

【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】	2021年8月24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 松下 浩一
【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】	西脇 保宏 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オンライン 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） ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） ダイワ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） ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス（為替ヘッジあり） ダイワ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） ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス 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 ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス
【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90兆円を上限とします。
【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オンライン TOPIXインデックス

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)

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)

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

ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

ダイワ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)

ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス

ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

ダイワ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)

(注1) 上記の総称を「ダイワファンドラップオンライン 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るものとします。

(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オンライン TOPIX : FWO TOPIXインデックス
インデックス

ダイワファンドラップオンライン 外国株式イ : FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)
ンデックス(為替ヘッジあり)

ダイワファンドラップオンライン 外国株式イ : FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジな
ンデックス エマージングプラス(為替ヘッジ し)
なし)

ダイワファンドラップオンライン 日本債券イ : FWO 日本債券インデックス
ンデックス

ダイワファンドラップオンライン 外国債券イ : FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)
ンデックス(為替ヘッジあり)

ダイワファンドラップオンライン 外国債券イ : FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジな
ンデックス エマージングプラス(為替ヘッジ し)
なし)

ダイワファンドラップオンライン J-REI : FWO J-REITインデックス
Tインデックス

ダイワファンドラップオンライン 外国REI : FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあ
Tインデックス(為替ヘッジあり) り)

ダイワファンドラップオンライン 外国REI : FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジな
Tインデックス(為替ヘッジなし) 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90兆円を上限とします。

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

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、販売会社にお問い合わせ下さい。

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】

2021年8月25日から2022年2月21日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 【申込取扱場所】

下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

<FWO TOPIXインデックス>

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FWO 外国株式インデックス EM+ (為替ヘッジなし)>

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

< FWO 日本債券インデックス >

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

< FWO 外国債券インデックス EM+ (為替ヘッジなし) >

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FWO J - R E I T インデックス>

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

<FWO 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)>

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

<FW0 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

(注1) 商品分類の定義

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

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

(注2) 属性区分の定義

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

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

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

< 信託金の限度額 >

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

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

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

< ファンドの特色 >

1 「ダイワファンドラップオンライン 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オンライン 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オンライン 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いません。

- 各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行いません。

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	FWO TOPIXインデックス	東証株価指数 (TOPIX)	トピックス・インデックス・ マザーファンド
海外の 株式	FWO 外国株式インデックス (為替ヘッジあり)	MSCIコクサイ指数 (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
	FWO 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 (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	FWO 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	FWO 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
	FWO 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・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算)	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	FWO 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	FWO 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) (円ベース) ^(注)	ダイワ・グローバルREITインデックス・ マザーファンド
	FWO 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 (FWO 外国株式インデックスEM+ (為替ヘッジなし)、FWO 外国債券インデックスEM+ (為替ヘッジなし) および FWO 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。

(注) 当ファンドは、特定の指数 (S&P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)) の動きに連動する投資成果をあげることをめざして運用を
行なうマザーファンドに投資するとともに、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。

●各ファンドの運用方針

FWO TOPIXインデックス

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

◆東京証券取引所第一部上場株式（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の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行いません。

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

◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル^(注1)を用います。
TOPIXへの連動性を随時チェックし、必要があればリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行いません。

FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）に連動する投資成果をあげることがをめざして運用を行いません。

◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル^(注1)を用います。
MSCIコクサイ指数（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いません。なお、保有外貨建資産については、MSCIコクサイ指数（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いません。

※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。

※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。

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

FWO 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（円ベース）	80%
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	FTSE RAFI エマージング インデックス（円換算）	20%

- ◆ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドにおいて、株式およびETF（上場投資信託証券）の組入比率の合計は、通常の状態では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。

FWO 日本債券インデックス

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

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

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

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

FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

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

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

※為替ヘッジを行なう際、日本円の金利が組入資産の通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因によっては、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。

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

FWO J-REITインデックス

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

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

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

FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）

海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。

◆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。

◆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。

◆為替ヘッジは一定間隔で行なうため、保有実質外貨建資産とヘッジ金額が一致するとは限りません。

※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。

※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。

FWO 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が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1.および2.の運用が行なわれないことがあります。

