROUP INC	4,290	1,256.050	5,388,454.500	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	7,200	159.760	1,150,272.000	
CASEYS GENERAL STORES INC	2,800	895.140	2,506,392.000	
KINDER MORGAN INC	143,481	31.940	4,582,783.140	
HCA HEALTHCARE INC	11,880	387.180	4,599,698.400	
T MOBILE US INC	37,727	189.100	7,134,175.700	
EMCOR GROUP INC	3,400	823.050	2,798,370.000	
COCA-COLA	293,850	82.620	24,277,887.000	
COCA COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	15,800	99.340	1,569,572.000	
EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHIN	10,050	166.620	1,674,531.000	
CSX CORP	141,400	47.570	6,726,398.000	
EXPEDIA GROUP INC	8,925	224.890	2,007,143.250	
AMAZON COM INC	736,000	238.550	175,572,800.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	43,800	85.110	3,727,818.000	
EXXON MOBIL CORP	315,909	147.010	46,441,782.090	
EVEREST GROUP LTD	3,040	339.400	1,031,776.000	
EOG RESOURCES INC	40,700	136.650	5,561,655.000	
EQT CORP	45,100	51.940	2,342,494.000	
FIRST CITIZENS BANCSHARES INC CLAS	570	2,108.610	1,201,907.700	
CENCORA INC	14,040	281.670	3,954,646.800	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	21,500	129.840	2,791,560.000	
FORD MOTOR	297,923	14.840	4,421,177.320	
ENTEGRIS INC	11,600	150.520	1,746,032.000	
STRATEGY INC CLASS A	19,820	123.970	2,457,085.400	
AERCAP HOLDINGS NV	12,700	140.000	1,778,000.000	
FORTINET INC	47,800	146.300	6,993,140.000	
MARKEL GROUP INC	950	1,846.000	1,753,700.000	
NEXTERA ENERGY INC	158,580	85.990	13,636,294.200	
FREEPORT MCMORAN INC	109,308	68.410	7,477,760.280	
INSULET CORP	5,280	149.700	790,416.000	
US BANCORP	118,000	58.940	6,954,920.000	
UNITED RENTALS INC	4,800	1,074.240	5,156,352.000	

F5 INC	4,260	396.160	1,687,641.600	
SUPER MICRO COMPUTER INC	38,700	30.460	1,178,802.000	
PINNACLE FINANCIAL PARTNERS INC	11,500	96.360	1,108,140.000	
FASTENAL	87,300	46.570	4,065,561.000	
FISERV INC	40,433	53.780	2,174,486.740	
GE AEROSPACE	79,386	335.300	26,618,125.800	
AXON ENTERPRISE INC	5,820	441.730	2,570,868.600	
INSMED INC	16,000	97.850	1,565,600.000	
GENERAL MOTORS	68,700	81.500	5,599,050.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	17,540	360.220	6,318,258.800	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	22,410	1,062.750	23,816,227.500	
ALPHABET INC CLASS A	442,660	359.680	159,215,948.800	
ALPHABET INC CLASS C	350,740	358.160	125,621,038.400	
GENERAL MILLS INC	40,600	34.510	1,401,106.000	
FIRSTENERGY CORP	41,818	47.030	1,966,700.540	
GENUINE PARTS	10,650	103.750	1,104,937.500	
FIFTH THIRD BANCORP	68,900	54.730	3,770,897.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,210	307.790	4,373,695.900	
HALLIBURTON	63,500	39.600	2,514,600.000	
HOME DEPOT INC	75,730	328.390	24,868,974.700	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	154,900	17.520	2,713,848.000	
HERSHEY FOODS	11,300	181.660	2,052,758.000	
HUMANA INC	9,140	379.220	3,466,070.800	
NXP SEMICONDUCTORS NV	19,200	304.860	5,853,312.000	
HP INC	69,000	25.240	1,741,560.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	100,900	48.170	4,860,353.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	26,400	91.660	2,419,824.000	
KRAFT HEINZ	65,203	24.390	1,590,301.170	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CO	71,260	272.240	19,399,822.400	
HUBBELL INC	4,040	476.890	1,926,635.600	
INTERNATIONAL PAPER	38,200	36.150	1,380,930.000	
ZOETIS INC CLASS A	31,900	79.570	2,538,283.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	16,839	458.250	7,716,471.750	
CHENIERE ENERGY INC	15,540	241.280	3,749,491.200	
HYATT HOTELS CORP CLASS A	3,000	199.360	598,080.000	
ALLEGION PLC	6,450	133.970	864,106.500	
WASTE CONNECTIONS INC	19,437	156.110	3,034,310.070	

JOHNSON & JOHNSON	183,100	240.870	44,103,297.000	
FABRINET	2,840	611.010	1,735,268.400	
NEBIUS NV CLASS A	15,900	232.360	3,694,524.000	
ABBVIE INC	134,472	227.730	30,623,308.560	
KIMBERLY CLARK CORP	25,200	102.290	2,577,708.000	
KROGER	41,800	64.710	2,704,878.000	
KLA CORP	99,600	254.540	25,352,184.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	15,780	540.330	8,526,407.400	
CORPAY INC	4,760	356.110	1,695,083.600	
LOWES COMPANIES INC	42,620	220.780	9,409,643.600	
ELI LILLY	61,045	1,133.000	69,163,985.000	
LAM RESEARCH CORP	94,900	366.810	34,810,269.000	
MASTEC INC	4,800	362.970	1,742,256.000	
LOEWS CORP	12,900	108.120	1,394,748.000	
MCDONALDS CORP	54,010	284.810	15,382,588.100	
3M	39,990	158.320	6,331,216.800	
META PLATFORMS INC CLASS A	167,000	566.980	94,685,660.000	
S&P GLOBAL INC	23,039	418.910	9,651,267.490	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,620	577.330	2,667,264.600	
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	7,300	93.770	684,521.000	
PHILLIPS 66	30,500	179.450	5,473,225.000	
ATLASSIAN CORP CLASS A	12,900	88.520	1,141,908.000	
TECHNIPFMC PLC	31,500	70.790	2,229,885.000	
MCCORMICK & CO NON-VOTING INC	19,300	48.950	944,735.000	
METLIFE INC	42,000	88.840	3,731,280.000	
MARVELL TECHNOLOGY INC	64,800	279.700	18,124,560.000	
ARISTA NETWORKS INC	81,200	163.240	13,255,088.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,638	412.250	5,210,015.500	
METTLER TOLEDO INC	1,550	1,131.490	1,753,809.500	
BAKER HUGHES CLASS A	75,423	63.140	4,762,208.220	
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,560	459.340	3,931,950.400	
MERCK & CO INC	187,921	119.050	22,371,995.050	
DUPONT DE NEMOURS INC	31,051	48.260	1,498,521.260	
MASCO CORP	15,500	74.030	1,147,465.000	
M&T BANK CORP	11,299	231.880	2,620,012.120	
MARSH INC	36,570	168.680	6,168,627.600	
HEICO CORP CLASS A	5,800	247.090	1,433,122.000	

MARRIOTT INTERNATIONAL INC CLASS A	16,582	402.540	6,674,918.280	
WORKDAY INC CLASS A	16,000	130.800	2,092,800.000	
BLOCK INC CLASS A	38,812	69.520	2,698,210.240	
TRANSUNION	14,600	66.130	965,498.000	
VISTRA CORP	25,700	148.020	3,804,114.000	
NETAPP INC	15,000	161.610	2,424,150.000	
NIKE INC CLASS B	91,200	44.930	4,097,616.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	17,100	313.910	5,367,861.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	41,100	95.240	3,914,364.000	
RAYMOND JAMES INC	13,505	154.400	2,085,172.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,260	550.330	5,646,385.800	
NEWMONT	82,111	100.230	8,229,985.530	
MCKESSON CORP	9,340	784.050	7,323,027.000	
XYLEM INC	18,500	110.080	2,036,480.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	118,500	184.300	21,839,550.000	
NUCOR CORP	16,900	266.350	4,501,315.000	
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	11,560	482.000	5,571,920.000	
LUMENTUM HOLDINGS INC	5,420	921.560	4,994,855.200	
EVERGY INC	17,550	83.850	1,471,567.500	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	56,224	56.540	3,178,904.960	
ERIE INDEMNITY CLASS A	1,890	226.670	428,406.300	
OKTA INC CLASS A	12,900	116.290	1,500,141.000	
KKR AND CO INC	47,500	96.240	4,571,400.000	
PAYCHEX INC	24,500	100.630	2,465,435.000	
O REILLY AUTOMOTIVE INC	63,600	91.020	5,788,872.000	
ALTRIA GROUP INC	127,000	71.940	9,136,380.000	
PG&E CORP	167,400	16.950	2,837,430.000	
PFIZER INC	432,513	26.210	11,336,165.730	
CIGNA	20,060	298.000	5,977,880.000	
DELL TECHNOLOGIES INC CLASS C	22,901	395.570	9,058,948.570	
XCEL ENERGY INC	47,500	79.220	3,762,950.000	
STERIS	7,500	207.560	1,556,700.000	
SEA ADS REPRESENTING LTD CLASS A	29,600	82.940	2,455,024.000	
FOX CORP CLASS B	10,233	58.920	602,928.360	
FOX CORP CLASS A	15,199	65.850	1,000,854.150	
STRYKER CORP	26,200	312.200	8,179,640.000	

DOW INC	54,718	33.850	1,852,204.300	
TRADEWEB MARKETS INC CLASS A	8,800	101.190	890,472.000	
ZOOM COMMUNICATIONS INC CLASS A	18,200	93.680	1,704,976.000	
PARKER-HANNIFIN CORP	9,620	903.480	8,691,477.600	
UBER TECHNOLOGIES INC	135,000	68.850	9,294,750.000	
PROCTER & GAMBLE	176,667	149.610	26,431,149.870	
EXELON CORP	77,822	46.210	3,596,154.620	
INGERSOLL RAND INC	29,708	74.000	2,198,392.000	
NVR INC	200	6,374.930	1,274,986.000	
CONOCOPHILLIPS	92,903	116.980	10,867,792.940	
TWILIO INC CLASS A	10,900	204.080	2,224,472.000	
EVERPURE INC CLASS A	23,900	72.310	1,728,209.000	
PEPSICO INC	103,900	144.270	14,989,653.000	
MONGODB INC CLASS A	5,960	342.800	2,043,088.000	
CORTEVA INC	50,968	76.140	3,880,703.520	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	26,300	108.500	2,853,550.000	
AMCOR PLC	35,060	40.600	1,423,436.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC CLASS A	18,760	682.800	12,809,328.000	
AMERICAN WATER WORKS INC	14,700	126.310	1,856,757.000	
ACCENTURE PLC CLASS A	46,700	170.280	7,952,076.000	
PENTAIR PLC	12,275	73.800	905,895.000	
QUALCOMM INC	81,100	211.720	17,170,492.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC	16,400	111.115	1,822,286.000	
DATADOG INC CLASS A	23,800	229.900	5,471,620.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS INC	7,940	612.140	4,860,391.600	
REPUBLIC SERVICES INC	15,200	209.910	3,190,632.000	
BOOKING HOLDINGS INC	59,480	164.940	9,810,631.200	
ROSS STORES INC	23,900	240.130	5,739,107.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,830	228.230	1,558,810.900	
RESMED INC	11,060	194.780	2,154,266.800	
QUEST DIAGNOSTICS INC	8,430	203.060	1,711,795.800	
CARRIER GLOBAL CORP	57,087	69.910	3,990,952.170	
OTIS WORLDWIDE CORP	29,638	70.750	2,096,888.500	
CARLYLE GROUP INC	20,000	45.750	915,000.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	64,885	29.270	1,899,183.950	
ROYALTY PHARMA PLC CLASS A	31,300	54.870	1,717,431.000	
CHEVRON CORP	140,118	187.220	26,232,891.960	

ZSCALER INC	7,900	129.520	1,023,208.000	
EDISON INTERNATIONAL	29,300	72.950	2,137,435.000	
TESLA INC	213,910	406.430	86,939,441.300	
BLOOM ENERGY CLASS A CORP	20,600	260.220	5,360,532.000	
SNOWFLAKE INC	25,000	232.780	5,819,500.000	
GEN DIGITAL INC	40,300	24.320	980,096.000	
SYNOPSYS INC	13,819	453.890	6,272,305.910	
CARVANA CLASS A	48,840	64.100	3,130,644.000	
CLOUDFLARE INC CLASS A	23,600	228.480	5,392,128.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC CLASS A	6,205	145.820	904,813.100	
DOORDASH INC CLASS A	27,990	150.580	4,214,734.200	
ROBLOX CORP CLASS A	45,300	43.310	1,961,943.000	
AIRBNB INC CLASS A	32,200	132.280	4,259,416.000	
CBRE GROUP INC CLASS A	22,400	133.410	2,988,384.000	
SOUTHERN	85,800	94.000	8,065,200.000	
SYSCO CORP	36,400	79.190	2,882,516.000	
TRAVELERS COMPANIES INC	16,123	304.460	4,908,808.580	
FUTU HOLDINGS ADR LTD	3,900	97.540	380,406.000	
REVOLUTION MEDICINES INC	12,300	153.870	1,892,601.000	
STEEL DYNAMICS INC	10,550	282.760	2,983,118.000	
SLB NV	114,152	56.180	6,413,059.360	
AFFIRM HOLDINGS INC CLASS A	21,100	66.170	1,396,187.000	
AT&T INC	530,591	23.580	12,511,335.780	
ON SEMICONDUCTOR CORP	29,900	116.790	3,492,021.000	
SHERWIN WILLIAMS	17,880	317.300	5,673,324.000	
SEMPRA	49,700	92.290	4,586,813.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC CLASS A	165,300	127.990	21,156,747.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	16,610	931.040	15,464,574.400	
COINBASE GLOBAL INC CLASS A	16,120	159.780	2,575,653.600	
TEXAS INSTRUMENT INC	69,200	301.120	20,837,504.000	
SALESFORCE INC	60,266	165.890	9,997,526.740	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,809	133.880	4,258,588.920	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	46,534	144.960	6,745,568.640	
TERADYNE INC	11,920	403.200	4,806,144.000	
UNION PACIFIC CORP	45,080	272.700	12,293,316.000	

MARATHON PETROLEUM CORP	22,388	263.580	5,901,029.040	
RTX CORP	102,279	183.530	18,771,264.870	
UNITED PARCEL SERVICE INC CLASS B	56,600	108.100	6,118,460.000	
IQVIA HOLDINGS INC	12,904	181.460	2,341,559.840	
AMEREN CORP	21,100	109.000	2,299,900.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	68,986	408.520	28,182,160.720	
APPLOVIN CORP CLASS A	17,460	496.770	8,673,604.200	
TOAST INC CLASS A	35,900	24.820	891,038.000	
VERISIGN INC	6,280	279.890	1,757,709.200	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A	61,200	16.760	1,025,712.000	
ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A	57,100	93.190	5,321,149.000	
VALERO ENERGY CORP	22,742	258.670	5,882,673.140	
SOFI TECHNOLOGIES INC	97,000	16.580	1,608,260.000	
ULTA BEAUTY INC	3,320	467.740	1,552,896.800	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC	19,588	47.920	938,656.960	
ELEVANCE HEALTH INC	16,680	404.070	6,739,887.600	
WALT DISNEY	134,662	100.040	13,471,586.480	
WELLS FARGO	232,822	83.730	19,494,186.060	
WASTE MANAGEMENT INC	30,600	219.450	6,715,170.000	
WILLIAMS INC	93,000	72.080	6,703,440.000	
TRACTOR SUPPLY	39,700	31.250	1,240,625.000	
WALMART INC	333,400	121.040	40,354,736.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	14,700	88.570	1,301,979.000	
GRAB HOLDINGS LTD CLASS A	184,500	3.300	608,850.000	
WESTINGHOUSE AIR BRAKE TECHNOLOGIE	12,911	265.200	3,423,997.200	
TJX INC	84,100	168.410	14,163,281.000	
WATERS CORP	7,494	355.530	2,664,341.820	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	6,200	115.520	716,224.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,183	262.630	1,886,471.290	
WILLIAMS SONOMA INC	9,000	223.540	2,011,860.000	
WESTERN DIGITAL CORP	26,340	562.925	14,827,444.500	
WEC ENERGY GROUP INC	24,800	113.440	2,813,312.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP IN	37,900	79.700	3,020,630.000	
VISA INC CLASS A	127,790	322.390	41,198,218.100	
PPL CORP	57,200	35.850	2,050,620.000	

CONSTELLATION ENERGY CORP	23,404	253.760	5,938,999.040	
PULTEGROUP INC	14,550	123.170	1,792,123.500	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	179,053	26.980	4,830,849.940	
PPG INDUSTRIES INC	17,000	119.340	2,028,780.000	
NORTHERN TRUST CORP	13,300	174.340	2,318,722.000	
NVIDIA CORP	1,754,100	205.190	359,923,779.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC	30,613	237.660	7,275,485.580	
TYSON FOODS INC CLASS A	21,400	57.430	1,229,002.000	
NETFLIX INC	320,060	80.340	25,713,620.400	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,260	469.340	13,263,548.400	
NRG ENERGY INC	15,550	125.470	1,951,058.500	
TEXTRON INC	13,200	92.820	1,225,224.000	
NEWS CORP CLASS A	27,787	25.680	713,570.160	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	4,430	378.910	1,678,571.300	
OMNICOM GROUP INC	21,600	76.680	1,656,288.000	
JACOBS SOLUTIONS INC	8,920	127.000	1,132,840.000	
ORACLE CORP	131,153	184.130	24,149,201.890	
MASTERCARD INC CLASS A	62,140	489.980	30,447,357.200	
ONEOK INC	47,900	90.590	4,339,261.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,800	334.970	2,612,766.000	
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	15,900	134.900	2,144,910.000	
EXPAND ENERGY CORP	18,300	88.780	1,624,674.000	
YUM BRANDS INC	21,000	154.310	3,240,510.000	
TAKE TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	13,300	211.750	2,816,275.000	
BANK OF AMERICA CORP	516,001	56.020	28,906,376.020	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,520	626.020	2,203,590.400	
AMERICAN EXPRESS	40,360	325.440	13,134,758.400	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	34,735	65.180	2,264,027.300	
LINDE PLC	35,246	523.570	18,453,748.220	
ANALOG DEVICES INC	37,111	417.790	15,504,604.690	
ADVANCED MICRO DEVICES INC	124,027	511.570	63,448,492.390	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	18,100	28.740	520,194.000	
NATERA INC	10,200	212.070	2,163,114.000	
LIBERTY MEDIA FORMULA ONE SERIES C	16,200	88.930	1,440,666.000	

KENVUE INC	145,700	18.140	2,642,998.000	
VERALTO CORP	18,616	83.360	1,551,829.760	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC	40,672	75.740	3,080,497.280	
BUNGE GLOBAL SA	9,500	127.170	1,208,115.000	
VERTIV HOLDINGS CLASS A	27,660	302.870	8,377,384.200	
ROYAL CARIBBEAN GROUP LTD	19,340	294.380	5,693,309.200	
AVERY DENNISON CORP	5,830	159.250	928,427.500	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS COR	36,400	52.170	1,898,988.000	
EMERSON ELECTRIC	42,700	143.070	6,109,089.000	
AON PLC	15,500	335.310	5,197,305.000	
AMGEN INC	41,000	355.200	14,563,200.000	
SAMSARA INC CLASS A	26,600	33.660	895,356.000	
IREN LTD	24,600	59.770	1,470,342.000	
TAPESTRY INC	15,400	147.420	2,270,268.000	
EATON PLC	29,476	391.390	11,536,611.640	
COOPER INC	14,700	67.880	997,836.000	
CONSTELLATION BRANDS INC CLASS A	10,500	148.510	1,559,355.000	
APPLIED MATERIAL INC	60,380	567.250	34,250,555.000	
CME GROUP INC CLASS A	27,620	269.530	7,444,418.600	
ECOLAB INC	19,320	265.410	5,127,721.200	
EQUIFAX INC	9,200	163.710	1,506,132.000	
GILEAD SCIENCES INC	94,400	125.590	11,855,696.000	
KEURIG DR PEPPER INC	98,100	31.710	3,110,751.000	
STATE STREET CORP	21,213	167.630	3,555,935.190	
ECHOSTAR CORP CLASS A	9,900	114.080	1,129,392.000	
GE VERNOVA INC	20,486	940.660	19,270,360.760	
CHARLES SCHWAB CORP	125,440	91.100	11,427,584.000	
COHERENT CORP	14,160	385.030	5,452,024.800	
CRH PUBLIC LIMITED PLC	50,900	106.480	5,419,832.000	
LABCORP HOLDINGS INC	6,240	266.160	1,660,838.400	
SMURFIT WESTROCK PLC	39,900	43.320	1,728,468.000	
SHARKNINJA INC	6,700	133.800	896,460.000	
FERGUSON ENTERPRISES INC	14,800	230.080	3,405,184.000	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	10,480	110.650	1,159,612.000	
REDDIT INC CLASS A	8,800	162.100	1,426,480.000	
TE CONNECTIVITY PLC	22,295	210.380	4,690,422.100	

BLACKROCK INC	11,260	1,032.000	11,620,320.000	
ASTERA LABS INC	10,400	367.150	3,818,360.000	
ROCKET COMPANIES INC CLASS A	69,005	13.070	901,895.350	
CARDINAL HEALTH INC	17,900	223.850	4,006,915.000	
APTIV PLC	16,100	68.050	1,095,605.000	
FTAI AVIATION LTD	7,580	241.960	1,834,056.800	
FEDEX CORP	16,800	338.310	5,683,608.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	45,374	184.730	8,381,939.020	
FLEX LTD	27,900	149.710	4,176,909.000	
ROCKET LAB CORP	39,700	102.390	4,064,883.000	
CIRCLE INTERNET GROUP INC CLASS A	11,700	77.840	910,728.000	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES	18,913	78.270	1,480,320.510	
CREDO TECHNOLOGY GROUP HOLDING LTD	12,600	250.810	3,160,206.000	
INTEL CORPORATION	333,700	124.570	41,569,009.000	
COREWEAVE INC CLASS A	20,800	100.550	2,091,440.000	
QNITY ELECTRONICS INC	15,875	150.650	2,391,568.750	
IONQ INC	25,900	57.850	1,498,315.000	
AMRIZE AG	37,800	53.170	2,009,826.000	
HARTFORD INSURANCE GROUP INC	20,850	129.620	2,702,577.000	
ILLINOIS TOOL INC	20,820	257.430	5,359,692.600	
MEDLINE INC CLASS A	29,100	36.610	1,065,351.000	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	10,511	166.450	1,749,555.950	
ILLUMINA INC	11,300	160.970	1,818,961.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	27,020	411.060	11,106,841.200	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	6,150	124.060	762,969.000	
SNAP ON INC	3,980	387.480	1,542,170.400	
CIENA CORP	10,760	445.980	4,798,744.800	
DUKE ENERGY CORP	59,228	124.970	7,401,723.160	
TARGET CORP	34,400	135.230	4,651,912.000	
DOVER CORP	10,200	217.430	2,217,786.000	
WW GRAINGER INC	3,320	1,315.870	4,368,688.400	
JABIL INC	8,060	384.820	3,101,649.200	
CINTAS CORP	25,800	176.280	4,548,024.000	
CLOROX	9,200	96.820	890,744.000	

ENTERGY CORP	34,800	111.110	3,866,628.000	
MICROSOFT CORP	536,340	390.740	209,569,491.600	
INCYTE CORP	12,900	108.530	1,400,037.000	
CVS HEALTH CORP	96,669	101.960	9,856,371.240	
MEDTRONIC PLC	97,598	80.200	7,827,359.600	
MICRON TECHNOLOGY INC	85,780	981.610	84,202,505.800	
CENTERPOINT ENERGY INC	49,600	42.900	2,127,840.000	
KEYCORP	68,800	22.700	1,561,760.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC CLASS A	97,411	62.990	6,135,918.890	
CHUBB	26,539	328.140	8,708,507.460	
ALLSTATE CORP	19,600	221.630	4,343,948.000	
EBAY INC	32,300	108.610	3,508,103.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	64,850	41.530	2,693,220.500	
ESTEE LAUDER INC CLASS A	18,800	89.680	1,685,984.000	
TRIMBLE INC	17,900	50.420	902,518.000	
LENNAR A CORP CLASS A	15,400	90.300	1,390,620.000	
AST SPACEMOBILE INC CLASS A	18,100	82.410	1,491,621.000	
COMPASS GROUP PLC	125,437	34.180	4,287,436.660	
PROGRESSIVE CORP	44,500	203.110	9,038,395.000	
PACCAR INC	39,955	118.520	4,735,466.600	
BIOGEN INC	11,200	200.050	2,240,560.000	
IDEXX LABORATORIES INC	6,060	560.880	3,398,932.800	
STARBUCKS CORP	86,600	103.040	8,923,264.000	
PTC INC	9,000	113.680	1,023,120.000	
EVERSOURCE ENERGY	28,600	68.690	1,964,534.000	
INTUIT INC	21,040	276.730	5,822,399.200	
BEST BUY INC	15,150	78.530	1,189,729.500	
BALL CORP	19,104	56.980	1,088,545.920	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	112,997	46.910	5,300,689.270	
ELECTRONIC ARTS INC	17,100	203.270	3,475,917.000	
VULCAN MATERIALS	9,920	286.470	2,841,782.400	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,360	444.925	8,613,748.000	
CARNIVAL CORP LTD	97,600	29.180	2,847,968.000	
COEUR MINING INC	78,600	17.200	1,351,920.000	
COMCAST CORP CLASS A	272,690	24.500	6,680,905.000	
FEDEX FREIGHT HOLDING COMPANY INC	8,400	174.760	1,467,984.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	12,600	63.250	796,950.000	

	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	76,200	7.330	558,546.000	
アメリカ・ドル 小計				4,794,475,104.120 (767,979,022,178)	
イギリス・ポンド	SHELL PLC	413,880	32.205	13,329,005.400	
	AIRTEL AFRICA PLC	55,540	3.710	206,053.400	
	HALEON PLC	657,084	3.368	2,213,058.910	
	WISE PLC CLASS A	54,809	8.040	440,664.360	
	SUNBELT RENTALS HOLDINGS INC	30,199	62.240	1,879,585.760	
	BP PLC	1,158,007	5.345	6,189,547.410	
	UNILEVER PLC	161,200	43.860	7,070,232.000	
	BARCLAYS PLC	1,009,689	4.728	4,774,314.430	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	619,578	13.080	8,104,080.240	
	MARKS AND SPENCER GROUP PLC	150,130	3.763	564,939.190	
	PRUDENTIAL PLC	185,743	9.812	1,822,510.310	
	NATWEST GROUP PLC	588,645	6.142	3,615,457.590	
	BAE SYSTEMS PLC	215,769	19.110	4,123,345.590	
	AVIVA PLC	223,168	6.278	1,401,048.700	
	GLAXOSMITHKLINE	299,164	19.840	5,935,413.760	
	INFORMA PLC	92,772	8.162	757,205.060	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	90,508	4.625	418,599.500	
	SPIRAX GROUP PLC	5,453	68.100	371,349.300	
	HALMA PLC	27,258	38.980	1,062,516.840	
	STANDARD LIFE PLC	52,037	7.910	411,612.670	
	M&G PLC	167,052	3.216	537,239.230	
	ENDEAVOUR MINING	15,838	38.300	606,595.400	
	RELX PLC	131,560	24.920	3,278,475.200	
	DIAGEO PLC	164,249	15.145	2,487,551.100	
	RIO TINTO PLC	78,381	78.140	6,124,691.340	
	STANDARD CHARTERED PLC	130,620	19.280	2,518,353.600	
	TESCO PLC	471,044	4.730	2,228,038.120	
	FRESNILLO PLC	13,407	30.020	402,478.140	
	SMITH AND NEPHEW PLC	56,504	11.330	640,190.320	
	GLENCORE PLC	689,665	5.889	4,061,437.180	
	SMITHS GROUP PLC	22,369	25.230	564,369.870	
	PEARSON PLC	34,388	11.470	394,430.360	
	SAINSBURY(J) PLC	123,342	3.138	387,047.190	
	NEXT PLC	8,489	144.250	1,224,538.250	
	BUNZL	23,941	25.380	607,622.580	

	VODAFONE GROUP PLC	1,359,645	1.157	1,573,789.080	
	KINGFISHER PLC	124,777	2.883	359,732.090	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	55,102	13.140	724,040.280	
	SEVERN TRENT PLC	19,777	29.260	578,675.020	
	RENTOKIL INITIAL PLC	184,349	4.536	836,207.060	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	47,356	46.380	2,196,371.280	
	SCHRODERS PLC	59,874	5.830	349,065.420	
	SSE PLC	89,447	24.000	2,146,728.000	
	ASTRAZENECA PLC	111,360	134.620	14,991,283.200	
	LEGAL AND GENERAL GROUP PLC	384,089	2.807	1,078,137.820	
	3I GROUP PLC	71,712	23.090	1,655,830.080	
	THE SAGE GROUP PLC	69,055	8.184	565,146.120	
	NATIONAL GRID PLC	366,901	12.090	4,435,833.090	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,318,584	1.023	4,420,070.720	
	IMPERIAL BRANDS PLC	54,812	27.970	1,533,091.640	
	CENTRICA PLC	337,648	1.858	627,349.980	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO	147,292	46.310	6,821,092.520	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	20,675	19.460	402,335.500	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,267,647	13.728	17,402,258.010	
	ANGLO AMERICAN PLC	77,920	40.020	3,118,358.400	
	BT GROUP PLC	421,559	2.095	883,166.100	
	COCA COLA HBC AG	14,700	45.860	674,142.000	
	INTERTEK GROUP PLC	11,368	56.600	643,428.800	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	32,819	90.100	2,956,991.900	
	ADMIRAL GROUP PLC	19,229	34.640	666,092.560	
	ANTOFAGASTA PLC	25,209	40.440	1,019,451.960	
	EXPERIAN PLC	66,380	25.690	1,705,302.200	
イギリス・ポンド 小計				165,117,569.130 (35,576,231,445)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	96,324	29.930	2,882,977.320	
	AZRIELI GROUP LTD	3,430	439.400	1,507,142.000	
	PHOENIX FINANCIAL LTD	17,797	175.000	3,114,475.000	
	ENLIGHT RENEWABLE ENERGY LTD	10,959	278.700	3,054,273.300	
	HAREL INSURANCE INVESTMENTS & FINA	9,315	170.000	1,583,550.000	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	8,799	764.400	6,725,955.600	
	NOVA LTD	2,403	1,665.000	4,000,995.000	

	OPC ENERGY LTD	13,422	106.000	1,422,732.000	
	ICL GROUP LTD	55,887	16.500	922,135.500	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,199	2,575.000	5,662,425.000	
	BANK HAPOALIM BM	103,139	70.690	7,290,895.910	
	BANK LEUMI LE ISRAEL	116,344	68.290	7,945,131.760	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	12,134	206.000	2,499,604.000	
イスラエル・シュケル 小計				48,612,292.390 (2,666,768,275)	
オーストラリア・ドル	THE LOTTERY CORPORATION LTD	156,723	5.680	890,186.640	
	TELSTRA GROUP LTD	281,023	5.200	1,461,319.600	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	215,090	34.170	7,349,625.300	
	SGH LTD	14,554	41.510	604,136.540	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & COMP	24,448	44.360	1,084,513.280	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	193,917	4.970	963,767.490	
	BHP GROUP LTD	362,658	62.930	22,822,067.940	
	SOUTH32 LTD	320,192	4.520	1,447,267.840	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	135,674	31.230	4,237,099.020	
	FORTESCUE LTD	114,794	20.210	2,319,986.740	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	218,920	36.500	7,990,580.000	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	244,094	35.000	8,543,290.000	
	SANTOS LTD	231,785	8.070	1,870,504.950	
	RIO TINTO LTD	26,539	184.320	4,891,668.480	
	ORIGIN ENERGY LTD	122,948	11.090	1,363,493.320	
	PLS GROUP LTD	247,324	6.520	1,612,552.480	
	XERO LTD	11,505	73.500	845,617.500	
	PRO MEDICUS LTD	4,109	164.000	673,876.000	
	COLES GROUP LTD	95,863	24.010	2,301,670.630	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,917	37.500	521,887.500	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	97,030	19.260	1,868,797.800	
	EVOLUTION MINING LTD	144,954	11.750	1,703,209.500	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	119,429	159.510	19,050,119.790	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	107,154	24.060	2,578,125.240	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	87,181	38.330	3,341,647.730	
	QANTAS AIRWAYS LTD	51,131	9.350	478,074.850	
	MACQUARIE GROUP LTD DEF	25,840	242.440	6,264,649.600	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	38,949	53.910	2,099,740.590	

	CSL LTD	34,637	107.510	3,723,823.870	
	WESFARMERS LTD	81,020	86.470	7,005,799.400	
	COCHLEAR LTD	4,511	103.750	468,016.250	
	SUNCORP GROUP LTD	77,281	18.730	1,447,473.130	
	ASX LTD	13,985	49.200	688,062.000	
	COMPUTERSHARE LTD	36,653	36.850	1,350,663.050	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	158,364	8.000	1,266,912.000	
	SONIC HEALTHCARE LTD	32,380	20.200	654,076.000	
	BRAMBLES LTD	95,582	19.010	1,817,013.820	
	LYNAS RARE EARTHS LTD	64,695	17.770	1,149,630.150	
	CAR GROUP LTD	26,112	26.370	688,573.440	
	SIGMA HEALTHCARE LTD	365,817	2.640	965,756.880	
	REA GROUP LTD	3,764	143.000	538,252.000	
オーストラリア・ドル 小計				132,943,528.340 (15,059,842,890)	
カナダ・ドル	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	47,500	84.310	4,004,725.000	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	22,081	65.940	1,456,021.140	
	BROOKFIELD RENEWABLE SUBORDINATE V	9,700	50.980	494,506.000	
	CELESTICA INC	8,000	550.220	4,401,760.000	
	BOMBARDIER INC CLASS B	5,800	310.490	1,800,842.000	
	ATKINSREALIS GROUP INC	11,200	82.210	920,752.000	
	IMPERIAL OIL LTD	9,900	169.770	1,680,723.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,400	2,924.000	4,093,600.000	
	RESTAURANTS BRANDS INTERNATIONAL I	22,287	104.840	2,336,569.080	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	31,600	162.320	5,129,312.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	12,250	277.880	3,404,030.000	
	BCE INC	23,830	34.370	819,037.100	
	FRANCO NEVADA CORP	13,400	293.330	3,930,622.000	
	SUNCOR ENERGY INC	82,530	86.010	7,098,405.300	
	METRO INC	13,100	93.210	1,221,051.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	26,900	209.800	5,643,620.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	85,800	117.430	10,075,494.000	
	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	63,800	158.710	10,125,698.000	
	TORONTO DOMINION	115,000	164.010	18,861,150.000	
	GREAT WEST LIFECO INC	17,100	83.390	1,425,969.000	

ROYAL BANK OF CANADA	97,350	278.930	27,153,835.500	
TOURMALINE OIL CORP	25,400	63.200	1,605,280.000	
TC ENERGY CORP	72,550	97.040	7,040,252.000	
PEMBINA PIPELINE CORP	40,429	67.590	2,732,596.110	
BARRICK MINING CORP	116,500	56.250	6,553,125.000	
CAE INC	20,000	35.390	707,800.000	
THOMSON REUTERS CORP	8,873	114.090	1,012,320.570	
EMPIRE LTD CLASS A	7,900	49.330	389,707.000	
CCL INDUSTRIES INC CLASS B	10,150	83.940	851,991.000	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	27,200	26.570	722,704.000	
HYDRO ONE LTD	22,800	56.690	1,292,532.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	38,340	65.000	2,492,100.000	
STANTEC INC	7,900	101.090	798,611.000	
WSP GLOBAL INC	9,400	182.950	1,719,730.000	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	5,700	209.490	1,194,093.000	
EMERA INC	21,100	73.500	1,550,850.000	
TFI INTERNATIONAL INC	5,400	224.370	1,211,598.000	
CANADIAN UTILITIES LTD CLASS A	9,000	51.740	465,660.000	
WHITECAP RESOURCES INC	83,700	16.340	1,367,658.000	
ROGERS COMMUNICATIONS NON-VOTING I	25,100	53.920	1,353,392.000	
IVANHOE MINES LTD CLASS A	53,900	11.780	634,942.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	34,817	227.410	7,917,733.970	
ALAMOS GOLD INC CLASS A	29,000	49.190	1,426,510.000	
KINROSS GOLD CORP	83,200	35.760	2,975,232.000	
BANK OF MONTREAL	47,800	235.250	11,244,950.000	
POWER CORPORATION OF CANADA	37,100	86.620	3,213,602.000	
LUNDIN GOLD INC	6,600	76.810	506,946.000	
SHOPIFY SUBORDINATE VOTING INC CLA	85,400	151.470	12,935,538.000	
NUTRIEN LTD	33,519	94.610	3,171,232.590	
CAMECO CORP	30,300	141.030	4,273,209.000	
FIRSTSERVICE SUBORDINATE VOTING CO	2,900	200.250	580,725.000	
GFL ENVIRONMENTAL SUBORDINATE VOTI	17,100	50.300	860,130.000	
TELUS	10,800	16.640	179,712.000	
EQUINOX GOLD CORP	59,000	14.740	869,660.000	

	LUNR ROYALTIES CORP	1,386	23.700	32,848.200	
	TECK RESOURCES SUBORDINATE VOTING	31,900	90.610	2,890,459.000	
	CANADIAN TIRE LTD CLASS A	3,300	186.770	616,341.000	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	145,200	63.400	9,205,680.000	
	FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS SUB VOT	1,300	2,263.690	2,942,797.000	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	18,100	93.210	1,687,101.000	
	GEORGE WESTON LTD	10,311	104.010	1,072,447.110	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	29,400	67.400	1,981,560.000	
	DESCARTES SYSTEMS GROUP INC	6,000	102.020	612,120.000	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	38,600	107.040	4,131,744.000	
	ENBRIDGE INC	151,900	78.980	11,997,062.000	
	BROOKFIELD CORP CLASS A	138,387	63.200	8,746,058.400	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	116,700	56.320	6,572,544.000	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD	62,120	125.880	7,819,665.600	
	IA FINANCIAL INC	6,300	178.830	1,126,629.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	12,100	85.130	1,030,073.000	
	CANADIAN NATIONAL RAILWAY	36,050	166.470	6,001,243.500	
	CGI INC CLASS A	13,200	93.200	1,230,240.000	
	IGM FINANCIAL INC	5,600	80.510	450,856.000	
	TMX GROUP LTD	19,300	50.480	974,264.000	
	SAPUTO INC	16,700	42.010	701,567.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	47,700	43.390	2,069,703.000	
	FORTIS INC	35,300	79.610	2,810,233.000	
	RB GLOBAL INC	12,800	150.530	1,926,784.000	
	LUNDIN MINING CORP	47,600	37.860	1,802,136.000	
	CENOVUS ENERGY	90,900	39.470	3,587,823.000	
	DOLLARAMA INC	19,000	190.940	3,627,860.000	
	ALTAGAS LTD	21,600	55.200	1,192,320.000	
	KEYERA CORP	16,000	59.010	944,160.000	
	ARC RESOURCES LTD	39,400	31.760	1,251,344.000	
カナダ・ドル 小計				292,965,507.170 (33,600,214,017)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND INVESTMENT LTD	182,200	2.560	466,432.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	95,100	38.160	3,629,016.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	162,340	63.240	10,266,381.600	

	SINGAPORE AIRLINES LTD	117,975	7.000	825,825.000	
	KEPPEL LTD	111,100	10.650	1,183,215.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING (HOLDINGS	201,000	3.450	693,450.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING LTD	257,700	23.500	6,055,950.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LTD	583,750	4.270	2,492,612.500	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	121,500	10.570	1,284,255.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	69,500	6.130	426,035.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	63,300	22.580	1,429,314.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	126,000	3.570	449,820.000	
シンガポール・ドル 小計				29,202,306.100 (3,650,872,308)	
スイス・フラン	SANDOZ GROUP AG	29,136	67.040	1,953,277.440	
	BELIMO N AG	685	875.000	599,375.000	
	GALDERMA GROUP N AG	13,129	172.150	2,260,157.350	
	ROCHE PS PAR AG	48,970	330.000	16,160,100.000	
	AVOLTA AG	5,957	50.400	300,232.800	
	UBS GROUP AG	221,273	38.900	8,607,519.700	
	ROCHE HOLDING AG	2,021	334.000	675,014.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG	488	698.500	340,868.000	
	SIKA AG	10,627	155.150	1,648,779.050	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SPRUENGL	7	94,300.000	660,100.000	
	ABB LTD	109,246	81.620	8,916,658.520	
	SWISS RE AG	20,824	120.750	2,514,498.000	
	NESTLE SA	179,591	79.810	14,333,157.710	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,477	697.800	1,030,650.600	
	SCHINDLER HOLDING PAR AG	2,812	262.600	738,431.200	
	JULIUS BAER GRUPPE AG	14,225	64.700	920,357.500	
	SGS SA	11,432	89.480	1,022,935.360	
	SCHINDLER HOLDING AG	1,366	251.000	342,866.000	
	HELVETIA BALOISE HOLDING N AG	5,351	204.200	1,092,674.200	
	VAT GROUP AG	1,883	663.400	1,249,182.200	
	BKW N AG	1,366	139.000	189,874.000	
	ALCON AG	34,830	53.160	1,851,562.800	
	THE SWATCH GROUP AG	1,958	209.300	409,809.400	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	10,458	563.800	5,896,220.400	

	NOVARTIS AG	127,019	122.080	15,506,479.520	
	BARRY CALLEBAUT AG	248	1,144.000	283,712.000	
	COMPAGNIE FINANCIERE RICHEMONT SA	37,471	178.900	6,703,561.900	
	SWISSCOM AG	1,805	656.500	1,184,982.500	
	BC VAUD N	2,045	118.900	243,150.500	
	GEBERIT AG	2,231	509.200	1,136,025.200	
	GIVAUDAN SA	644	3,182.000	2,049,208.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	7,707	93.620	721,529.340	
	SONOVA HOLDING AG	3,411	200.600	684,246.600	
	LOGITECH INTERNATIONAL SA	10,014	88.400	885,237.600	
	LONZA GROUP AG	4,895	490.300	2,400,018.500	
	HOLCIM LTD AG	35,561	74.560	2,651,428.160	
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,933	857.000	1,656,581.000	
	KUEHNE UND NAGEL INTERNATIONAL AG	3,364	195.550	657,830.200	
	SWISS PRIME SITE AG	5,539	129.700	718,408.300	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SPRUENGL	65	9,190.000	597,350.000	
スイス・フラン 小計				111,794,050.550 (22,544,388,233)	
スウェーデン・クローナ	SAGAX CLASS B	17,099	159.200	2,722,160.800	
	OCTAVE INTELLIGENCE SDR PLC	16,024	173.400	2,778,561.600	
	ERICSSON CLASS B	208,093	116.600	24,263,643.800	
	VOLVO CLASS B	122,196	315.100	38,503,959.600	
	SKF CLASS B	26,539	237.900	6,313,628.100	
	TELE2 CLASS B	42,591	186.950	7,962,387.450	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN CLAS	115,365	188.900	21,792,448.500	
	SVENSKA HANDELSBANKEN CLASS A	107,177	138.350	14,827,937.950	
	SWEDBANK CLASS A	64,613	347.900	22,478,862.700	
	HENNES & MAURITZ CLASS B	33,305	171.250	5,703,481.250	
	SVENSKA CELLULOSA AKTIEBOLAGET SCA	47,261	100.050	4,728,463.050	
	SKANSKA CLASS B	26,006	240.200	6,246,641.200	
	SANDVIK	81,474	378.600	30,846,056.400	
	INVESTOR CLASS B	136,267	379.100	51,658,819.700	
	ATLAS COPCO CLASS A	198,254	185.950	36,865,331.300	
	SECURITAS CLASS B	38,260	157.100	6,010,646.000	

	TELIA COMPANY	183,539	51.680	9,485,295.520	
	ALFA LAVAL	22,779	530.800	12,091,093.200	
	ATLAS COPCO CLASS B	116,742	164.200	19,169,036.400	
	ASSA ABLOY CLASS B	76,833	332.400	25,539,289.200	
	TRELLEBORG CLASS B	15,170	407.200	6,177,224.000	
	SAAB CLASS B	25,218	521.600	13,153,708.800	
	INDUSTRIVARDEN CLASS A	8,360	517.000	4,322,120.000	
	FASTIGHETS BALDER CLASS B	55,857	51.420	2,872,166.940	
	INDUTRADE	21,257	188.900	4,015,447.300	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM	14,069	439.200	6,179,104.800	
	LUNDBERGFORETAGEN CLASS B	5,684	542.000	3,080,728.000	
	LATOUR INVESTMENT CLASS B	10,724	192.150	2,060,616.600	
	LIFCO CLASS B	16,684	307.800	5,135,335.200	
	NIBE INDUSTRIER CLASS B	112,295	36.290	4,075,185.550	
	BEIJER REF CLASS B	31,815	133.700	4,253,665.500	
	ESSITY CLASS B	45,054	265.100	11,943,815.400	
	BOLIDEN	22,377	533.600	11,940,367.200	
	EPIROC CLASS A	48,641	266.500	12,962,826.500	
	EPIROC CLASS B	30,338	227.600	6,904,928.800	
	EQT	34,034	287.500	9,784,775.000	
	EVOLUTION	9,658	726.200	7,013,639.600	
	HEXAGON CLASS B	163,456	79.000	12,913,024.000	
	ADDTECH CLASS B	20,221	321.800	6,507,117.800	
	INDUSTRIVARDEN CLASS C	12,629	501.200	6,329,654.800	
スウェーデン・クローナ 小計				491,613,195.510 (8,401,669,511)	
デンマーク・クローネ	NOVO NORDISK CLASS B	253,557	287.250	72,834,248.250	
	DANSKE BANK	49,304	339.400	16,733,777.600	
	A P MOLLER MAERSK CLASS A	192	17,250.000	3,312,000.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS	75,531	166.100	12,545,699.100	
	CARLSBERG CLASS B	7,313	844.000	6,172,172.000	
	NOVOZYMES CLASS B	27,742	387.000	10,736,154.000	
	COLOPLAST CLASS B	9,812	382.900	3,757,014.800	
	DSV	15,144	1,611.000	24,396,984.000	
	ROCKWOOL CLASS B	7,522	211.200	1,588,646.400	
	DEMANT	6,668	251.200	1,675,001.600	
	A P MOLLER MAERSK CLASS B	263	17,715.000	4,659,045.000	
	TRYG	24,066	151.100	3,636,372.600	
	PANDORA	5,905	643.800	3,801,639.000	

	GENMAB	4,805	1,619.000	7,779,295.000	
	OERSTED	36,406	156.300	5,690,257.800	
デンマーク・クローネ 小計				179,318,307.150 (4,457,853,115)	
ニュージーランド・ドル	MERIDIAN ENERGY LTD	102,620	5.950	610,589.000	
	INFRATIL LTD	70,808	14.810	1,048,666.480	
	AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT LTD	131,861	8.230	1,085,216.030	
	CONTACT ENERGY LTD	71,646	9.550	684,219.300	
	FISHER AND PAYKEL HEALTHCARE CORPO	45,686	39.450	1,802,312.700	
ニュージーランド・ドル 小計				5,231,003.510 (489,988,099)	
ノルウェー・クローネ	DNB BANK	63,982	291.000	18,618,762.000	
	VAR ENERGI	73,702	47.020	3,465,468.040	
	NORSK HYDRO	101,247	109.800	11,116,920.600	
	ORKLA	57,160	99.750	5,701,710.000	
	TELENOR	47,903	151.600	7,262,094.800	
	EQUINOR	55,356	348.400	19,286,030.400	
	YARA INTERNATIONAL	12,534	470.100	5,892,233.400	
	MOWI	34,248	195.400	6,692,059.200	
	GJENSIDIGE FORSIKRING	15,559	258.600	4,023,557.400	
	AKER BP	24,584	343.400	8,442,145.600	
	KONGSBERG GRUPPEN	32,894	294.200	9,677,414.800	
	SALMAR	5,266	538.000	2,833,108.000	
ノルウェー・クローネ 小計				103,011,504.240 (1,738,834,191)	
ユーロ	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	72,490	17.760	1,287,422.400	
	DAIMLER TRUCK HOLDING E AG	33,201	41.840	1,389,129.840	
	EXOR NV	6,343	66.900	424,346.700	
	DR ING HC F PORSCHE PRF AG	7,863	49.100	386,073.300	
	DSM FIRMENICH AG	11,853	73.800	874,751.400	
	FERROVIAL NV	34,011	58.300	1,982,841.300	
	LOTUS BAKERIES NV	29	11,700.000	339,300.000	
	SYENSQO NV	5,048	66.400	335,187.200	
	CVC CAPITAL PARTNERS PLC	15,300	12.950	198,135.000	
	HENSOLDT AG	4,360	75.620	329,703.200	
	FINANCIERE DE TUBIZE SA	1,423	241.800	344,081.400	