●特定の指数について

◆東証株価指数（TOPIX）

東証株価指数（TOPIX）は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての銘柄の時価総額を指数化し、株価の変動をとらえようとするもので、1968年1月4日（基準時）の時価総額を100として、1969年7月1日から株式会社東京証券取引所が算出・公表しています。

◆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 RAFI エマージング インデックスとは、FTSE社（FTSE International Limited）の流動性基準、時価総額基準、浮動株調整をクリア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、リサーチ・アフィリエイツ社（Research Affiliates LLC）独自のインデックス構成手法により、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における債券市場のパフォーマンス・インデックスです。日本で発行されている確定利付公募債券で、残存額が50億円以上、残存期間が1年以上である国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債の時価総額加重方式による累積投資収益率指数です。

◆FTSE世界国債インデックス

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

◆JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス

－エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円換算）

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11月30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11月30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、分配を行わないことがあります。

主な投資制限

●FWO TOPIX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。

●FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

●FWO 外国株式インデックス EM+（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。

●FWO 日本債券インデックス

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

●FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）

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

●FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）

- ①マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- ②株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使等により取得したものに限り、株式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。

●FWO 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。

●FWO 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がめざして運用を行いません。ただし、主として次の理由から、基準価額の動きが指数と完全に一致するものではありません。

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

FWO TOPIXインデックス FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

- ・指数の構成銘柄のすべてを指数の算出方法どおりに組入れ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

*「FWO TOPIXインデックス」を除きます。

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

- ・指数の構成銘柄のすべてを指数の算出方法どおりに組入れるわけではないこと
- ・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

*「FWO 日本債券インデックス」を除きます。

FWO J-REITインデックス

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

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

FWO 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ートの価格の不一致
- ・指数の算出に使用するリーートの価格と基準価額の算出に使用するリーートの価格の不一致
- ・指数の算出に使用する為替レートと基準価額の算出に使用する為替レートの不一致
- ・不動産投信指数先物と指数の動きの不一致（先物を利用した場合）
- ・指数の構成銘柄の入替えおよび指数の算出方法の変更による影響
- ・ベンチマークに指数先物取引が存在しないこと
- ・追加設定および組入銘柄の配当金や権利処理によって信託財産に現金が発生すること

●各マザーファンドが連動対象とする指数の著作権等について

- TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利、ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有します。
- 株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの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。
- 株東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果ならびに特定日のTOPIX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。
- 株東京証券取引所は、TOPIX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、株東京証券取引所は、TOPIX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。
- 「FWO TOPIXインデックス」は、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- 株東京証券取引所は、「FWO TOPIXインデックス」の購入者または公衆に対し、「FWO TOPIXインデックス」の説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
- 株東京証券取引所は、当社または「FWO TOPIXインデックス」の購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- 以上の項目に限らず、株東京証券取引所は「FWO TOPIXインデックス」の発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

MSCIコクサイ指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

FWO 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「RAJ」）（以下、総称して「ライセンス各社」）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、ライセンス各社はいずれも、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。いずれのライセンス各社も、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 Online Global Equity Index EM plus are not in any way sponsored, endorsed, sold or promoted by FTSE International Limited ("FTSE"), by the London Stock Exchange Group companies ("LSEG"), or by Research Affiliates LLC ("RA") (collectively the "Licensor Parties"), and none of the Licensor Parties make any warranty or representation whatsoever, expressly or impliedly, either as to the results to be obtained from the use of the FTSE RAFI[®] Emerging Index (the "Index") and/or the figure at which the said Index stands at any particular time on any particular day or otherwise. The Index is compiled and calculated by FTSE in conjunction with RA. None of the Licensor Parties shall be liable (whether in negligence or otherwise) to any person for any error in the Index and none of the Licensor Parties shall be under any obligation to advise any person of any error therein. FTSE[®] is a trade mark of LSEG. The trade names Fundamental Index[®] and RAFI[®] are registered trademarks of Research Affiliates, LLC.

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

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

- 東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の高標は、(株)東京証券取引所の知的財産であり、東証REIT指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数の高標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有します。
- (株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証REIT指数の高標の変更もしくは使用の停止を行なうことができます。
- (株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の高標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証REIT指数の指数値について、何ら保証、言及をすることはできません。
- (株)東京証券取引所は、東証REIT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、(株)東京証券取引所は、東証REIT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。
- 「FWO J-REITインデックス」は、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- (株)東京証券取引所は、「FWO J-REITインデックス」の購入者または公衆に対し、「FWO J-REITインデックス」の説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
- (株)東京証券取引所は、当社または「FWO J-REITインデックス」の購入者のニーズを、東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- 以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は「FWO J-REITインデックス」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）（円ベース）（以下「当インデックス」といいます。）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJ」）の商品であり、これを利用する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。Standard & Poor's[®]およびS&P[®]はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。「FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり/為替ヘッジなし）」は、SPDJ、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、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、当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

(2) 【ファンドの沿革】

2017年1月11日

信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

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

委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2 ）の委託者であり、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成</p> <p style="text-align: right;">など</p>
運用指図	2	損益 信託金（ 3 ）
受託会社	<p>三井住友信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行</p>	<p>信託契約（ 2 ）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算</p> <p style="text-align: right;">など</p>
		損益 投資
投資対象		<p>ファミリーファンド方式で運用を行ないます。</p> <p><FWO T O P I X インデックス> 東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。） など</p> <p><FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）> 外国の株式（ D R（預託証券）を含みます。） など</p> <p><FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）> 外国の株式（ D R（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 D R（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 E T F（上場投資信託証券）など</p> <p><FWO 日本債券インデックス> わが国の公社債 など</p> <p><FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）> 外国の公社債 など</p> <p><FWO 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</p> <p><FWO J - R E I T 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</p> <p><FWO 外国 R E I T 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</p>

（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(2021年5月末日現在) >

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

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

・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

主要投資対象

ファンド名	主要投資対象
FWO 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
FWO 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
FWO 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
FWO 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

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

以下、各ファンドにおいて(「FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)」および「FWO 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。

投資態度

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

<FWO 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(円ヘッジ・ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
- ロ.マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ハ.マザーファンドにお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。

<FWO 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%

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%

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。

< FWO 日本債券インデックス >

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

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

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

< FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり) >

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

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

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

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

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

< FWO 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%

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%

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。

<FWO J-REITインデックス>

- イ．主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券に投資し、投資成果を東証REIT指数（配当込み、以下同じ。）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
- ロ．マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。
- ハ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

<投資先ファンドについて>

投資先ファンドの選定の方針は次のとおりです。

投資先ファンド	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（「ダイワ」-REITマザーファンド）を通じて実質的に投資します。）
選定の方針	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指数の構成銘柄であること。

くわしくは前掲「1 ファンドの性格（1）ファンドの目的及び基本的性格<ファンドの特色>」および後掲「<参考>マザーファンド（ダイワ）-REITマザーファンドの概要」をご参照下さい。

<FWO 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に投資し、海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。
- ロ．マザーファンドの運用にあたっては、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。
- ハ．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。
- 保有実質外貨建資産とは、当ファンドが保有する外貨建資産およびマザーファンドが保有する外貨建資産のうち当ファンドに属するとみなした外貨建資産をいいます。
- 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。

<FWO 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、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

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

(2)【投資対象】

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 日本債券インデックス>

<FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形

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

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、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。

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 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

<FWO 日本債券インデックス>

<FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 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

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 日本債券インデックス>

<FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10. コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