MAGNUM ICE CREAM NV	34,779	15.464	537,822.450	
CSG CLASS A NV	10,524	14.488	152,471.710	
VERISURE PLC	16,508	11.000	181,588.000	
ABIVAX SA	4,214	85.050	358,400.700	
BAYER AG	70,989	36.190	2,569,091.910	
EVONIK INDUSTRIES AG	18,445	15.870	292,722.150	
DEUTSCHE BANK AG	131,189	28.740	3,770,371.860	
COMMERZBANK AG	46,311	36.830	1,705,634.130	
VOLKSWAGEN NON-VOTING PREF AG	14,900	88.420	1,317,458.000	
SIEMENS N AG	53,571	264.500	14,169,529.500	
E.ON N	162,231	18.410	2,986,672.710	
BMW AG	20,274	67.000	1,358,358.000	
GEA GROUP AG	10,547	55.900	589,577.300	
CONTINENTAL AG	7,852	72.300	567,699.600	
BASF N	64,493	49.500	3,192,403.500	
ALLIANZ	27,492	386.400	10,622,908.800	
HENKEL & KGAA PREF AG	10,885	69.440	755,854.400	
RHEINMETALL AG	3,368	1,205.600	4,060,460.800	
RWE AG	41,295	57.460	2,372,810.700	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	43,194	8.446	364,816.520	
BRENNTAG	8,293	56.100	465,237.300	
FRESENIUS SE AND CO KGAA	30,524	37.670	1,149,839.080	
HOCHTIEF AG	1,062	485.400	515,494.800	
SAP	75,455	140.260	10,583,318.300	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESE	9,440	458.900	4,332,016.000	
ZALANDO	15,173	24.630	373,710.990	
HEIDELBERG MATERIALS AG	9,553	182.150	1,740,078.950	
RATIONAL AG	358	650.500	232,879.000	
CTS EVENTIM AG	4,128	50.450	208,257.600	
SARTORIUS PREF AG	1,819	231.200	420,552.800	
TALANX AG	4,255	101.200	430,606.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING PREF	11,035	30.840	340,319.400	
DELIVERY HERO	11,886	37.640	447,389.040	
NEMETSCHEK	4,158	56.300	234,095.400	
SCOUT24 N	5,022	74.450	373,887.900	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	24,157	34.630	836,556.910	
KNORR BREMSE AG	4,607	101.800	468,992.600	

SIEMENS ENERGY N AG	56,004	153.580	8,601,094.320	
BEIERSDORF AG	6,535	70.540	460,978.900	
MERCK	9,339	133.250	1,244,421.750	
ADIDAS N AG	11,648	176.350	2,054,124.800	
HENKEL AG	6,486	64.750	419,968.500	
DEUTSCHE TELEKOM N AG	246,532	28.320	6,981,786.240	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	13,580	39.670	538,718.600	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	52,184	48.015	2,505,614.760	
QIAGEN NV	14,768	31.980	472,280.640	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	94,365	80.060	7,554,861.900	
HANNOVER RUECK	4,357	228.200	994,267.400	
DEUTSCHE POST AG	66,500	51.720	3,439,380.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	13,082	249.500	3,263,959.000	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	3,896	312.000	1,215,552.000	
SYMRISE AG	9,558	82.200	785,667.600	
BMW PREF AG	3,862	67.250	259,719.500	
VONOVIA	51,834	20.390	1,056,895.260	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	55,664	22.810	1,269,695.840	
NN GROUP NV	19,004	73.280	1,392,613.120	
ARCELORMITTAL SA	30,823	60.600	1,867,873.800	
HEINEKEN NV	20,811	70.520	1,467,591.720	
AEGON LTD	89,232	7.294	650,858.200	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	63,593	36.370	2,312,877.410	
AKZO NOBEL NV	11,003	57.780	635,753.340	
WOLTERS KLUWER NV	16,333	61.100	997,946.300	
ING GROEP NV	211,076	25.960	5,479,532.960	
KONINKLIJKE KPN NV	276,731	4.456	1,233,113.330	
ASML HOLDING NV	28,047	1,629.600	45,705,391.200	
ABN AMRO BANK NV	44,835	34.670	1,554,429.450	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV	5,118	317.000	1,622,406.000	
ASR NEDERLAND NV	11,192	65.440	732,404.480	
ADYEN NV	1,948	828.400	1,613,723.200	
PROSUS NV CLASS N	94,546	39.295	3,715,185.070	
INPOST SA	17,987	15.320	275,560.840	
ASM INTERNATIONAL NV	3,386	1,015.000	3,436,790.000	
HEINEKEN HOLDING NV	8,622	64.150	553,101.300	
TOTALENERGIES	142,245	76.380	10,864,673.100	
MICHELIN	44,479	33.140	1,474,034.060	

LAIR LIQUIDE SOCIETE ANONYME POUR	46,043	168.300	7,749,036.900	
KERING SA	5,135	268.350	1,377,977.250	
SCHNEIDER ELECTRIC	39,617	265.300	10,510,390.100	
BOUYGUES SA	16,192	50.300	814,457.600	
BNP PARIBAS SA	71,552	96.690	6,918,362.880	
THALES SA	6,697	234.700	1,571,785.900	
DANONE SA	45,434	67.180	3,052,256.120	
CARREFOUR SA	42,384	16.725	708,872.400	
LOREAL SA	17,357	390.250	6,773,569.250	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN SA	32,182	75.760	2,438,108.320	
LEGRAND SA	18,434	133.550	2,461,860.700	
PERNOD RICARD SA	14,087	63.440	893,679.280	
REXEL SA	15,800	36.420	575,436.000	
SOCIETE GENERALE SA	45,840	73.400	3,364,656.000	
LVMH	17,982	510.600	9,181,609.200	
ACCOR SA	13,355	47.390	632,893.450	
CAPGEMINI	11,054	96.720	1,069,142.880	
PUBLICIS GROUPE SA	16,539	89.660	1,482,886.740	
BUREAU VERITAS SA	22,812	25.460	580,793.520	
EIFFAGE SA	4,897	126.500	619,470.500	
SODEXO SA	5,534	50.400	278,913.600	
IPSEN SA	2,393	157.800	377,615.400	
AMUNDI SA	4,435	82.550	366,109.250	
EURONEXT NV	5,555	148.200	823,251.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	8,241	64.080	528,083.280	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH SA	2,102	175.600	369,111.200	
ESSILORLUXOTTICA SA	21,760	182.700	3,975,552.000	
DASSAULT AVIATION SA	1,218	297.000	361,746.000	
AYVENS SA	23,761	11.760	279,429.360	
AXA SA	112,657	40.860	4,603,165.020	
RENAULT SA	13,431	27.770	372,978.870	
HERMES INTERNATIONAL	1,831	1,697.000	3,107,207.000	
STMICROELECTRONICS NV	45,382	67.750	3,074,630.500	
DASSAULT SYSTEMES	48,482	17.210	834,375.220	
ORANGE SA	134,550	17.835	2,399,699.250	
ALSTOM SA	24,735	16.190	400,459.650	
SANOFI SA	78,794	76.590	6,034,832.460	
VINCI SA	33,475	125.900	4,214,502.500	

AIRBUS	42,937	179.280	7,697,745.360	
VEOLIA ENVIRON. SA	42,637	35.460	1,511,908.020	
CREDIT AGRICOLE SA	64,621	16.725	1,080,786.220	
BIOMERIEUX SA	2,758	67.750	186,854.500	
ENGIE SA	128,298	27.510	3,529,477.980	
SAFRAN SA	24,874	306.100	7,613,931.400	
AEROPORTS DE PARIS SA	2,306	106.300	245,127.800	
GETLINK	17,512	18.410	322,395.920	
BOLLORE	44,212	5.435	240,292.220	
UCB SA	8,753	274.900	2,406,199.700	
KBC GROEP NV	16,599	114.600	1,902,245.400	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	5,259	80.400	422,823.600	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA	64,351	71.280	4,586,939.280	
AGEAS SA	10,740	66.600	715,284.000	
DIETEREN GROUP SA	1,502	169.500	254,589.000	
ELIA GROUP SA	3,143	135.900	427,133.700	
SOFINA SA	1,157	216.800	250,837.600	
ARGENX	4,472	783.600	3,504,259.200	
BUZZI	5,472	46.190	252,751.680	
PRYSMIAN	20,347	143.900	2,927,933.300	
GENERALI	58,542	41.170	2,410,174.140	
TENARIS SA	22,871	27.120	620,261.520	
UNICREDIT	126,151	73.300	9,246,868.300	
UNIPOL ASSICURAZIONI SPA	25,607	24.200	619,689.400	
TELECOM ITALIA	1,735,416	0.788	1,368,549.050	
INTESA SANPAOLO	1,006,630	5.840	5,878,719.200	
POSTE ITALIANE	32,631	28.230	921,173.130	
MONCLER	15,797	53.860	850,826.420	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA E FARM	7,482	50.800	380,085.600	
ENI	129,801	23.220	3,013,979.220	
BPER BANCA	113,674	13.044	1,482,763.650	
DAVIDE CAMPARI MILANO NV	42,024	5.436	228,442.460	
BANCO BPM	81,742	14.440	1,180,354.480	
BANCA MEDIOLANUM	14,725	20.590	303,187.750	
LEONARDO	29,244	53.480	1,563,969.120	
BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SP	136,762	10.716	1,465,541.590	
ENEL	547,690	9.794	5,364,075.860	
SNAM	145,713	6.432	937,226.010	

ITALGAS	43,746	10.650	465,894.900	
TERNA RETE ELETTRICA NAZIONALE	101,669	10.280	1,045,157.320	
FINECOBANK BANCA FINECO	44,217	21.930	969,678.810	
STELLANTIS NV	146,636	5.892	863,979.310	
FERRARI NV	8,727	306.850	2,677,879.950	
TELEFONICA SA	266,320	3.945	1,050,632.400	
ENDESA SA	22,672	38.210	866,297.120	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	406,654	20.090	8,169,678.860	
IBERDROLA SA	437,314	20.320	8,886,220.480	
BANCO DE SABADELL SA	343,233	2.946	1,011,164.410	
BANKINTER SA	45,176	14.440	652,341.440	
REPSOL SA	79,724	22.720	1,811,329.280	
BANCO SANTANDER	1,032,634	11.026	11,385,822.480	
AMADEUS IT GROUP SA	31,666	50.960	1,613,699.360	
NATURGY ENERGY GROUP SA	19,394	29.440	570,959.360	
MAPFRE SA	65,611	4.118	270,186.090	
CAIXABANK SA	251,540	11.890	2,990,810.600	
INTERNATIONAL AIRLINES GROUP SA	85,007	5.050	429,285.350	
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y	12,757	125.500	1,601,003.500	
AENA SME SA	54,195	25.940	1,405,818.300	
CELLNEX TELECOM	34,526	28.870	996,765.620	
ACCIONA SA	1,776	259.600	461,049.600	
INDRA SISTEMAS SA	5,355	56.040	300,094.200	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	78,823	55.940	4,409,358.620	
REDEIA CORPORACION SA	29,379	15.150	445,091.850	
UPM-KYMMENE	38,134	24.700	941,909.800	
NOKIA	361,305	12.965	4,684,319.320	
WARTSILA	35,179	33.060	1,163,017.740	
STORA ENSO CLASS R	40,694	9.652	392,778.480	
ELISA	10,248	40.320	413,199.360	
SAMPO CLASS A	171,419	9.014	1,545,170.860	
FORTUM	32,023	20.350	651,668.050	
KESKO CLASS B	19,658	21.400	420,681.200	
KONE CORP CLASS B	23,668	48.720	1,153,104.960	
NESTE	30,199	27.710	836,814.290	
ORION CLASS B	7,807	68.350	533,608.450	

	METSO CORPORATION	46,255	14.800	684,574.000	
	NORDEA BANK	221,756	16.350	3,625,710.600	
	VERBUND AG	4,906	57.650	282,830.900	
	OMV AG	10,513	58.700	617,113.100	
	ERSTE GROUP BANK AG	22,248	109.000	2,425,032.000	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	9,344	50.350	470,470.400	
	BAWAG GROUP AG	5,220	161.400	842,508.000	
	RYANAIR HOLDINGS PLC	27,444	25.090	688,569.960	
	AIB GROUP PLC	152,537	10.355	1,579,520.630	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	68,678	17.540	1,204,612.120	
	KINGSPAN GROUP PLC	11,074	84.050	930,769.700	
	JERONIMO MARTINS SA	20,501	17.760	364,097.760	
	EDP ENERGIAS DE PORTUGAL SA	210,112	4.467	938,570.300	
	BANCO COMERCIAL PORTUGUES SA	593,369	0.950	563,700.550	
	GALP ENERGIA SGPS SA CLASS B	29,783	19.120	569,450.960	
	EDP RENEWABLES SA	22,691	13.630	309,278.330	
	KERRY GROUP PLC	11,449	75.800	867,834.200	
ユーロ 小計				471,821,127.000 (87,673,801,819)	
香港・ドル	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	108,000	55.800	6,026,400.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	153,000	31.340	4,795,020.000	
	MTR CORPORATION CORP LTD	121,000	31.720	3,838,120.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD	102,500	117.000	11,992,500.000	
	SINO LAND LTD	298,000	11.300	3,367,400.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	211,169	69.450	14,665,687.050	
	SWIRE PACIFIC LTD A	27,500	82.950	2,281,125.000	
	CLP HOLDINGS LTD	129,500	73.400	9,505,300.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT LTD	104,507	26.940	2,815,418.580	
	HONG KONG AND CHINA GAS LTD	871,475	6.820	5,943,459.500	
	WH GROUP LTD	606,000	8.820	5,344,920.000	
	HONG KONG EXCHANGES AND CLEARING L	94,800	380.600	36,080,880.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	138,169	46.280	6,394,461.320	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE HOLDING	47,000	57.650	2,709,550.000	
	AIA GROUP LTD	827,400	74.550	61,682,670.000	

	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	105,000	34.480	3,620,400.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT COMPA	120,000	22.480	2,697,600.000	
	SANDS CHINA LTD	188,800	14.700	2,775,360.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES LTD	108,000	118.700	12,819,600.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	291,500	48.260	14,067,790.000	
香港・ドル 小計				213,423,661.450 (4,362,379,640)	
合計				988,201,865,721 [988,201,865,721]	

(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 REIT INC (REIT)	10,637	1,989,438.110	
		SIMON PROPERTY GROUP REIT INC (REIT)	24,707	5,411,821.280	
		SBA COMMUNICATIONS REIT CORP CLASS (REIT)	8,000	1,638,320.000	
		EQUITY RESIDENTIAL REIT (REIT)	25,600	1,723,904.000	
		EQUINIX REIT INC (REIT)	7,508	7,927,321.800	
		AMERICAN TOWER REIT CORP (REIT)	35,400	6,626,172.000	
		KIMCO REALTY REIT CORP (REIT)	50,800	1,316,228.000	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES REIT (REIT)	20,400	968,388.000	
		INVITATION HOMES INC (REIT)	40,900	1,213,912.000	
		VICI PPTYS INC (REIT)	83,100	2,370,012.000	
		VENTAS REIT INC (REIT)	36,200	3,062,520.000	
		WEYERHAEUSER REIT (REIT)	54,814	1,362,127.900	
		CROWN CASTLE INC (REIT)	33,200	3,059,712.000	
		IRON MOUNTAIN INC (REIT)	22,600	2,875,624.000	
		SUN COMMUNITIES REIT INC (REIT)	9,300	1,180,635.000	
		PROLOGIS REIT INC (REIT)	70,854	10,538,823.960	
		ESSEX PROPERTY TRUST REIT INC (REIT)	4,940	1,401,725.000	

	WELLTOWER INC (REIT)	53,600	11,482,728.000	
	MID AMERICA APARTMENT COMMUNITIES (REIT)	8,800	1,222,584.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT REIT INC (REIT)	51,400	1,130,800.000	
	REALTY INCOME REIT CORP (REIT)	70,895	4,446,534.400	
	PUBLIC STORAGE REIT (REIT)	12,000	3,911,280.000	
	REGENCY CENTERS REIT CORP (REIT)	12,500	1,003,500.000	
	W. P. CAREY REIT INC (REIT)	16,700	1,281,057.000	
	DIGITAL REALTY TRUST REIT INC (REIT)	26,100	4,807,620.000	
	EXTRA SPACE STORAGE REIT INC (REIT)	16,100	2,424,660.000	
アメリカ・ドル 小計			86,377,448.450 (13,835,939,693)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP REIT PLC (REIT)	55,208	362,716.560	
	SEGRO REIT PLC (REIT)	89,543	672,109.750	
イギリス・ポンド 小計			1,034,826.310 (222,963,677)	
オーストラリア・ドル	TRANSURBAN GROUP STAPLED UNITS	222,715	3,476,581.150	
	APA GROUP UNITS	94,722	1,029,628.140	
	SCENTRE GROUP UNIT (REIT)	372,798	1,439,000.280	
	STOCKLAND STAPLED UNITS LTD	170,568	721,502.640	
	GOODMAN GROUP UNITS	141,904	4,472,814.080	
	VICINITY CENTRES (REIT)	282,371	728,517.180	
オーストラリア・ドル 小計			11,868,043.470 (1,344,411,964)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	324,100	819,973.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL T	473,491	1,107,968.940	
シンガポール・ドル 小計			1,927,941.940 (241,031,301)	
ユーロ	UNIBAIL RODAMCO WE STAPLED UNITS	7,716	777,001.200	
	GECINA SA (REIT)	3,322	244,499.200	

		KLEPIERRE REIT SA (REIT)	15,357	560,530.500	
		COVIVIO SA (REIT)	3,810	209,740.500	
	ユーロ 小計			1,791,771.400 (332,946,961)	
	香港・ドル	LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	206,000	7,560,200.000	
		HKT TRUST AND HKT UNITS LTD	269,000	3,249,520.000	
	香港・ドル 小計			10,809,720.000 (220,950,677)	
投資証券 合計				16,198,244,273 [16,198,244,273]	
合計				16,198,244,273 [16,198,244,273]	

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 513銘柄 投資証券 26銘柄	98.2%	1.8%	77.9%
イギリス・ポンド	株式 62銘柄 投資証券 2銘柄	99.4%	0.6%	3.6%
イスラエル・シュケル	株式 13銘柄	100%	-%	0.3%
オーストラリア・ドル	株式 41銘柄 投資証券 6銘柄	91.8%	8.2%	1.6%
カナダ・ドル	株式 84銘柄	100%	-%	3.3%
シンガポール・ドル	株式 12銘柄 投資証券 2銘柄	93.8%	6.2%	0.4%
スイス・フラン	株式 40銘柄	100%	-%	2.2%
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%	-%	0.4%
ニュージーランド・ドル	株式 5銘柄	100%	-%	0.0%
ノルウェー・クローネ	株式 12銘柄	100%	-%	0.2%

ユーロ	株式 215銘柄 投資証券 4銘柄	99.6%	0.4%	8.8%
香港・ドル	株式 20銘柄 投資証券 2銘柄	95.2%	4.8%	0.5%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

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

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間(2025年6月17日から2026年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

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

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	75,592,269	106,470,179
親投資信託受益証券	6,954,993,897	10,244,197,550
未収入金	1,080,000	5,140,000
流動資産合計	7,031,666,166	10,355,807,729
資産合計	7,031,666,166	10,355,807,729
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,480,399	7,036,857
未払受託者報酬	732,798	1,047,087
未払委託者報酬	14,473,583	20,680,731
その他未払費用	183,123	261,684
流動負債合計	20,869,903	29,026,359
負債合計	20,869,903	29,026,359
純資産の部		
元本等		
元本	※1 2,036,904,712	※1 2,176,684,994
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,973,891,551	8,150,096,376
（分配準備積立金）	2,229,182,513	4,384,903,039
元本等合計	7,010,796,263	10,326,781,370
純資産合計	7,010,796,263	10,326,781,370
負債純資産合計	7,031,666,166	10,355,807,729

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 自　2024年6月18日 至　2025年6月16日	第10期 自　2025年6月17日 至　2026年6月15日
営業収益		
受取利息	208,199	542,996
有価証券売買等損益	357,364,824	2,778,036,653
営業収益合計	357,573,023	2,778,579,649
営業費用		
受託者報酬	1,446,090	1,923,379
委託者報酬	28,561,980	37,988,328
その他費用	361,373	480,690
営業費用合計	30,369,443	40,392,397
営業利益又は営業損失（△）	327,203,580	2,738,187,252
経常利益又は経常損失（△）	327,203,580	2,738,187,252
当期純利益又は当期純損失（△）	327,203,580	2,738,187,252
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	25,473,014	250,457,392
期首剰余金又は期首欠損金（△）	4,469,103,896	4,973,891,551
剰余金増加額又は欠損金減少額	963,758,824	1,543,757,533
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	963,758,824	1,543,757,533
剰余金減少額又は欠損金増加額	760,701,735	855,282,568
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	760,701,735	855,282,568
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,973,891,551	8,150,096,376

(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10期 自2025年6月17日 至2026年6月15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 2025年6月15日が休日のため、前計算期間末日を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9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
1.　※1 期首元本額	1,953,160,126円	2,036,904,712円
期中追加設定元本額	415,794,997円	480,303,056円
期中一部解約元本額	332,050,411円	340,522,774円
2.　計算期間末日における受益権の総数	2,036,904,712口	2,176,684,994口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日	第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15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（189,093円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（301,541,473円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,744,709,038円）及び分配準備積立金（1,927,451,947円）より分配対象額は4,973,891,551円（1万口当たり24,418.87円）であり、分配を行っておりません。	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（509,933円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（2,487,219,927円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,765,193,337円）及び分配準備積立金（1,897,173,179円）より分配対象額は8,150,096,376円（1万口当たり37,442.70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10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	第10期 2026年6月15日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	327,366,855	2,577,397,903
合計	327,366,855	2,577,397,903

（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9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.4419円 (34,419円)	4.7443円 (47,443円)

(4)【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	508,620,927	2,157,112,213	
	外国株式インデックスマザーファンド	849,822,969	8,087,085,337	
親投資信託受益証券 合計			10,244,197,550	
合計			10,244,197,550	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2025年6月16日現在 金 額（円）	2026年6月15日現在 金 額（円）

資産の部		
流動資産		
預金	700,287,179	1,537,875,126
コール・ローン	584,127,696	437,628,402
株式	41,713,943,384	70,051,149,336
投資証券	2,786,106,592	4,367,322,917
派生商品評価勘定	82,448,202	502,633,024
未収入金	1,923,639	6,522,437
未収配当金	231,706,961	359,174,938
差入委託証拠金	763,587,592	1,594,474,678
流動資産合計	46,864,131,245	78,856,780,858
資産合計	46,864,131,245	78,856,780,858
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,776,000	2,081,700
流動負債合計	10,776,000	2,081,700
負債合計	10,776,000	2,081,700
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	15,838,866,034	18,592,969,167
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	31,014,489,211	60,261,729,991
元本等合計	46,853,355,245	78,854,699,158
純資産合計	46,853,355,245	78,854,699,158
負債純資産合計	46,864,131,245	78,856,780,858

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2026年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2025年6月16日現在	2026年6月15日現在
1.　※1 期首	2024年6月18日	2025年6月17日
期首元本額	13,426,251,057円	15,838,866,034円
期中追加設定元本額	3,062,196,792円	3,313,846,545円
期中一部解約元本額	649,581,815円	559,743,412円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
新興国株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	133,899,697円	130,613,351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）	477,988,547円	508,620,927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）	372,793,908円	392,675,463円
Ｄ－Ｉ'ｓ 新興国株式インデックス	108,128,077円	100,780,733円
ｉＦｒｅｅ 新興国株式インデックス	8,696,050,730円	10,627,385,876円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	3,894,680,608円	3,804,874,441円
ダイワ新興国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	5,190,817円	765,620,909円

ＤＣダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド	1,788,688,257円	1,940,644,412円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式	265,356,693円	226,384,887円
ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド	96,088,700円	95,368,168円
計	15,838,866,034円	18,592,969,167円
2.　期末日における受益権の総数	15,838,866,034口	18,592,969,167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2025年6月17日 至2026年6月15日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。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	2026年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2025年6月16日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2026年6月15日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	2,141,693,559	9,518,827,326
投資証券	261,765,222	469,243,065
合計	2,403,458,781	9,988,070,391

（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	2025年6月16日現在				2026年6月15日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買建	1,722,483,620	-	1,804,831,182	82,347,562	3,334,797,030	-	3,836,439,944	501,642,914
合計	1,722,483,620	-	1,804,831,182	82,347,562	3,334,797,030	-	3,836,439,944	501,642,914

（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6月16日現在				2026年6月15日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	14,306,360	-	14,407,000	100,640	174,885,260	-	175,875,370	990,110
アメリカ・ドル	14,306,360	-	14,407,000	100,640	174,885,260	-	175,875,370	990,110
合計	14,306,360	-	14,407,000	100,640	174,885,260	-	175,875,370	990,110

（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6月16日現在	2026年6月15日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.9581円 (29,581円)	4.2411円 (42,411円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	SURGUTNEFTEGAZ ADR REPRESENTING P	29,000	0.000	0.000	
	VIPSHOP HOLDINGS SPONSORED ADS REP	30,300	13.920	421,776.000	
	IQIYI ADS REPRESENTING CLASS A IN	191,700	1.030	197,451.000	
	PDD HOLDINGS ADS INC	30,200	81.560	2,463,112.000	
	DAQO NEW ENERGY ADR REPRESENTING	15,800	15.710	248,218.000	
	SBERBANK ROSSII	698,708	0.000	0.000	
	BANK VTB	76,486	0.000	0.000	
	NK LUKOIL	23,088	0.000	0.000	
	MOBILNYE TELESISTEMY	70,700	0.000	0.000	
	NK ROSNEFT	97,499	0.000	0.000	
	MAGNIT	4,678	0.000	0.000	
	SURGUTNEFTEGAZ	360,750	0.000	0.000	
	TATNEFT	57,648	0.000	0.000	
	GAZPROM	853,478	0.000	0.000	
	GMK NORILSKIY NIKEL	182,900	0.000	0.000	
	NOVATEK	26,980	0.000	0.000	
	QFIN HOLDINGS ADR INC	31,900	15.400	491,260.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	7,290	0.000	0.000	

	MMC NORILSK NICKEL PJSC SPONSORED	3	0.000	0.000	
	PUBLIC JOINT STOCK COMPANY SEVERST	13,460	0.000	0.000	
	TATNEFT PREF	21,009	0.000	0.000	
	AFK SISTEMA	319,200	0.000	0.000	
	INTER RAO EES	2,726,100	0.000	0.000	
	AK ALROSA	180,310	0.000	0.000	
	MOSCOW EXCHANGE	56,619	0.000	0.000	
	AEROFLOT ROSSIYSKIYE AVIALINII	164,910	0.000	0.000	
アメリカ・ドル 小計				3,821,817.000 (612,178,648)	
インド・ルピー	JIO FINANCIAL SERVICES LTD	169,497	235.890	39,982,647.330	
	TATA MOTORS LTD	69,146	390.300	26,987,683.800	
	VEDANTA ALUMINIUM METAL LTD	236,524	121.025	28,625,317.100	
	VEDANTA POWER LTD	236,524	121.025	28,625,317.100	
	VEDANTA IRON AND STEEL	236,524	121.025	28,625,317.100	
	VEDANTA OIL AND GAS LTD	236,524	121.025	28,625,317.100	
	IDFC FIRST BANK LTD	445,582	76.500	34,087,023.000	
	HDFC LIFE INSURANCE COMPANY LTD	38,110	555.350	21,164,388.500	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	6,590	4,709.700	31,036,923.000	
	TATA STEEL LTD	492,049	197.860	97,356,815.140	
	CIPLA LTD	24,525	1,389.400	34,075,035.000	
	AXIS BANK LTD	105,192	1,356.300	142,671,909.600	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	4,372	13,366.000	58,436,152.000	
	TATA POWER LTD	77,706	393.550	30,581,196.300	
	FEDERAL BANK LTD	106,710	315.700	33,688,347.000	
	BANK OF BARODA LTD	140,482	274.750	38,597,429.500	
	ASIAN PAINTS LTD	12,359	2,747.400	33,955,116.600	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	26,987	2,168.800	58,529,405.600	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	78,937	388.900	30,698,599.300	
	STATE BANK OF INDIA	130,439	1,017.150	132,676,028.850	
	NTPC LTD	174,842	353.900	61,876,583.800	
	POWER FINANCE CORPORATION LTD	100,982	421.050	42,518,471.100	
	JSW STEEL LTD	25,711	1,297.600	33,362,593.600	
	POWER GRID CORPORATION OF INDIA LT	178,525	284.800	50,843,920.000	
	INDIAN OIL CORP LTD	195,313	140.940	27,527,414.220	

BAJAJ FINSERV LTD	19,635	1,689.100	33,165,478.500	
BHARAT PETROLEUM LTD	122,736	302.350	37,109,229.600	
PUNJAB NATIONAL BANK	287,907	106.880	30,771,500.160	
STEEL AUTHORITY OF INDIA LTD	275,488	184.090	50,714,585.920	
JINDAL STEEL LTD	27,152	1,148.500	31,184,072.000	
CANARA BANK LTD	239,968	131.670	31,596,586.560	
UNION BANK OF INDIA LTD	185,317	170.050	31,513,155.850	
ULTRATECH CEMENT LTD	3,424	11,117.000	38,064,608.000	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	228,021	403.300	91,960,869.300	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNATIONA	222,259	143.400	31,871,940.600	
SHRIRAM FINANCE LTD	52,355	954.950	49,996,407.250	
TECH MAHINDRA LTD	37,613	1,429.200	53,756,499.600	
YES BANK LTD	1,679,651	23.020	38,665,566.020	
REC LTD	163,812	348.050	57,014,766.600	
ADANI POWER LTD	204,131	223.070	45,535,502.170	
COAL INDIA LTD	141,624	443.500	62,810,244.000	
INDUSIND BANK LTD	35,937	917.350	32,966,806.950	
BAJAJ FINANCE LTD	59,204	918.300	54,367,033.200	
INDUS TOWERS LTD	89,734	421.200	37,795,960.800	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	108,485	1,021.600	110,828,276.000	
GRASIM INDUSTRIES LTD	10,300	3,105.500	31,986,650.000	
WIPRO LTD	196,473	180.140	35,392,646.220	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	60,850	2,161.400	131,521,190.000	
INFOSYS LTD	239,800	1,116.400	267,712,720.000	
LARSEN AND TOUBRO LTD	25,318	4,049.300	102,520,177.400	
TATA MOTORS PASSENGER VEHICLES LTD	195,737	390.000	76,337,430.000	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	28,596	1,275.400	36,471,338.400	
HDFC BANK LTD	556,370	772.450	429,768,006.500	
ICICI BANK LTD	236,052	1,340.800	316,498,521.600	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	199,330	1,293.000	257,733,690.000	
OIL AND NATURAL GAS LTD	179,711	246.200	44,244,848.200	
ITC LTD	241,845	285.100	68,950,009.500	
MAHINDRA AND MAHINDRA LTD	35,269	3,042.900	107,320,040.100	
HERO MOTOCORP LTD	7,610	4,962.600	37,765,386.000	
BHARTI AIRTEL LTD	78,627	1,822.500	143,297,707.500	
UPL LTD	58,963	610.100	35,973,326.300	

	SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	29,991	1,807.700	54,214,730.700	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	50,656	1,109.600	56,207,897.600	
	VEDANTA LTD	236,524	309.650	73,239,656.600	
インド・ルピー 小計				4,434,000,013.340 (7,537,800,023)	
インドネシア・ルピア	ASTRA INTERNATIONAL	973,000	4,740.000	4,612,020,000.000	
	TELKOM INDONESIA	3,453,900	2,860.000	9,878,154,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA	1,500,000	3,560.000	5,340,000,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA	1,899,900	5,925.000	11,256,907,500.000	
	BANK MANDIRI (PERSERO)	2,938,800	4,200.000	12,342,960,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA (PERSERO)	6,015,500	2,850.000	17,144,175,000.000	
インドネシア・ルピア 小計				60,574,216,500.000 (545,167,949)	
オフショア・人民元	CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	667,200	2.650	1,768,080.000	
	INDUSTRIAL BANK LTD A	408,500	18.610	7,602,185.000	
	BANK OF BEIJING LTD A	489,100	5.270	2,577,557.000	
	GUOTAI HAITONG SECURITIES LTD A	53,300	17.680	942,344.000	
	PING AN INSURANCE (GROUP) OF CHINA	119,053	54.010	6,430,052.530	
	INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF	670,900	7.780	5,219,602.000	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING L	51,400	16.340	839,876.000	
	GREAT WALL MOTOR LTD A	20,900	17.600	367,840.000	
	CHINA MOLYBDENUM LTD A	49,200	19.110	940,212.000	
	KWEICHOW MOUTAI LTD A	3,200	1,291.910	4,134,112.000	
	ANHUI CONCH CEMENT LTD A	70,000	18.710	1,309,700.000	
	BANK OF JIANGSU CORPORATION LTD A	261,900	11.890	3,113,991.000	
	POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GRO	353,500	5.210	1,841,735.000	
	SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK L	616,600	9.670	5,962,522.000	
	CITIC SECURITIES LTD A	62,000	26.290	1,629,980.000	
	CHINA MERCHANTS BANK LTD A	220,240	39.340	8,664,241.600	

PING AN BANK LTD A	426,200	11.240	4,790,488.000	
GF SECURITIES LTD A	33,800	20.080	678,704.000	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY LT	7,300	394.850	2,882,405.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERI	1,883,500	4.770	8,984,295.000	
HAIER SMART HOME LTD A	44,100	21.130	931,833.000	
SAIC MOTOR CORP LTD A	224,200	10.920	2,448,264.000	
TSINGTAO BREWERY LTD A	3,400	60.560	205,904.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY LTD A	109,700	27.000	2,961,900.000	
S.F. HOLDING LTD A	38,400	34.360	1,319,424.000	
XIAMEN C&D INC A	258,400	9.540	2,465,136.000	
CHINA GALAXY SECURITIES LTD A	43,000	12.400	533,200.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK LT	125,400	7.000	877,800.000	
POWER CONSTRUCTION CORPORATION OF	558,000	4.820	2,689,560.000	
CHINA COAL ENERGY LTD A	53,300	16.180	862,394.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS LTD A	253,090	14.570	3,687,521.300	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD A	674,100	2.680	1,806,588.000	
ALUMINUM CORPORATION OF CHINA LTD	82,200	10.800	887,760.000	
JIANGXI COPPER LTD A	20,400	43.050	878,220.000	
YANKUANG ENERGY GROUP LTD A	73,150	22.950	1,678,792.500	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP A	102,600	10.700	1,097,820.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD A	998,800	6.800	6,791,840.000	
BANK OF CHINA LTD A	521,000	6.290	3,277,090.000	
PETROCHINA LTD A	339,502	10.380	3,524,030.760	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP A	725,300	4.940	3,582,982.000	
CHINA YANGTZE POWER LTD A	113,000	28.280	3,195,640.000	
BANK OF COMMUNICATIONS LTD A	901,400	7.140	6,435,996.000	
CHINA SHENHUA ENERGY LTD A	59,460	46.140	2,743,484.400	
CHINA VANKE LTD A	648,900	3.160	2,050,524.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE (GROUP) LT	65,076	32.860	2,138,397.360	
CHINA CITIC BANK CORP LTD A	153,900	7.680	1,181,952.000	

	CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD A	1,027,500	3.630	3,729,825.000	
	THE PEOPLES INSURANCE COMPANY (GRO	87,400	7.020	613,548.000	
	CHINA EVERBRIGHT BANK LTD A	1,248,900	3.230	4,033,947.000	
	CRRC CORP LTD A	272,400	5.760	1,569,024.000	
	CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATION	669,200	4.370	2,924,404.000	
	CGN POWER LTD A	135,900	4.370	593,883.000	
	HUATAI SECURITIES LTD A	45,800	19.970	914,626.000	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD A	795,100	4.570	3,633,607.000	
	BAOSHAN IRON & STEEL LTD A	417,400	6.020	2,512,748.000	
	NEW CHINA LIFE INSURANCE LTD A	11,000	61.460	676,060.000	
	ZTE CORP A	21,500	36.350	781,525.000	
	HUA XIA BANK LTD A	395,700	6.990	2,765,943.000	
	BYD LTD A	18,200	91.600	1,667,120.000	
	WEICHAI POWER LTD A	41,000	28.000	1,148,000.000	
	ZIJIN MINING GROUP LTD A	50,000	29.090	1,454,500.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL INC A	129,200	8.050	1,040,060.000	
	POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA LTD A	420,000	5.200	2,184,000.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP L	11,800	32.820	387,276.000	
	CHINA ZHESHANG BANK LTD A	454,300	3.080	1,399,244.000	
オフショア・人民元 小計				164,963,315.450 (3,908,393,351)	
サウジアラビア・リアル	SAUDI ARABIAN MINING	39,437	62.050	2,447,065.850	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES	27,799	55.750	1,549,794.250	
	SAUDI TELECOM	48,074	44.120	2,121,024.880	
	AL RAJHI BANK	79,719	67.000	5,341,173.000	
	ALINMA BANK	106,099	25.100	2,663,084.900	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	74,110	40.760	3,020,723.600	
	SAUDI ARABIAN OIL	162,662	26.880	4,372,354.560	
サウジアラビア・リアル 小計				21,515,221.040 (920,206,003)	
シンガポール・ドル	YANGZIJIANG SHIPBUILDING (HOLDINGS	111,100	3.450	383,295.000	

シンガポール・ドル 小計				383,295.000 (47,919,540)	
タイ・バーツ	SCB X PUBLIC COMPANY LIMITED NON-V	242,200	140.000	33,908,000.000	
	SIAM CEMENT NON-VOTING DR PCL	79,000	237.000	18,723,000.000	
	KASIKORNBANK PUBLIC NON-VOTING DR	253,200	203.000	51,399,600.000	
	TMBTHANACHART BANK NON-VOTING DR P	4,932,100	2.360	11,639,756.000	
	INDORAMA VENTURES NON-VOTING DR PC	548,900	22.600	12,405,140.000	
	ADVANCED INFO SERVICE NON-VOTING D	48,700	366.000	17,824,200.000	
	KRUNG THAI BANK PUBLIC NON-VOTING	662,000	35.250	23,335,500.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NON	677,300	18.000	12,191,400.000	
	PTT EXPLORATION AND PRODUCTION NON	221,100	142.500	31,506,750.000	
	PTT NON-VOTING DR PCL	1,361,700	36.000	49,021,200.000	
	THAI OIL NON-VOTING DR PCL	276,800	44.500	12,317,600.000	
	CP ALL NON-VOTING DR PCL	566,100	45.500	25,757,550.000	
	BANGKOK BANK NON-VOTING DR PCL	98,000	172.500	16,905,000.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS NON-VOTING	522,300	19.100	9,975,930.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL NON-VOTING DR	598,700	34.000	20,355,800.000	
タイ・バーツ 小計				347,266,426.000 (1,708,550,816)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	4,667,815	73.600	343,551,184.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE	13,760	75,500.000	1,038,880,000.000	
	BANCO DE CHILE	3,285,142	182.000	597,895,844.000	
チリ・ペソ 小計				1,980,327,028.000 (353,056,663)	
トルコ・リラ	TURKIYE GARANTI BANKASI A	152,796	135.900	20,764,976.400	
	AKBANK A	482,071	72.600	34,998,354.600	
	TURKIYE IS BANKASI C	1,672,450	14.310	23,932,759.500	

	TURKCELL ILETISIM HIZMETLERI A	192,227	110.700	21,279,528.900	
	TURKIYE PETROL RAFINERILERI A	215,383	233.800	50,356,545.400	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI	902,029	39.360	35,503,861.440	
	HACI OMER SABANCI HOLDING A	253,397	95.950	24,313,442.150	
	YAPI VE KREDI BANKASI A	659,929	38.100	25,143,294.900	
	KOC HOLDING A	499,434	187.500	93,643,875.000	
	TURK HAVA YOLLARI AO A	175,283	307.750	53,943,343.250	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR A	96,264	380.000	36,580,320.000	
トルコ・リラ 小計				420,460,301.540 (1,458,955,200)	
ブラジル・レアル	REDE DOR SAO LUIZ SA	48,500	34.080	1,652,880.000	
	AXIA ENERGIA PRF SA	23,216	50.360	1,169,157.760	
	LOCALIZA RENT A CAR PRF SA	3,842	39.230	150,721.660	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA COPEL	209,100	14.610	3,054,951.000	
	ENERGISA UNITS SA	46,040	47.400	2,182,296.000	
	BCO BTG PACTUAL UNT SA	35,700	50.390	1,798,923.000	
	VIBRA ENERGIA SA	150,255	29.150	4,379,933.250	
	TIM SA	73,200	22.510	1,647,732.000	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	313,800	8.100	2,541,780.000	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMEN	170,460	11.400	1,943,244.000	
	PETROLEO BRASILEIRO PREF SA	1,050,100	41.180	43,243,118.000	
	BANCO BRADESCO PREF SA	752,659	17.800	13,397,330.200	
	ITAU UNIBANCO HOLDING PREF SA	470,556	40.600	19,104,573.600	
	COMPANHIA SIDERURGICA NACIONAL SA	314,300	6.050	1,901,515.000	
	VALE SA	724,290	79.170	57,342,039.300	
	GERDAU PREF SA	353,292	23.880	8,436,612.960	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	846,900	46.190	39,118,311.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS PRE	263,574	10.730	2,828,149.020	
	ITAUSA INVESTIMENTOS ITAU PREF SA	266,805	12.900	3,441,784.500	
	BANCO DO BRASIL SA	414,900	19.460	8,073,954.000	
	COSAN INDUSTRIA E COMERCIO SA	255,300	3.340	852,702.000	
	AXIA ENERGIA SA	87,980	52.000	4,574,960.000	

	EMBRAER SA	22,200	72.850	1,617,270.000	
	MOTIVA INFRAESTRUTURA DE MOBILIDAD	124,700	13.950	1,739,565.000	
	COMPANHIA DE SANEAMENTO BASICO DE	116,541	27.540	3,209,539.140	
	LOJAS RENNER SA	125,092	15.380	1,923,914.960	
	SUZANO SA	84,345	41.520	3,502,004.400	
	LOCALIZA RENT A CAR SA	69,600	40.700	2,832,720.000	
	MARFRIG GLOBAL FOODS SA	186,716	15.990	2,985,588.840	
	B3 BRASIL BOLSA BALCAO SA	281,100	15.230	4,281,153.000	
	EQUATORIAL SA	100,000	38.770	3,877,000.000	
	WEG SA	36,600	42.610	1,559,526.000	
	COMPANHIA ENERGETICA MINAS GERAIS	12,309	15.920	195,959.280	
	BANCO SANTANDER BRASIL UNITS SA	67,700	27.130	1,836,701.000	
	RAIA DROGASIL	71,314	17.460	1,245,142.440	
	TELEFONICA BRASIL SA	78,600	33.530	2,635,458.000	
	PETRO RIO SA	39,200	61.340	2,404,528.000	
	KLABIN UNITS SA	97,252	16.880	1,641,613.760	
	ULTRAPAR PARTICIPOES SA	135,700	24.800	3,365,360.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	43,527	41.880	1,822,910.760	
	BANCO BRADESCO SA	213,121	15.500	3,303,375.500	
	AMBEV SA	378,500	16.610	6,286,885.000	
ブラジル・レアル 小計				275,102,883.330 (8,705,575,723)	
マレーシア・リンギット	MALAYAN BANKING	304,800	10.720	3,267,456.000	
	PUBLIC BANK	435,600	4.830	2,103,948.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS	264,100	7.390	1,951,699.000	
	TENAGA NASIONAL	102,100	14.420	1,472,282.000	
	IHH HEALTHCARE	134,000	8.780	1,176,520.000	
マレーシア・リンギット 小計				9,971,905.000 (394,883,449)	
メキシコ・ペソ	AMERICA MOVIL B	1,618,100	23.880	38,640,228.000	
	COCA-COLA FEMSA CLASS UBL UNITS	38,615	187.970	7,258,461.550	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO	12,500	408.740	5,109,250.000	
	CEMEX CPO	1,497,019	22.370	33,488,315.030	

	FOMENTO ECONOMICO MEXICANO UBD UNI	116,400	222.640	25,915,296.000	
	ARCA CONTINENTAL	33,400	209.610	7,000,974.000	
	INDUST PENOLES	5,775	831.050	4,799,313.750	
	GRUPO MEXICO B	134,200	209.690	28,140,398.000	
	WALMART DE MEXICO V	397,100	52.080	20,680,968.000	
	GPO FINANCE BANORTE	136,100	188.650	25,675,265.000	
メキシコ・ペソ 小計				196,708,469.330 (1,834,247,463)	
香港・ドル	TRIP.COM GROUP LTD	28,550	371.000	10,592,050.000	
	XPENG CLASS A INC	41,000	57.700	2,365,700.000	
	LI AUTO CLASS A INC	78,800	57.000	4,491,600.000	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	21,450	344.800	7,395,960.000	
	KE HOLDINGS INC	104,600	43.900	4,591,940.000	
	MIDEA GROUP LTD CLASS H	46,200	91.550	4,229,610.000	
	S.F. HOLDING LTD CLASS H	27,400	31.080	851,592.000	
	CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY LT	1,600	672.500	1,076,000.000	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD H	2,094,000	3.620	7,580,280.000	
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	550,000	19.150	10,532,500.000	
	BYD ELECTRONIC (INTERNATIONAL) LTD	90,500	24.780	2,242,590.000	
	CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS LTD	122,500	23.800	2,915,500.000	
	JIANGXI COPPER LTD H	146,000	34.540	5,042,840.000	
	CHINA PETROLEUM AND CHEMICAL CORP	7,261,800	4.220	30,644,796.000	
	TENCENT HOLDINGS LTD	179,700	463.600	83,308,920.000	
	ZTE CORP H	58,000	26.000	1,508,000.000	
	CHINA RESOURCES POWER LTD	214,000	19.610	4,196,540.000	
	PETROCHINA LTD H	3,424,000	10.350	35,438,400.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL INC H	888,000	7.060	6,269,280.000	
	ANHUI CONCH CEMENT LTD H	290,500	18.180	5,281,290.000	
	CHINA CONSTRUCTION BANK CORP H	6,374,000	8.980	57,238,520.000	
	CHINA TAIPING INSURANCE HLDGS LTD	237,000	20.840	4,939,080.000	
	CHINA CITIC BANK CORP LTD H	1,639,000	7.730	12,669,470.000	
	GF SECURITIES LTD H	83,200	16.500	1,372,800.000	