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

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

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

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

14. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

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

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

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

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

<FWO J - R E I T インデックス>

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

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

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

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

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

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

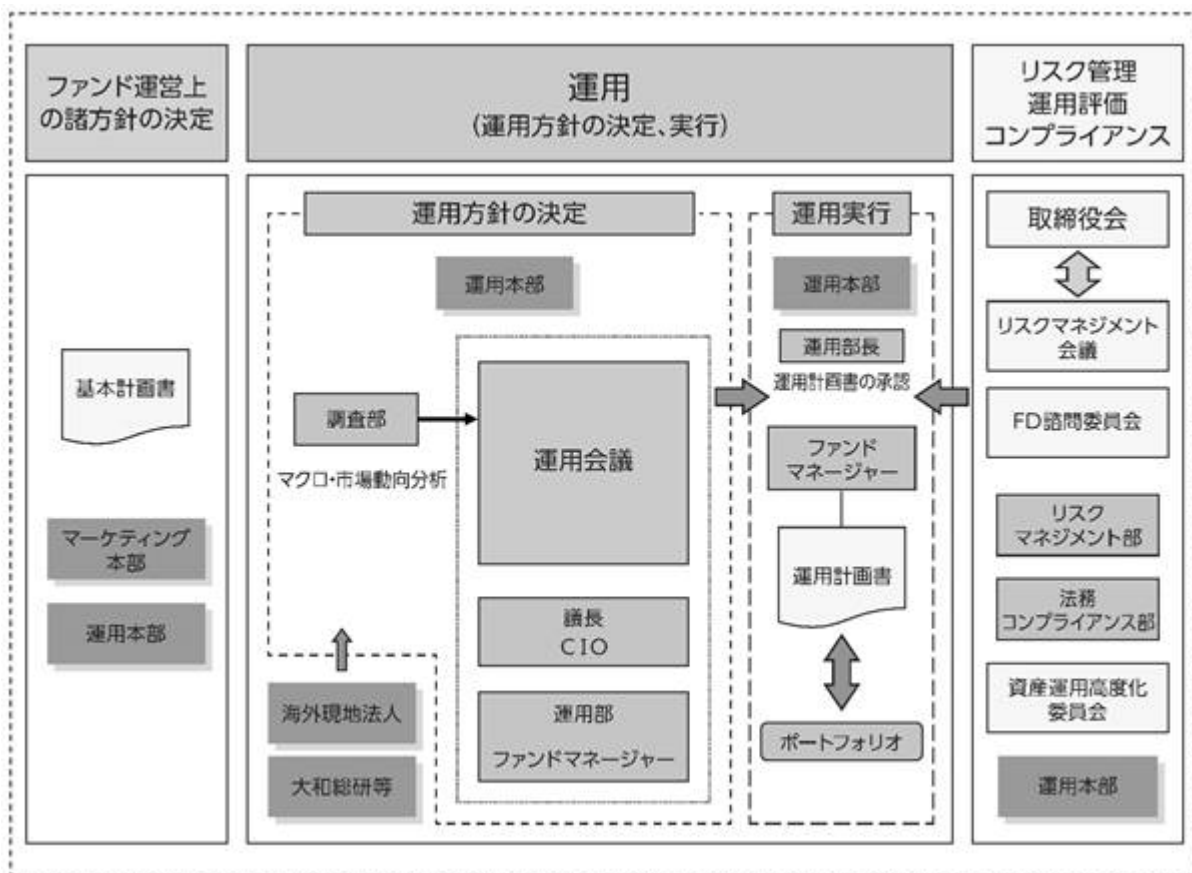
指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、＜ファンドの特色＞をご参照下さい。

(3) 【運用体制】

＜各ファンド共通＞

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．基本的な運用方針の決定

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

ハ．運用計画書の作成・承認

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

職務権限

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

イ．CIO (Chief Investment Officer) (3名)

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

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

ロ．Deputy-CIO (0~5名程度)

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー (0~5名程度)

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

ニ．運用部長 (各運用部に1名)

ファンドマネージャーが策定する運用計画を決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

リスクマネジメント会議、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会

次のとおり各会議体等において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体等の事務局となる部署の人員は40~50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．FD諮問委員会

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

ハ．資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は2021年5月31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>

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

原則として、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、分配を行わないことがあります。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

マザーファンドの受益証券（信託約款）

<各ファンド共通>

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

株式（信託約款）

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 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。

<FWO 日本債券インデックス>

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せん。）の行使等により取得したものに限りません。

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。

<FWO 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せん。）の行使等により取得したものに限りません。

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。

<FWO 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せん。）の行使等により取得したものに限りません。

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。

<FWO J-REITインデックス>

株式への直接投資は、行ないません。

新株引受権証券等(信託約款)

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 日本債券インデックス>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 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)

投資信託証券(信託約款)

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 日本債券インデックス>

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 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。

<FWO 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。

投資する株式等の範囲(信託約款)

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 日本債券インデックス>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 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、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、

<FWO 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、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、

<FWO J-REITインデックス>

(規定なし)

同一銘柄の新株引受権証券等(信託約款)

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 日本債券インデックス>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 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）

信用取引（信託約款）

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 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てします。

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

<上記以外の各ファンド>

（規定なし）

先物取引等（信託約款）

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 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。

<FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

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

<FWO J-REITインデックス>

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

スワップ取引(信託約款)

<FWO TOPIXインデックス>

<FWO 日本債券インデックス>

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

- < FWO J-REITインデックス >
- (規定なし)

金利先渡取引(信託約款)

- < FWO TOPIXインデックス >
- < FWO 日本債券インデックス >

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

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

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

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

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

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

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

<上記以外の各ファンド>

(規定なし)

金利先渡取引および為替先渡取引(信託約款)

<FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

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

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

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

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

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

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

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

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

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

<上記以外の各ファンド>

（規定なし）

直物為替先渡取引（信託約款）

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

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

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

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

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

<上記以外の各ファンド>

（規定なし）

デリバティブ取引等（信託約款）

<各ファンド共通>

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

有価証券の貸付け（信託約款）

- <FWO TOPIXインデックス>
- <FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>
- <FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>
- <FWO 日本債券インデックス>
- <FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>
- <FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>
- <FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>
- <FWO 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るときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

- <FWO J-REITインデックス>
- （規定なし）

外貨建資産（信託約款）

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

- <FWO 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。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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

<上記以外の各ファンド>

（規定なし）

外国為替予約取引（信託約款）

<FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）>

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

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

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

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

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

<上記以外の各ファンド>

（規定なし）

信用リスク集中回避（信託約款）

<各ファンド共通>

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

資金の借入れ（信託約款）

<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	東京証券取引所第一部上場株式（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、東証株価指数との連動性を維持するよう構築します。 ハ．株式の組入比率は、高位を保ちます。

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

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

主な投資制限	<p>株式 株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券等 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>投資信託証券 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債等 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものへの投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>先物取引等 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。</p> <p>八．委託会社は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>スワップ取引 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。</p> <p>二．スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。</p> <p>ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。</p> <p>金利先渡取引および為替先渡取引 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。</p> <p>二．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、</p>
--------	--

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

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

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	<p>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。）</p> <p>ロ．新興国の企業のDR（預託証券）</p> <p>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）</p>
投資態度	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>ロ．株式およびETF（上場投資信託証券）の組入比率の合計は、通常の状態では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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>ホ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>

<p>主な投資制限</p>	<p>株式 株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>投資信託証券 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>先物取引等 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。</p> <p>八．委託会社は、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。</p> <p>スワップ取引 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。</p> <p>ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。</p> <p>金利先渡取引および為替先渡取引 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。</p> <p>ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。</p> <p>ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。</p>
---------------	--

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	株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限り、株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 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。 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。

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、）の行使等により取得したものに限り、

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券

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

外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等

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

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

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

スワップ取引

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

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

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

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

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

金利先渡取引および為替先渡取引

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。

主な投資制限

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

外国債券インデックスマザーファンド

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

ダイワ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・マーケット 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	<p>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・マーケット 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。</p> <p>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。</p> <p>ハ。為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。</p> <p>ニ。当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>

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

運用の基本方針	東京証券取引所が算出・公表する「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．東京証券取引所が算出・公表する「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	株式 株式への直接投資は、行ないません。 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。 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。 外貨建資産 外貨建資産への直接投資は、行ないません。 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。