HUATAI SECURITIES LTD H	113,400	16.920	1,918,728.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA LTD H	1,947,000	5.200	10,124,400.000	
CHINA SHENHUA ENERGY LTD H	414,500	45.320	18,785,140.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	485,120	7.240	3,512,268.800	
CHINA RESOURCES LAND LTD	281,500	37.280	10,494,320.000	
YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LTD	589,500	14.140	8,335,530.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL LTD	447,500	4.700	2,103,250.000	
BYD LTD H	172,600	86.550	14,938,530.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD H	4,919,000	6.060	29,809,140.000	
GUOTAI HAITONG SECURITIES CO LTD H	154,200	14.610	2,252,862.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE COMPANY L	79,100	51.550	4,077,605.000	
THE PEOPLES INSURANCE CO (GROUP) O	1,059,000	5.440	5,760,960.000	
CITIC LTD	348,000	13.110	4,562,280.000	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	223,000	26.960	6,012,080.000	
INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF	9,861,000	7.220	71,196,420.000	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	109,000	31.080	3,387,720.000	
CHINA TOWER CORP LTD H	229,500	9.720	2,230,740.000	
XIAOMI CORP	672,000	26.200	17,606,400.000	
MEITUAN	290,990	77.900	22,668,121.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	888,000	110.200	97,857,600.000	
CHINA ZHESHANG BANK LTD H	891,000	2.580	2,298,780.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP L	96,400	19.620	1,891,368.000	
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	1,252,000	1.180	1,477,360.000	
JD.COM CLASS A INC	568,745	112.600	64,040,687.000	
NETEASE INC	80,800	199.600	16,127,680.000	
ZTO EXPRESS (CAYMAN) INC	28,900	179.000	5,173,100.000	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOG	59,700	36.680	2,189,796.000	
METALLURGICAL CORPORATION OF CHINA	1,453,000	1.460	2,121,380.000	

HAIER SMART HOME CLASS H LTD H	243,200	21.560	5,243,392.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	94,500	45.880	4,335,660.000	
BAIDU CLASS A INC	227,100	115.600	26,252,760.000	
CHINA OVERSEAS LAND INVESTMENT LTD	376,000	15.690	5,899,440.000	
CRRC CORP LTD H	651,000	5.410	3,521,910.000	
CGN POWER LTD H	1,233,000	3.050	3,760,650.000	
PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CH	1,007,000	57.150	57,550,050.000	
CHINA COAL ENERGY LTD H	374,000	12.190	4,559,060.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	2,798,000	0.840	2,350,320.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS LTD H	676,550	14.150	9,573,182.500	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD H	2,915,580	3.530	10,291,997.400	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	70,800	76.250	5,398,500.000	
TSINGTAO BREWERY LTD H	46,000	50.100	2,304,600.000	
CHINA VANKE LTD H	2,123,900	2.640	5,607,096.000	
CHINA MENGNIU DAIRY LTD	395,000	16.610	6,560,950.000	
PICC PROPERTY AND CASUALTY LTD H	644,000	15.550	10,014,200.000	
LI NING LTD	193,500	17.940	3,471,390.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD H	230,000	10.620	2,442,600.000	
WEICHAI POWER LTD H	173,000	35.540	6,148,420.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY LTD	52,800	71.550	3,777,840.000	
ALUMINUM CORPORATION OF CHINA LTD	336,000	10.330	3,470,880.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE (GROUP) LT	342,000	31.640	10,820,880.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING L	174,100	11.870	2,066,567.000	
CHINA LIFE INSURANCE LTD H	494,000	30.120	14,879,280.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	61,900	48.860	3,024,434.000	
ZIJIN MINING GROUP LTD H	180,000	31.400	5,652,000.000	
CHINA NATIONAL BUILDING MATERIAL L	450,000	4.830	2,173,500.000	
BANK OF COMMUNICATIONS LTD H	1,693,100	7.720	13,070,732.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK LT	457,000	6.690	3,057,330.000	

	GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	3,997,000	0.730	2,917,810.000	
	SINOTRUK (HONG KONG) LTD	57,500	41.800	2,403,500.000	
	CHINA MERCHANTS BANK LTD H	559,500	49.400	27,639,300.000	
	BANK OF CHINA LTD H	10,123,000	5.530	55,980,190.000	
	CHINA MOLYBDENUM LTD H	129,000	18.800	2,425,200.000	
	CITIC SECURITIES COMPANY LTD H	111,500	26.180	2,919,070.000	
	CHINA EVERBRIGHT BANK LTD H	1,132,000	3.420	3,871,440.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES LTD H	321,000	7.870	2,526,270.000	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	331,500	8.750	2,900,625.000	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	738,000	2.410	1,778,580.000	
香港・ドル 小計				1,082,371,109.700 (22,123,665,482)	
台湾・ドル	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTUR	150,000	67.200	10,080,000.000	
	WT MICROELECTRONICS LTD	104,000	228.500	23,764,000.000	
	SUPREME ELECTRONICS LTD	138,000	98.800	13,634,400.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL LTD	128,000	136.500	17,472,000.000	
	GLOBALWAFERS LTD	28,000	864.000	24,192,000.000	
	SINO-AMERICAN SILICON PRODUCTS INC	144,000	159.000	22,896,000.000	
	TAIWAN CEMENT LTD	671,000	24.550	16,473,050.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING LTD	195,000	590.000	115,050,000.000	
	WIWYNN CORPORATION	4,000	4,850.000	19,400,000.000	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	189,112	76.500	14,467,068.000	
	FORMOSA PLASTICS CORP	489,600	45.250	22,154,400.000	
	NAN YA PLASTICS CORP	519,140	106.500	55,288,410.000	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CORP	355,000	48.800	17,324,000.000	
	WALSIN LIHWA CORP	423,000	37.700	15,947,100.000	
	CHINA STEEL CORP	840,686	18.900	15,888,965.400	
	LITE ON TECHNOLOGY CORP	121,616	217.000	26,390,672.000	
	DELTA ELECTRONICS INC	33,000	2,215.000	73,095,000.000	
	YAGEO CORP	70,312	855.000	60,116,760.000	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	85,000	172.000	14,620,000.000	
	ACCTON TECHNOLOGY CORP	8,000	2,335.000	18,680,000.000	
	ACER INC	484,000	36.700	17,762,800.000	
	INVENTEC CORP	291,000	66.200	19,264,200.000	
	GIGABYTE TECHNOLOGY LTD	53,000	342.000	18,126,000.000	

REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	41,000	618.000	25,338,000.000	
QUANTA COMPUTER INC	235,000	372.000	87,420,000.000	
AUO CORP	1,620,000	23.500	38,070,000.000	
CHUNGHWA TELECOM LTD	154,400	145.000	22,388,000.000	
KING YUAN ELECTRONICS LTD	29,000	282.000	8,178,000.000	
MEDIATEK INC	79,003	4,180.000	330,232,540.000	
CATCHER TECHNOLOGY LTD	68,000	205.500	13,974,000.000	
EVERGREEN MARINE CORP (TAIWAN) LTD	174,800	228.000	39,854,400.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT CORP	277,000	52.400	14,514,800.000	
CHINA AIRLINES LTD	462,000	20.400	9,424,800.000	
WAN HAI LINES LTD	148,000	85.000	12,580,000.000	
EVA AIRWAYS CORP	341,000	38.700	13,196,700.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING LTD	290,153	122.000	35,398,666.000	
CATHAY FINANCIAL HOLDING LTD	423,838	100.500	42,595,719.000	
KGI FINANCIAL HOLDING LTD	575,710	27.450	15,803,239.500	
E.SUN FINANCIAL HOLDING LTD	647,947	34.350	22,256,979.450	
YUANTA FINANCIAL HOLDING LTD	398,940	63.900	25,492,266.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING LTD	293,718	43.400	12,747,361.200	
TS FINANCIAL HOLDING LTD	1,098,792	30.200	33,183,518.400	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS LTD	366,270	34.150	12,508,120.500	
CTBC FINANCIAL HOLDING LTD	522,028	67.600	35,289,092.800	
FIRST FINANCIAL HOLDING LTD	345,275	31.000	10,703,525.000	
LARGAN PRECISION LTD	9,000	4,020.000	36,180,000.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS CORP	68,000	488.500	33,218,000.000	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	45,939	902.000	41,436,978.000	
TRIPOD TECHNOLOGY CORP	27,000	497.000	13,419,000.000	
TAIWAN MOBILE LTD	91,000	119.500	10,874,500.000	
WISTRON CORP	438,110	156.000	68,345,160.000	
INNOLUX CORP	1,347,029	48.550	65,398,257.950	
WPG HOLDINGS LTD	195,000	105.000	20,475,000.000	
PEGATRON CORP	156,000	93.100	14,523,600.000	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	83,000	552.000	45,816,000.000	
CHAILEASE HOLDING LTD	145,311	121.500	17,655,286.500	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	65,000	347.500	22,587,500.000	
COMPAL ELECTRONICS INC	627,000	36.350	22,791,450.000	

	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	424,000	2,310.000	979,440,000.000	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY LTD	1,125,902	260.500	293,297,471.000	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	48,000	230.000	11,040,000.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	85,760	785.000	67,321,600.000	
	UNITED MICRO ELECTRONICS CORP	1,220,000	133.500	162,870,000.000	
台湾・ドル 小計				3,439,926,356.700 (17,411,531,246)	
南アフリカ・ランド	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	8,997	1,392.620	12,529,402.140	
	NORTHAM PLATINUM HLDGS LTD	13,326	259.490	3,457,963.740	
	PEPKOR HOLDINGS SHS LTD	255,880	22.040	5,639,595.200	
	GOLD FIELDS LTD	22,399	590.070	13,216,977.930	
	CAPITEC LTD	1,899	4,487.500	8,521,762.500	
	OLD MUTUAL LIMITED LTD	360,946	13.530	4,883,599.380	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	25,275	294.900	7,453,597.500	
	NEDBANK GROUP LTD	32,113	260.500	8,365,436.500	
	BID CORPORATION LTD	15,077	432.950	6,527,587.150	
	STANDARD BANK GROUP LTD	45,967	320.610	14,737,479.870	
	SASOL LTD	62,213	213.570	13,286,830.410	
	DISCOVERY LTD	24,307	283.010	6,879,124.070	
	SANLAM LIMITED LTD	63,034	88.040	5,549,513.360	
	FIRSTRAND LTD	211,870	94.450	20,011,121.500	
	ABSA GROUP LTD	44,355	240.000	10,645,200.000	
	NASPERS LIMITED LTD CLASS N	26,386	855.920	22,584,305.120	
	MTN GROUP LTD	75,587	225.050	17,010,854.350	
	IMPALA PLATINUM LTD	80,872	197.280	15,954,428.160	
	HARMONY GOLD MINING COMPANY LIMITE	15,713	257.180	4,041,069.340	
	MR PRICE GROUP LTD	28,381	169.410	4,808,025.210	
	VALTERRA PLATINUM LTD	26,174	1,196.000	31,304,104.000	
	SIBANYE STILLWATER LTD	351,429	39.860	14,007,959.940	
南アフリカ・ランド 小計				251,415,937.370 (2,489,017,780)	
合計				70,051,149,336 [70,051,149,336]	

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考

投資証券	アメリカ・ドル	INVESCO RAFI EMERGING MARKETS ETF (ETF)	940,500	27,265,095.000	
	アメリカ・ドル 小計			27,265,095.000 (4,367,322,917)	
投資証券 合計				4,367,322,917 [4,367,322,917]	
合計				4,367,322,917 [4,367,322,917]	

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 26銘柄 投資証券 1銘柄	12.3%	87.7%	6.7%
インド・ルピー	株式 64銘柄	100%	-%	10.1%
インドネシア・ルピア	株式 6銘柄	100%	-%	0.7%
オフショア・人民元	株式 65銘柄	100%	-%	5.3%
サウジアラビア・リアル	株式 7銘柄	100%	-%	1.2%
シンガポール・ドル	株式 1銘柄	100%	-%	0.1%
タイ・バーツ	株式 15銘柄	100%	-%	2.3%
チリ・ペソ	株式 3銘柄	100%	-%	0.5%
トルコ・リラ	株式 11銘柄	100%	-%	2.0%
ブラジル・レアル	株式 42銘柄	100%	-%	11.7%
マレーシア・リンギット	株式 5銘柄	100%	-%	0.5%
メキシコ・ペソ	株式 10銘柄	100%	-%	2.5%
香港・ドル	株式 91銘柄	100%	-%	29.7%
台湾・ドル	株式 63銘柄	100%	-%	23.4%
南アフリカ・ランド	株式 22銘柄	100%	-%	3.3%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

前記「ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）」に記載のとおりであります。

【ダイワファンドラップ 日本債券インデックス】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間(2025年6月17日から2026年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 日本債券インデックス

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	128,062,641	166,193,141
親投資信託受益証券	40,538,292,459	56,785,442,162
流動資産合計	40,666,355,100	56,951,635,303
資産合計	40,666,355,100	56,951,635,303
負債の部		
流動負債		
未払解約金	21,409,828	27,372,845
未払受託者報酬	4,328,372	5,419,441
未払委託者報酬	61,679,847	77,227,634
その他未払費用	1,082,006	1,092,303
流動負債合計	88,500,053	111,112,223
負債合計	88,500,053	111,112,223
純資産の部		
元本等		
元本	※1 45,588,181,446	※1 67,695,620,185
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △ 5,010,326,399	※2 △ 10,855,097,105
（分配準備積立金）	163,410,591	140,829,744
元本等合計	40,577,855,047	56,840,523,080
純資産合計	40,577,855,047	56,840,523,080
負債純資産合計	40,666,355,100	56,951,635,303

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 自　2024年6月18日 至　2025年6月16日	第10期 自　2025年6月17日 至　2026年6月15日
営業収益		
受取利息	300,036	694,406
有価証券売買等損益	△ 1,382,702,002	△ 2,514,632,111
営業収益合計	△ 1,382,401,966	△ 2,513,937,705
営業費用		
受託者報酬	7,198,693	10,136,835
委託者報酬	100,134,216	144,451,175
その他費用	2,149,258	2,193,958
営業費用合計	109,482,167	156,781,968
営業利益又は営業損失（△）	△ 1,491,884,133	△ 2,670,719,673
経常利益又は経常損失（△）	△ 1,491,884,133	△ 2,670,719,673
当期純利益又は当期純損失（△）	△ 1,491,884,133	△ 2,670,719,673
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（△）	△ 92,365,565	△ 189,518,461
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 3,107,272,084	△ 5,010,326,399
剰余金増加額又は欠損金減少額	638,269,034	896,512,556
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	638,269,034	896,512,556
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,141,804,781	4,260,082,050
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,141,804,781	4,260,082,050
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△ 5,010,326,399	△ 10,855,097,105

(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10期 自2025年6月17日 至2026年6月15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 2025年6月15日が休日のため、前計算期間末日を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9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
1.　※1 期首元本額	41,077,266,835円	45,588,181,446円
期中追加設定元本額	12,868,104,378円	29,996,697,959円
期中一部解約元本額	8,357,189,767円	7,889,259,220円
2.　計算期間末日における受益権の総数	45,588,181,446口	67,695,620,185口
3.　※2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は5,010,326,399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10,855,097,105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9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日	第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日

※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,055,159,429円）及び分配準備積立金（163,410,591円）より分配対象額は1,218,570,020円（1万口当たり267.30円）であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,668,672,444円）及び分配準備積立金（140,829,744円）より分配対象額は1,809,502,188円（1万口当たり267.30円）であり、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券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10期 2026年6月15日現在

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	△1,330,953,323	△2,432,247,712
合計	△1,330,953,323	△2,432,247,712

(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9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.8901円 (8,901円)	0.8396円 (8,396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	47,101,395,291	56,785,442,162	
親投資信託受益証券 合計			56,785,442,162	
合計			56,785,442,162	

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

	2025年6月16日現在 金 額（円）	2026年6月15日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	371,897,741	635,695,580

国債証券	112,302,429,390	171,279,204,650
地方債証券	6,097,020,700	5,830,619,800
特殊債券	3,843,766,200	3,849,508,600
社債券	8,720,607,000	8,213,345,600
未収利息	354,403,183	580,637,871
前払費用	30,738,602	116,919,694
流動資産合計	131,720,862,816	190,505,931,795
資産合計	131,720,862,816	190,505,931,795
負債の部		
流動負債		
未払金	-	96,048,000
未払解約金	21,974,891	18,895,862
流動負債合計	21,974,891	114,943,862
負債合計	21,974,891	114,943,862
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	103,390,699,779	157,920,736,565
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	28,308,188,146	32,470,251,368
元本等合計	131,698,887,925	190,390,987,933
純資産合計	131,698,887,925	190,390,987,933
負債純資産合計	131,720,862,816	190,505,931,795

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2026年6月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2025年6月16日現在	2026年6月15日現在
1.　※1 期首	2024年6月18日	2025年6月17日
期首元本額	91,769,046,895円	103,390,699,779円
期中追加設定元本額	29,241,960,313円	70,874,570,196円
期中一部解約元本額	17,620,307,429円	16,344,533,410円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	32,289,249円	32,297,842円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	165,868,655円	110,773,388円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	35,582,786円	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)	420,295,551円	419,027,580円
ＤＣダイワ日本債券インデックス	10,852,963,402円	11,228,683,654円
ダイワ国内債券インデックス（ラップ専用）	26,112,989,477円	42,962,659,804円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	7,359,581,695円	7,387,462,479円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	1,366,798,648円	1,364,556,196円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	163,662,413円	148,244,674円
ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	178,299,358円	161,777,021円
ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド	47,479,769円	35,507,259円
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	31,824,691,835円	47,101,395,291円
ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用）	15,310,914,564円	24,879,508,012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	1,747,985,093円	2,910,075,166円
スタイル9（4資産分散・保守型）	9,389,402円	16,643,370円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	18,083,199円	39,283,709円

スタイル9（4資産分散・積極型）	2,043,691円	7,579,901円
スタイル9（6資産分散・保守型）	3,767,446円	7,564,978円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	34,455,402円	73,407,657円
スタイル9（6資産分散・積極型）	2,523,674円	7,315,592円
スタイル9（8資産分散・保守型）	6,108,052円	12,051,037円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	30,318,323円	65,921,973円
スタイル9（8資産分散・積極型）	3,553,566円	7,503,829円
ダイワ国内債券インデックス（投資一任専用）	8,444,232円	11,308,994,003円
ダイワ・インデックスセレクト日本債券	623,698,801円	532,419,083円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	5,726,038,799円	5,558,488,834円
ダイワライフスタイル２５	448,275,204円	472,901,414円
ダイワライフスタイル５０	659,038,099円	775,294,726円
ダイワライフスタイル７５	195,559,394円	254,237,986円
計	103,390,699,779円	157,920,736,565円
2.　期末日における受益権の総数	103,390,699,779口	157,920,736,565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2025年6月17日 至2026年6月15日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。

3.　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	2026年6月15日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2025年6月16日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2026年6月15日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△3,717,321,680	△5,092,480,930
地方債証券	△117,546,800	△140,235,600
特殊債券	△72,261,000	△116,808,700
社債券	△72,342,600	△112,879,900
合計	△3,979,472,080	△5,462,405,130

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2025年6月16日現在	2026年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2025年6月16日現在	2026年6月15日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2738円 (12,738円)	1.2056円 (12,056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	474 2年国債	400,000,000	398,168,000	
	475 2年国債	570,000,000	568,284,300	
	476 2年国債	1,800,000,000	1,793,646,000	
	477 2年国債	550,000,000	548,454,500	
	478 2年国債	850,000,000	847,178,000	
	479 2年国債	1,580,000,000	1,573,996,000	
	481 2年国債	1,200,000,000	1,199,616,000	
	482 2年国債	350,000,000	349,765,500	
	483 2年国債	230,000,000	230,158,700	
	484 2年国債	1,330,000,000	1,330,598,500	
	154 5年国債	1,570,000,000	1,548,318,300	
	155 5年国債	730,000,000	719,385,800	
	156 5年国債	1,380,000,000	1,357,878,600	
	157 5年国債	200,000,000	196,030,000	
	158 5年国債	2,300,000,000	2,250,389,000	
	161 5年国債	2,410,000,000	2,357,678,900	
	162 5年国債	450,000,000	438,610,500	
	163 5年国債	3,000,000,000	2,930,640,000	
	164 5年国債	270,000,000	261,500,400	
	165 5年国債	450,000,000	436,923,000	
	166 5年国債	2,850,000,000	2,774,076,000	
	167 5年国債	610,000,000	591,596,300	
	168 5年国債	400,000,000	390,100,000	
	169 5年国債	1,480,000,000	1,439,448,000	
	170 5年国債	770,000,000	748,416,900	
	171 5年国債	400,000,000	386,432,000	
	172 5年国債	1,390,000,000	1,346,840,500	
	173 5年国債	360,000,000	348,562,800	

174 5年国債	2,060,000,000	2,000,939,800	
175 5年国債	500,000,000	487,225,000	
176 5年国債	570,000,000	557,420,100	
177 5年国債	1,970,000,000	1,933,062,500	
178 5年国債	2,500,000,000	2,436,425,000	
179 5年国債	1,080,000,000	1,048,852,800	
180 5年国債	1,920,000,000	1,872,172,800	
181 5年国債	1,630,000,000	1,597,400,000	
182 5年国債	1,250,000,000	1,230,200,000	
183 5年国債	1,900,000,000	1,881,000,000	
184 5年国債	450,000,000	448,623,000	
185 5年国債	750,000,000	754,425,000	
1 40年国債	100,000,000	82,684,000	
2 40年国債	110,000,000	86,256,500	
3 40年国債	195,000,000	150,680,400	
4 40年国債	180,000,000	136,222,200	
5 40年国債	190,000,000	135,103,300	
6 40年国債	280,000,000	192,318,000	
7 40年国債	350,000,000	226,254,000	
8 40年国債	340,000,000	200,943,400	
9 40年国債	950,000,000	387,011,000	
10 40年国債	150,000,000	73,461,000	
11 40年国債	450,000,000	209,200,500	
12 40年国債	380,000,000	152,235,600	
13 40年国債	520,000,000	206,289,200	
14 40年国債	430,000,000	182,195,300	
15 40年国債	450,000,000	211,923,000	
16 40年国債	850,000,000	442,637,500	
17 40年国債	910,000,000	629,528,900	
18 40年国債	1,920,000,000	1,679,059,200	
1 CT5年国債	300,000,000	291,813,000	
2 CT5年国債	900,000,000	872,433,000	
3 CT5年国債	350,000,000	340,480,000	
1 CT10年国債	400,000,000	357,172,000	
2 CT10年国債	800,000,000	726,736,000	
3 CT10年国債	400,000,000	375,888,000	
348 10年国債	900,000,000	887,571,000	
349 10年国債	1,250,000,000	1,228,112,500	
350 10年国債	800,000,000	782,744,000	

351 10年国債	600,000,000	584,628,000	
352 10年国債	20,000,000	19,408,200	
353 10年国債	750,000,000	724,665,000	
354 10年国債	800,000,000	769,608,000	
355 10年国債	320,000,000	306,387,200	
356 10年国債	860,000,000	819,227,400	
357 10年国債	620,000,000	587,412,800	
358 10年国債	1,100,000,000	1,036,343,000	
359 10年国債	1,100,000,000	1,030,425,000	
360 10年国債	1,600,000,000	1,489,936,000	
361 10年国債	1,400,000,000	1,295,798,000	
362 10年国債	2,190,000,000	2,014,865,700	
363 10年国債	2,280,000,000	2,085,060,000	
364 10年国債	2,370,000,000	2,154,021,900	
365 10年国債	2,760,000,000	2,492,804,400	
366 10年国債	2,080,000,000	1,877,428,800	
367 10年国債	2,030,000,000	1,819,752,900	
368 10年国債	1,650,000,000	1,469,143,500	
369 10年国債	2,380,000,000	2,148,307,000	
370 10年国債	2,500,000,000	2,243,325,000	
371 10年国債	1,840,000,000	1,628,436,800	
372 10年国債	1,850,000,000	1,675,730,000	
373 10年国債	1,870,000,000	1,657,867,200	
374 10年国債	1,280,000,000	1,145,292,800	
375 10年国債	2,120,000,000	1,931,574,400	
376 10年国債	1,580,000,000	1,407,353,400	
377 10年国債	2,000,000,000	1,816,860,000	
378 10年国債	2,120,000,000	1,948,916,000	
379 10年国債	1,550,000,000	1,430,216,000	
380 10年国債	850,000,000	794,367,500	
381 10年国債	1,700,000,000	1,638,919,000	
382 10年国債	1,050,000,000	1,035,667,500	
1 30年国債	16,000,000	16,605,600	
2 30年国債	184,000,000	188,692,000	
3 30年国債	30,000,000	30,651,000	
4 30年国債	36,000,000	37,655,640	
5 30年国債	28,000,000	28,410,200	
6 30年国債	24,000,000	24,554,400	
7 30年国債	55,000,000	55,844,250	

8 30年国債	27,000,000	26,525,610	
9 30年国債	43,000,000	41,157,450	
10 30年国債	45,000,000	42,062,400	
11 30年国債	40,000,000	38,773,200	
12 30年国債	60,000,000	59,549,400	
13 30年国債	75,000,000	73,723,500	
14 30年国債	225,000,000	226,779,750	
15 30年国債	50,000,000	50,642,000	
16 30年国債	400,000,000	404,148,000	
17 30年国債	130,000,000	130,045,500	
18 30年国債	80,000,000	79,191,200	
19 30年国債	500,000,000	493,550,000	
20 30年国債	400,000,000	400,148,000	
21 30年国債	60,000,000	58,851,600	
22 30年国債	170,000,000	169,136,400	
24 30年国債	92,000,000	91,033,080	
25 30年国債	150,000,000	145,204,500	
26 30年国債	300,000,000	292,131,000	
27 30年国債	150,000,000	146,586,000	
28 30年国債	300,000,000	291,006,000	
29 30年国債	200,000,000	190,522,000	
30 30年国債	220,000,000	205,409,600	
31 30年国債	300,000,000	274,623,000	
32 30年国債	385,000,000	353,757,250	
33 30年国債	350,000,000	306,911,500	
34 30年国債	270,000,000	240,999,300	
35 30年国債	470,000,000	404,284,600	
36 30年国債	350,000,000	298,494,000	
37 30年国債	350,000,000	291,357,500	
38 30年国債	260,000,000	211,081,000	
39 30年国債	470,000,000	385,700,800	
40 30年国債	240,000,000	192,876,000	
41 30年国債	250,000,000	196,552,500	
42 30年国債	320,000,000	250,336,000	
43 30年国債	300,000,000	233,382,000	
44 30年国債	300,000,000	232,077,000	
45 30年国債	300,000,000	222,714,000	
46 30年国債	300,000,000	221,520,000	
47 30年国債	450,000,000	336,640,500	

48 30年国債	470,000,000	336,679,800	
49 30年国債	360,000,000	256,298,400	
50 30年国債	500,000,000	311,225,000	
51 30年国債	830,000,000	453,163,400	
52 30年国債	530,000,000	301,946,300	
53 30年国債	500,000,000	289,530,000	
54 30年国債	570,000,000	344,012,100	
55 30年国債	550,000,000	329,334,500	
56 30年国債	580,000,000	344,566,400	
57 30年国債	550,000,000	324,192,000	
58 30年国債	880,000,000	514,676,800	
59 30年国債	530,000,000	299,503,000	
60 30年国債	450,000,000	265,986,000	
61 30年国債	480,000,000	266,913,600	
62 30年国債	620,000,000	322,821,600	
63 30年国債	560,000,000	280,168,000	
64 30年国債	520,000,000	257,628,800	
65 30年国債	590,000,000	289,495,300	
66 30年国債	640,000,000	311,020,800	
67 30年国債	580,000,000	297,319,600	
68 30年国債	600,000,000	304,722,000	
69 30年国債	560,000,000	290,785,600	
70 30年国債	780,000,000	401,388,000	
71 30年国債	650,000,000	331,461,000	
72 30年国債	580,000,000	293,091,400	
73 30年国債	580,000,000	290,614,800	
74 30年国債	800,000,000	437,504,000	
75 30年国債	600,000,000	356,040,000	
76 30年国債	550,000,000	334,108,500	
77 30年国債	540,000,000	344,844,000	
78 30年国債	720,000,000	434,008,800	
79 30年国債	580,000,000	328,807,800	
80 30年国債	560,000,000	373,055,200	
81 30年国債	575,000,000	362,439,750	
82 30年国債	630,000,000	417,482,100	
83 30年国債	570,000,000	416,048,700	
84 30年国債	550,000,000	391,380,000	
85 30年国債	550,000,000	409,887,500	
86 30年国債	630,000,000	480,097,800	

87 30年国債	400,000,000	332,860,000	
88 30年国債	450,000,000	406,395,000	
89 30年国債	430,000,000	403,821,600	
90 30年国債	180,000,000	178,858,800	
97 20年国債	40,000,000	40,497,600	
98 20年国債	320,000,000	323,580,800	
99 20年国債	100,000,000	101,231,000	
100 20年国債	155,000,000	157,303,300	
101 20年国債	700,000,000	712,810,000	
107 20年国債	50,000,000	50,757,000	
108 20年国債	300,000,000	303,087,000	
109 20年国債	55,000,000	55,560,450	
110 20年国債	260,000,000	264,061,200	
111 20年国債	400,000,000	407,536,000	
112 20年国債	250,000,000	253,990,000	
113 20年国債	510,000,000	518,144,700	
114 20年国債	70,000,000	71,092,700	
115 20年国債	180,000,000	183,407,400	
116 20年国債	200,000,000	203,676,000	
117 20年国債	200,000,000	202,968,000	
118 20年国債	155,000,000	156,568,600	
119 20年国債	93,000,000	93,225,990	
120 20年国債	317,000,000	315,335,750	
121 20年国債	200,000,000	200,990,000	
122 20年国債	200,000,000	200,158,000	
123 20年国債	300,000,000	303,564,000	
124 20年国債	520,000,000	523,900,000	
125 20年国債	130,000,000	131,989,000	
126 20年国債	110,000,000	110,697,400	
127 20年国債	450,000,000	450,783,000	
128 20年国債	250,000,000	250,055,000	
129 20年国債	430,000,000	428,030,600	
130 20年国債	140,000,000	139,129,200	
131 20年国債	150,000,000	148,315,500	
132 20年国債	200,000,000	197,314,000	
134 20年国債	30,000,000	29,682,300	
135 20年国債	92,000,000	90,527,080	
136 20年国債	650,000,000	636,077,000	
137 20年国債	200,000,000	196,200,000	

138 20年国債	300,000,000	290,934,000	
139 20年国債	370,000,000	360,894,300	
140 20年国債	770,000,000	753,160,100	
141 20年国債	400,000,000	390,160,000	
142 20年国債	240,000,000	235,536,000	
143 20年国債	210,000,000	202,883,100	
144 20年国債	140,000,000	134,391,600	
145 20年国債	340,000,000	329,572,200	
146 20年国債	400,000,000	386,384,000	
147 20年国債	600,000,000	573,276,000	
148 20年国債	350,000,000	330,473,500	
149 20年国債	432,000,000	406,144,800	
150 20年国債	970,000,000	900,315,200	
151 20年国債	550,000,000	499,636,500	
152 20年国債	900,000,000	813,294,000	
153 20年国債	500,000,000	453,370,000	
154 20年国債	470,000,000	419,935,600	
155 20年国債	1,230,000,000	1,071,735,900	
156 20年国債	870,000,000	708,597,600	
157 20年国債	1,150,000,000	909,086,500	
158 20年国債	970,000,000	786,185,000	
159 20年国債	800,000,000	650,448,000	
160 20年国債	950,000,000	775,114,500	
161 20年国債	890,000,000	712,026,700	
162 20年国債	1,180,000,000	936,070,400	
163 20年国債	800,000,000	629,240,000	
164 20年国債	1,330,000,000	1,024,060,100	
165 20年国債	720,000,000	549,424,800	
166 20年国債	1,240,000,000	963,579,200	
167 20年国債	800,000,000	599,768,000	
168 20年国債	1,100,000,000	805,618,000	
169 20年国債	800,000,000	571,904,000	
170 20年国債	950,000,000	672,495,500	
171 20年国債	980,000,000	686,950,600	
172 20年国債	830,000,000	585,606,500	
173 20年国債	1,090,000,000	761,953,600	
174 20年国債	1,380,000,000	955,719,000	
175 20年国債	910,000,000	635,034,400	
176 20年国債	1,230,000,000	851,012,400	

	177 20年国債	980,000,000	660,245,600	
	178 20年国債	1,070,000,000	727,139,900	
	179 20年国債	840,000,000	565,874,400	
	180 20年国債	1,190,000,000	838,950,000	
	181 20年国債	800,000,000	569,616,000	
	182 20年国債	1,300,000,000	951,496,000	
	183 20年国債	800,000,000	612,336,000	
	184 20年国債	980,000,000	707,628,600	
	185 20年国債	790,000,000	566,390,500	
	186 20年国債	1,060,000,000	810,062,600	
	187 20年国債	850,000,000	623,279,500	
	188 20年国債	810,000,000	622,695,600	
	189 20年国債	830,000,000	668,158,300	
	190 20年国債	750,000,000	590,512,500	
	191 20年国債	820,000,000	665,011,800	
	192 20年国債	840,000,000	724,693,200	
	193 20年国債	610,000,000	532,761,800	
	194 20年国債	680,000,000	611,075,200	
	195 20年国債	640,000,000	618,451,200	
	196 20年国債	300,000,000	297,885,000	
	27 メキシコ国債	100,000,000	97,765,000	
	11 フイリピン共和国	100,000,000	97,719,400	
国債証券 合計			171,279,204,650	
地方債証券	796 東京都公債	100,000,000	94,720,300	
	808 東京都公債	100,000,000	92,644,300	
	827 東京都公債	100,000,000	89,977,200	
	866 東京都公債	200,000,000	185,220,600	
	16 東京都20年	100,000,000	101,037,700	
	3-5 北海道公債	100,000,000	90,949,200	
	37-2 宮城県公債	100,000,000	90,117,400	
	262 神奈川県公債	100,000,000	90,273,500	
	27 神奈川県20年	100,000,000	91,541,800	
	31 神奈川県20年	100,000,000	85,634,600	
	7 大阪府20年	200,000,000	197,621,400	
	26-2 京都府15年	100,000,000	98,385,400	
	2-1 京都府公債	200,000,000	187,487,000	
	19兵庫県公債20年	100,000,000	94,213,400	
	28兵庫県公債20年	100,000,000	78,157,700	

2-1 静岡県公債	100,000,000	93,851,900	
8-1 静岡県公債	100,000,000	98,455,200	
8 静岡県20年	200,000,000	203,395,200	
21-5 愛知県公債	100,000,000	101,764,800	
26-4 愛知県20年	100,000,000	93,263,200	
27-12 愛知県15年	100,000,000	95,167,800	
29-5 広島県公債	100,000,000	98,141,700	
25-1 広島県20年	100,000,000	95,817,200	
2-7 埼玉県公債	100,000,000	92,546,000	
4 埼玉県30年	100,000,000	67,856,000	
9 埼玉県20年	100,000,000	101,131,300	
12 埼玉県20年	100,000,000	97,489,900	
5-1 福岡県公債	100,000,000	89,443,800	
13 千葉県20年	100,000,000	96,817,800	
16 千葉県20年	100,000,000	93,448,900	
195 共同発行地方	100,000,000	95,120,300	
196 共同発行地方	100,000,000	95,070,900	
206 共同発行地方	100,000,000	93,468,000	
244 共同発行地方	200,000,000	176,809,800	
255 共同発行地方	100,000,000	89,715,100	
270 共同発行地方	200,000,000	184,790,600	
4-3 長崎県公債	100,000,000	89,775,500	
6-1 大阪市5年	100,000,000	96,902,500	
6-2 大阪市公債	100,000,000	89,271,800	
11 名古屋市20年	200,000,000	202,482,800	
10 京都市20年	100,000,000	98,507,700	
20-1 神戸市20年	100,000,000	101,701,600	
14 横浜市20年	100,000,000	101,507,700	
19 横浜市20年	100,000,000	101,558,200	
26-5 札幌市15年	100,000,000	97,647,000	
2-4 札幌市公債	100,000,000	92,694,500	
4 川崎市公債30年	100,000,000	85,163,800	
1 北九州市15年	100,000,000	97,429,000	
17 北九州市20年	100,000,000	93,088,600	
23-4 福岡市20年	100,000,000	99,209,200	
1-5 千葉市公債	100,000,000	93,830,400	
18さいたま市公債	100,000,000	92,096,700	
3-2 徳島県公債	100,000,000	89,901,200	
1-1 山梨県公債	100,000,000	94,490,400	

	2-2 岡山県公債	100,000,000	91,814,300	
地方債証券 合計			5,830,619,800	
特殊債券	86 政保政策投資C	300,000,000	277,407,000	
	47日本政策投資CO	100,000,000	97,666,900	
	174 日本政策投資	300,000,000	266,064,600	
	69 政保政策投資C	100,000,000	92,026,800	
	247 道路機構	200,000,000	135,832,200	
	86 政保道路機構	100,000,000	100,965,100	
	97 政保道路機構	100,000,000	101,148,900	
	160 政保道路機構	200,000,000	196,312,200	
	223 政保道路機構	100,000,000	92,279,300	
	235 政保道路機構	100,000,000	89,795,200	
	284 政保道路機構	200,000,000	153,918,800	
	298 政保道路機構	100,000,000	79,415,300	
	321 政保道路機構	200,000,000	197,262,800	
	403 政保道路機構	100,000,000	93,394,600	
	478 政保道路機構	100,000,000	89,987,400	
	2 公営企業30年	200,000,000	199,036,200	
	F143地方公共団体	100,000,000	99,992,900	
	1 地方公共団15年	100,000,000	99,764,400	
	31 地方公共団20	100,000,000	95,522,100	
	F192地方公共団体	100,000,000	98,959,500	
	F221地方公共団体	200,000,000	194,842,000	
	F226地方公共団体	100,000,000	98,466,700	
	129 地方公共団体	200,000,000	187,362,400	
	F568地方公共団体	200,000,000	162,111,200	
	4 国際協力銀行CO	100,000,000	97,185,500	
	123 住宅支援機構	100,000,000	97,310,800	
	33 沖縄振興開発	200,000,000	177,470,200	
	156鉄道建設・運輸	200,000,000	178,007,600	
特殊債券 合計			3,849,508,600	
社債券	39 BPCE S.A.	100,000,000	96,911,200	
	33 首都高速道路	100,000,000	97,177,500	
	8 ビーエヌピーパリバ	100,000,000	97,919,800	
	111 東日本高速道	100,000,000	96,868,000	
	101 中日本高速道	400,000,000	390,003,600	
	88 西日本高速道	100,000,000	94,123,800	
	22 積水ハウス	100,000,000	97,499,000	
	11サントリーホールデイング	100,000,000	97,608,200	

23 森ビル	100,000,000	75,579,100	
18 セブンアンドアイ	100,000,000	94,502,500	
35 東レ	300,000,000	284,195,100	
12 クラレ	100,000,000	99,242,500	
1 レゾナツクHD	100,000,000	97,597,300	
18 武田薬品	100,000,000	95,632,100	
4 アステラス製薬	300,000,000	292,263,300	
9 エーザイ	100,000,000	100,331,900	
20 ZHD	100,000,000	96,743,300	
18 楽天グループ	100,000,000	86,532,000	
2 AGC	100,000,000	88,833,300	
7 日本製鉄	100,000,000	98,013,300	
32 住友電工	100,000,000	95,831,100	
16 クボタ	100,000,000	97,864,700	
34 ダイキン工業	100,000,000	95,567,400	
62 日本電気	200,000,000	194,400,000	
41 ソニーG	100,000,000	88,685,500	
31 トヨタ自動車	100,000,000	89,001,100	
3 オリツクス銀行	200,000,000	194,659,600	
7 凸版印刷	100,000,000	97,064,300	
89 伊藤忠商事	100,000,000	101,284,600	
31 豊田通商	200,000,000	194,736,600	
63 住友商事	100,000,000	88,689,300	
26 りそなホールデイン	100,000,000	97,548,300	
27 りそなホールデイン	200,000,000	194,742,800	
28 三井住友TB	300,000,000	290,456,100	
63 三井住友銀行	100,000,000	98,716,300	
33 NTTフアイナンス	100,000,000	94,240,100	
38 NTTフアイナンス	200,000,000	178,365,200	
81 ホンダフアイナンス	100,000,000	97,090,100	
78 トヨタフアイナンス	100,000,000	98,760,500	
1 SOMPOHD	100,000,000	97,715,900	
11 三井住友海上	200,000,000	185,784,800	
82 三井不動産	100,000,000	97,468,800	
143 三菱地所	100,000,000	89,853,900	
111 住友不動産	100,000,000	97,905,600	
13 NTTフアイナンス	100,000,000	97,356,600	
91東日本旅客鉄道	100,000,000	96,003,300	
107東日本旅客鉄	100,000,000	69,249,200	

	8 東日本旅客鉄道	100,000,000	96,044,500	
	41 東海旅客鉄道	100,000,000	101,060,100	
	52 阪急阪神HLDG	100,000,000	94,453,300	
	67 阪急阪神HLDG	100,000,000	88,616,700	
	68 名古屋鉄道	200,000,000	194,602,400	
	34 KDDI	100,000,000	94,342,200	
	15 ソフトバンク	100,000,000	96,386,700	
	538 関西電力	100,000,000	91,911,400	
	448 中国電力	100,000,000	88,706,200	
	560 東北電力	200,000,000	176,056,600	
	332 北海道電力	100,000,000	80,919,100	
	393 北海道電力	100,000,000	89,377,900	
	34 沖縄電力	100,000,000	97,409,400	
	62 電源開発	100,000,000	79,032,400	
	85 電源開発	100,000,000	96,389,100	
	87 電源開発	100,000,000	88,177,200	
	11 東京電力パワー	100,000,000	98,440,800	
	83 東京電力PG	200,000,000	187,444,200	
	16 JERA	100,000,000	97,975,400	
	65 東京瓦斯	100,000,000	92,623,200	
	44 大阪瓦斯	100,000,000	89,161,300	
	50 大阪瓦斯	100,000,000	97,597,000	
社債券 合計			8,213,345,600	
合計			189,172,678,650	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間(2025年6月17日から2026年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	562,855,539	640,112,926
親投資信託受益証券	97,351,069,902	114,150,902,800
未収入金	20,508,933	-
流動資産合計	97,934,434,374	114,791,015,726
資産合計	97,934,434,374	114,791,015,726
負債の部		
流動負債		
未払解約金	93,163,245	73,062,067
未払受託者報酬	10,645,577	12,110,757
未払委託者報酬	191,621,273	217,994,662
その他未払費用	1,109,459	1,105,492
流動負債合計	296,539,554	304,272,978
負債合計	296,539,554	304,272,978
純資産の部		
元本等		
元本	※1 121,329,143,313	※1 143,614,937,376
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △ 23,691,248,493	※2 △ 29,128,194,628
（分配準備積立金）	2,074,703,859	1,723,885,794
元本等合計	97,637,894,820	114,486,742,748
純資産合計	97,637,894,820	114,486,742,748
負債純資産合計	97,934,434,374	114,791,015,726

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 自　2024年6月18日 至　2025年6月16日	第10期 自　2025年6月17日 至　2026年6月15日
営業収益		
受取利息	1,478,544	3,086,693
有価証券売買等損益	△ 798,166,739	△ 670,105,544
営業収益合計	△ 796,688,195	△ 667,018,851
営業費用		
受託者報酬	21,632,116	23,275,196
委託者報酬	389,379,901	418,955,054
その他費用	2,189,231	2,191,845
営業費用合計	413,201,248	444,422,095
営業利益又は営業損失（△）	△ 1,209,889,443	△ 1,111,440,946
経常利益又は経常損失（△）	△ 1,209,889,443	△ 1,111,440,946
当期純利益又は当期純損失（△）	△ 1,209,889,443	△ 1,111,440,946
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（△）	△ 58,900,655	△ 54,237,525
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 22,321,809,410	△ 23,691,248,493
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,456,477,639	4,828,427,048
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,456,477,639	4,828,427,048
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,674,927,934	9,208,169,762
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,674,927,934	9,208,169,762
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△ 23,691,248,493	△ 29,128,194,628

(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10期 自2025年6月17日 至2026年6月15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 2025年6月15日が休日のため、前計算期間末日を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9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
1.　※1 期首元本額	120,507,203,109円	121,329,143,313円
期中追加設定元本額	24,888,452,073円	47,039,191,999円
期中一部解約元本額	24,066,511,869円	24,753,397,936円
2.　計算期間末日における受益権の総数	121,329,143,313口	143,614,937,376口
3.　※2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は23,691,248,493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29,128,194,628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9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日	第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日

※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（8,344,163,631円）及び分配準備積立金（2,074,703,859円）より分配対象額は10,418,867,490円（1万口当たり858.73円）であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（10,608,668,139円）及び分配準備積立金（1,723,885,794円）より分配対象額は12,332,553,933円（1万口当たり858.72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10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	第10期 2026年6月15日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	△801,491,246	△649,492,764
合計	△801,491,246	△649,492,764

（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9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.8047円 (8,047円)	0.7972円 (7,972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	137,614,108,258	114,150,902,800	
親投資信託受益証券 合計			114,150,902,800	
合計			114,150,902,800	

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

	2025年6月16日現在 金 額（円）	2026年6月15日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		

預金	1,213,941,714	1,828,209,122
コール・ローン	1,202,132,901	1,402,979,529
国債証券	131,381,088,870	155,510,786,959
派生商品評価勘定	19,112,737	93,682,209
未収入金	948,413	-
未収利息	950,523,358	1,141,377,219
前払費用	123,929,595	209,156,946
差入委託証拠金	226,471,478	299,974,899
流動資産合計	135,118,149,066	160,486,166,883
資産合計	135,118,149,066	160,486,166,883
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,081,611,756	757,833,517
未払金	11,810,530	1,200,910,381
未払解約金	62,422,385	53,254,776
流動負債合計	1,155,844,671	2,011,998,674
負債合計	1,155,844,671	2,011,998,674
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	160,646,455,421	191,048,664,006
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△26,684,151,026	△32,574,495,797
元本等合計	133,962,304,395	158,474,168,209
純資産合計	133,962,304,395	158,474,168,209
負債純資産合計	135,118,149,066	160,486,166,883

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2026年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2025年6月16日現在	2026年6月15日現在
1.　※1 期首	2024年6月18日	2025年6月17日
期首元本額	150,884,982,568円	160,646,455,421円
期中追加設定元本額	44,552,509,331円	68,440,714,731円

期中一部解約元本額	34,791,036,478円	38,038,506,146円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）	116,741,899,391円	137,614,108,258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）	4,792,001,832円	4,905,235,531円
ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ラップ専用）	21,625,656円	18,548,512円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	3,888,821,561円	3,966,846,743円
ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用）	11,715,977円	16,416,234円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル1（安定）	-円	1,562,672円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル2（やや安定）	-円	1,010,399円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル3（バランス）	-円	659,723円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル4（やや積極）	-円	264,257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）	30,468,053,398円	39,716,591,415円
ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	2,376,780,748円	2,416,575,972円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	2,345,556,858円	2,390,844,290円
計	160,646,455,421円	191,048,664,006円
2. 期末日における受益権の総数	160,646,455,421口	191,048,664,006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26,684,151,026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32,574,495,797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2025年6月17日 至2026年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における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	2026年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引

	デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2025年6月16日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2026年6月15日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	338,753,591	△1,128,474,021
合計	338,753,591	△1,128,474,021

（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	2025年6月16日現在				2026年6月15日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
債券先物取引								
買建	1,952,330,673	-	1,959,625,843	7,295,170	392,823,480	-	393,083,628	260,148
合計	1,952,330,673	-	1,959,625,843	7,295,170	392,823,480	-	393,083,628	260,148