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	<p>イ．主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券に投資し、ベンチマーク（S & 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いません。</p> <p>ロ．組入銘柄はベンチマーク構成銘柄とし、不動産投資信託証券の組入比率を高位に保ちます。</p> <p>ハ．運用の効率化を図るため、不動産投信指数先物取引を利用することがあります。このため、不動産投資信託証券の組入総額と不動産投信指数先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>ニ．保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。</p> <p>ホ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>
主な投資制限	<p>株式への直接投資は、行ないません。</p> <p>投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、「投資態度」で定めた指数における時価の構成割合が30%を超える場合には、当該指数における構成割合の範囲で組入れることができるものとします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>先物取引</p> <p>委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号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。</p>

3【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

< FWO TOPIXインデックス >

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

その他

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

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

< FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） >

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

（FWO TOPIXインデックスの と同内容）

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・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可能性があります。

その他

（FWO TOPIXインデックスの と同内容）

< FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし） >

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。

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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。

その他

(FWO TOPIXインデックスの と同内容)

<FWO 日本債券インデックス>

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

〈金利変動による価格変化のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

その他

（FWO TOPIXインデックスの と同内容）

<FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)>

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

（FWO 日本債券インデックスの と同内容）

外国証券への投資に伴うリスク

（FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の と同内容）

その他

（FWO TOPIXインデックスの と同内容）

<FWO 外国債券インデックス EM+(為替ヘッジなし)>

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

〈金利変動による価格変化のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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。）。新興国の公社債は、先進国の公社債と比較して価格変動が大きく、債務不履行が生じるリスクがより高いものになると考えられます。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。

外国証券への投資に伴うリスク

（FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)の と同内容）

その他

（FWO T O P I Xインデックスの と同内容）

<FWO J - REITインデックス>

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

〈リートの主な価格変動要因〉



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に影響を受けることが考えられます。
- ・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。

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

その他

(FWO TOPIXインデックスの と同内容)

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

リート(不動産投資信託)への投資に伴うリスク

〈リートの主な価格変動要因〉



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に影響を受けることが考えられます。
- ・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。

ニ．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．組入リート市場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。

外国証券への投資に伴うリスク

(FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)の と同内容)

その他

(FWO T O P I Xインデックスの と同内容)

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)>

リート(不動産投資信託)への投資に伴うリスク

(FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)の と同内容)

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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。

その他

(FWO T O P I Xインデックスの と同内容)

(2)換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止(「FWO T O P I Xインデックス」、「FWO 日本債券インデックス」および「FWO J - R E I T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を中止すること、すでに受付けたお買付けの申込みを取消すことがあります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止（「FWO T O P I Xインデックス」、
「FWO 日本債券インデックス」および「FWO J - R E I T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を中止することがあります。ご換金の申込みの受付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。