（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6月16日現在				2026年6月15日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	133,122,565,752	-	134,192,359,941	△1,069,794,189	158,160,054,299	-	158,824,465,755	△664,411,456
アメリカ・ドル	59,522,290,805	-	59,660,395,490	△138,104,685	70,562,437,899	-	71,073,311,400	△510,873,501
イギリス・ポンド	7,855,894,782	-	7,909,448,658	△53,553,876	9,027,524,494	-	9,074,364,124	△46,839,630
イスラエル・シュケル	447,732,735	-	436,423,176	11,309,559	743,184,132	-	720,062,947	23,121,185
オーストラリア・ドル	1,656,065,932	-	1,674,506,730	△18,440,798	2,097,834,384	-	2,077,454,640	20,379,744
オフショア・人民元	15,553,876,935	-	15,605,895,030	△52,018,095	20,238,498,682	-	20,371,804,981	△133,306,299
カナダ・ドル	2,745,198,236	-	2,781,829,680	△36,631,444	3,334,471,618	-	3,311,021,248	23,450,370
シンガポール・ドル	586,730,157	-	590,673,585	△3,943,428	550,694,612	-	551,652,892	△958,280
スウェーデン・クローナ	257,460,256	-	260,466,899	△3,006,643	300,582,343	-	299,103,216	1,479,127
デンマーク・クローネ	319,197,161	-	324,752,113	△5,554,952	336,455,985	-	336,663,300	△207,315
ニュージーランド・ドル	372,738,757	-	376,738,014	△3,999,257	373,144,570	-	366,989,384	6,155,186
ノルウェー・クローネ	229,252,557	-	236,728,450	△7,475,893	277,244,990	-	272,130,975	5,114,015
ポーランド・ズロチ	834,741,336	-	846,518,918	△11,777,582	1,170,550,810	-	1,167,575,205	2,975,605
マレーシア・リンギット	647,994,316	-	649,302,808	△1,308,492	755,761,076	-	746,943,776	8,817,300
メキシコ・ペソ	1,082,865,077	-	1,113,648,400	△30,783,323	1,464,536,663	-	1,491,021,308	△26,484,645
ユーロ	41,010,526,710	-	41,725,031,990	△714,505,280	46,098,644,995	-	46,134,776,228	△36,131,233
韓国・ウォン	-	-	-	-	828,487,046	-	829,590,131	△1,103,085
合計	133,122,565,752	-	134,192,359,941	△1,069,794,189	158,160,054,299	-	158,824,465,755	△664,411,456

（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6月16日現在	2026年6月15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.8339円 (8,339円)	0.8295円 (8,295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	8,182,219.500	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	400,000.000	410,576.000	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	1,500,000.000	1,611,495.000	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	630,000.000	661,941.000	

		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	500,000.000	504,775.000	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	1,300,000.000	1,360,775.000	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	1,000,000.000	988,000.000	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	800,000.000	797,496.000	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	430,000.000	385,065.000	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,410,000.000	1,363,582.800	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	390,000.000	386,127.300	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	500,000.000	498,280.000	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,700,000.000	1,622,497.000	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	600,000.000	530,880.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,400,000.000	1,137,542.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	670,000.000	542,143.900	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,000,000.000	791,790.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	1,500,000.000	1,140,165.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,000,000.000	756,170.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,000,000.000	1,591,320.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,500,000.000	1,909,275.000	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	1,100,000.000	933,020.000	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	532,000.000	457,913.680	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	1,000,000.000	843,350.000	

		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	940,000.000	732,053.200	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	370,000.000	279,797.700	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,800,000.000	1,327,914.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	1,200,000.000	901,308.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	300,000.000	205,674.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	1,070,000.000	730,767.200	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	1,000,000.000	648,350.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	726,210.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	900,000.000	666,153.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	950,000.000	701,290.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	9,000,000.000	8,821,350.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	1,000,000.000	703,080.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	3,000,000.000	2,926,620.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	700,000.000	490,707.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	4,000,000.000	3,915,040.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	1,000,000.000	731,670.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	1,000,000.000	746,540.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	4,000,000.000	3,911,320.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	3,000,000.000	2,924,460.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	1,800,000.000	1,310,292.000	

		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	4,300,000.000	4,202,992.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,350,000.000	2,603,821.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	4,500,000.000	4,330,620.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	1,500,000.000	1,086,735.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	1,800,000.000	1,269,900.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	2,300,000.000	2,190,612.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	2,000,000.000	1,852,960.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	1,500,000.000	926,595.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	300,000.000	189,876.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	4,500,000.000	4,096,890.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20500215	1,000,000.000	578,730.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	3,300,000.000	2,880,537.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	400,000.000	189,044.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	500,000.000	314,380.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	2,800,000.000	2,422,308.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	1,300,000.000	633,087.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	400,000.000	248,944.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	4,000,000.000	3,836,160.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	5,000,000.000	4,337,000.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	8,000,000.000	7,624,320.000	

		1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	1,300,000.000	674,882.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,000,000.000	642,630.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	4,500,000.000	4,283,685.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	1,800,000.000	1,706,544.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	3,950,000.000	2,180,874.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	4,900,000.000	4,270,154.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	1,000,000.000	951,750.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,300,000.000	896,896.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	5,000,000.000	4,757,300.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	4,600,000.000	4,074,910.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,694,960.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	1,800,000.000	1,118,520.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	800,000.000	580,312.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	2,000,000.000	1,893,980.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	1,500,000.000	1,417,200.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	3,200,000.000	2,761,056.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	2,400,000.000	1,357,968.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	2,350,000.000	1,566,134.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,687,200.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	1,000,000.000	937,550.000	

		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	1,500,000.000	1,406,970.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	2,500,000.000	2,155,175.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	1,300,000.000	709,917.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	2,000,000.000	1,377,800.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	2,000,000.000	1,876,980.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	2,000,000.000	1,761,120.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	6,000,000.000	5,648,040.000	
		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	2,500,000.000	1,496,225.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	1,000,000.000	725,560.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	2,500,000.000	2,357,075.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	4,000,000.000	3,816,640.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	4,800,000.000	4,450,944.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	2,300,000.000	1,582,055.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,000,000.000	819,550.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	2,200,000.000	2,125,772.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	1,000,000.000	961,770.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	1,500,000.000	1,489,080.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	2,500,000.000	2,292,700.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	2,000,000.000	1,409,920.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	2,000,000.000	1,911,860.000	

		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	1,200,000.000	1,189,896.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	3,000,000.000	3,003,840.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	6,300,000.000	6,237,441.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	3,000,000.000	2,554,140.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	2,985,030.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	700,000.000	693,322.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	1,000,000.000	977,690.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	4,000,000.000	3,810,600.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	1,000,000.000	882,340.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	1,800,000.000	1,431,756.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131	3,500,000.000	3,468,815.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300228	2,000,000.000	1,988,580.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,500,000.000	1,471,335.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	1,300,000.000	1,268,787.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	3,000,000.000	2,828,550.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	1,800,000.000	1,430,784.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	2,500,000.000	2,200,375.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531	3,000,000.000	2,953,590.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	2,000,000.000	1,967,960.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630	1,000,000.000	998,160.000	

		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815	2,800,000.000	2,718,660.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815	1,900,000.000	1,651,252.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430815	1,500,000.000	1,404,570.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	1,500,000.000	1,489,620.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300831	3,000,000.000	2,991,900.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	3,000,000.000	3,016,620.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20331115	3,000,000.000	3,026,010.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20431115	600,000.000	587,622.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20531115	2,100,000.000	2,022,636.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301130	1,500,000.000	1,510,605.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	2,500,000.000	2,514,875.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340215	3,600,000.000	3,511,584.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540215	1,200,000.000	1,065,084.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440215	1,200,000.000	1,137,936.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310331	2,000,000.000	1,992,420.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340515	3,700,000.000	3,695,930.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	4,000,000.000	4,052,960.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310430	1,200,000.000	1,221,444.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540515	2,500,000.000	2,362,000.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440515	700,000.000	673,365.000	

		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	5,500,000.000	5,555,055.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310531	1,000,000.000	1,017,910.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310630	1,800,000.000	1,802,520.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	7,000,000.000	7,021,980.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310731	1,500,000.000	1,493,280.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340815	3,800,000.000	3,663,124.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540815	2,000,000.000	1,775,580.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310831	2,000,000.000	1,955,060.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,500,000.000	3,496,220.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20341115	4,800,000.000	4,743,360.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20541115	2,200,000.000	2,036,584.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311031	3,000,000.000	2,983,470.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	1,500,000.000	1,498,440.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20441115	1,200,000.000	1,151,412.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271215	4,500,000.000	4,496,625.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	3,500,000.000	3,524,255.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311231	3,500,000.000	3,543,330.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280115	3,000,000.000	3,007,830.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	1,300,000.000	1,303,393.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350215	3,300,000.000	3,345,738.000	

		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550215	1,400,000.000	1,322,972.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20450215	500,000.000	486,930.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320131	3,500,000.000	3,520,755.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320229	2,000,000.000	1,986,860.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280315	4,500,000.000	4,484,700.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320331	1,300,000.000	1,290,926.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,000,000.000	994,020.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550515	1,700,000.000	1,639,565.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350515	4,200,000.000	4,140,990.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280515	4,500,000.000	4,471,695.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	1,200,000.000	1,187,220.000	
		5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20450515	1,000,000.000	1,004,190.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320531	2,000,000.000	1,984,400.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531	1,000,000.000	993,470.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280615	3,300,000.000	3,285,942.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	2,600,000.000	2,570,334.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280715	4,000,000.000	3,981,680.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350815	4,500,000.000	4,431,240.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	2,000,000.000	1,997,220.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550815	2,500,000.000	2,411,900.000	

		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320731	1,000,000.000	984,680.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320831	1,500,000.000	1,466,220.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20450815	1,100,000.000	1,086,679.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930	3,000,000.000	2,933,670.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320930	1,000,000.000	976,890.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301031	2,000,000.000	1,954,560.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20351115	2,800,000.000	2,700,684.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281115	800,000.000	788,728.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20551115	1,900,000.000	1,797,419.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321031	500,000.000	484,625.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20451115	800,000.000	764,872.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301130	2,400,000.000	2,332,104.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	1,500,000.000	1,485,690.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281215	1,000,000.000	985,440.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301231	900,000.000	878,688.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321231	900,000.000	877,743.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271231	900,000.000	890,784.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290115	900,000.000	886,356.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310131	2,300,000.000	2,256,323.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20360215	1,700,000.000	1,653,641.000	

	3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290215	2,000,000.000	1,968,820.000	
	4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20560215	3,000,000.000	2,897,550.000	
	4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330131	1,000,000.000	981,750.000	
	3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330228	2,300,000.000	2,224,077.000	
	4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20460215	1,300,000.000	1,242,098.000	
	3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310228	2,800,000.000	2,717,092.000	
	3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310331	1,200,000.000	1,182,840.000	
	4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330331	1,200,000.000	1,194,744.000	
	3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310430	800,000.000	788,368.000	
	5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20560515	400,000.000	401,904.000	
アメリカ・ドル 小計			433,829,462.280 (69,490,803,268)	
イギリス・ポンド	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	810,000.000	424,845.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	400,000.000	201,200.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	820,000.000	594,221.200	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	900,000.000	397,530.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	650,000.000	630,136.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	700,000.000	660,842.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	217,000.000	81,461.800	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	500,000.000	258,175.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20541022	670,000.000	296,475.000	

		0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,200,000.000	1,076,052.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20411022	700,000.000	407,561.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20301022	400,000.000	339,016.000	
		0.5% United Kingdom Gilt 20611022	850,000.000	201,662.500	
		0.125% United Kingdom Gilt 20280131	500,000.000	469,620.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20501022	820,000.000	286,262.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,630,000.000	1,133,176.000	
		0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,250,000.000	1,834,920.000	
		0.875% United Kingdom Gilt 20460131	200,000.000	90,170.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20510731	1,000,000.000	419,700.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	1,000,000.000	634,640.000	
		0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	2,200,000.000	2,002,044.000	
		0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	1,300,000.000	1,007,903.000	
		1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	200,000.000	86,690.000	
		1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	500,000.000	414,865.000	
		1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	200,000.000	58,272.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	800,000.000	709,080.000	
		3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	1,000,000.000	926,240.000	
		3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	700,000.000	522,130.000	
		4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	600,000.000	457,320.000	

		4.5% UNITED KINGDOM GILT 20280607	900,000.000	904,230.000	
		4.625% UNITED KINGDOM GILT 20340131	1,000,000.000	997,500.000	
		4.75% UNITED KINGDOM GILT 20431022	700,000.000	649,320.000	
		4.375% UNITED KINGDOM GILT 20540731	1,000,000.000	831,900.000	
		4% UNITED KINGDOM GILT 20311022	500,000.000	490,135.000	
		4.125% UNITED KINGDOM GILT 20290722	500,000.000	497,615.000	
		4.25% UNITED KINGDOM GILT 20340731	1,460,000.000	1,414,667.000	
		4.375% UNITED KINGDOM GILT 20400131	1,210,000.000	1,115,499.000	
		4.375% UNITED KINGDOM GILT 20280307	800,000.000	801,840.000	
		4.375% UNITED KINGDOM GILT 20300307	1,900,000.000	1,903,591.000	
		4.5% UNITED KINGDOM GILT 20350307	1,100,000.000	1,078,242.000	
		5.375% UNITED KINGDOM GILT 20560131	700,000.000	683,060.000	
		4.75% UNITED KINGDOM GILT 20351022	600,000.000	595,962.000	
		5.25% UNITED KINGDOM GILT 20410131	200,000.000	200,232.000	
		4.125% UNITED KINGDOM GILT 20310307	400,000.000	395,780.000	
		4.125% UNITED KINGDOM GILT 20330307	500,000.000	487,410.000	
		4.625% UNITED KINGDOM GILT 20370307	200,000.000	194,250.000	
		4.875% UNITED KINGDOM GILT 20360731	300,000.000	299,088.000	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	963,000.000	1,004,697.900	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,390,000.000	1,376,739.400	

	4.25% United Kingdom Gilt 20360307	915,000.000	871,656.450	
	4.75% United Kingdom Gilt 20381207	550,000.000	533,186.500	
	4.25% United Kingdom Gilt 20461207	770,000.000	655,077.500	
	4.25% United Kingdom Gilt 20271207	500,000.000	500,675.000	
	4.5% United Kingdom Gilt 20421207	911,000.000	828,463.400	
	4.75% United Kingdom Gilt 20301207	907,500.000	925,359.600	
	4.25% United Kingdom Gilt 20491207	743,000.000	620,702.200	
	4.25% United Kingdom Gilt 20390907	330,000.000	301,950.000	
	4.5% United Kingdom Gilt 20340907	600,000.000	591,720.000	
	4% United Kingdom Gilt 20600122	827,000.000	636,955.400	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	600,000.000	541,458.000	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	300,000.000	226,380.000	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	875,000.000	661,150.000	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	500,000.000	340,175.000	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	950,000.000	735,965.000	
イギリス・ポンド 小計			41,514,841.850 (8,944,787,825)	
イスラエル・シュケル	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,200,000.000	1,419,000.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	1,200,000.000	1,150,092.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,000,000.000	976,830.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	1,700,000.000	1,560,090.000	

	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,000,000.000	800,150.000	
	2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129	750,000.000	582,277.500	
	4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20350330	1,000,000.000	1,029,490.000	
	4.1% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20280731	2,700,000.000	2,743,281.000	
	4.15% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20351031	600,000.000	623,562.000	
	3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20310731	1,700,000.000	1,728,356.000	
イスラエル・シュケル 小計			12,613,128.500 (691,929,742)	
オーストラリア・ドル	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	520,000.000	503,843.600	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,159,000.000	1,151,443.320	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	725,000.000	657,662.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	800,000.000	682,248.000	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	184,000.000	154,094.480	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	800,000.000	780,632.000	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	658,000.000	631,265.460	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	775,000.000	556,225.250	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,250,000.000	1,201,712.500	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	200,000.000	189,460.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	1,600,000.000	1,490,016.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	510,000.000	388,257.900	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	1,800,000.000	1,561,806.000	

	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	850,000.000	705,933.500	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	750,000.000	380,475.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	1,000,000.000	832,670.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	500,000.000	421,675.000	
	3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	1,000,000.000	896,970.000	
	3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	1,000,000.000	938,070.000	
	3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221	400,000.000	365,520.000	
	4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20351221	1,500,000.000	1,438,140.000	
	4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20360321	600,000.000	573,978.000	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20361021	800,000.000	762,096.000	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20371021	700,000.000	692,419.000	
オーストラリア・ドル 小計			17,956,613.010 (2,034,125,122)	
オフショア・人民元	3.25% China Government Bond 20281122	6,500,000.000	6,843,915.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	11,000,000.000	11,707,630.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	5,300,000.000	5,647,362.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	24,000,000.000	24,432,720.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	4,000,000.000	4,195,720.000	
	3.28% China Government Bond 20271203	14,000,000.000	14,472,220.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	12,000,000.000	13,037,400.000	
	3.81% China Government Bond 20500914	9,500,000.000	12,183,370.000	

		3.01% China Government Bond 20280513	8,000,000.000	8,292,880.000	
		3.72% China Government Bond 20510412	6,000,000.000	7,632,540.000	
		3.02% China Government Bond 20310527	12,800,000.000	13,815,680.000	
		3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	6,500,000.000	6,710,600.000	
		3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	6,000,000.000	6,325,620.000	
		3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	10,000,000.000	10,553,700.000	
		4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	6,400,000.000	8,446,400.000	
		3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	7,000,000.000	8,981,910.000	
		3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	7,600,000.000	9,137,328.000	
		2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	3,500,000.000	3,640,420.000	
		3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	3,300,000.000	4,100,382.000	
		2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	5,300,000.000	5,701,740.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	9,800,000.000	10,469,536.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	4,000,000.000	4,172,640.000	
		3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	4,000,000.000	4,820,680.000	
		2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	8,000,000.000	8,563,840.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	3,000,000.000	3,130,620.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	11,000,000.000	11,715,660.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	2,000,000.000	2,125,520.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	13,000,000.000	13,549,120.000	

		2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	16,000,000.000	16,244,640.000	
		3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	4,000,000.000	4,671,160.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	8,000,000.000	8,621,840.000	
		2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	13,000,000.000	13,660,790.000	
		2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	8,000,000.000	8,186,320.000	
		2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	8,000,000.000	8,697,440.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	21,000,000.000	22,161,300.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	4,000,000.000	4,105,760.000	
		3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	6,000,000.000	7,093,680.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	9,000,000.000	9,643,950.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	11,000,000.000	11,532,730.000	
		2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	20,000,000.000	20,488,600.000	
		2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	7,000,000.000	7,436,240.000	
		2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925	11,000,000.000	11,318,780.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	21,000,000.000	22,024,170.000	
		3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	6,500,000.000	7,478,185.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	12,000,000.000	12,899,400.000	
		2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225	8,000,000.000	8,390,160.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20290115	10,000,000.000	10,285,300.000	
		2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225	9,000,000.000	9,467,190.000	

		2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325	17,000,000.000	17,653,480.000	
		2.05% CHINA GOVERNMENT BOND 20290415	16,000,000.000	16,338,240.000	
		2.27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525	10,000,000.000	10,462,400.000	
		2.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20310625	10,000,000.000	10,321,200.000	
		1.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20290715	10,000,000.000	10,175,000.000	
		1.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20270815	10,000,000.000	10,052,000.000	
		2.11% CHINA GOVERNMENT BOND 20340825	15,000,000.000	15,521,400.000	
		1.87% CHINA GOVERNMENT BOND 20310915	5,000,000.000	5,096,000.000	
		1.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20291015	4,000,000.000	4,051,000.000	
		1.42% CHINA GOVERNMENT BOND 20271115	17,000,000.000	17,045,390.000	
		2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20341125	18,000,000.000	18,514,620.000	
		1.49% CHINA GOVERNMENT BOND 20311225	2,000,000.000	1,997,660.000	
		1.43% CHINA GOVERNMENT BOND 20300125	15,000,000.000	15,026,850.000	
		1.92% CHINA GOVERNMENT BOND 20550115	5,600,000.000	5,175,688.000	
		1.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20350215	6,000,000.000	5,953,080.000	
		1.45% CHINA GOVERNMENT BOND 20280225	20,000,000.000	20,077,200.000	
		1.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20320325	15,000,000.000	15,223,350.000	
		1.65% CHINA GOVERNMENT BOND 20350515	7,000,000.000	6,968,220.000	
		1.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20280525	13,000,000.000	13,060,190.000	
		1.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20350525	12,000,000.000	11,957,280.000	

	1.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20300725	4,000,000.000	4,025,680.000	
	1.42% CHINA GOVERNMENT BOND 20280815	9,000,000.000	9,023,940.000	
	1.83% CHINA GOVERNMENT BOND 20350825	12,000,000.000	12,080,400.000	
	1.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20270915	13,000,000.000	13,032,240.000	
	1.78% CHINA GOVERNMENT BOND 20320915	22,000,000.000	22,289,080.000	
	1.78% CHINA GOVERNMENT BOND 20351115	14,000,000.000	14,033,040.000	
	1.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20281125	8,000,000.000	8,024,400.000	
	1.66% CHINA GOVERNMENT BOND 20321225	9,000,000.000	9,040,410.000	
	1.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20310125	9,000,000.000	9,032,670.000	
	2.38% CHINA GOVERNMENT BOND 20560115	3,900,000.000	3,976,635.000	
	1.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20290225	8,000,000.000	8,006,240.000	
	1.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20360225	17,000,000.000	16,995,410.000	
	1.29% CHINA GOVERNMENT BOND 20280315	3,000,000.000	3,001,080.000	
	1.66% CHINA GOVERNMENT BOND 20330325	10,000,000.000	10,042,500.000	
	1.5% CHINA GOVERNMENT BOND 20310415	5,000,000.000	5,008,500.000	
オフショア・人民元 小計			847,097,261.000 (20,069,851,856)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	760,000.000	596,820.400	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	907,000.000	980,566.770	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	300,000.000	341,406.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	620,000.000	648,340.200	

3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	140,000.000	136,179.400	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	500,000.000	424,180.000	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	930,000.000	916,663.800	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	600,000.000	591,426.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	1,570,000.000	1,108,891.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,300,000.000	1,277,783.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	2,400,000.000	2,245,920.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	2,000,000.000	1,856,920.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	250,000.000	162,447.500	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,000,000.000	919,960.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	500,000.000	469,165.000	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,000,000.000	960,600.000	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	1,500,000.000	1,519,230.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	600,000.000	582,564.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201	1,400,000.000	1,136,940.000	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20331201	1,500,000.000	1,499,175.000	
3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340601	1,500,000.000	1,469,610.000	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20341201	800,000.000	795,704.000	
3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20350601	1,000,000.000	991,480.000	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20571201	300,000.000	282,744.000	

	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300901	1,000,000.000	989,920.000	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20351201	1,200,000.000	1,185,396.000	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20271101	1,000,000.000	997,730.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310301	500,000.000	493,635.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280201	1,000,000.000	992,550.000	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20360601	200,000.000	196,858.000	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280501	1,000,000.000	995,270.000	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310901	500,000.000	498,115.000	
カナダ・ドル 小計			28,264,190.070 (3,241,619,959)	
シンガポール・ドル	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	600,000.000	628,344.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	239,000.000	263,258.500	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	420,000.000	460,110.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	500,000.000	518,000.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	300,000.000	336,369.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	260,000.000	265,330.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	300,000.000	305,970.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	350,000.000	342,650.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	170,000.000	167,110.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	200,000.000	250,500.000	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20540601	80,000.000	100,696.800	

	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20350301	200,000.000	212,400.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20400701	300,000.000	309,051.000	
シンガポール・ドル 小計			4,159,789.300 (520,056,858)	
スウェーデン・クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	2,520,000.000	2,679,087.600	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	2,550,000.000	2,477,682.000	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	500,000.000	492,165.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	3,000,000.000	2,840,340.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	4,000,000.000	3,569,240.000	
	1.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20331111	1,500,000.000	1,411,035.000	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20350511	1,000,000.000	962,380.000	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20361015	2,000,000.000	1,942,340.000	
スウェーデン・クローナ 小計			16,374,269.600 (279,836,267)	
デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	4,740,000.000	5,527,077.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	3,200,000.000	3,122,464.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	1,700,000.000	1,594,566.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	2,400,000.000	1,162,776.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	2,000,000.000	1,746,980.000	
デンマーク・クローネ 小計			13,153,863.000 (327,005,034)	
ニュージーランド・ドル	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	300,000.000	287,814.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	300,000.000	253,668.000	

	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	500,000.000	491,855.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	500,000.000	445,595.000	
	2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	500,000.000	445,385.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	200,000.000	135,014.000	
	5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20540515	250,000.000	247,517.500	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20350515	700,000.000	705,880.000	
	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20360515	600,000.000	589,332.000	
ニュージーランド・ドル 小計			3,602,060.500 (337,405,007)	
ノルウェー・クローネ	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	2,000,000.000	1,910,640.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	2,000,000.000	1,839,020.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	2,500,000.000	2,218,650.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	2,000,000.000	1,715,400.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	2,000,000.000	1,774,180.000	
	3.625% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20390531	1,300,000.000	1,211,834.000	
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20350612	5,000,000.000	4,797,950.000	
ノルウェー・クローネ 小計			15,467,674.000 (261,094,337)	
ポーランド・ズロチ	2.5% Poland Government Bond 20270725	1,815,000.000	1,787,375.700	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	2,300,000.000	2,168,302.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	1,800,000.000	1,552,122.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	2,300,000.000	1,916,521.000	

	7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	2,000,000.000	2,121,440.000	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	2,000,000.000	2,083,240.000	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725	1,000,000.000	1,004,230.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20341025	2,000,000.000	1,946,240.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300125	1,500,000.000	1,514,730.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20280125	1,300,000.000	1,217,827.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20351025	1,400,000.000	1,348,088.000	
	4.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20310125	4,000,000.000	3,932,200.000	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20360425	600,000.000	585,660.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	600,000.000	619,284.000	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	1,800,000.000	1,754,082.000	
ポーランド・ズロチ 小計			25,551,341.700 (1,118,967,352)	
マレーシア・リンギット	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,760,000.000	1,831,667.200	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,000,000.000	1,037,110.000	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,400,000.000	1,424,080.000	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,500,000.000	1,515,630.000	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	700,000.000	788,564.000	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	500,000.000	525,030.000	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	1,420,000.000	1,568,375.800	
	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	500,000.000	505,495.000	

	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,000,000.000	1,096,030.000	
	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	1,600,000.000	1,778,224.000	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,200,000.000	1,221,660.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,323,127.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	400,000.000	397,120.000	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	1,400,000.000	1,404,074.000	
	3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	1,200,000.000	1,204,392.000	
	3.917% MALAYSIAN GOVERNMENT 20550715	1,000,000.000	970,280.000	
	3.766% MALAYSIAN GOVERNMENT 20410115	1,000,000.000	991,490.000	
マレーシア・リンギット 小計			19,582,349.000 (775,453,187)	
メキシコ・ペソ	8% Mexican Bonos 20471107	11,450,000.000	9,863,602.500	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	10,000,000.000	8,512,600.000	
	7.5% MEXICAN BONOS 20330526	10,000,000.000	9,336,100.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20290301	18,500,000.000	18,770,655.000	
	8% MEXICAN BONOS 20360221	10,000,000.000	9,349,000.000	
	8% MEXICAN BONOS 20320415	15,000,000.000	14,511,900.000	
	8% MEXICAN BONOS 20550429	2,000,000.000	1,697,700.000	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	20,800,000.000	20,912,736.000	
	10% Mexican Bonos 20361120	2,750,000.000	2,926,412.500	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	6,500,000.000	6,589,570.000	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	5,000,000.000	4,707,900.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	12,700,000.000	12,342,368.000	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	19,050,000.000	16,308,705.000	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	16,300,000.000	15,145,960.000	
メキシコ・ペソ 小計			150,975,209.000 (1,407,798,531)	

ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	190,000.000	171,946.200	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	270,000.000	175,986.000	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	200,000.000	194,814.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	150,000.000	129,265.500	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	476,650.000	
	0.125% Finland Government Bond 20360415	350,000.000	257,173.000	
	0.25% Finland Government Bond 20400915	650,000.000	407,491.500	
	1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	1,300,000.000	1,189,305.000	
	2.875% FINLAND GOVERNMENT BOND 20290415	300,000.000	301,275.000	
	2.95% FINLAND GOVERNMENT BOND 20550415	500,000.000	417,630.000	
	3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20340915	350,000.000	345,607.500	
	3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20350915	200,000.000	195,940.000	
	1.5% Austria Government Bond 20470220	470,000.000	321,846.600	
	1.5% Austria Government Bond 20861102	110,000.000	52,356.700	
	2.1% Austria Government Bond 21170920	200,000.000	118,814.000	
	0.75% Austria Government Bond 20280220	530,000.000	513,601.800	
	0.5% Austria Government Bond 20290220	700,000.000	660,772.000	
	Austria Government Bond 20300220	450,000.000	407,047.500	
	0.75% Austria Government Bond 20510320	550,000.000	286,022.000	
	Austria Government Bond 20401020	500,000.000	302,965.000	

		0.85% Austria Government Bond 21200630	240,000.000	74,040.000	
		Austria Government Bond 20310220	1,000,000.000	876,940.000	
		0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	200,000.000	147,386.000	
		0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	150,000.000	52,761.000	
		0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	500,000.000	447,710.000	
		1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	200,000.000	143,152.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	800,000.000	794,952.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20290523	500,000.000	502,965.000	
		3.45% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20301020	100,000.000	102,587.000	
		2.95% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20350220	300,000.000	295,146.000	
		3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20360220	450,000.000	448,380.000	
		3.75% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20560320	200,000.000	197,562.000	
		1% Belgium Government Bond 20310622	300,000.000	272,703.000	
		1.9% Belgium Government Bond 20380622	460,000.000	379,380.400	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	650,000.000	416,227.500	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	300,000.000	175,029.000	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	310,000.000	198,527.100	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	400,000.000	321,916.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	500,000.000	482,070.000	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	100,000.000	88,529.000	

		0.9% Belgium Government Bond 20290622	500,000.000	473,450.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	150,000.000	92,391.000	
		0.1% Belgium Government Bond 20300622	900,000.000	806,499.000	
		0.4% Belgium Government Bond 20400622	600,000.000	375,462.000	
		Belgium Government Bond 20311022	400,000.000	341,168.000	
		0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	600,000.000	510,924.000	
		1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	400,000.000	214,724.000	
		2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	500,000.000	448,230.000	
		3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	800,000.000	790,600.000	
		3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	400,000.000	331,976.000	
		2.85% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20341022	300,000.000	289,098.000	
		3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20550622	400,000.000	342,512.000	
		2.7% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20291022	1,000,000.000	996,910.000	
		3.1% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20350622	300,000.000	292,269.000	
		3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20420622	100,000.000	93,287.000	
		3.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20360622	400,000.000	395,160.000	
		4.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20560622	200,000.000	198,088.000	
		2% Slovakia Government Bond 20471017	123,000.000	83,894.610	
		1% Slovakia Government Bond 20320514	240,000.000	212,851.200	
		0.375% Slovakia Government Bond 20360421	285,000.000	208,939.200	

1% SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 20511013	83,000.000	41,563.910	
3.75% SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 20350223	132,000.000	134,048.640	
3.625% SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 20330608	170,000.000	173,250.400	
3.75% SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 20400227	130,000.000	126,674.600	
1% SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 20301009	240,000.000	221,335.200	
3.625% SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 20290116	190,000.000	193,583.400	
3.75% SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 20340306	150,000.000	153,568.500	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	455,000.000	473,436.600	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	800,000.000	836,536.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	800,000.000	834,136.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	496,000.000	555,901.920	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	2,000,000.000	2,237,580.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,100,000.000	1,246,850.000	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	1,390,000.000	1,507,468.900	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,020,000.000	1,130,639.400	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	800,000.000	931,912.000	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	656,000.000	646,245.280	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,098,000.000	961,880.940	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	800,000.000	688,576.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	1,100,000.000	1,074,447.000	

1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	1,250,000.000	819,237.500	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,800,000.000	1,739,718.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	200,000.000	190,344.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	1,300,000.000	1,222,676.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	500,000.000	460,920.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,400,000.000	603,638.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	500,000.000	385,350.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,076,268.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	600,000.000	530,466.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	1,200,000.000	892,044.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	1,500,000.000	1,410,450.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,450,000.000	627,545.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,000,000.000	870,940.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,000,000.000	871,240.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	1,100,000.000	943,426.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	800,000.000	558,104.000	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	1,000,000.000	982,430.000	
2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,100,000.000	1,065,559.000	
2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	900,000.000	871,938.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	400,000.000	279,964.000	

		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330815	1,000,000.000	983,810.000	
		2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,000,000.000	987,860.000	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340215	800,000.000	762,632.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20540815	1,100,000.000	896,159.000	
		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20410515	800,000.000	730,840.000	
		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340815	1,000,000.000	977,590.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20350215	1,200,000.000	1,159,764.000	
		2.9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20560815	950,000.000	836,095.000	
		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20350815	1,500,000.000	1,455,720.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20321115	300,000.000	294,648.000	
		2.9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20360215	400,000.000	396,624.000	
		3.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20470515	400,000.000	395,352.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	200,000.000	80,378.000	
		1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270610	1,800,000.000	1,785,330.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,200,000.000	1,189,548.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280614	400,000.000	399,116.000	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	1,000,000.000	992,840.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	600,000.000	591,576.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	500,000.000	493,085.000	
		2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300418	2,700,000.000	2,674,269.000	

2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310416	200,000.000	198,038.000	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	2,300,000.000	2,466,474.000	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,000,000.000	2,284,360.000	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	1,210,000.000	1,318,028.800	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	600,000.000	553,602.000	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	1,265,000.000	1,278,029.500	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	1,143,000.000	1,200,938.670	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	700,000.000	636,608.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	2,410,000.000	2,410,457.900	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	990,000.000	865,646.100	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	3,200,000.000	3,147,712.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	2,800,000.000	2,601,340.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	1,650,000.000	1,317,987.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	1,000,000.000	779,080.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	760,000.000	510,697.200	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	2,500,000.000	2,406,075.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	2,000,000.000	1,695,500.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	2,750,000.000	2,618,687.500	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	1,050,000.000	604,968.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	3,600,000.000	3,365,604.000	

0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	1,230,000.000	539,601.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	800,000.000	501,272.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	700,000.000	613,627.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	300,000.000	77,040.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	1,400,000.000	752,262.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	2,200,000.000	1,859,418.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	1,000,000.000	424,830.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	1,100,000.000	911,592.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	1,000,000.000	749,830.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	1,500,000.000	1,450,860.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	2,000,000.000	1,853,580.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	1,400,000.000	1,117,900.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	1,100,000.000	842,754.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20330525	800,000.000	783,024.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20331125	2,300,000.000	2,313,294.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20490625	300,000.000	241,629.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270924	2,000,000.000	1,994,620.000	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550525	800,000.000	639,920.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300225	2,200,000.000	2,186,206.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20341125	1,300,000.000	1,250,600.000	

3.6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20420525	300,000.000	281,397.000	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20560525	900,000.000	787,482.000	
3.2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350525	2,000,000.000	1,942,100.000	
2.7% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310225	900,000.000	886,266.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20351125	1,300,000.000	1,285,232.000	
4.1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20460525	200,000.000	195,498.000	
4.4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20570525	600,000.000	586,428.000	
3.8% FRENCH GOVERNMENT BOND 20370625	1,000,000.000	1,000,660.000	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20320225	500,000.000	501,625.000	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	800,000.000	859,632.000	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	880,000.000	914,874.400	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	390,000.000	381,135.300	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	910,000.000	808,717.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	500,000.000	490,520.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	770,312.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	700,000.000	650,594.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	250,000.000	173,175.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	200,000.000	81,570.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	700,000.000	608,496.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	220,000.000	151,608.600	

NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	500,000.000	467,405.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	600,000.000	521,814.000	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	1,030,000.000	751,570.400	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715	500,000.000	486,520.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300115	200,000.000	198,564.000	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20440115	100,000.000	97,307.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20340715	1,000,000.000	965,410.000	
3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20560115	100,000.000	98,734.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310115	500,000.000	494,310.000	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20360715	200,000.000	193,746.000	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	1,135,000.000	1,192,499.100	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	505,000.000	433,471.800	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	500,000.000	459,705.000	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	300,000.000	234,102.000	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	450,000.000	394,087.500	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	350,000.000	243,960.500	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	400,000.000	376,116.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	910,000.000	797,160.000	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,050,000.000	2,036,634.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	700,000.000	635,754.000	

2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	1,500,000.000	1,483,170.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	800,000.000	800,488.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	700,000.000	688,366.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,000,000.000	925,210.000	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	500,000.000	471,515.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	200,000.000	142,004.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	900,000.000	736,488.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	500,000.000	460,430.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	600,000.000	565,224.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	700,000.000	523,817.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,000,000.000	903,200.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	400,000.000	235,576.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	200,000.000	150,402.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,000,000.000	881,150.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	200,000.000	117,126.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	300,000.000	266,811.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,900,000.000	1,666,680.000	
0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	700,000.000	657,664.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	200,000.000	129,650.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	500,000.000	498,910.000	

2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	400,000.000	381,564.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	400,000.000	376,712.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	900,000.000	927,864.000	
4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	1,000,000.000	1,062,930.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	1,500,000.000	1,544,610.000	
3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,300,000.000	1,314,508.000	
4.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20430901	100,000.000	102,886.000	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	600,000.000	601,980.000	
3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	500,000.000	512,710.000	
4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	800,000.000	846,712.000	
3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280801	1,000,000.000	1,020,650.000	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,200,000.000	1,220,712.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290701	1,500,000.000	1,519,425.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340701	1,000,000.000	1,022,230.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350201	1,000,000.000	1,018,860.000	
4.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20541001	700,000.000	678,503.000	
3.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311115	1,000,000.000	998,040.000	
3.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350801	600,000.000	600,192.000	
4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460430	700,000.000	681,527.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20401001	1,000,000.000	976,510.000	

		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320715	400,000.000	399,208.000	
		3.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20351001	500,000.000	497,380.000	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301001	1,000,000.000	985,820.000	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321115	1,000,000.000	995,220.000	
		4.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20551001	200,000.000	204,064.000	
		3.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330315	700,000.000	690,529.000	
		2.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290315	100,000.000	98,775.000	
		3.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20411001	600,000.000	587,334.000	
		3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360701	1,400,000.000	1,406,678.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	1,840,000.000	1,977,356.000	
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	1,488,000.000	1,682,243.520	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	400,000.000	456,760.000	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	750,000.000	827,925.000	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	1,270,000.000	1,298,613.100	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,290,000.000	1,426,417.500	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	500,000.000	552,560.000	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,080,000.000	2,166,652.800	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	605,000.000	646,182.350	

		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,370,000.000	1,396,646.500	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,000,000.000	1,048,400.000	
		5% Belgium Government Bond 20350328	750,000.000	840,165.000	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	300,000.000	311,169.000	
		4% Belgium Government Bond 20320328	500,000.000	525,040.000	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	200,000.000	190,422.000	
		3% Belgium Government Bond 20340622	300,000.000	293,766.000	
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	680,000.000	671,615.600	
		2% IRISH TREASURY 20450218	510,000.000	402,900.000	
		1.7% IRISH TREASURY 20370515	500,000.000	429,305.000	
		0.9% IRISH TREASURY 20280515	400,000.000	387,516.000	
		1.3% IRISH TREASURY 20330515	150,000.000	134,913.000	
		1.35% IRISH TREASURY 20310318	100,000.000	93,808.000	
		1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	397,308.000	
		0.55% IRISH TREASURY 20410422	200,000.000	133,080.000	
		3.1% IRISH TREASURY 20360618	100,000.000	99,379.000	
		6.25% Austria Government Bond 20270715	380,000.000	394,645.200	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	500,000.000	538,155.000	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	170,000.000	170,117.300	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	200,000.000	187,404.000	

		2.4% Austria Government Bond 20340523	800,000.000	761,112.000	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	120,000.000	120,252.000	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	910,000.000	880,243.000	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	350,000.000	298,067.000	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	880,000.000	757,724.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	820,000.000	778,901.600	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	1,170,000.000	1,152,099.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	3,150,000.000	3,079,314.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	780,000.000	630,388.200	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	900,000.000	869,544.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	300,000.000	265,386.000	
		0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	900,000.000	838,305.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	800,000.000	424,488.000	
		1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	800,000.000	748,384.000	
		1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	400,000.000	287,300.000	
		0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	1,500,000.000	1,312,215.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	150,000.000	68,868.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	1,000,000.000	958,990.000	
		0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	900,000.000	678,213.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	500,000.000	330,055.000	

		0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	900,000.000	790,011.000	
		1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	550,000.000	355,910.500	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	1,400,000.000	1,318,968.000	
		2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	1,750,000.000	1,699,652.500	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	640,000.000	603,884.800	
		3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	1,000,000.000	1,001,560.000	
		3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730	630,000.000	643,406.400	
		3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290531	1,500,000.000	1,532,295.000	
		3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20340430	2,100,000.000	2,100,945.000	
		4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20541031	400,000.000	390,916.000	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20341031	600,000.000	607,032.000	
		3.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310730	1,000,000.000	1,008,290.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300131	1,600,000.000	1,594,704.000	
		3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350430	1,300,000.000	1,282,164.000	
		3.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20351031	300,000.000	295,710.000	
		3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330131	300,000.000	298,089.000	
		3.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20360430	700,000.000	692,748.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290331	400,000.000	395,696.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	680,000.000	783,128.800	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,100,000.000	1,167,925.000	

		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	800,000.000	901,104.000	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	500,000.000	551,675.000	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	990,000.000	1,149,875.100	
		4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20370415	1,000,000.000	1,060,830.000	
		2.125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20281017	1,000,000.000	989,770.000	
		4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20450215	200,000.000	206,544.000	
		2.25% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20340418	500,000.000	469,160.000	
		1.95% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20290615	500,000.000	490,140.000	
		0.475% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20301018	500,000.000	453,590.000	
		0.3% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20311017	600,000.000	524,904.000	
		3.625% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20540612	400,000.000	373,040.000	
		3.25% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20360613	200,000.000	198,046.000	
	ユーロ 小計			243,727,961.040 (45,289,529,720)	
	韓国・ウォン	1.875% KOREA TREASURY BOND 20510310	1,000,000,000.000	630,650,000.000	
		2.625% KOREA TREASURY BOND 20550310	550,000,000.000	402,688,000.000	
		3.25% KOREA TREASURY BOND 20540310	500,000,000.000	417,780,000.000	
		2% KOREA TREASURY BOND 20490310	300,000,000.000	200,025,000.000	
		1.5% KOREA TREASURY BOND 20500310	500,000,000.000	292,090,000.000	
		1.375% KOREA TREASURY BOND 20300610	100,000,000.000	90,637,000.000	
		1.5% KOREA TREASURY BOND 20301210	300,000,000.000	269,709,000.000	

		1.875% KOREA TREASURY BOND 20410910	300,000,000.000	219,453,000.000	
		2.375% KOREA TREASURY BOND 20311210	200,000,000.000	183,746,000.000	
		3.25% KOREA TREASURY BOND 20530310	300,000,000.000	250,680,000.000	
		3.625% KOREA TREASURY BOND 20530910	600,000,000.000	537,324,000.000	
		3.875% KOREA TREASURY BOND 20430910	320,000,000.000	303,552,000.000	
		2.75% KOREA TREASURY BOND 20540910	600,000,000.000	452,238,000.000	
		2.875% KOREA TREASURY BOND 20440910	150,000,000.000	123,100,500.000	
		2.625% KOREA TREASURY BOND 20550910	250,000,000.000	182,352,500.000	
		2.75% KOREA TREASURY BOND 20450910	430,000,000.000	343,238,900.000	
		2.75% KOREA TREASURY BOND 20281210	300,000,000.000	292,782,000.000	
		3.25% KOREA TREASURY BOND 20351210	480,000,000.000	444,777,600.000	
		3.5% KOREA TREASURY BOND 20560310	400,000,000.000	350,216,000.000	
		3.75% KOREA TREASURY BOND 20331210	250,000,000.000	243,725,000.000	
		2.75% KOREA TREASURY BOND 20441210	300,000,000.000	240,945,000.000	
		2% KOREA TREASURY BOND 20460310	300,000,000.000	208,530,000.000	
		2.125% KOREA TREASURY BOND 20470310	150,000,000.000	105,367,500.000	
	韓国・ウォン 小計			6,785,607,000.000 (720,522,894)	
国債証券 合計				155,510,786,959 [155,510,786,959]	
合計				155,510,786,959 [155,510,786,959]	

（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	214銘柄	100%	44.7%
イギリス・ポンド	国債証券	64銘柄	100%	5.8%
イスラエル・シュケル	国債証券	10銘柄	100%	0.4%
オーストラリア・ドル	国債証券	24銘柄	100%	1.3%
オフショア・人民元	国債証券	83銘柄	100%	12.9%
カナダ・ドル	国債証券	32銘柄	100%	2.1%
シンガポール・ドル	国債証券	13銘柄	100%	0.3%
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	5銘柄	100%	0.2%
ニュージーランド・ドル	国債証券	9銘柄	100%	0.2%
ノルウェー・クローネ	国債証券	7銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券	15銘柄	100%	0.7%
マレーシア・リンギット	国債証券	17銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	14銘柄	100%	0.9%
ユーロ	国債証券	330銘柄	100%	29.1%
韓国・ウォン	国債証券	23銘柄	100%	0.5%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間(2025年6月17日から2026年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	168,453,348	230,931,116
親投資信託受益証券	26,052,513,368	46,155,793,309
流動資産合計	26,220,966,716	46,386,724,425
資産合計	26,220,966,716	46,386,724,425
負債の部		
流動負債		
未払解約金	40,026,978	9,066,369
未払受託者報酬	2,656,234	4,480,268
未払委託者報酬	47,812,914	80,645,598
その他未払費用	996,016	1,082,760
流動負債合計	91,492,142	95,274,995
負債合計	91,492,142	95,274,995
純資産の部		
元本等		
元本	※1 18,710,739,378	※1 29,035,540,465
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,418,735,196	17,255,908,965
（分配準備積立金）	1,962,111,188	5,311,395,254
元本等合計	26,129,474,574	46,291,449,430
純資産合計	26,129,474,574	46,291,449,430
負債純資産合計	26,220,966,716	46,386,724,425

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 自　2024年6月18日 至　2025年6月16日	第10期 自　2025年6月17日 至　2026年6月15日
営業収益		
受取利息	357,496	1,041,438
有価証券売買等損益	△ 447,459,058	4,491,883,624
営業収益合計	△ 447,101,562	4,492,925,062
営業費用		
受託者報酬	4,945,370	7,822,670
委託者報酬	89,018,061	140,809,587
その他費用	1,854,365	2,193,608
営業費用合計	95,817,796	150,825,865
営業利益又は営業損失（△）	△ 542,919,358	4,342,099,197
経常利益又は経常損失（△）	△ 542,919,358	4,342,099,197
当期純利益又は当期純損失（△）	△ 542,919,358	4,342,099,197
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（△）	△ 63,495,761	328,039,803
期首剰余金又は期首欠損金（△）	5,619,016,876	7,418,735,196
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,362,878,498	7,143,651,504
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,362,878,498	7,143,651,504
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,083,736,581	1,320,537,129
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,083,736,581	1,320,537,129
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,418,735,196	17,255,908,965

(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10期 自2025年6月17日 至2026年6月15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 2025年6月15日が休日のため、前計算期間末日を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9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
1.　※1 期首元本額	12,917,741,944円	18,710,739,378円
期中追加設定元本額	8,320,396,861円	13,448,340,368円
期中一部解約元本額	2,527,399,427円	3,123,539,281円
2.　計算期間末日における受益権の総数	18,710,739,378口	29,035,540,465口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日	第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日

※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（5,456,624,008円）及び分配準備積立金（1,962,111,188円）より分配対象額は7,418,735,196円（1万口当たり3,964.96円）であり、分配を行っておりません。	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（996,190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（3,593,572,664円）、投資信託約款に規定される収益調整金（11,944,513,711円）及び分配準備積立金（1,716,826,400円）より分配対象額は17,255,908,965円（1万口当たり5,943.03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10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	第10期 2026年6月15日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	△428,095,660	4,369,357,911
合計	△428,095,660	4,369,357,911

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3965円 (13,965円)	1.5943円 (15,943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	11,033,872,800	46,155,793,309	
親投資信託受益証券 合計			46,155,793,309	
合計			46,155,793,309	

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

	2025年6月16日現在 金 額（円）	2026年6月15日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		

預金	2,411,669,275	1,309,327,812
コール・ローン	1,239,485,159	1,572,494,890
国債証券	332,386,902,609	418,717,820,331
派生商品評価勘定	7,692,152	3,272,691
未収入金	2,715,975	1,290,989
未収利息	2,649,765,248	3,417,404,841
前払費用	173,055,867	264,490,523
流動資産合計	338,871,286,285	425,286,102,077
資産合計	338,871,286,285	425,286,102,077
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,242,505	4,472,071
未払金	35,510	346,414
未払解約金	76,754,967	465,993,509
流動負債合計	78,032,982	470,811,994
負債合計	78,032,982	470,811,994
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	92,889,444,303	101,554,320,093
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	245,903,809,000	323,260,969,990
元本等合計	338,793,253,303	424,815,290,083
純資産合計	338,793,253,303	424,815,290,083
負債純資産合計	338,871,286,285	425,286,102,077

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2026年6月15日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2025年6月16日現在	2026年6月15日現在
1.　※1 期首	2024年6月18日	2025年6月17日
期首元本額	86,637,182,960円	92,889,444,303円
期中追加設定元本額	16,478,826,746円	19,056,451,819円
期中一部解約元本額	10,226,565,403円	10,391,576,029円
期末元本額の内訳		
ファンド名		

ダイワ外国債券インデックスＶＡ	277,900,961円	242,881,740円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	4,730,030円	3,778,493円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	24,917,757円	13,607,695円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	12,385,718円	12,142,433円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	147,712,078円	121,744,486円
外国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	964,924,636円	1,118,520,148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）	667,057,238円	732,032,530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）	1,028,574,741円	1,137,066,960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）	7,142,958,728円	11,033,872,800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）	1,077,882,036円	939,262,943円
Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス	1,389,137円	1,452,517円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	26,007,029円	34,411,361円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	1,314,132,605円	1,159,308,193円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	3,091,527,705円	3,663,126,761円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	720,414,402円	855,669,563円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	3,641,146円	5,259,350円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	50,894,144,304円	49,260,073,153円
ダイワ・ライフ・バランス３０	1,217,184,241円	1,209,160,822円
ダイワ・ライフ・バランス５０	975,382,066円	1,058,288,910円
ダイワ・ライフ・バランス７０	792,786,843円	922,600,408円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	776,125,300円	805,971,523円

ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	634,495,162円	683,654,364円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	302,956,186円	334,585,297円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	32,815,448円	32,395,910円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	27,157,786円	37,801,990円
ダイワつみたてインデックス外国債券	2,702,030,472円	3,351,387,824円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	5,257,691円	5,627,377円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	2,866,171円	3,872,395円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	36,309,993円	47,318,301円
ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ラップ専用）	2,911,995,855円	3,411,894,096円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	83,002,090円	49,931,831円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	26,997,549円	25,533,527円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	2,220,067,551円	1,911,163,567円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	146,975,221円	123,553,372円
スタイル9（4資産分散・保守型）	315,795円	213,811円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	3,721,549円	5,133,513円
スタイル9（4資産分散・積極型）	3,928,369円	6,224,915円
スタイル9（6資産分散・保守型）	117,952円	81,631円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	3,601,928円	3,745,620円
スタイル9（6資産分散・積極型）	1,637,839円	1,200,905円
スタイル9（8資産分散・保守型）	180,725円	233,907円

スタイル9（8資産分散・バランス型）	2,278,539円	3,371,837円
スタイル9（8資産分散・積極型）	2,378,158円	3,298,444円
ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	2,825,120円	888,965,527円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル1（安定）	-円	494,982円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル2（やや安定）	-円	372,398円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル3（バランス）	-円	255,752円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル4（やや積極）	-円	133,135円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル5（積極）	-円	47,910円
ダイワ・インデックスセレクト外国債券	117,205,552円	99,767,904円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	66,986,339円	66,545,166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）	6,177,489,546円	9,864,125,403円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	6,112,379,343円	6,164,221,930円
ダイワライフスタイル２５	24,284,842円	20,921,024円
ダイワライフスタイル５０	58,130,970円	57,469,496円
ダイワライフスタイル７５	17,275,861円	18,542,243円
計	92,889,444,303円	101,554,320,093円
2. 期末日における受益権の総数	92,889,444,303口	101,554,320,093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2025年6月17日 至2026年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 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	2026年6月15日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2025年6月16日現在	2026年6月15日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）

国債証券	△2,989,504,497	△6,594,426,669
合計	△2,989,504,497	△6,594,426,669

（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	2025年6月16日現在				2026年6月15日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	1,145,772,252	-	1,152,221,899	6,449,647	1,312,067,932	-	1,310,868,552	△1,199,380
アメリカ・ドル	69,180,071	-	69,729,880	549,809	189,358,111	-	189,321,600	△36,511
イギリス・ポンド	9,832,979	-	9,954,639	121,660	227,779,849	-	228,832,352	1,052,503
イスラエル・シュケル	44,810,036	-	43,678,152	△1,131,884	87,626,305	-	84,900,165	△2,726,140
オフショア・人民元	620,721,263	-	623,312,551	2,591,288	287,877,734	-	289,304,467	1,426,733
カナダ・ドル	233,241,297	-	236,223,120	2,981,823	17,432,361	-	17,303,392	△128,969
シンガポール・ドル	29,822,378	-	30,022,815	200,437	74,856,540	-	74,986,800	130,260
スウェーデン・クローナ	17,962,692	-	18,172,462	209,770	115,212,504	-	114,238,440	△974,064
ニュージーランド・ドル	-	-	-	-	33,299,490	-	32,750,200	△549,290
ユーロ	120,201,536	-	121,128,280	926,744	278,625,038	-	279,231,136	606,098
合計	1,145,772,252	-	1,152,221,899	6,449,647	1,312,067,932	-	1,310,868,552	△1,199,380

（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6月16日現在	2026年6月15日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.6473円 (36,473円)	4.1831円 (41,831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	729,709.890	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	757,512.720	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	767,071.620	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	2,512,223.700	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	2,076,000.000	2,095,825.800	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	886,597.250	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	541,424.000	

		4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	517,375.530	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	939,379.500	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,078,301.110	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,041,566.600	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,170,166.800	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	999,970.700	
		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	990,933.480	
		4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	769,000.000	726,551.200	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,249,686.240	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,302,769.650	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,342,241.600	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,178,168.500	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,313,282.910	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,071,291.870	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	4,231,000.000	3,216,025.410	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,232,557.100	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	2,089,403.160	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	1,755,005.580	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	2,726,114.800	

		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	1,791,199.940	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	4,307,000.000	3,632,308.450	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	1,327,000.000	1,077,139.170	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	1,502,266.620	
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	2,089,294.100	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,063,000.000	1,438,199.820	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	2,935,000.000	2,219,476.350	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	1,381,768.290	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	2,059,000.000	1,546,494.310	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	2,248,000.000	1,541,183.840	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	1,927,996.080	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	1,802,413.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,000,000.000	726,210.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,345,000.000	1,735,698.650	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	1,476,400.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	5,782,885.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,450,000.000	1,722,546.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,365,470.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	2,500,000.000	1,752,525.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	6,215,126.000	

		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,000,000.000	2,195,010.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	3,800,000.000	2,836,852.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	11,500,000.000	11,245,045.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	3,700,000.000	3,606,834.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	3,220,000.000	2,343,966.800	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	3,616,528.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	3,020,000.000	2,347,325.200	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	6,351,576.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	3,405,103.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,150,000.000	2,927,825.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	3,714,516.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	5,700,000.000	5,280,936.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	5,200,000.000	3,212,196.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,350,000.000	4,946,717.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	3,800,000.000	2,405,096.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	4,552,100.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20500215	4,400,000.000	2,546,412.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	6,800,000.000	5,935,652.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	3,900,000.000	1,843,179.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	3,400,000.000	2,137,784.000	

		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,386,950.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,377,185.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	8,000,000.000	6,920,880.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,802,050.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,200,000.000	3,019,338.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	5,600,000.000	3,485,216.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,356,640.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,818,400.000	
		0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	8,500,520.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,812,160.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,000,000.000	3,114,840.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	4,300,000.000	2,763,309.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,759,650.000	
		0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,745,100.000	
		0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,636,560.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	3,257,508.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	8,700,000.000	7,581,702.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,758,750.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	3,242,624.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	4,000,000.000	3,805,840.000	

		1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,000,000.000	7,086,800.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	8,000,000.000	7,593,280.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,400,000.000	3,976,960.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	2,756,482.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	6,000,000.000	5,681,940.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,724,000.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	10,300,000.000	8,887,149.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	3,900,000.000	2,206,698.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	5,700,000.000	3,798,708.000	
		1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,687,200.000	
		1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,687,750.000	
		1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	5,000,000.000	4,689,900.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311115	10,000,000.000	8,620,700.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20511115	6,000,000.000	3,276,540.000	
		2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20411115	4,000,000.000	2,755,600.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	5,630,940.000	
		1.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	5,600,000.000	5,260,136.000	
		1.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	6,500,000.000	6,073,535.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320215	7,900,000.000	6,956,424.000	
		1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	4,300,000.000	4,047,762.000	

		2.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520215	5,200,000.000	3,112,148.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420215	2,500,000.000	1,813,900.000	
		1.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,000,000.000	4,714,150.000	
		2.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	3,000,000.000	2,862,480.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320515	6,300,000.000	5,841,864.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520515	5,000,000.000	3,439,250.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420515	1,500,000.000	1,229,325.000	
		2.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,000,000.000	2,898,780.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	5,000,000.000	4,808,850.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	2,000,000.000	1,975,240.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	4,000,000.000	3,899,360.000	
		3.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	3,000,000.000	2,978,160.000	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	4,070,000.000	4,014,159.600	
		2.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320815	7,700,000.000	7,061,516.000	
		3% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20520815	4,700,000.000	3,313,312.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20420815	2,000,000.000	1,661,400.000	
		2.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	3,360,000.000	3,211,924.800	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	2,500,000.000	2,474,300.000	
		3.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	3,500,000.000	3,393,425.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	2,500,000.000	2,478,950.000	

4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	3,500,000.000	3,504,480.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031	3,000,000.000	3,002,910.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321115	10,200,000.000	10,098,714.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20521115	3,700,000.000	3,150,106.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	3,000,000.000	2,985,030.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	2,500,000.000	2,477,425.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	3,000,000.000	2,992,500.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20421115	2,500,000.000	2,246,625.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	3,000,000.000	2,971,380.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271231	1,500,000.000	1,495,770.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	3,000,000.000	2,933,070.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330215	8,000,000.000	7,621,200.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430215	2,500,000.000	2,205,850.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530215	4,500,000.000	3,579,390.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280131	14,700,000.000	14,569,023.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300228	8,700,000.000	8,650,323.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280229	3,000,000.000	2,996,460.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	1,800,000.000	1,765,602.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280331	3,700,000.000	3,670,770.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	3,000,000.000	2,927,970.000	

		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280430	2,000,000.000	1,978,740.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330515	8,800,000.000	8,297,080.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530515	5,600,000.000	4,451,328.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430515	2,500,000.000	2,200,375.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280531	3,700,000.000	3,667,736.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531	1,500,000.000	1,476,795.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	3,000,000.000	2,951,940.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280630	3,500,000.000	3,493,560.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	3,500,000.000	3,501,680.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330815	9,000,000.000	8,738,550.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20530815	5,000,000.000	4,345,400.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20430815	2,300,000.000	2,153,674.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	3,000,000.000	2,979,240.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300831	3,100,000.000	3,091,630.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	3,000,000.000	3,016,620.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930	1,500,000.000	1,525,095.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	4,200,000.000	4,246,998.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281031	6,000,000.000	6,101,340.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20331115	10,000,000.000	10,086,700.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20431115	2,300,000.000	2,252,551.000	

		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301031	3,100,000.000	3,183,173.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20531115	5,300,000.000	5,104,748.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301130	3,000,000.000	3,021,210.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281130	4,000,000.000	4,023,800.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310131	5,000,000.000	4,956,900.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301231	4,500,000.000	4,416,480.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290131	8,500,000.000	8,472,885.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281231	2,800,000.000	2,774,996.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340215	10,200,000.000	9,949,488.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540215	5,500,000.000	4,881,635.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440215	3,000,000.000	2,844,840.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310228	3,600,000.000	3,606,444.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290228	5,200,000.000	5,216,536.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290331	5,000,000.000	4,999,100.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310331	2,000,000.000	1,992,420.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340515	8,500,000.000	8,490,650.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290430	3,500,000.000	3,546,340.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310430	3,100,000.000	3,155,397.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540515	5,200,000.000	4,912,960.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440515	3,500,000.000	3,366,825.000	

4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290531	5,600,000.000	5,656,056.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310531	2,300,000.000	2,341,193.000	
4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270615	4,500,000.000	4,529,295.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310630	2,500,000.000	2,503,500.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290630	5,600,000.000	5,617,584.000	
4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270715	2,200,000.000	2,209,262.000	
4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290731	8,300,000.000	8,265,555.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310731	5,000,000.000	4,977,600.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20340815	10,500,000.000	10,121,790.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270815	7,000,000.000	6,980,120.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20540815	5,300,000.000	4,705,287.000	
3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310831	4,000,000.000	3,910,120.000	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20440815	1,800,000.000	1,620,306.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290831	5,000,000.000	4,922,050.000	
3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270915	4,000,000.000	3,969,520.000	
3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290930	6,800,000.000	6,664,884.000	
3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310930	2,300,000.000	2,234,220.000	
3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271015	4,610,000.000	4,600,872.200	
4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291031	5,000,000.000	4,994,600.000	
4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20341115	10,000,000.000	9,882,000.000	

		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271115	4,200,000.000	4,204,242.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20541115	6,100,000.000	5,646,892.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311031	4,300,000.000	4,276,307.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291130	5,500,000.000	5,494,280.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20441115	2,400,000.000	2,302,824.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311130	3,500,000.000	3,480,155.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271215	4,000,000.000	3,997,000.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20291231	4,000,000.000	4,027,720.000	
		4.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20311231	3,500,000.000	3,543,330.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280115	3,000,000.000	3,007,830.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300131	6,500,000.000	6,516,965.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350215	10,800,000.000	10,949,688.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280215	5,500,000.000	5,515,125.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550215	5,600,000.000	5,291,888.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20450215	3,500,000.000	3,408,510.000	
		4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320131	4,000,000.000	4,023,720.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320229	4,000,000.000	3,973,720.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280315	3,000,000.000	2,989,800.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320331	3,500,000.000	3,475,570.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300331	7,000,000.000	6,958,140.000	

		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280415	3,000,000.000	2,982,300.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320430	3,500,000.000	3,451,455.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550515	6,800,000.000	6,558,260.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350515	9,500,000.000	9,366,525.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280515	4,000,000.000	3,974,840.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300430	7,700,000.000	7,617,995.000	
		5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20450515	4,900,000.000	4,920,531.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270531	5,800,000.000	5,795,708.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320531	6,000,000.000	5,953,200.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300531	5,800,000.000	5,762,126.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280615	2,000,000.000	1,991,480.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270630	5,800,000.000	5,787,356.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320630	3,300,000.000	3,251,391.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300630	4,700,000.000	4,646,373.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280715	3,000,000.000	2,986,260.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300731	6,000,000.000	5,930,340.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20350815	8,700,000.000	8,567,064.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280815	6,000,000.000	5,941,020.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270731	8,000,000.000	7,988,880.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20550815	5,600,000.000	5,402,656.000	

		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320731	4,600,000.000	4,529,528.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320831	3,300,000.000	3,225,684.000	
		4.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20450815	2,500,000.000	2,469,725.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270831	3,500,000.000	3,484,250.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300831	5,500,000.000	5,380,100.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280915	3,000,000.000	2,952,990.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20300930	5,500,000.000	5,378,395.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20270930	4,500,000.000	4,470,615.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20320930	3,000,000.000	2,930,670.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281015	8,000,000.000	7,891,200.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301031	4,500,000.000	4,397,760.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271031	8,800,000.000	8,736,376.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20351115	9,800,000.000	9,452,394.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281115	4,500,000.000	4,436,595.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20551115	5,500,000.000	5,203,055.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321031	4,000,000.000	3,877,000.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20451115	3,000,000.000	2,868,270.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301130	5,500,000.000	5,344,405.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271130	6,000,000.000	5,942,760.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321130	3,500,000.000	3,390,800.000	

		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20281215	4,500,000.000	4,434,480.000	
		3.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20301231	5,000,000.000	4,881,600.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20321231	3,500,000.000	3,413,445.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20271231	3,000,000.000	2,969,280.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290115	3,000,000.000	2,954,520.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310131	6,000,000.000	5,886,060.000	
		4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20360215	10,300,000.000	10,019,119.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290215	4,000,000.000	3,937,640.000	
		4.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20560215	5,800,000.000	5,601,930.000	
		4% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330131	3,000,000.000	2,945,250.000	
		3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330228	3,000,000.000	2,900,970.000	
		4.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20460215	1,500,000.000	1,433,190.000	
		3.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280229	2,000,000.000	1,977,260.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310228	8,000,000.000	7,763,120.000	
		3.5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290315	1,000,000.000	984,000.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310331	5,000,000.000	4,928,500.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280331	4,000,000.000	3,985,600.000	
		4.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330331	3,300,000.000	3,285,546.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290415	2,400,000.000	2,383,968.000	
		3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310430	5,000,000.000	4,927,300.000	

	3.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20290515	2,200,000.000	2,184,952.000	
	4.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20360515	3,500,000.000	3,471,265.000	
	4.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20330430	3,000,000.000	2,962,950.000	
	3.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280430	2,400,000.000	2,385,456.000	
	5% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20560515	1,300,000.000	1,306,188.000	
アメリカ・ドル 小計			1,171,538,672.000 (187,657,064,481)	
イギリス・ポンド	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,482,000.000	777,309.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,760,000.000	885,280.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	3,050,000.000	2,210,213.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	799,477.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,510,000.000	1,463,854.400	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,416,090.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,740,000.000	653,196.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	624,783.500	
	1.625% United Kingdom Gilt 20541022	1,600,000.000	708,000.000	
	0.875% United Kingdom Gilt 20291022	2,600,000.000	2,331,446.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20411022	2,190,000.000	1,275,083.700	
	0.375% United Kingdom Gilt 20301022	2,600,000.000	2,203,604.000	
	0.5% United Kingdom Gilt 20611022	3,000,000.000	711,750.000	
	0.125% United Kingdom Gilt 20280131	2,200,000.000	2,066,328.000	

0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,900,000.000	663,290.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	4,200,000.000	2,919,840.000	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	2,500,000.000	2,038,800.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20460131	2,050,000.000	924,242.500	
1.25% United Kingdom Gilt 20510731	2,400,000.000	1,007,280.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	3,100,000.000	1,967,384.000	
0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	2,700,000.000	2,457,054.000	
0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	3,100,000.000	2,403,461.000	
1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	1,700,000.000	736,865.000	
1% UNITED KINGDOM GILT 20320131	4,100,000.000	3,401,893.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20731022	1,220,000.000	355,459.200	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20380129	2,200,000.000	1,949,970.000	
3.25% UNITED KINGDOM GILT 20330131	2,600,000.000	2,408,224.000	
3.75% UNITED KINGDOM GILT 20531022	2,500,000.000	1,864,750.000	
4% UNITED KINGDOM GILT 20631022	1,100,000.000	838,420.000	
4.5% UNITED KINGDOM GILT 20280607	3,400,000.000	3,415,980.000	
4.625% UNITED KINGDOM GILT 20340131	3,300,000.000	3,291,750.000	
4.75% UNITED KINGDOM GILT 20431022	1,500,000.000	1,391,400.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20540731	1,980,000.000	1,647,162.000	
4% UNITED KINGDOM GILT 20311022	2,600,000.000	2,548,702.000	

4.125% UNITED KINGDOM GILT 20290722	2,800,000.000	2,786,644.000	
4.25% UNITED KINGDOM GILT 20340731	3,100,000.000	3,003,745.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20400131	2,550,000.000	2,350,845.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20280307	2,000,000.000	2,004,600.000	
4.375% UNITED KINGDOM GILT 20300307	3,000,000.000	3,005,670.000	
4.5% UNITED KINGDOM GILT 20350307	2,400,000.000	2,352,528.000	
5.375% UNITED KINGDOM GILT 20560131	350,000.000	341,530.000	
4.75% UNITED KINGDOM GILT 20351022	1,900,000.000	1,887,213.000	
4% UNITED KINGDOM GILT 20290522	2,900,000.000	2,876,626.000	
5.25% UNITED KINGDOM GILT 20410131	1,100,000.000	1,101,276.000	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20310307	1,400,000.000	1,385,230.000	
4.125% UNITED KINGDOM GILT 20330307	1,400,000.000	1,364,748.000	
4.625% UNITED KINGDOM GILT 20370307	100,000.000	97,125.000	
4.875% UNITED KINGDOM GILT 20360731	800,000.000	797,568.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	990,091.700	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	3,040,000.000	3,010,998.400	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	2,262,000.000	2,154,849.060	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,757,000.000	1,703,288.510	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,708,000.000	1,389,287.200	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	1,162,124.500	

	4.25% United Kingdom Gilt 20271207	2,332,000.000	2,335,148.200	
	4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,116,000.000	1,924,290.400	
	4.75% United Kingdom Gilt 20301207	2,300,000.000	2,345,264.000	
	4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,143,000.000	954,862.200	
	4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	1,323,090.000	
	4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,760,000.000	1,735,712.000	
	4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	904,214.800	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	1,423,132.110	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,252,000.000	944,759.200	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,466,000.000	1,863,309.600	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	942,965.100	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,724,000.000	1,335,582.800	
イギリス・ポンド 小計			110,156,659.080 (23,734,353,765)	
イスラエル・シュケル	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	2,700,000.000	3,192,750.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	2,300,184.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,200,000.000	1,172,196.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,202,480.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	3,400,000.000	2,720,510.000	
	1.3% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20320430	3,400,000.000	3,018,996.000	
	2.8% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20521129	2,680,000.000	2,080,671.600	

	3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290228	3,800,000.000	3,843,586.000	
	4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20350330	3,700,000.000	3,809,113.000	
	3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20270930	2,500,000.000	2,513,900.000	
	4.6% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20290831	1,600,000.000	1,661,440.000	
	4.1% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20280731	1,400,000.000	1,422,442.000	
	4.15% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20351031	600,000.000	623,562.000	
	3.75% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20310731	1,000,000.000	1,016,680.000	
イスラエル・シュケル 小計			31,578,510.600 (1,732,330,777)	
オーストラリア・ドル	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	2,654,000.000	2,571,540.220	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	2,258,000.000	2,243,277.840	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	2,363,000.000	2,143,524.560	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	2,607,000.000	2,223,275.670	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	663,276.240	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,631,520.880	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,728,000.000	1,657,791.360	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	898,572.920	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,500,000.000	1,442,055.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	1,799,870.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	2,672,716.200	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,058,193.100	

	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,464,182.800	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	2,700,000.000	2,242,377.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,000,000.000	1,720,800.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	2,000,000.000	1,014,600.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,081,675.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	2,600,000.000	2,192,710.000	
	3% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20331121	2,400,000.000	2,152,728.000	
	3.75% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340521	2,000,000.000	1,876,140.000	
	3.5% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20341221	2,300,000.000	2,101,740.000	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20540621	900,000.000	824,814.000	
	4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20340621	1,100,000.000	1,066,945.000	
	4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20351221	1,700,000.000	1,629,892.000	
	4.25% AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF) 20360321	2,500,000.000	2,391,575.000	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20361021	1,400,000.000	1,333,668.000	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20371021	1,300,000.000	1,285,921.000	
	5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20360621	1,000,000.000	1,013,900.000	
オーストラリア・ドル 小計			48,399,281.790 (5,482,670,641)	
オフショア・人民元	3.25% China Government Bond 20281122	5,000,000.000	5,264,550.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,000,000.000	5,321,650.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	25,000,000.000	26,638,500.000	

		2.85% China Government Bond 20270604	13,000,000.000	13,234,390.000	
		2.68% China Government Bond 20300521	29,500,000.000	30,943,435.000	
		3.28% China Government Bond 20271203	29,000,000.000	29,978,170.000	
		3.27% China Government Bond 20301119	22,500,000.000	24,445,125.000	
		3.81% China Government Bond 20500914	16,300,000.000	20,904,098.000	
		3.01% China Government Bond 20280513	27,000,000.000	27,988,470.000	
		3.72% China Government Bond 20510412	14,000,000.000	17,809,260.000	
		3.02% China Government Bond 20310527	20,300,000.000	21,910,805.000	
		3.59% CHINA GOVERNMENT BOND 20270803	5,500,000.000	5,678,200.000	
		3.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20280517	5,000,000.000	5,271,350.000	
		3.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20280816	4,500,000.000	4,749,165.000	
		4.08% CHINA GOVERNMENT BOND 20481022	22,000,000.000	29,034,500.000	
		3.86% CHINA GOVERNMENT BOND 20490722	11,800,000.000	15,140,934.000	
		3.39% CHINA GOVERNMENT BOND 20500316	23,000,000.000	27,652,440.000	
		2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	15,500,000.000	16,121,860.000	
		3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	11,500,000.000	14,289,210.000	
		2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	16,000,000.000	17,212,800.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	15,200,000.000	16,238,464.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	15,000,000.000	15,647,400.000	
		3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	5,500,000.000	6,628,435.000	

		2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	20,000,000.000	21,409,600.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	19,000,000.000	19,827,260.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	19,000,000.000	20,236,140.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	31,000,000.000	32,945,560.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	9,500,000.000	9,901,280.000	
		2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	17,200,000.000	17,462,988.000	
		3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	19,500,000.000	22,771,905.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	29,500,000.000	31,793,035.000	
		2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	19,000,000.000	19,965,770.000	
		2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	20,000,000.000	20,465,800.000	
		2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	15,000,000.000	16,307,700.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	20,000,000.000	21,106,000.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	25,000,000.000	25,661,000.000	
		3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	21,700,000.000	25,655,476.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	35,000,000.000	37,504,250.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	33,000,000.000	34,598,190.000	
		2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	35,000,000.000	35,855,050.000	
		2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	28,000,000.000	29,744,960.000	
		2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925	25,000,000.000	25,724,500.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	30,000,000.000	31,463,100.000	

		3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	26,000,000.000	29,912,740.000	
		2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	20,000,000.000	20,599,400.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	36,000,000.000	38,698,200.000	
		2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225	50,000,000.000	52,438,500.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20290115	58,000,000.000	59,654,740.000	
		2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225	16,000,000.000	16,830,560.000	
		2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325	35,000,000.000	36,345,400.000	
		2.05% CHINA GOVERNMENT BOND 20290415	69,000,000.000	70,458,660.000	
		2.27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525	21,000,000.000	21,971,040.000	
		2.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20310625	20,000,000.000	20,642,400.000	
		1.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20290715	28,000,000.000	28,490,000.000	
		1.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20270815	45,000,000.000	45,234,000.000	
		2.11% CHINA GOVERNMENT BOND 20340825	44,000,000.000	45,529,440.000	
		1.87% CHINA GOVERNMENT BOND 20310915	33,000,000.000	33,633,600.000	
		1.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20291015	21,000,000.000	21,267,750.000	
		1.42% CHINA GOVERNMENT BOND 20271115	34,000,000.000	34,090,780.000	
		2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20341125	19,000,000.000	19,543,210.000	
		1.49% CHINA GOVERNMENT BOND 20311225	19,100,000.000	19,077,653.000	
		1.43% CHINA GOVERNMENT BOND 20300125	55,000,000.000	55,098,450.000	
		1.92% CHINA GOVERNMENT BOND 20550115	4,000,000.000	3,696,920.000	

		1.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20350215	39,000,000.000	38,695,020.000	
		1.45% CHINA GOVERNMENT BOND 20280225	35,000,000.000	35,135,100.000	
		1.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20320325	52,000,000.000	52,774,280.000	
		1.65% CHINA GOVERNMENT BOND 20350515	17,000,000.000	16,922,820.000	
		1.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20280525	30,000,000.000	30,138,900.000	
		1.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20350525	38,700,000.000	38,562,228.000	
		1.38% CHINA GOVERNMENT BOND 20270615	20,000,000.000	20,039,600.000	
		1.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20300725	8,000,000.000	8,051,360.000	
		1.42% CHINA GOVERNMENT BOND 20280815	38,000,000.000	38,101,080.000	
		1.83% CHINA GOVERNMENT BOND 20350825	39,000,000.000	39,261,300.000	
		1.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20270915	31,000,000.000	31,076,880.000	
		1.78% CHINA GOVERNMENT BOND 20320915	22,000,000.000	22,289,080.000	
		1.63% CHINA GOVERNMENT BOND 20301025	12,000,000.000	12,087,120.000	
		1.78% CHINA GOVERNMENT BOND 20351115	29,000,000.000	29,068,440.000	
		1.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20281125	100,000.000	100,305.000	
		1.36% CHINA GOVERNMENT BOND 20271215	31,000,000.000	31,056,110.000	
		1.66% CHINA GOVERNMENT BOND 20321225	9,000,000.000	9,040,410.000	
		1.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20310125	32,000,000.000	32,116,160.000	
		2.38% CHINA GOVERNMENT BOND 20560115	7,700,000.000	7,851,305.000	
		1.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20290225	5,700,000.000	5,704,446.000	

	1.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20360225	46,000,000.000	45,987,580.000	
	1.29% CHINA GOVERNMENT BOND 20280315	63,000,000.000	63,022,680.000	
	1.66% CHINA GOVERNMENT BOND 20330325	28,000,000.000	28,119,000.000	
	1.5% CHINA GOVERNMENT BOND 20310415	15,000,000.000	15,025,500.000	
	1.72% CHINA GOVERNMENT BOND 20360515	5,000,000.000	4,987,300.000	
	1.26% CHINA GOVERNMENT BOND 20290525	30,000,000.000	29,955,000.000	
オフショア・人民元 小計			2,256,885,222.000 (53,471,253,122)	
カナダ・ドル	2.75% Canada Government International Bond 20641201	855,000.000	671,422.950	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,383,000.000	1,495,175.130	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,292,045.070	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,151,676.240	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	954,733.230	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	934,774.310	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,134,257.320	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,222,218.400	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	640,711.500	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	2,620,373.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,199,150.200	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,228,510.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,800,000.000	2,509,920.000	

		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	3,400,000.000	3,156,764.000	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	2,650,000.000	1,721,943.500	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	2,700,000.000	2,483,892.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320601	1,500,000.000	1,407,495.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20291201	600,000.000	586,878.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270901	1,200,000.000	1,201,968.000	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20321201	2,270,000.000	2,180,562.000	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280301	1,300,000.000	1,316,666.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,700,000.000	1,650,598.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20551201	1,780,000.000	1,445,538.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280901	1,200,000.000	1,211,412.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20331201	1,000,000.000	999,450.000	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290301	1,800,000.000	1,853,010.000	
		3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340601	2,400,000.000	2,351,376.000	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20340301	1,500,000.000	1,523,955.000	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290901	800,000.000	814,120.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20341201	2,600,000.000	2,586,038.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300301	2,000,000.000	1,985,380.000	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20350601	3,000,000.000	2,974,440.000	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20571201	2,150,000.000	2,026,332.000	

	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300901	3,400,000.000	3,365,728.000	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270801	500,000.000	499,500.000	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20351201	3,500,000.000	3,457,405.000	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,100,000.000	2,095,233.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310301	2,200,000.000	2,171,994.000	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,000,000.000	994,270.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,800,000.000	2,779,140.000	
	3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20360601	1,600,000.000	1,574,864.000	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280501	2,500,000.000	2,488,175.000	
	3% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310901	200,000.000	199,246.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280801	2,500,000.000	2,497,575.000	
カナダ・ドル 小計			76,655,914.850 (8,791,666,874)	
シンガポール・ドル	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	847,217.160	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	440,600.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	622,244.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	647,500.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	818,000.000	917,166.140	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	765,375.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	560,945.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	650,000.000	675,675.000	

	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	540,000.000	528,660.000	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	600,000.000	594,000.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	500,000.000	491,500.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20320801	240,000.000	250,440.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20720801	920,000.000	1,152,300.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20270901	500,000.000	508,200.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20280801	400,000.000	410,992.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20290401	600,000.000	622,680.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20340501	300,000.000	330,600.000	
	3.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20540601	100,000.000	125,871.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20350301	230,000.000	244,260.000	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20300401	160,000.000	164,880.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20400701	90,000.000	92,715.300	
シンガポール・ドル 小計			10,993,820.600 (1,374,447,452)	
スウェーデン・クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	3,655,000.000	3,885,740.150	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	4,906,782.000	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,248,289.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	6,400,000.000	6,059,392.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	5,000,000.000	4,461,550.000	
	1.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20331111	4,000,000.000	3,762,760.000	

	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20350511	6,700,000.000	6,447,946.000	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20361015	5,000,000.000	4,855,850.000	
スウェーデン・クローナ 小計			37,628,309.150 (643,067,803)	
デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	15,930,575.100	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,100,000.000	4,976,427.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	4,090,000.000	3,836,338.200	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	5,500,000.000	2,664,695.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	2,900,000.000	2,533,121.000	
	2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20331115	2,000,000.000	1,941,280.000	
	2.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20351115	500,000.000	475,625.000	
	2% DANISH GOVERNMENT BOND 20281115	100,000.000	99,179.000	
デンマーク・クローネ 小計			32,457,240.300 (806,886,994)	
ニュージーランド・ドル	3.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20330414	1,500,000.000	1,439,070.000	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20370415	490,000.000	414,324.400	
	3% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20290420	1,100,000.000	1,082,081.000	
	1.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20310515	1,330,000.000	1,185,282.700	
	1.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20410515	350,000.000	235,945.500	
	0.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20280515	1,100,000.000	1,036,112.000	
	2% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20320515	940,000.000	837,323.800	
	2.75% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20510515	380,000.000	256,526.600	

	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20340515	500,000.000	498,735.000	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20300515	1,100,000.000	1,128,215.000	
	5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20540515	700,000.000	693,049.000	
	4.5% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20350515	1,500,000.000	1,512,600.000	
	4.25% NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 20360515	1,300,000.000	1,276,886.000	
ニュージーランド・ドル 小計			11,596,151.000 (1,086,211,464)	
ノルウェー・クローネ	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,343,620.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,540,113.500	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,259,808.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	3,001,950.000	
	2.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20320518	4,700,000.000	4,169,323.000	
	3.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20421006	1,600,000.000	1,447,280.000	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20330815	4,000,000.000	3,695,720.000	
	3.625% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20340413	3,500,000.000	3,353,525.000	
	3.625% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20390531	2,000,000.000	1,864,360.000	
	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20350612	6,900,000.000	6,621,171.000	
	4.125% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20360603	4,000,000.000	3,943,800.000	
ノルウェー・クローネ 小計			39,240,670.500 (662,382,519)	
ポーランド・ズロチ	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	3,121,752.600	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,562,861.600	

	1.25% Poland Government Bond 20301025	10,800,000.000	9,312,732.000	
	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	5,000,000.000	4,166,350.000	
	7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	5,000,000.000	5,303,600.000	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	5,000,000.000	5,208,100.000	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725	11,000,000.000	11,046,530.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20341025	4,500,000.000	4,379,040.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300125	4,000,000.000	4,039,280.000	
	4.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300725	2,900,000.000	2,864,591.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20280125	100,000.000	93,679.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20351025	5,600,000.000	5,392,352.000	
	4.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20310125	2,000,000.000	1,966,100.000	
	4% POLAND GOVERNMENT BOND 20310725	2,100,000.000	1,999,347.000	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20360425	750,000.000	732,075.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	853,579.780	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,556,888.500	
ポーランド・ズロチ 小計			68,598,858.480 (3,004,142,948)	
マレーシア・リンギット	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,382,325.890	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	3,378,000.000	3,515,552.160	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,800,000.000	1,866,798.000	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,451,544.400	

		3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,886,000.000	1,905,652.120	
		4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	1,300,000.000	1,464,476.000	
		4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,281,073.200	
		4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,027,175.700	
		3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,203,078.100	
		4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	2,250,000.000	2,466,067.500	
		4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	2,200,000.000	2,353,032.000	
		4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	2,000,000.000	2,222,780.000	
		3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,310,000.000	2,351,695.500	
		4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,357,860.000	
		3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	2,000,000.000	2,035,580.000	
		3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	2,550,000.000	2,531,640.000	
		4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,650,000.000	2,657,711.500	
		2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	2,200,000.000	2,124,012.000	
		3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	2,000,000.000	2,007,320.000	
		4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	1,900,000.000	2,082,001.000	
		4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	1,050,000.000	1,085,490.000	
		4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	2,200,000.000	2,339,172.000	
		3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	2,300,000.000	2,313,823.000	
		4.054% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390418	1,200,000.000	1,235,652.000	

	4.18% MALAYSIAN GOVERNMENT 20440516	1,500,000.000	1,549,380.000	
	3.336% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300515	1,000,000.000	999,260.000	
	3.476% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350702	2,050,000.000	2,033,210.500	
	3.917% MALAYSIAN GOVERNMENT 20550715	1,050,000.000	1,018,794.000	
	3.766% MALAYSIAN GOVERNMENT 20410115	500,000.000	495,745.000	
	3.237% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290315	700,000.000	699,874.000	
	3.987% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460423	550,000.000	551,441.000	
マレーシア・リンギット 小計			54,609,216.570 (2,162,503,133)	
メキシコ・ペソ	8% Mexican Bonos 20471107	21,300,000.000	18,348,885.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	37,000,000.000	31,496,620.000	
	7.5% MEXICAN BONOS 20330526	30,000,000.000	28,008,300.000	
	8% MEXICAN BONOS 20350524	5,000,000.000	4,661,950.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20290301	45,000,000.000	45,658,350.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20280302	10,000,000.000	10,179,800.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20300228	25,000,000.000	25,206,000.000	
	8% MEXICAN BONOS 20360221	14,000,000.000	13,088,600.000	
	8% MEXICAN BONOS 20320415	18,000,000.000	17,414,280.000	
	8% MEXICAN BONOS 20550429	4,000,000.000	3,395,400.000	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	28,119,586.560	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	9,443,267.100	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	29,951,116.320	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	28,894,000.000	27,206,012.520	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	44,515,000.000	43,261,457.600	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	42,654,000.000	36,516,089.400	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	35,944,000.000	33,399,164.800	
メキシコ・ペソ 小計			405,354,879.300 (3,779,812,643)	
ユーロ	0.75% Finland Government Bond 20310415	514,000.000	465,159.720	

		1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	234,648.000	
		0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	779,256.000	
		1.125% Finland Government Bond 20340415	470,000.000	405,031.900	
		0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	476,650.000	
		0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	465,440.000	
		0.125% Finland Government Bond 20360415	510,000.000	374,737.800	
		0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	250,764.000	
		Finland Government Bond 20300915	500,000.000	444,045.000	
		0.125% Finland Government Bond 20520415	520,000.000	205,114.000	
		0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	519,480.000	
		0.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20430415	450,000.000	269,793.000	
		1.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320915	800,000.000	731,880.000	
		2.75% FINLAND GOVERNMENT BOND 20380415	400,000.000	372,544.000	
		3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20330915	600,000.000	597,132.000	
		2.875% FINLAND GOVERNMENT BOND 20290415	1,000,000.000	1,004,250.000	
		2.95% FINLAND GOVERNMENT BOND 20550415	480,000.000	400,924.800	
		3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20340915	800,000.000	789,960.000	
		2.5% FINLAND GOVERNMENT BOND 20300415	500,000.000	494,785.000	
		3.2% FINLAND GOVERNMENT BOND 20450415	350,000.000	323,876.000	
		3% FINLAND GOVERNMENT BOND 20350915	700,000.000	685,790.000	

		2.625% FINLAND GOVERNMENT BOND 20320415	300,000.000	294,540.000	
		3.55% FINLAND GOVERNMENT BOND 20410415	350,000.000	345,502.500	
		3.35% FINLAND GOVERNMENT BOND 20360915	300,000.000	300,150.000	
		1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	536,867.520	
		1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	114,232.800	
		2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	320,797.800	
		0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,162,872.000	
		0.5% Austria Government Bond 20290220	1,280,000.000	1,208,268.800	
		Austria Government Bond 20300220	980,000.000	886,459.000	
		0.75% Austria Government Bond 20510320	1,200,000.000	624,048.000	
		Austria Government Bond 20401020	1,200,000.000	727,116.000	
		0.85% Austria Government Bond 21200630	750,000.000	231,375.000	
		Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	1,052,328.000	
		0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	442,158.000	
		0.7% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20710420	500,000.000	175,870.000	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20281020	1,800,000.000	1,691,694.000	
		0.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320220	1,500,000.000	1,343,130.000	
		1.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20490523	1,000,000.000	715,760.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20330220	2,100,000.000	2,086,749.000	
		3.15% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20531020	500,000.000	446,785.000	

		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20290523	200,000.000	201,186.000	
		3.45% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20301020	800,000.000	820,696.000	
		2.9% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20340220	500,000.000	493,865.000	
		3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20390715	500,000.000	486,670.000	
		2.5% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20291020	800,000.000	793,680.000	
		2.95% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20350220	1,100,000.000	1,082,202.000	
		2.8% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20320920	300,000.000	297,078.000	
		3.2% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20360220	600,000.000	597,840.000	
		3.75% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20560320	200,000.000	197,562.000	
		1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,612,583.740	
		1.9% Belgium Government Bond 20380622	758,000.000	625,152.920	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	796,595.400	
		2.15% Belgium Government Bond 20660622	740,000.000	431,738.200	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,080,541.000	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	880,000.000	563,560.800	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	482,874.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,436,568.600	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	1,350,000.000	1,195,141.500	
		0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,420,350.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	1,000,000.000	615,940.000	

0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,020,000.000	914,032.200	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	860,000.000	538,162.200	
Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,158,324.000	
Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,364,672.000	
0.65% Belgium Government Bond 20710622	530,000.000	158,777.400	
0.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20320622	1,400,000.000	1,192,156.000	
1.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20530622	800,000.000	429,448.000	
2.75% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20390422	800,000.000	717,168.000	
3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20330622	1,500,000.000	1,482,375.000	
3.3% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20540622	600,000.000	497,964.000	
3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20430622	700,000.000	648,900.000	
2.85% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20341022	1,400,000.000	1,349,124.000	
3.5% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20550622	1,000,000.000	856,280.000	
2.7% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20291022	800,000.000	797,528.000	
3.1% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20350622	1,100,000.000	1,071,653.000	
3.45% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20420622	700,000.000	653,009.000	
2.6% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20301022	550,000.000	542,679.500	
3.4% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20360622	900,000.000	889,110.000	
4.35% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20560622	500,000.000	495,220.000	
3.1% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20310822	250,000.000	250,905.000	

		2% Slovakia Government Bond 20471017	350,000.000	238,724.500	
		1% Slovakia Government Bond 20280612	250,000.000	241,860.000	
		1% Slovakia Government Bond 20320514	250,000.000	221,720.000	
		0.375% Slovakia Government Bond 20360421	400,000.000	293,248.000	
		1% SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 20511013	240,000.000	120,184.800	
		4% SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 20321019	250,000.000	261,742.500	
		3.75% SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 20350223	420,000.000	426,518.400	
		3.625% SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 20330608	370,000.000	377,074.400	
		3% SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 20311106	250,000.000	248,590.000	
		3.75% SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 20400227	250,000.000	243,605.000	
		3.625% SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 20371104	250,000.000	245,842.500	
		0.75% SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 20300409	250,000.000	230,880.000	
		1% SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 20301009	250,000.000	230,557.500	
		3.625% SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 20290116	250,000.000	254,715.000	
		1.625% SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 20310121	250,000.000	235,640.000	
		1.875% SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 20370309	250,000.000	209,767.500	
		3.75% SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 20340306	400,000.000	409,516.000	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,214,286.840	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	2,260,738.540	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	990,536.500	

6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	2,186,622.270	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	2,848,000.000	3,186,313.920	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,705,000.000	1,932,617.500	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	1,971,000.000	2,137,569.210	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	2,725,000.000	3,020,580.750	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	2,025,743.710	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	1,474,000.000	1,452,081.620	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,708,000.000	2,372,289.240	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	3,079,000.000	2,650,156.880	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,300,000.000	3,223,341.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	3,870,000.000	2,536,359.300	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	1,836,369.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,100,000.000	3,902,052.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	4,500,000.000	4,232,340.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	2,765,520.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	3,550,000.000	1,530,653.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,590,837.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,450,000.000	1,888,215.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	1,929,900.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	3,500,000.000	3,139,115.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,900,000.000	1,704,376.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,900,000.000	1,679,809.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	3,400,000.000	2,527,458.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	2,000,000.000	1,880,600.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,700,000.000	735,743.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	2,400,000.000	2,090,256.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	1,000,000.000	871,240.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20320215	3,100,000.000	2,658,746.000	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20380515	2,300,000.000	1,806,857.000	
1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20320815	2,700,000.000	2,538,594.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	2,650,000.000	1,848,719.500	
2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291115	3,200,000.000	3,143,776.000	
2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	4,200,000.000	4,068,498.000	
2.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330215	1,000,000.000	968,820.000	
1.8% GERMAN GOVERNMENT BOND 20530815	1,000,000.000	699,910.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20330815	2,400,000.000	2,361,144.000	
2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,800,000.000	1,778,148.000	
2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340215	2,900,000.000	2,764,541.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20540815	2,500,000.000	2,036,725.000	
2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20410515	1,600,000.000	1,461,680.000	

		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340815	3,500,000.000	3,421,565.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20350215	2,400,000.000	2,319,528.000	
		2.9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20560815	2,420,000.000	2,129,842.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20350215	800,000.000	773,544.000	
		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20350815	2,900,000.000	2,814,392.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20321115	250,000.000	245,540.000	
		2.9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20360215	1,800,000.000	1,784,808.000	
		3.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20470515	600,000.000	593,028.000	
		2.6% GERMAN GOVERNMENT BOND 20410515	600,000.000	548,922.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	2,400,000.000	964,536.000	
		1.7% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270610	100,000.000	99,185.000	
		1.9% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270916	1,400,000.000	1,388,422.000	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271216	1,700,000.000	1,684,938.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,400,000.000	1,387,806.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280614	700,000.000	698,453.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	3,000,000.000	2,950,890.000	
		1.3% GERMAN GOVERNMENT BOND 20271015	430,000.000	423,038.300	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280413	1,700,000.000	1,687,828.000	
		2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20281019	1,100,000.000	1,094,764.000	
		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	100,000.000	98,596.000	

		2.1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290412	1,100,000.000	1,084,787.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20291011	1,010,000.000	1,005,586.300	
		2.4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300418	1,400,000.000	1,386,658.000	
		2.2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20301010	1,400,000.000	1,372,406.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310416	2,500,000.000	2,475,475.000	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	3,563,518.740	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,927,000.000	3,343,160.860	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	3,659,000.000	3,985,675.520	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	2,664,000.000	2,457,992.880	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	2,398,452.200	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,164,000.000	3,324,383.160	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,867,000.000	1,697,924.480	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,099,000.000	5,099,968.810	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,788,000.000	2,437,799.320	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	5,003,878.420	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	6,420,000.000	5,964,501.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	5,869,000.000	4,688,039.820	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,587,000.000	794,087.190	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	3,170,000.000	2,469,683.600	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,550,000.000	1,713,523.500	

		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	6,400,000.000	6,159,552.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	6,350,000.000	5,383,212.500	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	4,713,637.500	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	3,250,000.000	1,872,520.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	4,750,000.000	4,440,727.500	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	3,807,342.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	1,215,199.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	3,400,000.000	2,130,406.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	5,600,000.000	4,909,016.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	1,180,000.000	303,024.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	2,400,000.000	1,289,592.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	5,200,000.000	4,394,988.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	2,600,000.000	1,104,558.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20320525	3,750,000.000	3,107,700.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20380525	3,000,000.000	2,249,490.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280225	4,300,000.000	4,159,132.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321125	5,800,000.000	5,375,382.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20430525	2,300,000.000	1,836,550.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20540525	2,100,000.000	1,608,894.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20330525	4,600,000.000	4,502,388.000	

2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290225	5,300,000.000	5,289,029.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20331125	3,200,000.000	3,218,496.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20490625	1,050,000.000	845,701.500	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270924	3,100,000.000	3,091,661.000	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550525	1,800,000.000	1,439,820.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300225	5,400,000.000	5,366,142.000	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20341125	4,000,000.000	3,848,000.000	
3.6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20420525	1,700,000.000	1,594,583.000	
3.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20560525	1,570,000.000	1,373,718.600	
3.2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350525	5,050,000.000	4,903,802.500	
2.4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280924	4,000,000.000	3,965,680.000	
2.7% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310225	3,200,000.000	3,151,168.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20351125	2,300,000.000	2,273,872.000	
4.1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20460525	1,200,000.000	1,172,988.000	
4.4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20570525	800,000.000	781,904.000	
2.4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290924	1,800,000.000	1,773,162.000	
3.8% FRENCH GOVERNMENT BOND 20370625	1,200,000.000	1,200,792.000	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20320225	800,000.000	802,600.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,190,084.150	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,755,000.000	1,885,817.700	