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

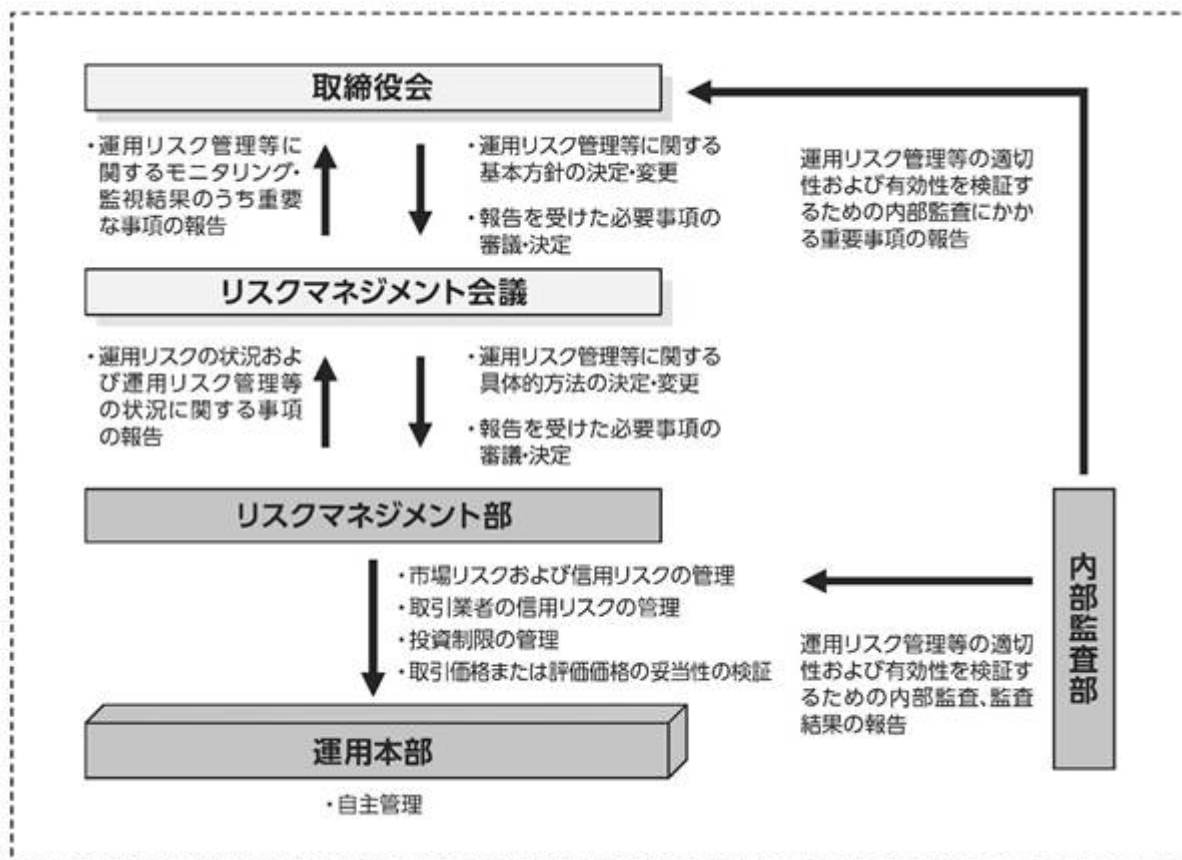
(3)その他の留意点

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

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

(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

当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策（コンティンジェンシー・プラン）を定めています。

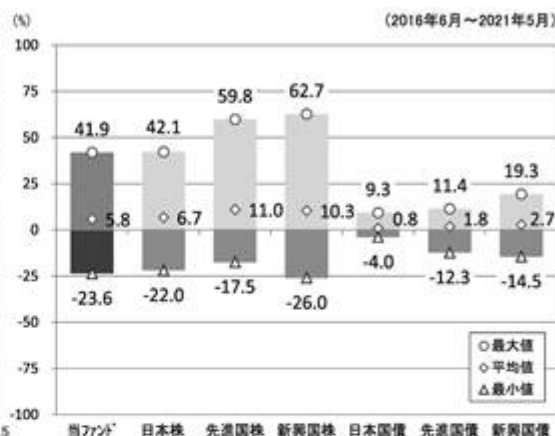
参考情報

- 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。

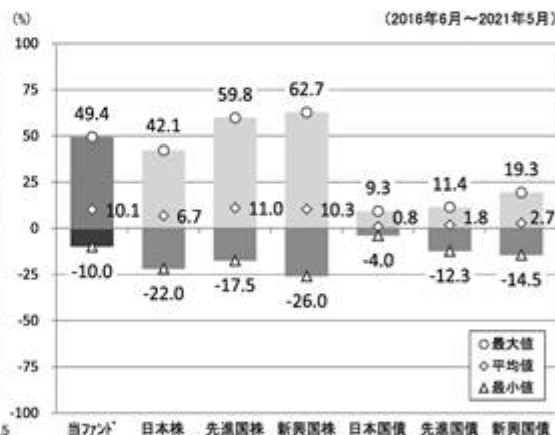
ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