3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	1,797,520.270	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,468,000.000	1,434,632.360	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,879,000.000	1,669,867.300	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	1,600,000.000	1,569,664.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,299,901.500	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,115,304.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	1,200,000.000	831,240.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,254,288.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,630,000.000	664,795.500	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,500,000.000	1,303,920.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	620,217.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	900,000.000	841,329.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20320715	1,200,000.000	1,043,628.000	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20540115	1,500,000.000	1,094,520.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330715	900,000.000	875,736.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300115	1,300,000.000	1,290,666.000	
3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20440115	900,000.000	875,763.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20340715	1,350,000.000	1,303,303.500	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20350715	1,800,000.000	1,722,096.000	
3.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20560115	750,000.000	740,505.000	

		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310115	600,000.000	593,172.000	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20360715	300,000.000	290,619.000	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	2,513,178.720	
		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,295,265.240	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	1,898,581.650	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,256,347.400	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	2,035,243.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	674,725.040	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,410,435.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,504,533.800	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,650,000.000	1,445,400.000	
		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	1,800,000.000	1,788,264.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,180,686.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,076,438.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,551,555.500	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	2,470,000.000	2,428,948.600	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,450,000.000	1,341,554.500	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	2,900,000.000	2,911,455.000	
		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,130,775.000	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,791,757.000	

		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,100,531.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,800,000.000	1,472,976.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	1,600,000.000	1,473,376.000	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,100,000.000	1,978,284.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	2,153,954.000	
		1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,500,000.000	1,122,465.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	2,600,000.000	2,348,320.000	
		1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,400,000.000	824,516.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	1,200,000.000	902,412.000	
		0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,820,276.000	
		0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,800,000.000	1,586,070.000	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	1,100,000.000	709,082.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	860,000.000	503,641.800	
		0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	2,300,000.000	2,195,948.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,689,803.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320601	2,300,000.000	2,017,560.000	
		0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,600,000.000	2,442,752.000	
		2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20520901	800,000.000	518,600.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290615	1,800,000.000	1,796,076.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321201	1,600,000.000	1,526,256.000	

3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380301	2,300,000.000	2,166,094.000	
2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271201	1,000,000.000	999,270.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350430	1,500,000.000	1,546,440.000	
4.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330501	1,800,000.000	1,913,274.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291215	3,100,000.000	3,192,194.000	
3.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280401	1,500,000.000	1,516,740.000	
4.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20430901	1,600,000.000	1,646,176.000	
4.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20531001	1,200,000.000	1,203,960.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311030	900,000.000	937,026.000	
3.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300615	1,200,000.000	1,230,504.000	
4.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20331101	2,100,000.000	2,222,619.000	
3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280801	700,000.000	714,455.000	
4.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340301	1,700,000.000	1,781,311.000	
4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301115	1,500,000.000	1,557,000.000	
4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290201	600,000.000	618,732.000	
3.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310215	1,500,000.000	1,525,890.000	
4.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20391001	2,000,000.000	2,031,340.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290701	1,400,000.000	1,418,130.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20340701	1,600,000.000	1,635,568.000	
4.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20371030	50,000.000	50,994.500	

3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310715	1,200,000.000	1,217,124.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270715	1,500,000.000	1,512,405.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350201	1,700,000.000	1,732,062.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20291001	800,000.000	801,736.000	
4.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20541001	1,000,000.000	969,290.000	
3.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311115	1,750,000.000	1,746,570.000	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271015	800,000.000	799,704.000	
3.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350801	2,200,000.000	2,200,704.000	
4.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460430	950,000.000	924,929.500	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20401001	1,200,000.000	1,171,812.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300701	1,700,000.000	1,695,529.000	
2.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280615	1,300,000.000	1,296,516.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320715	1,700,000.000	1,696,634.000	
3.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20351001	750,000.000	746,070.000	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301001	1,500,000.000	1,478,730.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270826	700,000.000	695,093.000	
2.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290115	300,000.000	296,265.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20321115	1,600,000.000	1,592,352.000	
4.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20551001	750,000.000	765,240.000	
2.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310201	1,550,000.000	1,533,306.500	

3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360201	1,000,000.000	980,070.000	
3.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330315	1,500,000.000	1,479,705.000	
2.4% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290315	700,000.000	691,425.000	
3.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20411001	1,000,000.000	978,890.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280228	1,300,000.000	1,287,910.000	
3.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360701	1,300,000.000	1,306,201.000	
3.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330615	1,100,000.000	1,092,410.000	
3.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310601	400,000.000	400,116.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	1,554,000.000	1,670,006.100	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	3,220,908.460	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,061,129.500	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	2,536,762.200	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	2,801,732.200	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,844,000.000	2,039,003.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	2,478,784.160	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	2,510,400.600	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,313,000.000	1,402,375.910	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,363,085.100	

		5.5% Belgium Government Bond 20280328	2,006,000.000	2,103,090.400	
		5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	2,132,898.880	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,504,000.000	1,559,993.920	
		4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	819,062.400	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	643,000.000	612,206.730	
		3% Belgium Government Bond 20340622	947,000.000	927,321.340	
		2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	949,150.870	
		2% IRISH TREASURY 20450218	1,081,000.000	853,990.000	
		1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	472,235.500	
		0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	775,032.000	
		1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	674,565.000	
		1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	703,560.000	
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	908,504.000	
		1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	397,308.000	
		0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	277,494.000	
		0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	717,936.000	
		IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	690,216.000	
		0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	266,160.000	
		0.35% IRISH TREASURY 20321018	100,000.000	85,337.000	
		3% IRISH TREASURY 20431018	400,000.000	372,936.000	
		2.6% IRISH TREASURY 20341018	500,000.000	483,675.000	

3.15% IRISH TREASURY 20551018	320,000.000	287,180.800	
3.1% IRISH TREASURY 20360618	600,000.000	596,274.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	856,795.500	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	1,477,773.630	
3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	338,233.220	
3.15% Austria Government Bond 20440620	723,000.000	677,465.460	
2.4% Austria Government Bond 20340523	1,371,000.000	1,304,355.690	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	389,816.900	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	355,689.510	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	2,872,089.480	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	1,984,899.600	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,752,000.000	1,492,038.240	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,250,000.000	1,076,312.500	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	1,662,290.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,018,635.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,346,144.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	2,100,000.000	1,697,199.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,600,000.000	2,535,468.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,545,856.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	3,950,000.000	3,494,249.000	

0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	3,800,000.000	3,539,510.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	2,560,000.000	2,347,136.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,900,000.000	1,008,159.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,600,000.000	2,548,442.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,400,000.000	2,245,152.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	2,100,000.000	1,508,325.000	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	3,100,000.000	2,711,911.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	950,000.000	436,164.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	2,500,000.000	2,397,475.000	
0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	1,850,000.000	1,394,104.500	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	2,200,000.000	1,936,748.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	396,066.000	
0.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320430	2,400,000.000	2,106,696.000	
1.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20521031	1,600,000.000	1,035,376.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290730	3,100,000.000	2,920,572.000	
2.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20321031	2,100,000.000	2,039,583.000	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20430730	1,300,000.000	1,226,641.000	
3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330430	2,300,000.000	2,303,588.000	
3.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20390730	2,100,000.000	2,144,688.000	
3.55% SPANISH GOVERNMENT BOND 20331031	1,500,000.000	1,535,685.000	

		3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290531	2,300,000.000	2,349,519.000	
		3.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20340430	2,600,000.000	2,601,170.000	
		2.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270531	200,000.000	199,784.000	
		4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20541031	1,500,000.000	1,465,935.000	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20341031	2,350,000.000	2,377,542.000	
		3.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310730	2,100,000.000	2,117,409.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300131	290,000.000	289,040.100	
		3.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350430	1,200,000.000	1,183,536.000	
		2.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280531	1,700,000.000	1,690,922.000	
		3.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410131	1,050,000.000	1,014,415.500	
		3.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20351031	1,500,000.000	1,478,550.000	
		3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330131	1,780,000.000	1,768,661.400	
		3.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20360430	1,500,000.000	1,484,460.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290331	300,000.000	296,772.000	
		2.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310531	500,000.000	492,870.000	
		3.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20561031	450,000.000	432,009.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	2,509,467.140	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,754,000.000	1,862,309.500	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	1,858,000.000	2,092,814.040	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	2,176,909.550	

		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	1,868,907.600	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,699,000.000	1,973,371.510	
		4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20370415	850,000.000	901,705.500	
		3.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20300215	630,000.000	655,930.800	
		2.125% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20281017	1,300,000.000	1,286,701.000	
		4.1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20450215	720,000.000	743,558.400	
		2.25% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20340418	720,000.000	675,590.400	
		1.95% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20290615	1,000,000.000	980,280.000	
		0.475% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20301018	900,000.000	816,462.000	
		0.7% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20271015	620,000.000	605,151.000	
		0.9% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20351012	750,000.000	608,227.500	
		1% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20520412	630,000.000	331,487.100	
		0.3% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20311017	1,050,000.000	918,582.000	
		1.15% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20420411	520,000.000	360,391.200	
		1.65% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20320716	570,000.000	529,427.400	
		3.5% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20380618	500,000.000	498,365.000	
		2.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20341020	630,000.000	615,547.800	
		3.625% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20540612	440,000.000	410,344.000	
		3% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20350615	450,000.000	441,283.500	
		3.375% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20400615	300,000.000	290,199.000	

	2.875% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20331014	450,000.000	443,299.500	
	3.25% PORTUGUESE GOVERNMENT BOND 20360613	500,000.000	495,115.000	
ユーロ 小計			653,105,717.950 (121,360,104,510)	
韓国・ウォン	1.875% KOREA TREASURY BOND 20510310	2,500,000,000.000	1,576,625,000.000	
	2.625% KOREA TREASURY BOND 20300310	600,000,000.000	573,408,000.000	
	2.625% KOREA TREASURY BOND 20550310	1,800,000,000.000	1,317,888,000.000	
	3.25% KOREA TREASURY BOND 20540310	700,000,000.000	584,892,000.000	
	2.625% KOREA TREASURY BOND 20280610	1,600,000,000.000	1,567,280,000.000	
	2.375% KOREA TREASURY BOND 20281210	1,600,000,000.000	1,547,392,000.000	
	1.5% KOREA TREASURY BOND 20500310	2,700,000,000.000	1,577,286,000.000	
	1.5% KOREA TREASURY BOND 20400910	1,400,000,000.000	986,916,000.000	
	1.5% KOREA TREASURY BOND 20301210	1,700,000,000.000	1,528,351,000.000	
	2.375% KOREA TREASURY BOND 20311210	600,000,000.000	551,238,000.000	
	4.25% KOREA TREASURY BOND 20321210	1,000,000,000.000	1,008,170,000.000	
	3.25% KOREA TREASURY BOND 20530310	600,000,000.000	501,360,000.000	
	3.25% KOREA TREASURY BOND 20330610	450,000,000.000	425,997,000.000	
	3.625% KOREA TREASURY BOND 20530910	1,000,000,000.000	895,540,000.000	
	4.125% KOREA TREASURY BOND 20331210	900,000,000.000	898,947,000.000	
	3.5% KOREA TREASURY BOND 20340610	500,000,000.000	478,105,000.000	
	3% KOREA TREASURY BOND 20290910	700,000,000.000	681,716,000.000	

		3% KOREA TREASURY BOND 20341210	2,000,000,000.000	1,837,800,000.000	
		2.25% KOREA TREASURY BOND 20270910	1,500,000,000.000	1,477,725,000.000	
		2.625% KOREA TREASURY BOND 20550910	2,000,000,000.000	1,458,820,000.000	
		2.75% KOREA TREASURY BOND 20450910	1,000,000,000.000	798,230,000.000	
		2.75% KOREA TREASURY BOND 20281210	700,000,000.000	683,158,000.000	
		3.25% KOREA TREASURY BOND 20351210	800,000,000.000	741,296,000.000	
		3% KOREA TREASURY BOND 20280310	600,000,000.000	593,274,000.000	
		3.375% KOREA TREASURY BOND 20310310	2,000,000,000.000	1,947,820,000.000	
		3% KOREA TREASURY BOND 20421210	800,000,000.000	678,272,000.000	
		2% KOREA TREASURY BOND 20460310	1,500,000,000.000	1,042,650,000.000	
	韓国・ウォン 小計			27,960,156,000.000 (2,968,921,205)	
国債証券 合計				418,717,820,331 [418,717,820,331]	
合計				418,717,820,331 [418,717,820,331]	

（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	292銘柄	100%	44.7%
イギリス・ポンド	国債証券	66銘柄	100%	5.7%
イスラエル・シュケル	国債証券	14銘柄	100%	0.4%
オーストラリア・ドル	国債証券	28銘柄	100%	1.3%
オフショア・人民元	国債証券	89銘柄	100%	12.8%

カナダ・ドル	国債証券	44銘柄	100%	2.1%
シンガポール・ドル	国債証券	21銘柄	100%	0.3%
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	8銘柄	100%	0.2%
ニュージーランド・ドル	国債証券	13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	17銘柄	100%	0.7%
マレーシア・リンギット	国債証券	31銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	17銘柄	100%	0.9%
ユーロ	国債証券	442銘柄	100%	29.0%
韓国・ウォン	国債証券	27銘柄	100%	0.7%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

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

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間(2025年6月17日から2026年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

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

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	23,631,332	29,645,854
親投資信託受益証券	4,688,675,200	5,951,545,554
未収入金	889,822	194,543
流動資産合計	4,713,196,354	5,981,385,951
資産合計	4,713,196,354	5,981,385,951
負債の部		
流動負債		
未払解約金	786,243	167,619
未払受託者報酬	498,347	621,585
未払委託者報酬	9,220,045	11,500,045
その他未払費用	186,810	233,024
流動負債合計	10,691,445	12,522,273
負債合計	10,691,445	12,522,273
純資産の部		
元本等		
元本	※1 3,282,449,951	※1 3,607,999,467
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,420,054,958	2,360,864,211
（分配準備積立金）	587,175,657	1,169,816,811
元本等合計	4,702,504,909	5,968,863,678
純資産合計	4,702,504,909	5,968,863,678
負債純資産合計	4,713,196,354	5,981,385,951

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 自　2024年6月18日 至　2025年6月16日	第10期 自　2025年6月17日 至　2026年6月15日
営業収益		
受取利息	60,886	138,192
有価証券売買等損益	△ 55,365,728	766,866,802
営業収益合計	△ 55,304,842	767,004,994
営業費用		
受託者報酬	991,605	1,175,327
委託者報酬	18,346,118	21,745,021
その他費用	371,703	440,608
営業費用合計	19,709,426	23,360,956
営業利益又は営業損失（△）	△ 75,014,268	743,644,038
経常利益又は経常損失（△）	△ 75,014,268	743,644,038
当期純利益又は当期純損失（△）	△ 75,014,268	743,644,038
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（△）	△ 11,146,210	45,601,162
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,399,281,544	1,420,054,958
剰余金増加額又は欠損金減少額	263,958,395	399,249,918
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	263,958,395	399,249,918
剰余金減少額又は欠損金増加額	179,316,923	156,483,541
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	179,316,923	156,483,541
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,420,054,958	2,360,864,211

(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10期 自2025年6月17日 至2026年6月15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 2025年6月15日が休日のため、前計算期間末日を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9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
1.　※1 期首元本額	3,064,897,601円	3,282,449,951円
期中追加設定元本額	611,590,534円	678,724,568円
期中一部解約元本額	394,038,184円	353,175,052円
2.　計算期間末日における受益権の総数	3,282,449,951口	3,607,999,467口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日	第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日

※1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（0円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（832,879,301円）及び分配準備積立金（587,175,657円）より分配対象額は1,420,054,958円（1万口当たり4,326.20円）であり、分配を行っておりません。	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（132,388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（640,331,955円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,191,047,400円）及び分配準備積立金（529,352,468円）より分配対象額は2,360,864,211円（1万口当たり6,543.42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10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	第10期 2026年6月15日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	△47,916,738	730,973,228
合計	△47,916,738	730,973,228

（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9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4326円 (14,326円)	1.6543円 (16,543円)

(4)【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	507,982,978	1,195,080,754	
	外国債券インデックスマザーファンド	1,137,066,960	4,756,464,800	
親投資信託受益証券 合計			5,951,545,554	
合計			5,951,545,554	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

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

「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2025年6月16日現在 金 額（円）	2026年6月15日現在 金 額（円）

資産の部		
流動資産		
預金	79,380,786	258,650,081
コール・ローン	115,872,557	369,540,695
国債証券	53,899,860,071	78,021,675,996
派生商品評価勘定	803,250	2,296,235
未収入金	229,600	-
未収利息	918,367,486	1,365,171,611
前払費用	63,821,786	116,248,174
流動資産合計	55,078,335,536	80,133,582,792
資産合計	55,078,335,536	80,133,582,792
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	204,484
未払金	40,009,832	97,046,750
未払解約金	8,286,114	23,729,611
流動負債合計	48,295,946	120,980,845
負債合計	48,295,946	120,980,845
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	28,417,348,768	34,009,919,422
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	26,612,690,822	46,002,682,525
元本等合計	55,030,039,590	80,012,601,947
純資産合計	55,030,039,590	80,012,601,947
負債純資産合計	55,078,335,536	80,133,582,792

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2026年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2025年6月16日現在	2026年6月15日現在
1.　※1 期首	2024年6月18日	2025年6月17日
期首元本額	25,463,772,957円	28,417,348,768円
期中追加設定元本額	4,085,805,967円	6,728,163,314円
期中一部解約元本額	1,132,230,156円	1,135,592,660円
期末元本額の内訳		
ファンド名		

新興国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	694,299,412円	785,781,520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）	483,942,447円	507,982,978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）	505,806,538円	422,229,395円
Ｄ－Ｉ'ｓ 新興国債券インデックス	71,192,051円	66,863,356円
ｉＦｒｅｅ 新興国債券インデックス	10,655,854,022円	13,429,770,170円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	5,833,290,999円	6,557,548,026円
ダイワ新興国債券インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	6,231,747円	1,788,133,392円
ＤＣダイワ新興国債券インデックスファンド	10,010,045,724円	10,294,662,554円
スタイル9（8資産分散・保守型）	81,138円	230,948円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	2,208,585円	4,973,287円
スタイル9（8資産分散・積極型）	5,476,500円	12,276,772円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券	109,585,370円	98,803,541円
ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド	39,334,235円	40,663,483円
計	28,417,348,768円	34,009,919,422円
2. 期末日における受益権の総数	28,417,348,768口	34,009,919,422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2025年6月17日 至2026年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 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	2026年6月15日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2025年6月16日現在	2026年6月15日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）

国債証券	1,218,399,206	△62,346,310
合計	1,218,399,206	△62,346,310

（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	2025年6月16日現在				2026年6月15日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	81,513,440	-	82,316,690	803,250	365,422,369	-	367,514,120	2,091,751
インド・ルピー	-	-	-	-	25,369,500	-	25,500,000	130,500
オフショア・人民元	81,513,440	-	82,316,690	803,250	-	-	-	-
ポーランド・ズロチ	-	-	-	-	118,140,104	-	118,087,850	△52,254
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	77,777,040	-	78,942,900	1,165,860
ルーマニア・レイ	-	-	-	-	46,358,000	-	46,266,870	△91,130
南アフリカ・ランド	-	-	-	-	97,777,725	-	98,716,500	938,775
合計	81,513,440	-	82,316,690	803,250	365,422,369	-	367,514,120	2,091,751

（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6月16日現在	2026年6月15日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.9365円 (19,365円)	2.3526円 (23,526円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	インド・ルピー	5.85% India Government Bond 20301201	119,000,000.000	115,446,660.000	
		7.26% INDIA GOVERNMENT BOND 20320822	140,000,000.000	143,641,400.000	
		7.18% INDIA GOVERNMENT BOND 20330814	200,000,000.000	203,938,000.000	
		7.26% INDIA GOVERNMENT BOND 20290114	125,000,000.000	127,997,500.000	
		7.72% INDIA GOVERNMENT BOND 20490615	89,000,000.000	91,015,850.000	
		6.45% INDIA GOVERNMENT BOND 20291007	100,000,000.000	100,377,000.000	
		7.16% INDIA GOVERNMENT BOND 20500920	90,000,000.000	86,503,500.000	
		5.79% INDIA GOVERNMENT BOND 20300511	104,000,000.000	101,676,640.000	
		5.77% INDIA GOVERNMENT BOND 20300803	150,000,000.000	146,376,000.000	

		6.67% INDIA GOVERNMENT BOND 20501217	150,000,000.000	134,811,000.000	
		6.1% INDIA GOVERNMENT BOND 20310712	140,000,000.000	135,270,800.000	
		6.99% INDIA GOVERNMENT BOND 20511215	150,000,000.000	140,844,000.000	
		6.54% INDIA GOVERNMENT BOND 20320117	152,000,000.000	150,934,480.000	
		7.1% INDIA GOVERNMENT BOND 20290418	160,000,000.000	163,526,400.000	
		7.54% INDIA GOVERNMENT BOND 20360523	160,000,000.000	166,803,200.000	
		7.38% INDIA GOVERNMENT BOND 20270620	90,000,000.000	91,440,000.000	
		7.36% INDIA GOVERNMENT BOND 20520912	148,000,000.000	144,781,000.000	
		7.41% INDIA GOVERNMENT BOND 20361219	160,000,000.000	165,422,400.000	
		7.26% INDIA GOVERNMENT BOND 20330206	150,000,000.000	153,298,500.000	
		7.06% INDIA GOVERNMENT BOND 20280410	91,000,000.000	92,294,020.000	
		7.17% INDIA GOVERNMENT BOND 20300417	99,000,000.000	101,627,460.000	
		7.3% INDIA GOVERNMENT BOND 20530619	200,000,000.000	191,950,000.000	
		7.18% INDIA GOVERNMENT BOND 20370724	170,000,000.000	172,803,300.000	
		7.37% INDIA GOVERNMENT BOND 20281023	60,000,000.000	61,440,000.000	
		7.32% INDIA GOVERNMENT BOND 20301113	70,000,000.000	71,562,400.000	
		7.37% INDIA GOVERNMENT BOND 20540123	8,000,000.000	7,895,680.000	
		7.1% INDIA GOVERNMENT BOND 20340408	200,000,000.000	202,654,000.000	
		7.04% INDIA GOVERNMENT BOND 20290603	89,000,000.000	90,957,110.000	
		7.02% INDIA GOVERNMENT BOND 20310618	71,000,000.000	72,356,100.000	

		6.79% INDIA GOVERNMENT BOND 20341007	180,000,000.000	178,779,600.000	
		6.75% INDIA GOVERNMENT BOND 20291223	80,000,000.000	81,008,800.000	
		6.79% INDIA GOVERNMENT BOND 20311230	70,000,000.000	70,611,100.000	
		6.79% INDIA GOVERNMENT BOND 20341202	10,000,000.000	9,924,900.000	
		6.33% INDIA GOVERNMENT BOND 20350505	180,000,000.000	172,942,200.000	
		6.28% INDIA GOVERNMENT BOND 20320714	50,000,000.000	49,075,500.000	
		6.01% INDIA GOVERNMENT BOND 20300721	119,000,000.000	117,787,390.000	
		6.48% INDIA GOVERNMENT BOND 20351006	220,000,000.000	211,527,800.000	
		6.68% INDIA GOVERNMENT BOND 20330127	53,000,000.000	52,137,690.000	
		6.36% INDIA GOVERNMENT BOND 20310216	34,000,000.000	33,378,480.000	
		6.94% INDIA GOVERNMENT BOND 20360511	45,000,000.000	45,177,750.000	
	インド・ルピー 小計			4,651,995,610.000 (7,908,392,538)	
	インドネシア・ルピア	8.25% Indonesia Treasury Bond 20360515	20,000,000,000.000	21,282,600,000.000	
		8.75% Indonesia Treasury Bond 20310515	12,000,000,000.000	12,742,200,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20320815	10,000,000,000.000	10,116,600,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20380515	11,000,000,000.000	11,053,680,000.000	
		8.375% Indonesia Treasury Bond 20390415	12,000,000,000.000	12,901,680,000.000	
		8.25% Indonesia Treasury Bond 20290515	20,000,000,000.000	20,506,800,000.000	
		7% Indonesia Treasury Bond 20300915	35,000,000,000.000	34,884,150,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20350615	30,000,000,000.000	30,497,400,000.000	

		7.5% Indonesia Treasury Bond 20400415	30,000,000,000.000	30,001,800,000.000	
		6.5% Indonesia Treasury Bond 20310215	35,000,000,000.000	33,854,100,000.000	
		6.25% Indonesia Treasury Bond 20360615	10,000,000,000.000	9,221,500,000.000	
		6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20320415	40,500,000,000.000	38,860,560,000.000	
		5.125% INDONESIA TREASURY BOND 20270415	20,000,000,000.000	19,681,200,000.000	
		7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20420615	20,000,000,000.000	19,387,800,000.000	
		6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20370715	2,700,000,000.000	2,506,734,000.000	
		7% INDONESIA TREASURY BOND 20330215	31,800,000,000.000	31,221,876,000.000	
		6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20280815	20,500,000,000.000	20,185,120,000.000	
		7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20430615	18,000,000,000.000	17,447,040,000.000	
		7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20380615	25,000,000,000.000	24,476,000,000.000	
		6.625% INDONESIA TREASURY BOND 20340215	33,000,000,000.000	31,798,140,000.000	
		6.875% INDONESIA TREASURY BOND 20290415	30,000,000,000.000	29,753,100,000.000	
		6.75% INDONESIA TREASURY BOND 20350715	40,000,000,000.000	38,507,600,000.000	
		6.5% INDONESIA TREASURY BOND 20300715	32,300,000,000.000	31,423,378,000.000	
		7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20400815	25,000,000,000.000	24,452,000,000.000	
		7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20450815	20,000,000,000.000	19,463,200,000.000	
		6.5% INDONESIA TREASURY BOND 20360415	22,800,000,000.000	21,435,876,000.000	
		5.875% INDONESIA TREASURY BOND 20310315	19,000,000,000.000	18,005,160,000.000	
		10.5% Indonesia Treasury Bond 20300815	9,000,000,000.000	10,006,470,000.000	

	9.5% Indonesia Treasury Bond 20310715	5,100,000,000.000	5,566,344,000.000	
	8.25% Indonesia Treasury Bond 20320615	10,000,000,000.000	10,412,900,000.000	
	7% Indonesia Treasury Bond 20270515	20,000,000,000.000	19,976,200,000.000	
	6.125% Indonesia Treasury Bond 20280515	30,000,000,000.000	29,461,200,000.000	
	6.625% Indonesia Treasury Bond 20330515	22,000,000,000.000	21,263,000,000.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20340315	26,920,000,000.000	28,647,456,400.000	
	9% Indonesia Treasury Bond 20290315	25,000,000,000.000	26,124,500,000.000	
インドネシア・ルピア 小計			767,125,364,400.000 (6,904,128,280)	
ウルグアイ・ペソ	8.5% Uruguay Government International Bond 20280315	2,800,000.000	2,897,636.000	
	8.25% Uruguay Government International Bond 20310521	12,000,000.000	12,524,400.000	
	9.75% URUGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 20330720	11,000,000.000	12,331,000.000	
	8% URUGUAY (ORIENTAL REPUBLIC OF) 20351029	8,000,000.000	8,207,120.000	
ウルグアイ・ペソ 小計			35,960,156.000 (142,779,799)	
オフショア・人民元	3.25% China Government Bond 20281122	4,800,000.000	5,053,968.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	5,900,000.000	6,279,547.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	5,700,000.000	6,073,578.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	4,800,000.000	4,886,544.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	4,000,000.000	4,195,720.000	
	3.28% China Government Bond 20271203	3,700,000.000	3,824,801.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	5,500,000.000	5,975,475.000	

		3.81% China Government Bond 20500914	4,500,000.000	5,771,070.000	
		3.01% China Government Bond 20280513	3,000,000.000	3,109,830.000	
		3.72% China Government Bond 20510412	2,000,000.000	2,544,180.000	
		3.02% China Government Bond 20310527	7,000,000.000	7,555,450.000	
		2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	3,000,000.000	3,120,360.000	
		3.53% CHINA GOVERNMENT BOND 20511018	2,000,000.000	2,485,080.000	
		2.89% CHINA GOVERNMENT BOND 20311118	3,500,000.000	3,765,300.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20270120	2,800,000.000	2,822,764.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20320217	3,000,000.000	3,204,960.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20290324	3,500,000.000	3,651,060.000	
		2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20270415	2,200,000.000	2,226,488.000	
		3.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20520415	2,000,000.000	2,410,340.000	
		2.76% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	2,500,000.000	2,676,200.000	
		2.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20290615	3,600,000.000	3,756,744.000	
		2.5% CHINA GOVERNMENT BOND 20270725	3,700,000.000	3,749,025.000	
		2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20320815	3,000,000.000	3,195,180.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20320901	3,000,000.000	3,188,280.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20290925	3,300,000.000	3,439,392.000	
		2.44% CHINA GOVERNMENT BOND 20271015	3,200,000.000	3,248,928.000	
		3.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20521025	1,200,000.000	1,401,348.000	

		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20321115	3,700,000.000	3,987,601.000	
		2.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20291215	3,000,000.000	3,152,490.000	
		2.64% CHINA GOVERNMENT BOND 20280115	3,200,000.000	3,274,528.000	
		2.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20330225	2,500,000.000	2,717,950.000	
		2.8% CHINA GOVERNMENT BOND 20300325	3,700,000.000	3,904,610.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20280415	3,300,000.000	3,387,252.000	
		3.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20530415	2,200,000.000	2,601,016.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20330525	3,200,000.000	3,428,960.000	
		2.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20300625	3,000,000.000	3,145,290.000	
		2.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20280715	3,000,000.000	3,073,290.000	
		2.52% CHINA GOVERNMENT BOND 20330825	3,000,000.000	3,186,960.000	
		2.48% CHINA GOVERNMENT BOND 20280925	1,200,000.000	1,234,776.000	
		2.6% CHINA GOVERNMENT BOND 20300915	4,700,000.000	4,929,219.000	
		3% CHINA GOVERNMENT BOND 20531015	2,800,000.000	3,221,372.000	
		2.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20281015	4,000,000.000	4,119,880.000	
		2.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20331125	5,000,000.000	5,374,750.000	
		2.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20301225	4,500,000.000	4,719,465.000	
		2.37% CHINA GOVERNMENT BOND 20290115	3,000,000.000	3,085,590.000	
		2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20270225	4,000,000.000	4,026,920.000	
		2.35% CHINA GOVERNMENT BOND 20340225	5,500,000.000	5,785,505.000	

		2.28% CHINA GOVERNMENT BOND 20310325	900,000.000	934,596.000	
		2.05% CHINA GOVERNMENT BOND 20290415	5,000,000.000	5,105,700.000	
		1.85% CHINA GOVERNMENT BOND 20270515	3,800,000.000	3,824,358.000	
		2.49% CHINA GOVERNMENT BOND 20440525	1,700,000.000	1,781,277.000	
		2.27% CHINA GOVERNMENT BOND 20340525	3,900,000.000	4,080,336.000	
		2.12% CHINA GOVERNMENT BOND 20310625	2,700,000.000	2,786,724.000	
		1.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20290715	3,000,000.000	3,052,500.000	
		2.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20540520	2,300,000.000	2,434,895.000	
		2.47% CHINA GOVERNMENT BOND 20540725	2,500,000.000	2,594,050.000	
		1.62% CHINA GOVERNMENT BOND 20270815	5,000,000.000	5,026,000.000	
		2.11% CHINA GOVERNMENT BOND 20340825	4,700,000.000	4,863,372.000	
		2.33% CHINA GOVERNMENT BOND 20440815	3,500,000.000	3,586,660.000	
		1.87% CHINA GOVERNMENT BOND 20310915	1,000,000.000	1,019,200.000	
		2.17% CHINA GOVERNMENT BOND 20340829	3,300,000.000	3,418,569.000	
		2.25% CHINA GOVERNMENT BOND 20390829	1,000,000.000	1,040,520.000	
		2.19% CHINA GOVERNMENT BOND 20540925	3,000,000.000	2,941,170.000	
		1.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20291015	2,000,000.000	2,025,500.000	
		1.42% CHINA GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	2,005,340.000	
		2.04% CHINA GOVERNMENT BOND 20341125	2,000,000.000	2,057,180.000	
		1.49% CHINA GOVERNMENT BOND 20311225	2,500,000.000	2,497,075.000	

		1.43% CHINA GOVERNMENT BOND 20300125	6,700,000.000	6,711,993.000	
		1.92% CHINA GOVERNMENT BOND 20550115	2,200,000.000	2,033,306.000	
		1.61% CHINA GOVERNMENT BOND 20350215	6,000,000.000	5,953,080.000	
		1.45% CHINA GOVERNMENT BOND 20280225	6,000,000.000	6,023,160.000	
		1.79% CHINA GOVERNMENT BOND 20320325	6,500,000.000	6,596,785.000	
		1.65% CHINA GOVERNMENT BOND 20350515	2,000,000.000	1,990,920.000	
		1.46% CHINA GOVERNMENT BOND 20280525	6,000,000.000	6,027,780.000	
		1.67% CHINA GOVERNMENT BOND 20350525	5,000,000.000	4,982,200.000	
		1.88% CHINA GOVERNMENT BOND 20550425	4,300,000.000	3,976,210.000	
		1.98% CHINA GOVERNMENT BOND 20450425	2,000,000.000	1,934,940.000	
		1.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20320515	2,000,000.000	2,001,660.000	
		1.45% CHINA GOVERNMENT BOND 20300425	2,000,000.000	2,002,940.000	
		1.55% CHINA GOVERNMENT BOND 20300725	3,000,000.000	3,019,260.000	
		1.42% CHINA GOVERNMENT BOND 20280815	6,000,000.000	6,015,960.000	
		1.83% CHINA GOVERNMENT BOND 20350825	4,800,000.000	4,832,160.000	
		2.15% CHINA GOVERNMENT BOND 20550825	2,500,000.000	2,427,825.000	
		1.9% CHINA GOVERNMENT BOND 20550715	3,000,000.000	2,752,800.000	
		1.78% CHINA GOVERNMENT BOND 20320915	3,200,000.000	3,242,048.000	
		1.92% CHINA GOVERNMENT BOND 20450715	900,000.000	860,733.000	
		1.63% CHINA GOVERNMENT BOND 20301025	2,500,000.000	2,518,150.000	

	1.78% CHINA GOVERNMENT BOND 20351115	3,600,000.000	3,608,496.000	
	1.4% CHINA GOVERNMENT BOND 20281125	1,000,000.000	1,003,050.000	
	1.66% CHINA GOVERNMENT BOND 20321225	2,000,000.000	2,008,980.000	
	1.54% CHINA GOVERNMENT BOND 20310125	2,000,000.000	2,007,260.000	
	2.38% CHINA GOVERNMENT BOND 20560115	1,000,000.000	1,019,650.000	
	1.32% CHINA GOVERNMENT BOND 20290225	1,000,000.000	1,000,780.000	
	1.75% CHINA GOVERNMENT BOND 20360225	6,000,000.000	5,998,380.000	
	1.66% CHINA GOVERNMENT BOND 20330325	3,100,000.000	3,113,175.000	
	1.5% CHINA GOVERNMENT BOND 20310415	2,000,000.000	2,003,400.000	
	1.72% CHINA GOVERNMENT BOND 20360515	900,000.000	897,714.000	
	2.2% CHINA GOVERNMENT BOND 20560425	1,600,000.000	1,589,552.000	
オフショア・人民元 小計			333,198,405.000 (7,894,303,210)	
コロンビア・ペソ	6% Colombian TES 20280428	7,300,000,000.000	6,494,372,000.000	
	7.75% Colombian TES 20300918	4,000,000,000.000	3,341,080,000.000	
	7% Colombian TES 20320630	5,300,000,000.000	4,086,088,000.000	
	7.25% Colombian TES 20341018	4,500,000,000.000	3,336,255,000.000	
	5.75% Colombian TES 20271103	3,500,000,000.000	3,189,970,000.000	
	7.25% Colombian TES 20501026	8,000,000,000.000	5,037,440,000.000	
	6.25% Colombian TES 20360709	3,750,000,000.000	2,511,225,000.000	
	7% COLOMBIAN TES 20310326	6,000,000,000.000	4,801,080,000.000	
	9.25% COLOMBIAN TES 20420528	9,300,000,000.000	7,440,558,000.000	

	13.25% COLOMBIAN TES 20330209	9,000,000,000.000	9,266,220,000.000	
	11.5% COLOMBIAN TES 20460725	6,000,000,000.000	5,698,980,000.000	
	11% COLOMBIAN TES 20290822	7,700,000,000.000	7,306,684,000.000	
	11.75% COLOMBIAN TES 20350124	5,000,000,000.000	4,829,150,000.000	
	12.75% COLOMBIAN TES 20401128	4,000,000,000.000	4,150,240,000.000	
	12.5% COLOMBIAN TES 20300227	2,500,000,000.000	2,469,975,000.000	
コロンビア・ペソ 小計			73,959,317,000.000 (3,406,566,141)	
セルビア・ディナール	5.875% Serbia Treasury Bonds 20280208	25,000,000.000	25,468,000.000	
	4.5% Serbia Treasury Bonds 20320820	35,000,000.000	33,763,100.000	
	7% SERBIA TREASURY BONDS 20311026	29,000,000.000	31,481,530.000	
	5.25% SERBIA TREASURY BONDS 20350727	25,000,000.000	25,000,250.000	
セルビア・ディナール 小計			115,712,880.000 (182,606,958)	
タイ・バーツ	4.875% Thailand Government Bond 20290622	48,050,000.000	52,964,554.000	
	3.65% Thailand Government Bond 20310620	39,200,000.000	42,847,560.000	
	3.4% Thailand Government Bond 20360617	34,600,000.000	37,834,754.000	
	3.775% Thailand Government Bond 20320625	40,000,000.000	44,371,600.000	
	2.875% Thailand Government Bond 20460617	34,900,000.000	33,629,989.000	
	2.875% Thailand Government Bond 20281217	39,000,000.000	40,507,350.000	
	3.3% Thailand Government Bond 20380617	50,000,000.000	53,902,000.000	
	1.6% Thailand Government Bond 20291217	38,500,000.000	38,618,580.000	

1.6% Thailand Government Bond 20350617	30,000,000.000	28,571,400.000	
1.585% Thailand Government Bond 20351217	40,900,000.000	38,788,333.000	
2% Thailand Government Bond 20311217	60,000,000.000	61,022,400.000	
2% Thailand Government Bond 20420617	29,000,000.000	25,621,500.000	
1% THAILAND GOVERNMENT BOND 20270617	61,000,000.000	61,000,610.000	
2.65% THAILAND GOVERNMENT BOND 20280617	50,000,000.000	51,435,000.000	
3.39% THAILAND GOVERNMENT BOND 20370617	48,500,000.000	53,513,930.000	
3.45% THAILAND GOVERNMENT BOND 20430617	63,500,000.000	67,199,510.000	
3.35% THAILAND GOVERNMENT BOND 20330617	43,000,000.000	47,101,340.000	
2.25% THAILAND GOVERNMENT BOND 20270317	50,000,000.000	50,461,000.000	
2.4% THAILAND GOVERNMENT BOND 20290317	50,000,000.000	51,473,000.000	
2.8% THAILAND GOVERNMENT BOND 20340617	40,000,000.000	42,387,200.000	
2.4% THAILAND GOVERNMENT BOND 20271117	40,000,000.000	40,751,200.000	
2.5% THAILAND GOVERNMENT BOND 20291117	44,000,000.000	45,614,360.000	
2.98% THAILAND GOVERNMENT BOND 20450617	40,000,000.000	39,486,000.000	
2.05% THAILAND GOVERNMENT BOND 20280417	35,000,000.000	35,572,950.000	
2.41% THAILAND GOVERNMENT BOND 20350317	40,000,000.000	40,982,000.000	
2.7% THAILAND GOVERNMENT BOND 20400617	40,000,000.000	40,047,600.000	
1.66% THAILAND GOVERNMENT BOND 20300317	40,000,000.000	40,258,800.000	
1.19% THAILAND GOVERNMENT BOND 20290417	37,000,000.000	36,886,040.000	

	1.34% THAILAND GOVERNMENT BOND 20310317	10,000,000.000	9,885,300.000	
	1.84% THAILAND GOVERNMENT BOND 20360517	15,000,000.000	14,519,700.000	
タイ・バーツ 小計			1,267,255,560.000 (6,234,897,356)	
チェコ・コルナ	2.5% Czech Republic Government Bond 20280825	26,600,000.000	25,810,512.000	
	0.95% Czech Republic Government Bond 20300515	27,500,000.000	24,440,350.000	
	0.25% Czech Republic Government Bond 20270210	27,000,000.000	26,442,990.000	
	2.75% Czech Republic Government Bond 20290723	30,000,000.000	28,851,600.000	
	2% Czech Republic Government Bond 20331013	30,100,000.000	25,365,571.000	
	1.2% Czech Republic Government Bond 20310313	25,000,000.000	21,866,250.000	
	0.05% Czech Republic Government Bond 20291129	15,500,000.000	13,509,955.000	
	4.2% Czech Republic Government Bond 20361204	16,000,000.000	15,255,200.000	
	1.75% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20320623	29,500,000.000	25,527,235.000	
	1.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20400424	16,500,000.000	10,848,090.000	
	3.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20350530	33,000,000.000	30,268,920.000	
	5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20300930	30,000,000.000	31,008,000.000	
	5.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20281212	25,000,000.000	25,878,500.000	
	1.95% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20370730	20,000,000.000	15,121,000.000	
	4.9% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20340414	28,900,000.000	29,509,790.000	
	5.75% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20290329	13,600,000.000	14,203,840.000	
	6.2% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20310616	15,000,000.000	16,300,500.000	

	4.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20321111	30,000,000.000	30,090,300.000	
	3% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20330303	17,800,000.000	16,266,708.000	
	3.6% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20360603	25,700,000.000	23,409,873.000	
	4.25% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20341024	16,000,000.000	15,559,200.000	
	5.3% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20350919	10,000,000.000	10,423,600.000	
	4% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20440404	3,000,000.000	2,590,800.000	
	4.95% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20370227	6,000,000.000	6,051,840.000	
チェコ・コルナ 小計			484,600,624.000 (3,730,504,064)	
チリ・ペソ	5% BONOS TESORERIA PESOS 20350301	970,000,000.000	937,320,700.000	
	6% BONOS TESORERIA PESOS 20430101	630,000,000.000	657,266,400.000	
	4.7% BONOS TESORERIA PESOS 20300901	800,000,000.000	786,608,000.000	
	5% BONOS TESORERIA PESOS 20281001	720,000,000.000	724,672,800.000	
	7% BONOS TESORERIA PESOS 20340501	220,000,000.000	240,904,400.000	
	6% BONOS TESORERIA PESOS 20330401	1,200,000,000.000	1,236,420,000.000	
	6.2% BONOS TESORERIA PESOS 20401001	350,000,000.000	370,118,000.000	
	5.8% BONOS TESORERIA PESOS 20291001	1,000,000,000.000	1,025,120,000.000	
	5.8% BONOS TESORERIA PESOS 20341001	440,000,000.000	448,206,000.000	
	5.3% BONOS TESORERIA PESOS 20371101	400,000,000.000	390,800,000.000	
	BONOS TESORERIA PESOS 20290401	1,150,000,000.000	1,005,732,500.000	
チリ・ペソ 小計			7,823,168,800.000 (1,394,730,180)	

ドミニカ・ペソ	13.625% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20330203	11,400,000.000	13,447,326.000	
	11.25% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20350915	12,500,000.000	13,572,875.000	
	10.75% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20360601	20,000,000.000	20,994,600.000	
	10.5% DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 20370315	18,000,000.000	18,677,160.000	
ドミニカ・ペソ 小計			66,691,961.000 (182,002,362)	
トルコ・リラ	11% Turkey Government Bond 20270224	2,970,000.000	2,477,009.700	
	10.5% Turkey Government Bond 20270811	15,000,000.000	11,182,350.000	
	12.4% Turkey Government Bond 20280308	15,000,000.000	10,255,650.000	
	11.7% Turkey Government Bond 20301113	1,900,000.000	966,112.000	
	17.8% TURKEY GOVERNMENT BOND 20330713	11,500,000.000	7,087,680.000	
	17.3% TURKEY GOVERNMENT BOND 20280719	23,000,000.000	16,365,190.000	
	26.2% TURKEY GOVERNMENT BOND 20331005	52,000,000.000	43,672,200.000	
	31.08% TURKEY GOVERNMENT BOND 20281108	39,500,000.000	36,026,370.000	
	30% TURKEY GOVERNMENT BOND 20290912	63,000,000.000	55,443,150.000	
	27.7% TURKEY GOVERNMENT BOND 20340927	16,000,000.000	13,999,680.000	
トルコ・リラ 小計			197,475,391.700 (685,219,862)	
ハンガリー・フォリント	3% Hungary Government Bond 20271027	270,000,000.000	262,426,500.000	
	6.75% Hungary Government Bond 20281022	373,000,000.000	385,331,380.000	
	3% Hungary Government Bond 20300821	400,000,000.000	367,144,000.000	
	3.25% Hungary Government Bond 20311022	400,000,000.000	363,424,000.000	

		3% Hungary Government Bond 20381027	100,000,000.000	79,299,000.000	
		2% Hungary Government Bond 20290523	410,000,000.000	374,908,100.000	
		2.25% Hungary Government Bond 20330420	315,000,000.000	261,550,800.000	
		3% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20410425	130,000,000.000	99,190,000.000	
		2.25% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20340622	150,000,000.000	120,711,000.000	
		4.5% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20280323	240,000,000.000	237,355,200.000	
		4.75% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20321124	318,000,000.000	308,879,760.000	
		7% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20351024	440,000,000.000	491,026,800.000	
		4.5% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20320527	63,000,000.000	60,537,960.000	
		6.75% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20310723	150,000,000.000	159,516,000.000	
		6% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20291128	96,000,000.000	98,067,840.000	
		6.25% HUNGARY GOVERNMENT BOND 20370923	140,000,000.000	150,939,600.000	
	ハンガリー・フォリント 小計			3,820,307,940.000 (2,020,408,057)	
	ブラジル・レアル	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20270101	19,000,000.000	18,600,810.000	
		10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20290101	22,000,000.000	20,096,340.000	
		10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20310101	34,000,000.000	29,369,880.000	
		10% BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F 20330101	12,400,000.000	10,245,996.000	
		10% BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F 20350101	21,000,000.000	16,808,400.000	
		10% BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F 20370101	4,000,000.000	3,117,000.000	
		BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20270701	18,900,000.000	16,427,691.000	

	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20300101	16,000,000.000	9,942,080.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20280101	11,000,000.000	8,925,950.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20280701	4,000,000.000	3,038,000.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20290101	32,000,000.000	22,718,080.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20320101	15,000,000.000	7,129,500.000	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL 20290701	26,000,000.000	17,262,180.000	
ブラジル・レアル 小計			183,681,907.000 (5,812,577,211)	
ペルー・ソル	6.15% Peru Government Bond 20320812	3,850,000.000	4,202,005.500	
	5.94% Peru Government Bond 20290212	2,300,000.000	2,420,980.000	
	5.4% Peru Government Bond 20340812	4,000,000.000	3,931,200.000	
	5.35% Peru Government Bond 20400812	2,100,000.000	1,843,128.000	
	7.3% PERU GOVERNMENT BOND 20330812	4,000,000.000	4,510,200.000	
	7.6% PERU GOVERNMENT BOND 20390812	3,500,000.000	3,781,680.000	
	6.85% PERU GOVERNMENT BOND 20350812	4,200,000.000	4,449,732.000	
	6.9% Peru Government Bond 20370812	4,465,000.000	4,633,330.500	
	6.95% Peru Government Bond 20310812	3,370,000.000	3,806,987.900	
ペルー・ソル 小計			33,579,243.900 (1,586,323,777)	
ポーランド・ズロチ	2.5% Poland Government Bond 20270725	8,000,000.000	7,878,240.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	10,850,000.000	10,228,729.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	10,200,000.000	8,795,358.000	

	1.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20320425	13,000,000.000	10,832,510.000	
	3.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20270525	6,150,000.000	6,145,572.000	
	7.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20280725	9,400,000.000	9,970,768.000	
	6% POLAND GOVERNMENT BOND 20331025	12,000,000.000	12,499,440.000	
	4.75% POLAND GOVERNMENT BOND 20290725	9,000,000.000	9,038,070.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20341025	10,000,000.000	9,731,200.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300125	10,000,000.000	10,098,200.000	
	4.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20300725	12,400,000.000	12,248,596.000	
	POLAND GOVERNMENT BOND 20280125	7,000,000.000	6,557,530.000	
	5% POLAND GOVERNMENT BOND 20351025	12,800,000.000	12,325,376.000	
	4.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20310125	10,000,000.000	9,830,500.000	
	4% POLAND GOVERNMENT BOND 20310725	5,560,000.000	5,293,509.200	
	5.25% POLAND GOVERNMENT BOND 20360425	1,800,000.000	1,756,980.000	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	6,950,000.000	6,772,705.500	
ポーランド・ズロチ 小計			150,003,283.700 (6,569,078,803)	
マレーシア・リンギット	4.258% Malaysia Government Investment Issue 20270726	1,800,000.000	1,823,274.000	
	4.369% Malaysia Government Investment Issue 20281031	4,400,000.000	4,514,224.000	
	4.13% Malaysia Government Investment Issue 20290709	5,000,000.000	5,122,650.000	
	3.465% Malaysia Government Investment Issue 20301015	5,100,000.000	5,114,790.000	
	3.422% Malaysia Government Investment Issue 20270930	4,250,000.000	4,267,510.000	

3.447% Malaysia Government Investment Issue 20360715	3,700,000.000	3,631,513.000	
4.417% MALAYSIA T-BILL 20410930	3,300,000.000	3,482,424.000	
3.804% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20311008	5,000,000.000	5,089,900.000	
3.635% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20300830	3,000,000.000	3,029,430.000	
3.612% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20350430	3,000,000.000	3,001,470.000	
3.974% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20400716	3,000,000.000	3,020,550.000	
3.775% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20450531	3,250,000.000	3,162,672.500	
3.624% MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 20330331	800,000.000	803,656.000	
3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	6,000,000.000	6,023,580.000	
3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	3,850,000.000	3,890,117.000	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	3,100,000.000	3,255,186.000	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	5,000,000.000	5,054,950.000	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	4,500,000.000	4,932,135.000	
4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	5,000,000.000	5,347,800.000	
4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	4,450,000.000	4,945,685.500	
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	5,000,000.000	5,090,250.000	
4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	2,750,000.000	3,111,762.500	
3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	7,900,000.000	8,040,541.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	4,400,000.000	4,368,320.000	
4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	5,000,000.000	5,014,550.000	

	2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	6,000,000.000	5,792,760.000	
	3.582% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320715	5,000,000.000	5,018,300.000	
	4.193% MALAYSIAN GOVERNMENT 20321007	6,200,000.000	6,434,360.000	
	4.696% MALAYSIAN GOVERNMENT 20421015	5,000,000.000	5,478,950.000	
	4.504% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290430	2,000,000.000	2,067,600.000	
	3.599% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280731	5,400,000.000	5,441,526.000	
	4.291% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430814	5,000,000.000	5,205,100.000	
	4.662% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380331	2,500,000.000	2,706,500.000	
	4.245% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300930	3,600,000.000	3,721,752.000	
	4.457% MALAYSIAN GOVERNMENT 20530331	5,000,000.000	5,316,300.000	
	3.519% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280420	4,300,000.000	4,325,843.000	
	4.467% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390915	4,900,000.000	5,191,305.000	
	4.054% MALAYSIAN GOVERNMENT 20390418	5,700,000.000	5,869,347.000	
	4.18% MALAYSIAN GOVERNMENT 20440516	4,200,000.000	4,338,264.000	
	4.119% MALAYSIAN GOVERNMENT 20341130	5,000,000.000	5,182,400.000	
	3.336% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300515	2,000,000.000	1,998,520.000	
	3.476% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350702	3,000,000.000	2,975,430.000	
	3.917% MALAYSIAN GOVERNMENT 20550715	2,300,000.000	2,231,644.000	
	3.766% MALAYSIAN GOVERNMENT 20410115	1,000,000.000	991,490.000	
マレーシア・リンギット 小計			185,426,331.500 (7,342,808,558)	
メキシコ・ペソ	8% Mexican Bonos 20471107	40,000,000.000	34,458,000.000	

	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	37,000,000.000	36,684,760.000	
	8% MEXICAN BONOS 20530731	70,000,000.000	59,588,200.000	
	7.5% MEXICAN BONOS 20330526	59,900,000.000	55,923,239.000	
	8% MEXICAN BONOS 20350524	6,000,000.000	5,594,340.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20290301	71,000,000.000	72,038,730.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20280302	50,000,000.000	50,899,000.000	
	8.5% MEXICAN BONOS 20300228	56,500,000.000	56,965,560.000	
	8% MEXICAN BONOS 20360221	40,000,000.000	37,396,000.000	
	8% MEXICAN BONOS 20320415	33,000,000.000	31,926,180.000	
	8% MEXICAN BONOS 20550429	25,000,000.000	21,221,250.000	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	45,000,000.000	45,243,900.000	
	10% Mexican Bonos 20361120	18,000,000.000	19,154,700.000	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	65,000,000.000	65,895,700.000	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	45,000,000.000	42,371,100.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	80,000,000.000	77,747,200.000	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	80,000,000.000	68,488,000.000	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	76,000,000.000	70,619,200.000	
メキシコ・ペソ 小計			852,215,059.000 (7,946,649,761)	
ルーマニア・レイ	5.8% Romania Government Bond 20270726	2,800,000.000	2,788,856.000	
	5% Romania Government Bond 20290212	2,600,000.000	2,506,842.000	
	3.65% Romania Government Bond 20310924	2,500,000.000	2,169,450.000	
	4.15% Romania Government Bond 20280126	2,600,000.000	2,516,020.000	
	4.15% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20301024	2,500,000.000	2,267,875.000	
	4.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20341011	2,700,000.000	2,342,169.000	
	2.5% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20271025	2,300,000.000	2,189,347.000	
	4.85% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20290725	2,300,000.000	2,188,956.000	
	6.7% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20320225	3,000,000.000	2,981,130.000	

	4.25% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20360428	3,000,000.000	2,432,610.000	
	8.25% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20320929	4,000,000.000	4,280,040.000	
	8.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20281030	2,800,000.000	2,939,608.000	
	8% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20300429	3,500,000.000	3,655,750.000	
	7.9% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20380224	3,000,000.000	3,206,970.000	
	7.2% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20331030	4,000,000.000	4,069,040.000	
	7.35% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20310428	3,400,000.000	3,491,358.000	
	7.2% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20270531	3,000,000.000	3,027,390.000	
	7.1% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20340731	4,000,000.000	4,049,960.000	
	6.3% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20290425	3,350,000.000	3,332,446.000	
	6.3% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20280426	3,000,000.000	2,996,010.000	
	6.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20350425	2,000,000.000	1,978,180.000	
	6.85% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20300729	2,000,000.000	2,012,080.000	
	7.65% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20310727	2,000,000.000	2,078,020.000	
	7.5% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20330727	1,000,000.000	1,033,860.000	
ルーマニア・レイ 小計			66,533,967.000 (2,368,682,412)	
南アフリカ・ランド	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	20,000,000.000	16,869,600.000	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	16,280,000.000	12,875,689.200	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	38,000,000.000	36,417,300.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	85,000,000.000	81,899,200.000	

		8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	65,700,000.000	64,374,831.000	
		8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	48,200,000.000	48,299,774.000	
		8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	60,000,000.000	57,661,800.000	
		8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	62,000,000.000	62,102,300.000	
		8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	67,000,000.000	68,550,380.000	
		9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	56,000,000.000	55,716,080.000	
		11.625% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20530331	23,000,000.000	28,870,290.000	
		10.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20380331	10,000,000.000	11,426,600.000	
		10% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20330331	11,000,000.000	11,955,680.000	
		9.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20390331	13,400,000.000	14,266,176.000	
		10.125% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20420331	5,000,000.000	5,382,650.000	
	南アフリカ・ランド 小計			576,668,350.200 (5,709,016,667)	
国債証券 合計				78,021,675,996 [78,021,675,996]	
合計				78,021,675,996 [78,021,675,996]	

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

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

3.　外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
インド・ルピー	国債証券	40銘柄	100%	10.1%
インドネシア・ルピア	国債証券	35銘柄	100%	8.8%
ウルグアイ・ペソ	国債証券	4銘柄	100%	0.2%

オフショア・人民元	国債証券	98銘柄	100%	10.1%
コロンビア・ペソ	国債証券	15銘柄	100%	4.4%
セルビア・ディナール	国債証券	4銘柄	100%	0.2%
タイ・バーツ	国債証券	30銘柄	100%	8.0%
チェコ・コルナ	国債証券	24銘柄	100%	4.8%
チリ・ペソ	国債証券	11銘柄	100%	1.8%
ドミニカ・ペソ	国債証券	4銘柄	100%	0.2%
トルコ・リラ	国債証券	10銘柄	100%	0.9%
ハンガリー・フォリント	国債証券	16銘柄	100%	2.6%
ブラジル・レアル	国債証券	13銘柄	100%	7.4%
ペルー・ソル	国債証券	9銘柄	100%	2.0%
ポーランド・ズロチ	国債証券	17銘柄	100%	8.4%
マレーシア・リンギット	国債証券	44銘柄	100%	9.4%
メキシコ・ペソ	国債証券	18銘柄	100%	10.4%
ルーマニア・レイ	国債証券	24銘柄	100%	3.0%
南アフリカ・ランド	国債証券	15銘柄	100%	7.3%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

前記「ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）」に記載のとおりであります。

【ダイワファンドラップ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間(2025年6月17日から2026年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワファンドラップ Ｊ－ＲＥＩＴインデックス

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	72,537,637	62,706,227
親投資信託受益証券	16,944,848,276	26,701,279,413
未収入金	3,000,000	-
流動資産合計	17,020,385,913	26,763,985,640
資産合計	17,020,385,913	26,763,985,640
負債の部		
流動負債		
未払解約金	41,026,850	7,901,945
未払受託者報酬	1,652,388	2,637,611
未払委託者報酬	23,960,247	38,245,850
その他未払費用	413,021	659,319
流動負債合計	67,052,506	49,444,725
負債合計	67,052,506	49,444,725
純資産の部		
元本等		
元本	※1 12,453,630,988	※1 18,505,056,992
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,499,702,419	8,209,483,923
（分配準備積立金）	1,254,169,348	1,425,379,575
元本等合計	16,953,333,407	26,714,540,915
純資産合計	16,953,333,407	26,714,540,915
負債純資産合計	17,020,385,913	26,763,985,640

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 自　2024年6月18日 至　2025年6月16日	第10期 自　2025年6月17日 至　2026年6月15日
営業収益		
受取利息	109,744	324,930
有価証券売買等損益	1,379,839,252	744,231,137
営業収益合計	1,379,948,996	744,556,067
営業費用		
受託者報酬	3,064,722	4,777,557
委託者報酬	44,439,798	69,275,784
その他費用	766,038	1,194,223
営業費用合計	48,270,558	75,247,564
営業利益又は営業損失（△）	1,331,678,438	669,308,503
経常利益又は経常損失（△）	1,331,678,438	669,308,503
当期純利益又は当期純損失（△）	1,331,678,438	669,308,503
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	43,480,162	296,965,031
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,353,421,411	4,499,702,419
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,345,108,924	4,286,604,078
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,345,108,924	4,286,604,078
剰余金減少額又は欠損金増加額	487,026,192	949,166,046
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	487,026,192	949,166,046
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,499,702,419	8,209,483,923

(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10期 自2025年6月17日 至2026年6月15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 2025年6月15日が休日のため、前計算期間末日を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9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
1.　※1 期首元本額	9,360,680,454円	12,453,630,988円
期中追加設定元本額	5,016,373,943円	8,502,298,430円
期中一部解約元本額	1,923,423,409円	2,450,872,426円
2.　計算期間末日における受益権の総数	12,453,630,988口	18,505,056,992口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日	第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15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（104,917円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（658,061,321円）、投資信託約款に規定される収益調整金（4,304,024,949円）及び分配準備積立金（596,003,110円）より分配対象額は5,558,194,297円（1万口当たり4,463.11円）であり、分配を行っておりません。	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（262,642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（372,080,830円）、投資信託約款に規定される収益調整金（7,206,029,035円）及び分配準備積立金（1,053,036,103円）より分配対象額は8,631,408,610円（1万口当たり4,664.35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10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	第10期 2026年6月15日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,351,604,139	593,200,876
合計	1,351,604,139	593,200,876

（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9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3613円 (13,613円)	1.4436円 (14,436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	7,309,611,381	26,701,279,413	
親投資信託受益証券 合計			26,701,279,413	
合計			26,701,279,413	

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

	2025年6月16日現在 金 額（円）	2026年6月15日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		

コール・ローン		8,034,824,481	4,530,525,426
投資証券	※2	244,793,677,200	218,091,916,200
派生商品評価勘定		159,656,000	140,531,820
未収入金		1,266,673,039	23,462,220
未収配当金		2,006,391,081	1,786,090,815
差入委託証拠金		397,099,042	261,121,592
流動資産合計		256,658,320,843	224,833,648,073
資産合計		256,658,320,843	224,833,648,073
負債の部			
流動負債			
前受金		160,272,000	118,918,100
未払金		-	133,173,694
未払解約金		626,750,000	181,440,000
流動負債合計		787,022,000	433,531,794
負債合計		787,022,000	433,531,794
純資産の部			
元本等			
元本	※1	74,539,061,065	61,430,778,280
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）		181,332,237,778	162,969,337,999
元本等合計		255,871,298,843	224,400,116,279
純資産合計		255,871,298,843	224,400,116,279
負債純資産合計		256,658,320,843	224,833,648,073

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2026年6月15日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2025年6月16日現在	2026年6月15日現在
1.　※1 期首	2024年6月18日	2025年6月17日
期首元本額	103,664,583,904円	74,539,061,065円
期中追加設定元本額	5,213,729,543円	6,743,992,705円
期中一部解約元本額	34,339,252,382円	19,852,275,490円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ世界ＲＥＩＴインデックスＶＡ	-円	4,567,676円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン	3,125,772,749円	2,468,406,831円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（毎月分配型）	53,826,059,442円	36,936,562,025円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（年1回決算型）	697,894,699円	768,341,583円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	27,910,142円	35,700,488円
ｉＦｒｅｅ Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	511,672,995円	475,681,706円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	3,376,710,749円	3,998,150,715円

ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（奇数月決算型）	91,405,955円	141,843,634円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	471,097円	733,053円
ＤＣ・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン	5,242,448,787円	5,236,891,689円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	8,385,587円	9,460,757円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	9,249,706円	12,619,246円
ダイワ国内ＲＥＩＴインデックス（投資一任専用）	6,138,165円	1,191,418,518円
ダイワ・ノーロード Ｊ－ＲＥＩＴファンド	71,107,333円	61,021,449円
ダイワファンドラップ Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	4,936,303,282円	7,309,611,381円
ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	1,308,011,544円	1,371,849,303円
ダイワファンドラップオンライン Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	674,397,154円	869,501,316円
スタイル9（6資産分散・保守型）	50,544円	149,174円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	3,087,757円	5,723,266円
スタイル9（6資産分散・積極型）	1,523,314円	5,109,624円
スタイル9（8資産分散・保守型）	58,166円	170,583円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	2,258,085円	4,332,775円
スタイル9（8資産分散・積極型）	3,266,088円	8,184,138円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル1（安定）	-円	74,389円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル2（やや安定）	-円	133,728円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル3（バランス）	-円	112,175円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル4（やや積極）	-円	105,419円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル5（積極）	-円	27,565円

ダイワ・インデックスセレクト Ｊ－ＲＥＩＴ	614,877,725円	514,294,074円
計	74,539,061,065円	61,430,778,280円
2.　期末日における受益権の総数	74,539,061,065口	61,430,778,280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　727,500,000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　762,500,000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2025年6月17日 至2026年6月15日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3.　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	2026年6月15日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2025年6月16日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2026年6月15日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	13,909,959,533	△18,604,860,094
合計	13,909,959,533	△18,604,860,094

（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	2025年6月16日現在				2026年6月15日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
不動産投信指数先物取引								
買建	9,676,128,000	-	9,836,400,000	160,272,000	5,176,359,600	-	5,317,219,000	140,859,400
合計	9,676,128,000	-	9,836,400,000	160,272,000	5,176,359,600	-	5,317,219,000	140,859,400

（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6月16日現在	2026年6月15日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.4327円 (34,327円)	3.6529円 (36,529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	4,531	525,596,000	
	サンケイリアルエステート	6,559	768,714,800	
	SOSILA物流リート投	10,216	1,168,710,400	
	東海道リート投資法	5,134	529,828,800	
	三井不動産アコモデーションファンド投資法人	35,350	4,337,445,000	
	森ヒルズリート	23,699	3,050,061,300	
	産業ファンド	37,374	5,340,744,600	
	アドバンス・レジデンス	42,161	6,425,336,400	
	ＡＰＩ投資法人	31,613	4,283,561,500	
	ＧＬＰ投資法人	67,371	9,115,296,300	
	コンフォリア・レジデンシャル	31,020	3,222,978,000	
	日本プロロジスリート	105,402	8,980,250,400	
	星野リゾート・リート	8,226	1,963,546,200	
	Ｏｎｅリート投資法人	12,206	915,450,000	
	イオンリート投資	24,863	3,068,094,200	
	ヒューリックリート投資法	18,092	2,807,878,400	

日本リート投資法人	27,012	2,312,227,200	
積水ハウス・リート投資	60,438	4,816,908,600	
トーセイ・リート投資法人	4,452	585,438,000	
ヘルスケア&メディカル投資	5,314	581,883,000	
サムティ・レジデンシャル	5,672	548,482,400	
野村不動産マスターＦ	65,246	9,950,015,000	※
いちごホテルリート投資	3,389	381,262,500	
ラサールロジポート投資	25,672	3,760,948,000	
スターアジア不動産投	37,732	2,075,260,000	
マリモ地方創生リート	3,745	406,332,500	
三井不ロジパーク	45,212	4,833,162,800	
日本ホテル＆レジデンシャル投資法人	5,989	386,290,500	
投資法人みらい	28,195	1,226,482,500	
三菱地所物流REIT	20,853	2,516,957,100	
CREロジスティクスファンド	8,613	1,231,659,000	
セントラル・リート投資法人	3,321	348,372,900	
MIRARTH不動産投資法人	14,905	1,240,096,000	
霞ヶ関ホテルリート	2,548	244,353,200	
日本ビルファンド	123,679	15,348,563,900	
ジャパンリアルエステイト	107,543	12,485,742,300	
日本都市ファンド投資法人	106,320	12,014,160,000	
オリックス不動産投資	81,593	7,800,290,800	
日本プライムリアルティ	56,775	5,416,335,000	
NTT都市開発リート投資法人	20,617	2,719,382,300	
東急リアル・エステート	13,500	2,469,150,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	16,093	1,775,057,900	
ユナイテッド・アーバン投資法人	47,206	7,675,695,600	
森トラストリート投資法人	39,466	2,916,537,400	
インヴィンシブル投資法人	113,025	7,064,062,500	
フロンティア不動産投資	35,985	2,954,368,500	
平和不動産リート	16,826	2,290,018,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	40,592	3,795,352,000	
福岡リート投資法人	11,558	2,008,780,400	
KDX不動産投資法人	59,705	9,397,567,000	
いちごオフィスリート投資法人	14,678	1,366,521,800	
大和証券オフィス投資法人	8,290	2,694,250,000	
阪急阪神リート投資法人	9,762	1,374,489,600	
スターツプロシード投資法人	3,423	634,281,900	

	大和ハウスリート投資法人	63,750	7,669,125,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	87,270	6,894,330,000	
	大和証券リビング投資法人	29,979	3,003,895,800	
	ジャパンエクセレント投資法人	17,168	2,374,334,400	
投資証券　合計			218,091,916,200	
合計			218,091,916,200	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

野村不動産マスターＦ　5,000口

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間(2025年6月17日から2026年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	63,340,232	75,201,894
親投資信託受益証券	21,146,679,875	26,431,074,324
未収入金	9,140,000	-
流動資産合計	21,219,160,107	26,506,276,218
資産合計	21,219,160,107	26,506,276,218
負債の部		
流動負債		
未払解約金	28,801,980	17,070,485
未払受託者報酬	2,309,537	2,845,034
未払委託者報酬	43,304,771	53,345,286
その他未払費用	577,301	711,185
流動負債合計	74,993,589	73,971,990
負債合計	74,993,589	73,971,990
純資産の部		
元本等		
元本	※1 20,503,902,892	※1 22,894,787,904
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	640,263,626	3,537,516,324
（分配準備積立金）	1,373,958,052	2,577,041,066
元本等合計	21,144,166,518	26,432,304,228
純資産合計	21,144,166,518	26,432,304,228
負債純資産合計	21,219,160,107	26,506,276,218

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 自　2024年6月18日 至　2025年6月16日	第10期 自　2025年6月17日 至　2026年6月15日
営業収益		
受取利息	126,403	254,576
有価証券売買等損益	905,927,856	2,990,494,449
営業収益合計	906,054,259	2,990,749,025
営業費用		
受託者報酬	4,794,556	5,320,912
委託者報酬	89,899,648	99,769,062
その他費用	1,204,415	1,336,016
営業費用合計	95,898,619	106,425,990
営業利益又は営業損失（△）	810,155,640	2,884,323,035
経常利益又は経常損失（△）	810,155,640	2,884,323,035
当期純利益又は当期純損失（△）	810,155,640	2,884,323,035
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（△）	295,748,016	241,314,064
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 101,233,534	640,263,626
剰余金増加額又は欠損金減少額	237,821,077	455,747,210
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	237,821,077	455,747,210
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,731,541	201,503,483
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	10,731,541	201,503,483
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	640,263,626	3,537,516,324

(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10期 自2025年6月17日 至2026年6月15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 2025年6月15日が休日のため、前計算期間末日を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9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
1.　※1 期首元本額	20,883,336,459円	20,503,902,892円
期中追加設定元本額	4,922,529,420円	8,077,923,235円
期中一部解約元本額	5,301,962,987円	5,687,038,223円
2.　計算期間末日における受益権の総数	20,503,902,892口	22,894,787,904口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日	第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15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（100,950円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（5,050,074,049円）及び分配準備積立金（1,373,857,102円）より分配対象額は6,424,032,101円（1万口当たり3,133.08円）であり、分配を行っておりません。	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（239,744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（1,500,897,754円）、投資信託約款に規定される収益調整金（6,097,221,214円）及び分配準備積立金（1,075,903,568円）より分配対象額は8,674,262,280円（1万口当たり3,788.75円）であり、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 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10期 2026年6月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	680,733,146	2,786,712,717
合計	680,733,146	2,786,712,717

(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9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
１口当たり純資産額	1.0312円	1.1545円

（1万口当たり純資産額）	(10,312円)	(11,545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	26,863,577,929	26,431,074,324	
親投資信託受益証券 合計			26,431,074,324	
合計			26,431,074,324	

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

	2025年6月16日現在 金 額（円）	2026年6月15日現在 金 額（円）

資産の部		
流動資産		
預金	261,179,826	422,407,003
コール・ローン	534,573,297	173,123,708
投資信託受益証券	482,734,580	-
投資証券	26,874,799,640	32,061,745,365
派生商品評価勘定	24,931,957	38,118,394
未収入金	103,221,956	1,863,718
未収配当金	68,255,651	58,772,321
差入委託証拠金	359,017,827	283,898,911
流動資産合計	28,708,714,734	33,039,929,420
資産合計	28,708,714,734	33,039,929,420
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	232,331,837	156,467,744
未払金	415,701	3,052,628
未払解約金	21,690,000	5,300,000
流動負債合計	254,437,538	164,820,372
負債合計	254,437,538	164,820,372
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	32,519,331,878	33,412,938,920
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△） ※2	△4,065,054,682	△537,829,872
元本等合計	28,454,277,196	32,875,109,048
純資産合計	28,454,277,196	32,875,109,048
負債純資産合計	28,708,714,734	33,039,929,420

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2026年6月15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、市場価格のある有価証券については外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。また、市場価格のない有価証券については投資法人が発行する投資証券の１口当たり純資産額に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.	デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3.	収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4.	その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準

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

（貸借対照表に関する注記）

区分	2025年6月16日現在	2026年6月15日現在
1.　※1 期首	2024年6月18日	2025年6月17日
期首元本額	30,158,213,460円	32,519,331,878円
期中追加設定元本額	9,878,138,629円	13,610,244,254円
期中一部解約元本額	7,517,020,211円	12,716,637,212円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）	24,167,634,143円	26,863,577,929円
ダイワファンドラップオンライン 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）	1,192,223,759円	939,979,571円
ダイワ海外ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用）	1,242,365円	6,043,497円
ダイワ・マクロ・ナビゲーター・ファンド2021-10（為替ヘッジあり／適格機関投資家専用）	419,369,715円	443,231,761円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル1（安定）	-円	3,519円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル2（やや安定）	-円	3,519円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル3（バランス）	-円	4,239円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル4（やや積極）	-円	5,115円

BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル5（積極）	-円	3,519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）	6,738,861,896円	5,160,086,251円
計	32,519,331,878円	33,412,938,920円
2.　期末日における受益権の総数	32,519,331,878口	33,412,938,920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4,065,054,682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537,829,872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2025年6月17日 至2026年6月15日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 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	2026年6月15日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2025年6月16日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2026年6月15日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	2,831,527	-
投資証券	△436,101,961	3,760,210,028
合計	△433,270,434	3,760,210,028

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

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1．不動産投信関連

種類	2025年6月16日現在				2026年6月15日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								

不動産投信指数先物取引								
買建	1,144,021,171	-	1,168,042,924	24,021,753	815,641,585	-	825,276,230	9,634,645
合計	1,144,021,171	-	1,168,042,924	24,021,753	815,641,585	-	825,276,230	9,634,645

（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6月16日現在				2026年6月15日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	27,699,925,460	-	27,931,347,093	△231,421,633	31,944,931,214	-	32,072,915,209	△127,983,995
アメリカ・ドル	21,491,872,374	-	21,643,059,820	△151,187,446	25,164,692,757	-	25,306,754,954	△142,062,197
イギリス・ポンド	1,349,694,734	-	1,364,937,158	△15,242,424	1,323,275,723	-	1,331,413,226	△8,137,503
イスラエル・シュケル	42,139,672	-	41,229,468	910,204	72,194,376	-	69,722,591	2,471,785
オーストラリア・ドル	2,135,150,037	-	2,161,943,053	△26,793,016	2,220,588,391	-	2,198,534,152	22,054,239
カナダ・ドル	403,744,286	-	409,909,724	△6,165,438	430,804,679	-	428,109,610	2,695,069
シンガポール・ドル	843,027,765	-	852,130,699	△9,102,934	1,011,141,718	-	1,013,417,886	△2,276,168

ニュージーランド・ドル	30,221,136	-	30,554,069	△332,933	45,549,947	-	44,818,736	731,211
ユーロ	1,104,605,564	-	1,126,809,135	△22,203,571	1,368,048,541	-	1,369,939,507	△1,890,966
香港・ドル	299,469,892	-	300,773,967	△1,304,075	308,635,082	-	310,204,547	△1,569,465
合計	27,699,925,460	-	27,931,347,093	△231,421,633	31,944,931,214	-	32,072,915,209	△127,983,995

（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6月16日現在	2026年6月15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.8750円 (8,750円)	0.9839円 (9,839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
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST REIT (REIT)	13,219	240,321.420	

URBAN EDGE PROPERTIES (REIT)	14,658	350,619.360	
XENIA HOTELS RESORTS REIT INC (REIT)	11,033	214,591.850	
AVALONBAY COMMUNITIES REIT INC (REIT)	16,477	3,081,693.310	
SIMON PROPERTY GROUP REIT INC (REIT)	37,846	8,289,787.840	
BXP INC (REIT)	17,159	1,137,298.520	
VORNADO REALTY TRUST REIT (REIT)	18,638	713,276.260	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	5,268	126,642.720	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST (REIT)	8,237	376,595.640	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC (REIT)	2,718	78,060.960	
EQUITY RESIDENTIAL REIT (REIT)	40,009	2,694,206.060	
APPLE HOSPITALITY REIT INC (REIT)	25,603	415,280.660	
EPR PROPERTIES REIT (REIT)	8,860	530,271.000	
GLOBAL NET LEASE INC (REIT)	22,943	216,581.920	
EQUINIX REIT INC (REIT)	11,434	12,072,588.900	
FOUR CORNERS PROPERTY INC TRUST (REIT)	12,771	322,723.170	
CHATHAM LODGING TRUST REIT (REIT)	5,858	75,333.880	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES REIT (REIT)	7,332	900,442.920	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC (REIT)	3,296	59,031.360	
BRAEMAR HOTELS RESORTS INC (REIT)	6,929	15,035.930	
HOST HOTELS & RESORTS REIT INC (REIT)	74,425	1,852,438.250	
AMERICAN HOMES RENT REIT CLASS A (REIT)	37,938	1,262,956.020	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES REIT INC (REIT)	6,757	103,314.530	

RLJ LODGING TRUST REIT (REIT)	17,952	197,831.040	
FARMLAND PARTNERS INC (REIT)	5,044	50,339.120	
AH REALTY INC (REIT)	9,327	64,169.760	
KIMCO REALTY REIT CORP (REIT)	78,445	2,032,509.950	
CHIRON REAL ESTATE INC (REIT)	1,613	59,810.040	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS (REIT)	40,596	840,337.200	
WHITESTONE REIT (REIT)	5,405	103,019.300	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES REIT (REIT)	32,934	1,563,376.980	
PIEDMONT REALTY TRUST INC CLASS A (REIT)	14,490	131,859.000	
PARK HOTELS RESORTS INC (REIT)	23,262	337,299.000	
INVITATION HOMES INC (REIT)	65,631	1,947,928.080	
OUTFRONT MEDIA INC (REIT)	16,931	530,617.540	
LAMAR ADVERTISING COMPANY CLASS A (REIT)	10,108	1,560,169.800	
JBG SMITH PROPERTIES (REIT)	7,125	104,880.000	
GLADSTONE LAND REIT CORP (REIT)	4,518	40,481.280	
AMERICOLD REALTY INC TRUST (REIT)	33,149	479,334.540	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TR (REIT)	7,310	65,790.000	
VICI PPTYS INC (REIT)	127,126	3,625,633.520	
BRT APARTMENTS CORP (REIT)	1,402	21,170.200	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES I (REIT)	3,261	197,257.890	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST (REIT)	24,424	754,213.120	
BROADSTONE NET LEASE INC (REIT)	22,019	463,940.330	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES REIT INC (REIT)	13,279	82,329.800	

AMERICAN ASSETS TRUST REIT INC (REIT)	5,509	134,474.690	
INDEPENDENCE REALTY INC (REIT)	27,562	464,970.940	
EMPIRE STATE REALTY REIT INC TRUST (REIT)	16,556	90,064.640	
NETSTREIT CORP (REIT)	11,297	230,119.890	
CTO REALTY GROWTH INC (REIT)	3,612	75,599.160	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY REIT INC (REIT)	26,791	940,096.190	
STAG INDUSTRIAL REIT INC (REIT)	22,231	862,118.180	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC (REIT)	1,652	33,287.800	
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A (REIT)	2,964	70,809.960	
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC (REIT)	14,639	614,545.220	
ORION PROPERTIES INC	6,028	16,818.120	
DIGITAL CORE REIT UNITS	118,500	57,472.500	
VENTAS REIT INC (REIT)	55,272	4,676,011.200	
CARETRUST REIT INC (REIT)	25,998	958,026.300	
INVENTRUST PROPERTIES CORP (REIT)	9,042	316,470.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP REIT INC (REIT)	35,678	1,162,389.240	
SABRA HEALTH CARE REIT INC (REIT)	29,342	549,575.660	
UMH PROPERTIES INC (REIT)	9,748	148,949.440	
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC (REIT)	1,862	92,541.400	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE T (REIT)	5,123	25,256.390	
NET LEASE OFFICE PROPERTIES (REIT)	1,890	22,226.400	
AMERICAN HEALTHCARE REIT INC (REIT)	20,645	966,392.450	
LINEAGE INC (REIT)	6,642	295,037.640	

MODIV INDUSTRIAL INC CLASS C (REIT)	1,056	19,377.600	
SILA RLTY TR INC TRUST (REIT)	6,414	194,215.920	
CURBLINE PROPERTIES (REIT)	11,281	349,259.760	
FRONTVIEW REIT INC (REIT)	2,554	50,747.980	
MILLROSE PROPERTIES INC CLASS A (REIT)	17,942	522,650.460	
SMARTSTOP SELF STORAGE REIT INC (REIT)	6,665	214,879.600	
NTT DC REIT UNITS (REIT)	95,900	93,023.000	
IRON MOUNTAIN INC (REIT)	34,426	4,380,364.240	
TERRENO REALTY REIT CORP (REIT)	12,123	815,514.210	
SUN COMMUNITIES REIT INC (REIT)	13,528	1,717,379.600	
ACADIA REALTY TRUST REIT (REIT)	15,249	336,850.410	
ALEXANDERS REIT INC (REIT)	274	71,952.400	
PROLOGIS REIT INC (REIT)	108,173	16,089,652.020	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES RE (REIT)	18,150	965,035.500	
BRANDYWINE REALTY TRUST REIT (REIT)	20,773	67,304.520	
SAUL CENTERS REIT INC (REIT)	1,623	60,781.350	
CAMDEN PROPERTY TRUST REIT (REIT)	12,034	1,383,669.320	
COUSINS PROPERTIES REIT INC	19,548	567,087.480	
SITE CENTERS CORP (REIT)	6,546	32,337.240	
EASTGROUP PROPERTIES REIT INC (REIT)	6,196	1,271,976.840	
ESSEX PROPERTY TRUST REIT INC (REIT)	7,499	2,127,841.250	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC (REIT)	15,422	980,376.540	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST RE (REIT)	9,136	1,149,674.240	
GETTY REALTY REIT CORP (REIT)	6,404	213,829.560	

WELLTOWER INC (REIT)	81,198	17,395,047.540	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC (REIT)	80,883	1,673,469.270	
HIGHWOODS PROPERTIES REIT INC (REIT)	12,793	381,743.120	
SERVICE PROPERTIES TRUST (REIT)	68,994	111,770.280	
KILROY REALTY REIT CORP (REIT)	12,687	486,800.190	
LTC PROPERTIES REIT INC (REIT)	5,541	204,075.030	
LXP INDUSTRIAL TRUST	6,875	364,650.000	
MID AMERICA APARTMENT COMMUNITIES (REIT)	13,604	1,890,003.720	
MACERICH REIT (REIT)	30,834	784,725.300	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES REIT I (REIT)	22,557	1,462,370.310	
NATIONAL HEALTH INVESTORS REIT INC (REIT)	5,544	399,722.400	
NNN REIT INC (REIT)	22,103	1,029,778.770	
REALTY INCOME REIT CORP (REIT)	107,050	6,714,176.000	
COPT DEFENSE PROPERTIES (REIT)	13,146	454,062.840	
PUBLIC STORAGE REIT (REIT)	18,381	5,991,103.140	
REGENCY CENTERS REIT CORP (REIT)	19,156	1,537,843.680	
SAFEHOLD INC (REIT)	5,623	88,899.630	
TANGER INC (REIT)	13,395	541,961.700	
SL GREEN REALTY REIT CORP (REIT)	8,281	423,573.150	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST (REIT)	25,361	229,009.830	
UDR REIT INC (REIT)	34,998	1,378,921.200	
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRU (REIT)	1,485	59,786.100	
W. P. CAREY REIT INC (REIT)	25,502	1,956,258.420	
AGREE REALTY REIT CORP (REIT)	13,945	1,057,449.350	

		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS REIT IN (REIT)	34,396	1,574,304.920	
		CUBESMART REIT (REIT)	26,537	1,111,634.930	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS REIT INC (REIT)	22,099	259,000.280	
		DIGITAL REALTY TRUST REIT INC (REIT)	37,581	6,922,420.200	
		EXTRA SPACE STORAGE REIT INC (REIT)	24,699	3,719,669.400	
		CENTERSPACE (REIT)	2,011	117,422.290	
		KITE REALTY GROUP TRUST REIT (REIT)	25,195	736,197.900	
		ONE LIBERTY PROPERTIES REIT INC (REIT)	1,965	48,339.000	
		GLADSTONE COMMERCIAL REIT CORP (REIT)	5,775	72,418.500	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY (REIT)	23,705	282,563.600	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST REIT INC (REIT)	57,397	284,689.120	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES REIT CO (REIT)	11,605	7,937.820	
		DOUGLAS EMMETT REIT INC (REIT)	19,488	239,312.640	
		FERMI INC (REIT)	4,003	28,581.420	
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT	203,400	10,983.600	
		PRIME US REIT UNITS	111,040	17,211.200	
	アメリカ・ドル 小計			158,912,312.210 (25,454,574,170)	
	イギリス・ポンド	HELICAL PLC (REIT)	13,564	25,554.570	
		HAMMERSON REIT PLC (REIT)	63,756	218,045.520	
		GRAINGER PLC (REIT)	87,181	145,592.270	
		SIRIUS REAL ESTATE LIMITED LTD (REIT)	177,883	174,236.390	
		CLS HOLDINGS PLC (REIT)	20,382	9,915.840	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD (REIT)	65,395	46,757.420	
		REGIONAL REIT LTD	19,105	17,385.550	

		NEWRIVER REIT PLC (REIT)	47,291	37,312.590	
		SHAFTESBURY CAPITAL PLC (REIT)	229,608	312,037.270	
		CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT PLC (REIT)	59,197	52,685.330	
		SOCIAL HOUSING REIT PLC (REIT)	39,779	28,521.540	
		TARGET HEALTHCARE REIT PLC (REIT)	74,384	80,781.020	
		AEW UK REIT PLC (REIT)	20,041	21,403.780	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC (REIT)	146,503	125,040.310	
		LAND SECURITIES GROUP REIT PLC (REIT)	87,583	575,420.310	
		SEGRO REIT PLC (REIT)	159,112	1,194,294.670	
		UNITE GROUP PLC (REIT)	55,513	293,108.640	
		BRITISH LAND REIT PLC (REIT)	120,422	503,363.960	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC (REIT)	47,750	154,423.500	
		DERWENT LONDON REIT PLC (REIT)	13,201	248,310.810	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES REIT PLC (REIT)	305,069	282,341.350	
		WORKSPACE GROUP REIT PLC (REIT)	17,408	59,813.880	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC (REIT)	25,685	157,705.900	
		BIG YELLOW GROUP PLC (REIT)	23,604	203,584.500	
		LONDONMETRIC PROPERTY REIT PLC (REIT)	275,600	511,513.600	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TR (REIT)	66,072	31,185.980	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC (REIT)	292,239	455,892.840	
	イギリス・ポンド 小計			5,966,229.340 (1,285,483,773)	
	イスラエル・シュケル	MENIVIM THE NEW REIT LTD (REIT)	101,181	197,100.580	

	SELLA CAPTIAL REAL ESTATE LTD (REIT)	29,354	278,275.920	
	REIT REIT LTD (REIT)	24,704	555,840.000	
イスラエル・シュケル 小計			1,031,216.500 (56,570,372)	
オーストラリア・ドル	DEXUS STAPLED UNITS	128,971	762,218.610	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	53,426	37,665.330	
	ABACUS STORAGE KING UNITS	53,537	73,881.060	
	DIGICO INFRASTRUCTURE REIT STAPLED (REIT)	50,218	122,531.920	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE	41,023	108,710.950	
	CROMWELL PROPERTY GROUP STAPLED UN	220,272	99,122.400	
	CENTURIA INDUSTR UNITS	62,891	191,817.550	
	RURAL FUND GROUP STAPLED UNITS	50,015	103,531.050	
	WAYPOINT REIT STAPLED UNIT LTD	78,294	193,386.180	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT STAPLE (REIT)	78,954	295,287.960	
	CENTURIA OFFICE REIT UNITS	52,359	48,955.660	
	CENTURIA CAPITAL STAPLED UNITS	99,537	211,018.440	
	HOMECO DAILY NEEDS UNITS	225,346	294,076.530	
	REGION GROUP STAPLED UNITS LTD	138,467	333,705.470	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA R	32,562	74,241.360	
	DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	33,774	84,435.000	
	SCENTRE GROUP UNIT (REIT)	625,503	2,414,441.580	
	ARENA REIT STAPLED UNITS	50,889	164,880.360	
	BWP GROUP STAPLED UNITS TRUST (REIT)	70,975	278,931.750	
	GPT GROUP STAPLED UNITS	229,698	1,173,756.780	
	CHARTER HALL RETAIL UNITS	60,635	237,689.200	
	MIRVAC GROUP STAPLED UNITS	473,150	837,475.500	

	STOCKLAND STAPLED UNITS LTD	290,467	1,228,675.410	
	ABACUS GROUP UNIT	52,859	52,594.700	
	GOODMAN GROUP UNITS	245,192	7,728,451.840	
	VICINITY CENTRES (REIT)	468,819	1,209,553.020	
	CHARTER HALL GROUP STAPLED UNITS	56,717	1,289,744.580	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP STAPLED	48,873	201,356.760	
オーストラリア・ドル 小計			19,852,136.950 (2,248,850,074)	
カナダ・ドル	NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	4,700	38,634.000	
	PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	7,225	147,462.250	
	SLATE GROCERY REIT UNITS CLASS U	3,600	62,496.000	
	KILLAM APARTMENT REIT UNITS CLASS	7,300	138,262.000	
	MINTO APARTMENT REIT UNITS TRUST	2,500	43,450.000	
	VITAL INFRASTRUCTURE PROPERTY UNIT	15,700	85,251.000	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT STA	3,600	339,984.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVES	16,900	240,825.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVESTMENT T	8,600	110,510.000	
	FIRST CAPITAL REALTY REAL ESTATE I	12,500	292,875.000	
	CHOICE PROPERTIES REAL ESTATE INVE	19,300	315,748.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIA	2,400	41,040.000	
	CT REIT UNITS TRUST	6,800	123,896.000	
	SMARTCENTRES RL ESTATE INVESTMENT	8,500	256,785.000	
	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES REAL	9,200	329,176.000	
	HANDR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,300	180,115.000	

		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	17,100	396,036.000	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE UNITS TRU	1,000	17,990.000	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT T	3,000	196,860.000	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRU	6,600	114,642.000	
		ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE INVT	11,300	113,113.000	
	カナダ・ドル 小計			3,585,150.250 (411,180,882)	
	シンガポール・ドル	CENTURION ACCOMMODATION REIT UNITS (REIT)	123,100	135,410.000	
		KEPPEL DC REIT	240,400	550,516.000	
		AIMS APAC REIT	78,300	125,280.000	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRU (REIT)	363,000	357,555.000	
		SASSEUR REIT UNITS TRUST (REIT)	78,800	52,402.000	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT U	316,300	181,872.500	
		EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TR (REIT)	32,900	0.000	
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	502,700	1,271,831.000	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL T	693,600	1,623,024.000	
		SUNTEC REIT UNITS TRUST	265,800	385,410.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST UNITS	410,600	500,932.000	
		KEPPEL REIT UNITS	376,700	323,962.000	
		CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	326,200	291,949.000	
		ESR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST U	69,750	165,307.500	
		CDL HOSPITALITY REIT UNITS	101,700	78,309.000	
		FRASERS CENTREPOINT UNITS TRUST	168,454	382,390.580	
		STARHILL GLOBAL REIT UNITS TRUST	189,100	102,114.000	

	CAPITALAND CHINA TRUST	148,700	96,655.000	
	PARKWAY LIFE REIT TRUST	52,400	206,456.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL UNITS TRUST	256,700	503,132.000	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	278,400	353,568.000	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST STAPLED (REIT)	130,400	73,676.000	
	OUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST (REIT)	291,500	102,025.000	
シンガポール・ドル 小計			7,863,776.580 (983,129,349)	
ニュージーランド・ドル	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST UN (REIT)	69,221	132,904.320	
	GOODMAN NEW ZEALAND & GOODMAN PROP	118,883	242,521.320	
ニュージーランド・ドル 小計			375,425.640 (35,166,120)	
ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV (REIT)	5,026	140,979.300	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD (REIT)	3,691	88,768.550	
	STONEWEG EUROPE STAPLED TRUST	44,200	68,068.000	
	VASTNED BELGIUM NV (REIT)	992	29,908.800	
	ASCENCIO SA (REIT)	720	37,800.000	
	HAMBORNER REIT N AG	8,459	39,038.280	
	WERELDHAVE NV (REIT)	4,431	91,721.700	
	UNIBAIL RODAMCO WE STAPLED UNITS	13,777	1,387,343.900	
	NSI NV (REIT)	1,736	30,345.280	
	ICADE REIT SA (REIT)	3,685	78,637.900	
	CARMILA SA (REIT)	7,479	127,741.320	
	ALTAREA (REIT)	769	74,516.100	
	GECINA SA (REIT)	5,904	434,534.400	
	KLEPIERRE REIT SA (REIT)	24,973	911,514.500	
	COVIVIO SA (REIT)	6,184	340,429.200	
	MERCIALYS REIT SA (REIT)	10,615	126,743.100	
	AEDIFICA NV (REIT)	9,437	668,139.600	
	COFINIMMO REIT SA (REIT)	898	74,623.800	

	RETAIL ESTATES NV (REIT)	1,524	107,899.200	
	WAREHOUSES DE PAUW NV (REIT)	21,534	477,193.440	
	CARE PROPERTY INV NV (REIT)	4,857	60,129.660	
	XIOR STUDENT HOUSING NV (REIT)	4,570	121,790.500	
	MONTEA NV (REIT)	2,408	161,336.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE S	6,703	29,560.230	
	COLONIAL SFL SOCIMI SA (REIT)	38,922	222,244.620	
	MERLIN PROPERTIES REIT SA (REIT)	49,069	747,811.560	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES PLC (REIT)	60,255	66,762.540	
ユーロ 小計			6,745,581.480 (1,253,463,950)	
韓国・ウォン	SK REITS LTD (REIT)	24,200	130,922,000.000	
	HANWHA REIT LTD (REIT)	16,522	74,349,000.000	
	SHINHAN ALPHA REIT LTD (REIT)	13,618	75,035,180.000	
	LOTTE REIT LTD (REIT)	19,578	74,004,840.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT LTD (REIT)	9,127	31,990,135.000	
	JR GLOBAL (REIT)	23,768	28,093,776.000	
	KLI REIT LTD (REIT)	8,114	33,267,400.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT LTD (REIT)	22,131	80,446,185.000	
韓国・ウォン 小計			528,108,516.000 (56,076,675)	
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	353,000	243,570.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TR	96,000	216,000.000	
	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRU	191,000	905,340.000	
	PROSPERITY REAL ESTATE INVESTMENT	170,000	241,400.000	
	LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	311,600	11,435,720.000	

		CHAMPION REAL ESTATE INVESTMENT TR	231,000	522,060.000	
	香港・ドル 小計			13,564,090.000 (277,250,000)	
投資証券 合計				32,061,745,365 [32,061,745,365]	
合計				32,061,745,365 [32,061,745,365]	

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 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券	133銘柄	100%	79.3%
イギリス・ポンド	投資証券	27銘柄	100%	4.0%
イスラエル・シュケル	投資証券	3銘柄	100%	0.2%
オーストラリア・ドル	投資証券	28銘柄	100%	7.0%
カナダ・ドル	投資証券	21銘柄	100%	1.3%
シンガポール・ドル	投資証券	23銘柄	100%	3.1%
ニュージーランド・ドル	投資証券	2銘柄	100%	0.1%
ユーロ	投資証券	27銘柄	100%	3.9%
韓国・ウォン	投資証券	8銘柄	100%	0.2%
香港・ドル	投資証券	6銘柄	100%	0.9%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期計算期間(2025年6月17日から2026年6月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	40,531,604	41,707,440
親投資信託受益証券	10,163,607,871	20,066,679,962
流動資産合計	10,204,139,475	20,108,387,402
資産合計	10,204,139,475	20,108,387,402
負債の部		
流動負債		
未払解約金	19,361,334	3,707,700
未払受託者報酬	1,015,367	1,844,579
未払委託者報酬	19,039,069	34,586,778
その他未払費用	253,765	461,067
流動負債合計	39,669,535	40,600,124
負債合計	39,669,535	40,600,124
純資産の部		
元本等		
元本	※1 5,486,936,130	※1 8,375,007,847
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,677,533,810	11,692,779,431
（分配準備積立金）	1,313,667,616	4,815,377,669
元本等合計	10,164,469,940	20,067,787,278
純資産合計	10,164,469,940	20,067,787,278
負債純資産合計	10,204,139,475	20,108,387,402

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 自　2024年6月18日 至　2025年6月16日	第10期 自　2025年6月17日 至　2026年6月15日
営業収益		
受取利息	53,378	155,623
有価証券売買等損益	100,357,178	3,941,589,091
営業収益合計	100,410,556	3,941,744,714
営業費用		
受託者報酬	1,949,968	3,154,449
委託者報酬	36,563,640	59,147,648
その他費用	487,338	788,458
営業費用合計	39,000,946	63,090,555
営業利益又は営業損失（△）	61,409,610	3,878,654,159
経常利益又は経常損失（△）	61,409,610	3,878,654,159
当期純利益又は当期純損失（△）	61,409,610	3,878,654,159
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（△）	48,919,434	206,614,675
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,385,095,315	4,677,533,810
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,936,371,772	4,206,853,529
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,936,371,772	4,206,853,529
剰余金減少額又は欠損金増加額	656,423,453	863,647,392
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	656,423,453	863,647,392
分配金	※1 -	※1 -
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,677,533,810	11,692,779,431

(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10期 自2025年6月17日 至2026年6月15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 2025年6月15日が休日のため、前計算期間末日を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9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
1.　※1 期首元本額	4,068,540,757円	5,486,936,130円
期中追加設定元本額	2,192,925,167円	3,850,991,507円
期中一部解約元本額	774,529,794円	962,919,790円
2.　計算期間末日における受益権の総数	5,486,936,130口	8,375,007,847口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第9期 自2024年6月18日 至2025年6月16日	第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15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（14,103円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（12,476,073円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,363,866,194円）及び分配準備積立金（1,301,177,440円）より分配対象額は4,677,533,810円（1万口当たり8,524.86円）であり、分配を行っておりません。	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（154,878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（3,671,884,606円）、投資信託約款に規定される収益調整金（6,877,401,762円）及び分配準備積立金（1,143,338,185円）より分配対象額は11,692,779,431円（1万口当たり13,961.51円）であり、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区分	第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区分	第10期 2026年6月15日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	68,347,329	3,833,909,060
合計	68,347,329	3,833,909,060

（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9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第10期 自2025年6月17日 至2026年6月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第9期 2025年6月16日現在	第10期 2026年6月15日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8525円 (18,525円)	2.3962円 (23,962円)

(4)【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	3,991,145,225	20,066,679,962	
親投資信託受益証券 合計			20,066,679,962	
合計			20,066,679,962	

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

	2025年6月16日現在 金 額（円）	2026年6月15日現在 金 額（円）
資産の部		
流動資産		

預金	472,152,544	797,592,497
コール・ローン	359,903,106	325,460,044
投資信託受益証券	1,478,950,340	1,860,383,220
投資証券	45,521,940,900	72,325,414,906
派生商品評価勘定	36,431,290	81,873,644
未収入金	1,615,430	3,770,192
未収配当金	114,203,036	128,645,582
差入委託証拠金	410,251,991	498,908,851
流動資産合計	48,395,448,637	76,022,048,936
資産合計	48,395,448,637	76,022,048,936
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,374,085	2,675,808
未払金	-	65,490,874
未払解約金	12,725,000	25,453,000
流動負債合計	20,099,085	93,619,682
負債合計	20,099,085	93,619,682
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	12,500,149,430	15,101,837,278
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	35,875,200,122	60,826,591,976
元本等合計	48,375,349,552	75,928,429,254
純資産合計	48,375,349,552	75,928,429,254
負債純資産合計	48,395,448,637	76,022,048,936

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2026年6月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券

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

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2025年6月16日現在	2026年6月15日現在
1.　※1 期首	2024年6月18日	2025年6月17日
期首元本額	10,981,310,353円	12,500,149,430円
期中追加設定元本額	2,436,041,310円	3,609,237,703円
期中一部解約元本額	917,202,233円	1,007,549,855円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ世界ＲＥＩＴインデックスＶＡ	-円	59,383,716円
ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）	2,626,255,264円	3,991,145,225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）	270,886,617円	176,645,839円
Ｄ－Ｉ's グローバルＲＥＩＴインデックス	1,354,223円	1,191,164円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	21,399,314円	22,893,358円
ｉＦｒｅｅ 外国ＲＥＩＴインデックス	614,241,119円	541,598,398円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	2,906,000,690円	3,250,719,964円

グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成型）	443,429,567円	432,257,852円
グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）	226,449,161円	189,564,871円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	6,390,038円	8,418,317円
ＤＣダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックスファンド	4,589,495,796円	4,723,283,280円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	7,393,088円	6,934,196円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	8,119,780円	9,248,118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）	5,135,087円	838,219,175円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	124,495,154円	113,891,128円
スタイル9（6資産分散・保守型）	20,848円	30,052円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	2,093,883円	1,295,614円
スタイル9（6資産分散・積極型）	2,754,481円	3,080,261円
スタイル9（8資産分散・保守型）	33,676円	50,071円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	1,421,077円	1,732,439円
スタイル9（8資産分散・積極型）	3,114,298円	4,312,522円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル1（安定）	-円	83,950円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル2（やや安定）	-円	95,271円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル3（バランス）	-円	108,523円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル4（やや積極）	-円	133,360円
BEST GOALS専用ポートフォリオ・レベル5（積極）	-円	154,238円
ダイワ・インデックスセレクトグローバルＲＥＩＴ	171,726,759円	141,380,176円

ダイワ・ノーロード グローバルＲＥＩＴファンド	56,368,123円	52,078,037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）	260,390,699円	393,882,743円
ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	76,089,763円	69,382,012円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	75,090,925円	68,643,408円
計	12,500,149,430円	15,101,837,278円
2.　期末日における受益権の総数	12,500,149,430口	15,101,837,278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2025年6月17日 至2026年6月15日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。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	2026年6月15日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2025年6月16日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2026年6月15日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	13,657,467	74,819,883
投資証券	△3,039,547,241	6,202,512,771
合計	△3,025,889,774	6,277,332,654

（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	2025年6月16日現在				2026年6月15日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								

不動産投信指数先物取引								
買建	1,329,696,037	-	1,354,101,601	24,405,564	1,712,536,510	-	1,791,222,531	78,686,021
合計	1,329,696,037	-	1,354,101,601	24,405,564	1,712,536,510	-	1,791,222,531	78,686,021

（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6月16日現在				2026年6月15日現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買建	345,342,452	-	349,994,093	4,651,641	347,886,433	-	348,398,248	511,815
アメリカ・ドル	177,382,000	-	178,626,092	1,244,092	71,646,095	-	71,777,811	131,716
ユーロ	167,960,452	-	171,368,001	3,407,549	276,240,338	-	276,620,437	380,099
合計	345,342,452	-	349,994,093	4,651,641	347,886,433	-	348,398,248	511,815

（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6月16日現在	2026年6月15日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.8700円 (38,700円)	5.0278円 (50,278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 INDEX FUND;ET (ETF)	117,900	11,614,329.000	
	アメリカ・ドル 小計			11,614,329.000 (1,860,383,220)	
投資信託受益証券 合計				1,860,383,220 [1,860,383,220]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST REIT (REIT)	29,878	543,182.040	
		URBAN EDGE PROPERTIES (REIT)	33,128	792,421.760	
		XENIA HOTELS RESORTS REIT INC (REIT)	24,936	485,005.200	
		AVALONBAY COMMUNITIES REIT INC (REIT)	37,242	6,965,371.260	

		SIMON PROPERTY GROUP REIT INC (REIT)	85,537	18,736,024.480	
		BXP INC (REIT)	38,782	2,570,470.960	
		VORNADO REALTY TRUST REIT (REIT)	42,125	1,612,123.750	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	11,509	276,676.360	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST (REIT)	18,617	851,169.240	
		NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC (REIT)	5,737	164,766.640	
		EQUITY RESIDENTIAL REIT (REIT)	90,426	6,089,286.840	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC (REIT)	57,868	938,618.960	
		EPR PROPERTIES REIT (REIT)	20,026	1,198,556.100	
		GLOBAL NET LEASE INC (REIT)	51,855	489,511.200	
		EQUINIX REIT INC (REIT)	25,843	27,286,331.550	
		FOUR CORNERS PROPERTY INC TRUST (REIT)	28,865	729,418.550	
		CHATHAM LODGING TRUST REIT (REIT)	12,286	157,997.960	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES REIT (REIT)	16,571	2,035,084.510	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC (REIT)	6,735	120,623.850	
		BRAEMAR HOTELS RESORTS INC (REIT)	13,415	29,110.550	
		HOST HOTELS & RESORTS REIT INC (REIT)	168,212	4,186,796.680	
		AMERICAN HOMES RENT REIT CLASS A (REIT)	85,747	2,854,517.630	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES REIT INC (REIT)	13,969	213,586.010	
		RLJ LODGING TRUST REIT (REIT)	39,220	432,204.400	
		FARMLAND PARTNERS INC (REIT)	10,078	100,578.440	
		AH REALTY INC (REIT)	20,662	142,154.560	

KIMCO REALTY REIT CORP (REIT)	177,297	4,593,765.270	
CHIRON REAL ESTATE INC (REIT)	3,249	120,472.920	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS (REIT)	91,753	1,899,287.100	
WHITESTONE REIT (REIT)	11,574	220,600.440	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES REIT (REIT)	74,436	3,533,476.920	
PIEDMONT REALTY TRUST INC CLASS A (REIT)	32,099	292,100.900	
PARK HOTELS RESORTS INC (REIT)	52,576	762,352.000	
INVITATION HOMES INC (REIT)	148,336	4,402,612.480	
OUTFRONT MEDIA INC (REIT)	38,267	1,199,287.780	
LAMAR ADVERTISING COMPANY CLASS A (REIT)	22,846	3,526,280.100	
JBG SMITH PROPERTIES (REIT)	15,256	224,568.320	
GLADSTONE LAND REIT CORP (REIT)	8,934	80,048.640	
AMERICOLD REALTY INC TRUST (REIT)	74,921	1,083,357.660	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TR (REIT)	15,465	139,185.000	
VICI PPTYS INC (REIT)	287,325	8,194,509.000	
BRT APARTMENTS CORP (REIT)	2,987	45,103.700	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES I (REIT)	7,371	445,871.790	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST (REIT)	55,202	1,704,637.760	
BROADSTONE NET LEASE INC (REIT)	49,767	1,048,590.690	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES REIT INC (REIT)	26,825	166,315.000	
AMERICAN ASSETS TRUST REIT INC (REIT)	12,452	303,953.320	
INDEPENDENCE REALTY INC (REIT)	62,296	1,050,933.520	
EMPIRE STATE REALTY REIT INC TRUST (REIT)	35,770	194,588.800	

NETSTREIT CORP (REIT)	25,532	520,086.840	
CTO REALTY GROWTH INC (REIT)	7,748	162,165.640	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY REIT INC (REIT)	60,552	2,124,769.680	
STAG INDUSTRIAL REIT INC (REIT)	50,246	1,948,539.880	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC (REIT)	3,267	65,830.050	
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A (REIT)	6,315	150,865.350	
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC (REIT)	33,087	1,388,992.260	
ORION PROPERTIES INC	11,711	32,673.690	
DIGITAL CORE REIT UNITS	227,600	110,386.000	
VENTAS REIT INC (REIT)	124,923	10,568,485.800	
CARETRUST REIT INC (REIT)	58,759	2,165,269.150	
INVENTRUST PROPERTIES CORP (REIT)	20,436	715,260.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP REIT INC (REIT)	80,638	2,627,186.040	
SABRA HEALTH CARE REIT INC (REIT)	66,318	1,242,136.140	
UMH PROPERTIES INC (REIT)	21,296	325,402.880	
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC (REIT)	3,964	197,010.800	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE T (REIT)	10,244	50,502.920	
NET LEASE OFFICE PROPERTIES (REIT)	3,506	41,230.560	
AMERICAN HEALTHCARE REIT INC (REIT)	46,662	2,184,248.220	
LINEAGE INC (REIT)	15,011	666,788.620	
MODIV INDUSTRIAL INC CLASS C (REIT)	2,486	45,618.100	
SILA RLTY TR INC TRUST (REIT)	14,497	438,969.160	
CURBLINE PROPERTIES (REIT)	25,496	789,356.160	
FRONTVIEW REIT INC (REIT)	5,695	113,159.650	

MILLROSE PROPERTIES INC CLASS A (REIT)	40,553	1,181,308.890	
SMARTSTOP SELF STORAGE REIT INC (REIT)	14,600	470,704.000	
NTT DC REIT UNITS (REIT)	216,800	210,296.000	
IRON MOUNTAIN INC (REIT)	77,809	9,900,417.160	
TERRENO REALTY REIT CORP (REIT)	27,401	1,843,265.270	
SUN COMMUNITIES REIT INC (REIT)	30,575	3,881,496.250	
ACADIA REALTY TRUST REIT (REIT)	34,465	761,331.850	
ALEXANDERS REIT INC (REIT)	564	148,106.400	
PROLOGIS REIT INC (REIT)	244,489	36,365,293.860	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES RE (REIT)	41,023	2,181,192.910	
BRANDYWINE REALTY TRUST REIT (REIT)	43,998	142,553.520	
SAUL CENTERS REIT INC (REIT)	3,275	122,648.750	
CAMDEN PROPERTY TRUST REIT (REIT)	27,198	3,127,226.040	
COUSINS PROPERTIES REIT INC	44,182	1,281,719.820	
SITE CENTERS CORP (REIT)	12,963	64,037.220	
EASTGROUP PROPERTIES REIT INC (REIT)	14,004	2,874,881.160	
ESSEX PROPERTY TRUST REIT INC (REIT)	16,949	4,809,278.750	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC (REIT)	34,856	2,215,795.920	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST RE (REIT)	20,650	2,598,596.000	
GETTY REALTY REIT CORP (REIT)	14,474	483,286.860	
WELLTOWER INC (REIT)	183,520	39,315,489.600	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC (REIT)	182,808	3,782,297.520	
HIGHWOODS PROPERTIES REIT INC (REIT)	28,914	862,793.760	

		SERVICE PROPERTIES TRUST (REIT)	150,732	244,185.840	
		KILROY REALTY REIT CORP (REIT)	28,675	1,100,259.750	
		LTC PROPERTIES REIT INC (REIT)	12,523	461,222.090	
		LXP INDUSTRIAL TRUST	15,538	824,135.520	
		MID AMERICA APARTMENT COMMUNITIES (REIT)	30,747	4,271,680.710	
		MACERICH REIT (REIT)	72,413	1,842,910.850	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES REIT I (REIT)	50,982	3,305,163.060	
		NATIONAL HEALTH INVESTORS REIT INC (REIT)	12,530	903,413.000	
		NNN REIT INC (REIT)	49,957	2,327,496.630	
		REALTY INCOME REIT CORP (REIT)	241,950	15,175,104.000	
		COPT DEFENSE PROPERTIES (REIT)	29,713	1,026,287.020	
		PUBLIC STORAGE REIT (REIT)	41,545	13,541,177.300	
		REGENCY CENTERS REIT CORP (REIT)	43,296	3,475,802.880	
		SAFEHOLD INC (REIT)	11,839	187,174.590	
		TANGER INC (REIT)	30,276	1,224,966.960	
		SL GREEN REALTY REIT CORP (REIT)	18,716	957,323.400	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST (REIT)	57,320	517,599.600	
		UDR REIT INC (REIT)	79,100	3,116,540.000	
		UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRU (REIT)	3,233	130,160.580	
		W. P. CAREY REIT INC (REIT)	57,639	4,421,487.690	
		AGREE REALTY REIT CORP (REIT)	31,519	2,390,085.770	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS REIT IN (REIT)	77,740	3,558,159.800	
		CUBESMART REIT (REIT)	59,977	2,512,436.530	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS REIT INC (REIT)	49,948	585,390.560	

		DIGITAL REALTY TRUST REIT INC (REIT)	84,939	15,645,763.800	
		EXTRA SPACE STORAGE REIT INC (REIT)	55,825	8,407,245.000	
		CENTERSPACE (REIT)	4,393	256,507.270	
		KITE REALTY GROUP TRUST REIT (REIT)	56,945	1,663,932.900	
		ONE LIBERTY PROPERTIES REIT INC (REIT)	4,129	101,573.400	
		GLADSTONE COMMERCIAL REIT CORP (REIT)	12,260	153,740.400	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY (REIT)	53,577	638,637.840	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST REIT INC (REIT)	129,727	643,445.920	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES REIT CO (REIT)	16,005	10,947.420	
		DOUGLAS EMMETT REIT INC (REIT)	44,045	540,872.600	
		FERMI INC (REIT)	7,900	56,406.000	
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT	445,062	24,033.340	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST UNITS	90,000	0.000	
		PRIME US REIT UNITS	235,620	36,521.100	
	アメリカ・ドル 小計			358,812,230.810 (57,474,543,131)	
	イギリス・ポンド	HELICAL PLC (REIT)	29,467	55,515.820	
		HAMMERSON REIT PLC (REIT)	141,129	482,661.180	
		GRAINGER PLC (REIT)	196,874	328,779.580	
		SIRIUS REAL ESTATE LIMITED LTD (REIT)	401,701	393,466.120	
		CLS HOLDINGS PLC (REIT)	37,724	18,352.720	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD (REIT)	136,405	97,529.570	
		REGIONAL REIT LTD	33,993	30,933.630	
		NEWRIVER REIT PLC (REIT)	98,275	77,538.970	
		SHAFTESBURY CAPITAL PLC (REIT)	518,508	704,652.370	

	CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT PLC (REIT)	116,999	104,129.110	
	SOCIAL HOUSING REIT PLC (REIT)	87,195	62,518.810	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC (REIT)	164,654	178,814.240	
	AEW UK REIT PLC (REIT)	42,123	44,987.360	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC (REIT)	330,838	282,370.230	
	LAND SECURITIES GROUP REIT PLC (REIT)	197,783	1,299,434.310	
	SEGRO REIT PLC (REIT)	359,311	2,696,988.360	
	UNITE GROUP PLC (REIT)	125,360	661,900.800	
	BRITISH LAND REIT PLC (REIT)	271,940	1,136,709.200	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC (REIT)	107,831	348,725.450	
	DERWENT LONDON REIT PLC (REIT)	29,810	560,726.100	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES REIT PLC (REIT)	688,916	637,591.750	
	WORKSPACE GROUP REIT PLC (REIT)	39,311	135,072.590	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC (REIT)	58,003	356,138.420	
	BIG YELLOW GROUP PLC (REIT)	52,249	450,647.620	
	LONDONMETRIC PROPERTY REIT PLC (REIT)	622,367	1,155,113.150	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TR (REIT)	126,035	59,488.520	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC (REIT)	659,943	1,029,511.080	
イギリス・ポンド 小計			13,390,297.060 (2,885,073,405)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM THE NEW REIT LTD (REIT)	227,368	442,912.860	
	SELLA CAPTIAL REAL ESTATE LTD (REIT)	65,917	624,893.160	
	REIT REIT LTD (REIT)	55,475	1,248,187.500	

イスラエル・シュケル 小計			2,315,993.520 (127,050,541)	
オーストラリア・ドル	DEXUS STAPLED UNITS	296,121	1,750,075.110	
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	116,634	82,226.970	
	ABACUS STORAGE KING UNITS	110,768	152,859.840	
	DIGICO INFRASTRUCTURE REIT STAPLED (REIT)	110,241	268,988.040	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE	88,914	235,622.100	
	CROMWELL PROPERTY GROUP STAPLED UN	454,183	204,382.350	
	CENTURIA INDUSTR UNITS	141,743	432,316.150	
	RURAL FUND GROUP STAPLED UNITS	107,297	222,104.790	
	WAYPOINT REIT STAPLED UNIT LTD	176,147	435,083.090	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT STAPLE (REIT)	181,280	677,987.200	
	CENTURIA OFFICE REIT UNITS	104,144	97,374.640	
	CENTURIA CAPITAL STAPLED UNITS	228,538	484,500.560	
	HOMECO DAILY NEEDS UNITS	517,400	675,207.000	
	REGION GROUP STAPLED UNITS LTD	317,924	766,196.840	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA R	73,124	166,722.720	
	DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	69,196	172,990.000	
	SCENTRE GROUP UNIT (REIT)	1,436,167	5,543,604.620	
	ARENA REIT STAPLED UNITS	111,252	360,456.480	
	BWP GROUP STAPLED UNITS TRUST (REIT)	168,521	662,287.530	
	GPT GROUP STAPLED UNITS	527,390	2,694,962.900	
	CHARTER HALL RETAIL UNITS	137,062	537,283.040	
	MIRVAC GROUP STAPLED UNITS	1,086,361	1,922,858.970	
	STOCKLAND STAPLED UNITS LTD	666,919	2,821,067.370	
	ABACUS GROUP UNIT	110,792	110,238.040	
	GOODMAN GROUP UNITS	562,966	17,744,688.320	

	VICINITY CENTRES (REIT)	1,076,418	2,777,158.440	
	CHARTER HALL GROUP STAPLED UNITS	130,224	2,961,293.760	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP STAPLED	110,026	453,307.120	
オーストラリア・ドル 小計			45,413,843.990 (5,144,480,247)	
カナダ・ドル	NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	9,400	77,268.000	
	PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	15,896	324,437.360	
	SLATE GROCERY REIT UNITS CLASS U	7,500	130,200.000	
	KILLAM APARTMENT REIT UNITS CLASS	16,421	311,013.740	
	MINTO APARTMENT REIT UNITS TRUST	4,700	81,686.000	
	VITAL INFRASTRUCTURE PROPERTY UNIT	33,739	183,202.770	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT STA	8,152	769,874.880	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVES	38,743	552,087.750	
	INTERRENT REAL ESTATE INVESTMENT T	18,865	242,415.250	
	FIRST CAPITAL REALTY REAL ESTATE I	28,654	671,363.220	
	CHOICE PROPERTIES REAL ESTATE INVE	44,233	723,651.880	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIA	4,400	75,240.000	
	CT REIT UNITS TRUST	14,800	269,656.000	
	SMARTCENTRES RL ESTATE INVESTMENT	19,512	589,457.520	
	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES REAL	20,789	743,830.420	
	HANDR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	35,703	394,518.150	
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	39,181	907,431.960	

	DREAM OFFICE REAL ESTATE UNITS TRU	1,650	29,683.500	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT T	6,545	429,482.900	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRU	14,891	258,656.670	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE INVT	24,124	241,481.240	
カナダ・ドル 小計			8,006,639.210 (918,281,451)	
シンガポール・ドル	CENTURION ACCOMMODATION REIT UNITS (REIT)	269,800	296,780.000	
	KEPPEL DC REIT	551,883	1,263,812.070	
	AIMS APAC REIT	175,800	281,280.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRU (REIT)	815,190	802,962.150	
	SASSEUR REIT UNITS TRUST (REIT)	147,100	97,821.500	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT U	685,840	394,358.000	
	EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TR (REIT)	36,500	0.000	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,154,077	2,919,814.810	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL T	1,592,622	3,726,735.480	
	SUNTEC REIT UNITS TRUST	610,300	884,935.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST UNITS	942,800	1,150,216.000	
	KEPPEL REIT UNITS	886,700	762,562.000	
	CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	748,856	670,226.120	
	ESR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST U	150,550	356,803.500	
	CDL HOSPITALITY REIT UNITS	205,000	157,850.000	
	FRASERS CENTREPOINT UNITS TRUST	386,901	878,265.270	
	STARHILL GLOBAL REIT UNITS TRUST	402,800	217,512.000	
	CAPITALAND CHINA TRUST	321,642	209,067.300	
	PARKWAY LIFE REIT TRUST	120,400	474,376.000	

	MAPLETREE INDUSTRIAL UNITS TRUST	589,369	1,155,163.240	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	625,184	793,983.680	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST STAPLED (REIT)	301,200	170,178.000	
	OUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST (REIT)	638,800	223,580.000	
シンガポール・ドル 小計			17,888,282.120 (2,236,393,030)	
ニュージーランド・ドル	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST UN (REIT)	154,474	296,590.080	
	GOODMAN NEW ZEALAND & GOODMAN PROP	279,999	571,197.960	
ニュージーランド・ドル 小計			867,788.040 (81,285,706)	
ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV (REIT)	10,958	307,371.900	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD (REIT)	7,715	185,545.750	
	STONEWEG EUROPE STAPLED TRUST	89,120	137,244.800	
	VASTNED BELGIUM NV (REIT)	1,869	56,350.350	
	ASCENCIO SA (REIT)	1,509	79,222.500	
	HAMBORNER REIT N AG	18,080	83,439.200	
	WERELDHAVE NV (REIT)	9,263	191,744.100	
	UNIBAIL RODAMCO WE STAPLED UNITS	30,036	3,024,625.200	
	NSI NV (REIT)	3,232	56,495.360	
	ICADE REIT SA (REIT)	7,704	164,403.360	
	CARMILA SA (REIT)	15,634	267,028.720	
	ALTAREA (REIT)	1,608	155,815.200	
	GECINA SA (REIT)	12,871	947,305.600	
	KLEPIERRE REIT SA (REIT)	54,445	1,987,242.500	
	COVIVIO SA (REIT)	13,482	742,184.100	
	MERCIALYS REIT SA (REIT)	23,142	276,315.480	
	AEDIFICA NV (REIT)	20,574	1,456,639.200	
	COFINIMMO REIT SA (REIT)	1,878	156,061.800	
	RETAIL ESTATES NV (REIT)	3,185	225,498.000	

	WAREHOUSES DE PAUW NV (REIT)	46,947	1,040,345.520	
	CARE PROPERTY INV NV (REIT)	10,420	128,999.600	
	XIOR STUDENT HOUSING NV (REIT)	9,553	254,587.450	
	MONTEA NV (REIT)	5,249	351,683.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE S	13,168	58,070.880	
	COLONIAL SFL SOCIMI SA (REIT)	83,502	476,796.420	
	MERLIN PROPERTIES REIT SA (REIT)	106,976	1,630,314.240	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES PLC (REIT)	129,269	143,230.050	
ユーロ 小計			14,584,560.280 (2,710,102,992)	
韓国・ウォン	SK REITS LTD (REIT)	51,808	280,281,280.000	
	HANWHA REIT LTD (REIT)	34,613	155,758,500.000	
	SHINHAN ALPHA REIT LTD (REIT)	28,968	159,613,680.000	
	LOTTE REIT LTD (REIT)	40,338	152,477,640.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT LTD (REIT)	18,593	65,168,465.000	
	JR GLOBAL (REIT)	45,328	53,577,696.000	
	KLI REIT LTD (REIT)	16,079	65,923,900.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT LTD (REIT)	50,814	184,708,890.000	
韓国・ウォン 小計			1,117,510,051.000 (118,661,687)	
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	698,000	481,620.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TR	206,000	463,500.000	
	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRU	412,000	1,952,880.000	
	PROSPERITY REAL ESTATE INVESTMENT	348,000	494,160.000	
	LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	715,574	26,261,565.800	

		CHAMPION REAL ESTATE INVESTMENT TR	507,000	1,145,820.000	
	香港・ドル 小計			30,799,545.800 (629,542,716)	
投資証券 合計				72,325,414,906 [72,325,414,906]	
合計				74,185,798,126 [74,185,798,126]	

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 134銘柄	3.1%	96.9%	80.0%
イギリス・ポンド	投資証券 27銘柄	-%	100%	3.9%
イスラエル・シュケル	投資証券 3銘柄	-%	100%	0.2%
オーストラリア・ドル	投資証券 28銘柄	-%	100%	6.9%
カナダ・ドル	投資証券 21銘柄	-%	100%	1.2%
シンガポール・ドル	投資証券 23銘柄	-%	100%	3.0%
ニュージーランド・ドル	投資証券 2銘柄	-%	100%	0.1%
ユーロ	投資証券 27銘柄	-%	100%	3.7%
韓国・ウォン	投資証券 8銘柄	-%	100%	0.2%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	-%	100%	0.8%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

２【ファンドの現況】

ダイワファンドラップ　ＴＯＰＩＸインデックス

【純資産額計算書】

2026年5月29日

Ⅰ	資産総額	73,864,049,055円
Ⅱ	負債総額	129,640,061円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	73,734,408,994円
Ⅳ	発行済数量	20,585,760,867口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.5818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

2026年5月29日

Ⅰ	資産総額	729,449,851,219円
Ⅱ	負債総額	17,772,734,932円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	711,677,116,287円
Ⅳ	発行済数量	236,061,248,438口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.0148円

ダイワファンドラップ　日経２２５インデックス

純資産額計算書

2026年5月29日

Ⅰ	資産総額	42,211,476,797円
Ⅱ	負債総額	71,261,720円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	42,140,215,077円
Ⅳ	発行済数量	9,091,798,910口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.6350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

2026年5月29日

Ⅰ	資産総額	654,200,892,754円

Ⅱ	負債総額	2,603,196,511円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	651,597,696,243円
Ⅳ	発行済数量	68,806,175,797口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	9.4700円

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

2026年5月29日

Ⅰ	資産総額	135,374,598,687円
Ⅱ	負債総額	432,825,159円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	134,941,773,528円
Ⅳ	発行済数量	52,323,000,625口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.5790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

2026年5月29日

Ⅰ	資産総額	205,607,117,880円
Ⅱ	負債総額	2,789,400,759円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	202,817,717,121円
Ⅳ	発行済数量	49,695,505,456口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.0812円

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）

純資産額計算書

2026年5月29日

Ⅰ	資産総額	91,705,176,163円
Ⅱ	負債総額	233,852,902円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	91,471,323,261円
Ⅳ	発行済数量	17,613,173,559口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	5.1933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

2026年5月29日

Ⅰ	資産総額	1,060,284,051,349円
Ⅱ	負債総額	103,983,543円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,060,180,067,806円
Ⅳ	発行済数量	110,677,736,150口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	9.5790円

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

純資産額計算書

2026年5月29日

Ⅰ	資産総額	10,525,138,038円
Ⅱ	負債総額	33,019,382円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	10,492,118,656円
Ⅳ	発行済数量	2,203,509,052口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.7616円

(参考) 外国株式インデックスマザーファンド

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

(参考) ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2026年5月29日

Ⅰ	資産総額	78,273,131,228円
Ⅱ	負債総額	382,735,403円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	77,890,395,825円
Ⅳ	発行済数量	18,519,452,982口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.2059円

ダイワファンドラップ 日本債券インデックス

純資産額計算書

2026年5月29日

Ⅰ	資産総額	53,749,299,732円

Ⅱ	負債総額	105,750,695円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	53,643,549,037円
Ⅳ	発行済数量	64,288,223,796口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8344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

2026年5月29日

Ⅰ	資産総額	184,201,988,359円
Ⅱ	負債総額	130,175,275円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	184,071,813,084円
Ⅳ	発行済数量	153,666,827,351口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1979円

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

2026年5月29日

Ⅰ	資産総額	113,724,080,946円
Ⅱ	負債総額	315,177,467円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	113,408,903,479円
Ⅳ	発行済数量	142,081,625,058口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.7982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

2026年5月29日

Ⅰ	資産総額	172,705,011,774円
Ⅱ	負債総額	15,444,214,980円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	157,260,796,794円
Ⅳ	発行済数量	189,371,545,276口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8304円

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）

純資産額計算書

2026年5月29日

Ⅰ	資産総額	45,136,230,538円
Ⅱ	負債総額	110,854,809円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	45,025,375,729円
Ⅳ	発行済数量	28,327,743,419口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5894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

2026年5月29日

Ⅰ	資産総額	432,095,306,247円
Ⅱ	負債総額	8,330,426,477円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	423,764,879,770円
Ⅳ	発行済数量	101,634,519,649口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.1695円

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

純資産額計算書

2026年5月29日

Ⅰ	資産総額	5,933,783,251円
Ⅱ	負債総額	22,097,967円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	5,911,685,284円
Ⅳ	発行済数量	3,589,997,790口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6467円

(参考) 外国債券インデックスマザーファンド

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

(参考) ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

純資産額計算書

2026年5月29日

Ⅰ	資産総額	78,614,014,673円
Ⅱ	負債総額	58,959,889円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	78,555,054,784円
Ⅳ	発行済数量	33,765,080,683口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.3265円

ダイワファンドラップ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス

純資産額計算書

2026年5月29日

Ⅰ	資産総額	25,218,314,981円
Ⅱ	負債総額	56,876,874円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	25,161,438,107円
Ⅳ	発行済数量	17,417,862,864口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4446円

(参考) ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

純資産額計算書

2026年5月29日

Ⅰ	資産総額	224,598,911,225円
Ⅱ	負債総額	1,015,735,920円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	223,583,175,305円
Ⅳ	発行済数量	61,177,262,685口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.6547円

ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

2026年5月29日

Ⅰ	資産総額	26,916,749,289円
Ⅱ	負債総額	87,016,168円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	26,829,733,121円
Ⅳ	発行済数量	23,686,998,925口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1327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

2026年5月29日

Ⅰ	資産総額	33,447,501,994円
Ⅱ	負債総額	486,586,642円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	32,960,915,352円
Ⅳ	発行済数量	34,152,462,203口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9651円

ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）

純資産額計算書

2026年5月29日

Ⅰ	資産総額	19,309,137,045円
Ⅱ	負債総額	46,797,675円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	19,262,339,370円
Ⅳ	発行済数量	8,235,244,020口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.3390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

2026年5月29日

Ⅰ	資産総額	75,423,315,521円
Ⅱ	負債総額	1,645,229,073円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	73,778,086,448円
Ⅳ	発行済数量	15,035,700,770口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.9069円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

2026年5月末日現在

資本金の額　　414億2,454万1,896円

発行可能株式総数　799万9,980株

発行済株式総数　　326万657株

過去5年間における資本金の額の増減：2024年10月1日262億5,026万9,396円増加しました。

ｂ．委託会社の機構

①　会社の意思決定機構

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

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

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

②　投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ．商品会議

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

2026年5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	72	407,103
追加型株式投資信託	765	43,910,205
株式投資信託　　合計	837	44,317,308
単位型公社債投資信託	67	129,810
追加型公社債投資信託	14	1,496,660
公社債投資信託　合計	81	1,626,470
総合計	918	45,943,778

３【委託会社等の経理状況】

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

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、当事業年度(2025年４月１日から2026年３月31日まで)の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

３．財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

		前事業年度 (2025年３月31日)		当事業年度 (2026年３月31日)
資産の部				
流動資産				
現金・預金		13,153		7,798
有価証券		1,194		652
前払費用		513		717
未収委託者報酬		19,097		23,971
未収収益		110		230
関係会社短期貸付金		70,000		52,400
金銭の信託		-		18,993
その他		94		404
流動資産計		104,164		105,168
固定資産				
有形固定資産	※１	61	※１	55
建物		0		0
器具備品		59		52
建設仮勘定		0		2
無形固定資産		1,160		1,262
ソフトウェア		1,062		1,167
ソフトウェア仮勘定		97		94
その他		0		1
投資その他の資産		14,856		21,090
投資有価証券		9,348		13,401
関係会社株式		3,414		5,586
出資金		34		34
長期差入保証金		1,049		1,050
繰延税金資産		995		1,007

その他	13	9
固定資産計	16,077	22,408
資産合計	120,241	127,577

(単位:百万円)

	前事業年度 (2025年３月31日)	当事業年度 (2026年３月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	134	148
未払金	6,757	8,109
未払収益分配金	62	80
未払償還金	12	12
未払手数料	6,660	7,935
その他未払金	22	79
未払費用	5,997	7,290
未払法人税等	4,121	4,925
未払消費税等	763	1,437
賞与引当金	1,456	1,738
その他	0	1
流動負債計	19,233	23,651
固定負債		
退職給付引当金	2,300	2,323
役員退職慰労引当金	58	25
固定負債計	2,358	2,348
負債合計	21,592	25,999
純資産の部		
株主資本		
資本金	41,424	41,424
資本剰余金		
資本準備金	37,745	37,745
資本剰余金合計	37,745	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	17,743	20,341
利益剰余金合計	18,117	20,715
株主資本合計	97,287	99,886

評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,361	1,691
評価・換算差額等合計	1,361	1,691
純資産合計	98,649	101,577
負債・純資産合計	120,241	127,577

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自　2024年４月１日 至　2025年３月31日)	当事業年度 (自　2025年４月１日 至　2026年３月31日)
営業収益		
委託者報酬	91,634	104,615
その他営業収益	1,233	3,205
営業収益計	92,868	107,820
営業費用		
支払手数料	37,180	41,200
広告宣伝費	1,124	1,129
調査費	13,135	15,770
調査費	1,954	2,312
委託調査費	11,180	13,457
委託計算費	1,957	2,120
営業雑経費	3,114	4,313
通信費	167	165
印刷費	483	472
協会費	57	61
諸会費	18	20
その他営業雑経費	2,388	3,593
営業費用計	56,512	64,534
一般管理費		
給料	7,599	8,495
役員報酬	453	422
給料・手当	5,116	5,773
賞与	572	561
賞与引当金繰入額	1,456	1,738
福利厚生費	1,070	1,132
交際費	108	116
旅費交通費	247	284
租税公課	1,004	1,061
不動産賃借料	1,298	1,318
退職給付費用	349	393

役員退職慰労引当金繰入額	6	7
固定資産減価償却費	444	452
諸経費	2,164	2,777
一般管理費計	14,293	16,042
営業利益	22,061	27,243

(単位:百万円)

		前事業年度 (自　2024年４月１日 至　2025年３月31日)	当事業年度 (自　2025年４月１日 至　2026年３月31日)
営業外収益			
投資有価証券売却益		387	383
有価証券償還益		183	294
受取利息		95	247
受取配当金		959	23
雑収入		76	157
営業外収益計		1,703	1,106
営業外費用			
金銭の信託運用損		-	1,006
投資有価証券売却損		176	80
有価証券償還損		4	59
その他		54	24
営業外費用計		235	1,171
経常利益		23,528	27,179
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	-
投資有価証券評価損		-	3
特別損失計		101	3
税引前当期純利益		23,918	27,175
法人税、住民税及び事業税		7,763	8,215
法人税等調整額		△ 397	△ 188
法人税等合計		7,366	8,026
当期純利益		16,552	19,149

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自　2024年４月１日 至　2025年３月31日)

（単位：百万円）

	株主資本					
	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	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

当事業年度(自　2025年４月１日 至　2026年３月31日)

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	41,424	37,745	374	17,743	18,117	97,287
当期変動額						
新株の発行	-	-	-	-	-	-
剰余金の配当	-	-	-	△ 16,551	△ 16,551	△ 16,551
当期純利益	-	-	-	19,149	19,149	19,149
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	2,598	2,598	2,598
当期末残高	41,424	37,745	374	20,341	20,715	99,886

	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
当期変動額			
新株の発行	-	-	-
剰余金の配当	-	-	△ 16,551
当期純利益	-	-	19,149
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	329	329	329
当期変動額合計	329	329	2,927
当期末残高	1,691	1,691	101,577

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．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。

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。

(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」に含めていた「雑収入」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するため、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76百万円は、「雑収入」76百万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 (2025年３月31日)	当事業年度 (2026年３月31日)
建物	40百万円	41百万円
器具備品	269百万円	281百万円

２　保証債務

前事業年度(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。

当事業年度(2026年３月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務2,598百万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　2024年４月１日 至　2025年３月31日)	当事業年度 (自　2025年４月１日 至　2026年３月31日)
投資有価証券売却益		
非上場株式	380百万円	－百万円

※２　固定資産売却益の項目

	前事業年度 (自　2024年４月１日 至　2025年３月31日)	当事業年度 (自　2025年４月１日 至　2026年３月31日)
固定資産売却益		
美術品	83百万円	－百万円
ゴ　ル　フ　会　員　権	26百万円	－百万円

※３　固定資産売却損の項目

	前事業年度 (自　2024年４月１日 至　2025年３月31日)	当事業年度 (自　2025年４月１日 至　2026年３月31日)
固定資産売却損		
美術品	85百万円	－百万円
ゴルフ会員権	15百万円	－百万円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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
③１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

当事業年度(自　2025年４月１日　至　2026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	3,260	－	－	3,260
合　　計	3,260	－	－	3,260

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
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

（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

2026年６月17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　19,146百万円
② 配当の原資　利益剰余金
③１株当たり配当額　5,872円
④ 基準日　2026年３月31日
⑤ 効力発生日　2026年６月18日

(リース取引関係)

前事業年度 (自　2024年４月１日 至　2025年３月31日)	当事業年度 (自　2025年４月１日 至　2026年３月31日)
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料 １年内　1,037百万円 １年超　7,521百万円 合計　8,559百万円	オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料 １年内　1,040百万円 １年超　6,511百万円 合計　7,552百万円

(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。金銭の信託を通じて保有している証券投資信託につきましては、事業推進目的で保有しており、価格変動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関係する業務を委託したことにより発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

（３）金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

（ⅰ）為替変動リスクの管理

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

（ⅱ）価格変動リスクの管理

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

②信用リスクの管理

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

２．金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

前事業年度(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
金銭の信託	－	－	－	－
資産合計	2,230	7,968	－	10,199

当事業年度(2026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	4,710	9,001	－	13,711
金銭の信託	－	18,993	－	18,993
資産合計	4,710	27,995	－	32,705

(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。

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	342	342
子会社株式	1,386	3,558
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(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。

当事業年度(2026年３月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額　3,558百万円)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(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。

当事業年度(2026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	133	55	78
(２)その他	7,886	4,756	3,130
小計	8,020	4,811	3,208
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	5,691	6,430	△739
小計	5,691	6,430	△739
合計	13,711	11,242	2,469

(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　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

当事業年度(自　2025年４月１日　至　2026年３月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(１)株式	-	-	-
(２)その他 証券投資信託	2,479	383	80
合計	2,479	383	80

４．減損処理を行った有価証券

当事業年度において、証券投資信託について3百万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　2024年４月１日 至　2025年３月31日)	当事業年度 (自　2025年４月１日 至　2026年３月31日)
退職給付債務の期首残高	2,227百万円	2,300百万円
勤務費用	149	172
退職給付の支払額	△ 166	△ 246
その他	89	97
退職給付債務の期末残高	2,300	2,323

(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　2024年４月１日 至　2025年３月31日)	当事業年度 (自　2025年４月１日 至　2026年３月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,300百万円	2,323百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,300	2,323
退職給付引当金	2,300	2,323

貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,300	2,323

(３)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自　2024年４月１日 至　2025年３月31日)	当事業年度 (自　2025年４月１日 至　2026年３月31日)
勤務費用	149百万円	172百万円
その他	8	10
確定給付制度に係る退職給付費用	158	182

(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191百万円、当事業年度211百万円であります。

(税効果会計関係)

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

	前事業年度 (2025年３月31日)	当事業年度 (2026年３月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	724	732
賞与引当金	340	434
未払事業税	260	323
株式報酬費用	150	136
関係会社株式評価損	87	87
投資有価証券評価損	171	31
出資金評価損	14	14
その他	157	395
繰延税金資産小計	1,907	2,155
評価性引当額	△ 277	△ 136
繰延税金資産合計	1,629	2,018
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	△ 633	△ 1,011
繰延税金負債合計	△ 633	△ 1,011
繰延税金資産の純額	995	1,007

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(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。

当事業年度(2026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27百万円増加、法人税等調整額が27百万円減少しております。

（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

大和かんぽ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
アドバイザリー費用等 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104,615百万円、その他3,205百万円であります。

（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５．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　2024年４月１日　至　2025年３月31日)
該当事項はありません。

当事業年度(自　2025年４月１日　至　2026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　2024年４月１日　至　2025年３月31日)

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関係内容		取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 80.0	あり	経営管理	資金の貸付 貸付の回収 利息の受取 (注１)	63,600 17,000 89	関係会社短期貸付金 － －	70,000 － －
その他の関係会社	㈱かんぽ生命保険	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。

当事業年度(自　2025年４月１日　至　2026年３月31日)

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関係内容		取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 80.0	あり	経営管理	資金の貸付 貸付の回収 利息の受取 (注１)	20,800 38,400 236	関係会社短期貸付金 － －	52,400 － －
その他の関係会社	㈱かんぽ生命保険	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)	1,492	－	－

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　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。

当事業年度(自　2025年４月１日　至　2026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)	2,598	―	―

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　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㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	―	なし	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料(注２) 不動産の賃借料(注３)	15,779 1,038	未払手数料 長期差入保証金	3,657 1,037
同一の親会社をもつ会社	㈱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。

当事業年度(自　2025年４月１日　至　2026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㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	－	なし	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料(注２) 不動産の賃借料(注３)	16,682 1,045	未払手数料 長期差入保証金	4,134 1,037
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研	東京都江東区	3,898	情報サービス業	－	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)	912	未払費用	82

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　2024年４月１日 至　2025年３月31日)	当事業年度 (自　2025年４月１日 至　2026年３月31日)
１株当たり純資産額　30,254.44円	１株当たり純資産額　31,152.40円
１株当たり当期純利益　5,642.31円	１株当たり当期純利益　5,872.86円

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

(注２）１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自　2024年４月１日 至　2025年３月31日)	当事業年度 (自　2025年４月１日 至　2026年３月31日)
当期純利益(百万円)	16,552	19,149
普通株式の期中平均株式数(株)	2,933,697	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充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

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

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

３【資本関係】

該当事項はありません。

第３【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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

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

・委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

・詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

①委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等

②請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨

・使用開始日を記載することがあります。

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

①届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

②届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日

・次の事項を記載することがあります。

①投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨

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

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

・委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。

・ファンドの形態等を記載することがあります。

・図案を採用することがあります。

・ファンドの管理番号等を記載することがあります。

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

・UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

2026年５月25日

大和アセットマネジメント株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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2026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（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、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

2026年8月7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	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、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）の2025年6月17日から2026年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）の2026年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

か検討すること、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

2026年8月7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	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、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2025年6月17日から2026年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2026年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

か検討すること、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

2026年8月7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	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、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の2025年6月17日から2026年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の2026年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

か検討すること、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

2026年8月7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	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、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）の2025年6月17日から2026年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）の2026年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

か検討すること、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

2026年8月7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	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、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2025年6月17日から2026年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2026年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

か検討すること、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

2026年8月7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	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、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）の2025年6月17日から2026年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）の2026年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

か検討すること、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

2026年8月7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	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、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）の2025年6月17日から2026年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）の2026年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

か検討すること、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

2026年8月7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	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、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）の2025年6月17日から2026年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）の2026年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

か検討すること、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

2026年8月7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	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、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ Ｊ－ＲＥＩＴインデックスの2025年6月17日から2026年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ Ｊ－ＲＥＩＴインデックスの2026年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

か検討すること、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

2026年8月7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	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、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックスの2025年6月17日から2026年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

　当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックスの2026年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

か検討すること、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

2026年8月7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	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、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 日経２２５インデックスの2025年6月17日から2026年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 日経２２５インデックスの2026年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

か検討すること、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

2026年8月7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	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、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 日本債券インデックスの2025年6月17日から2026年6月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワファンドラップ 日本債券インデックスの2026年6月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

か検討すること、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。