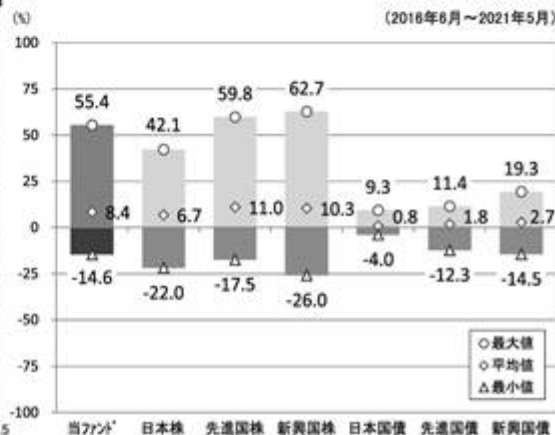
他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



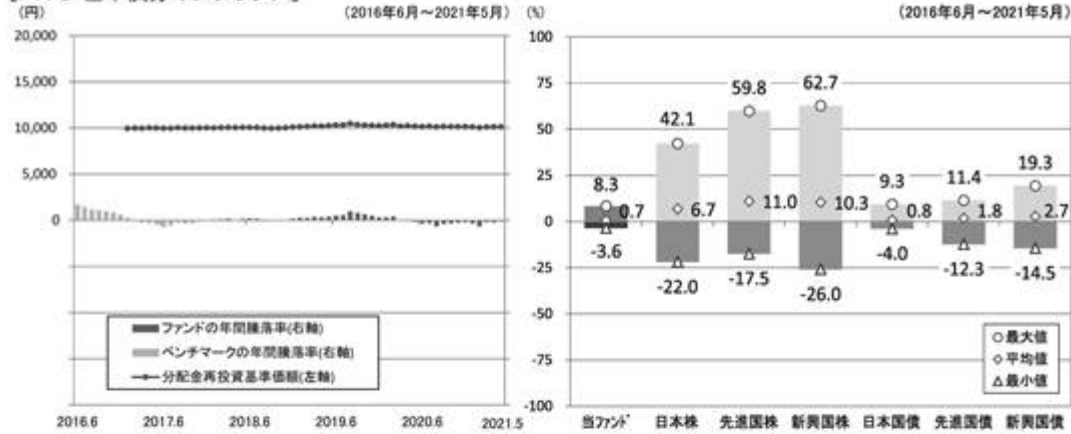
[FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)]



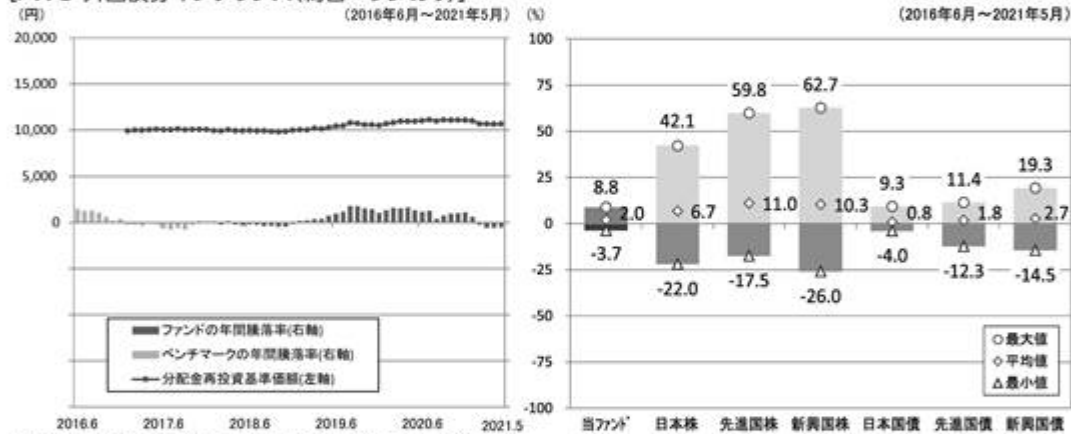
[FWO 外国株式インデックスEM+(為替ヘッジなし)]



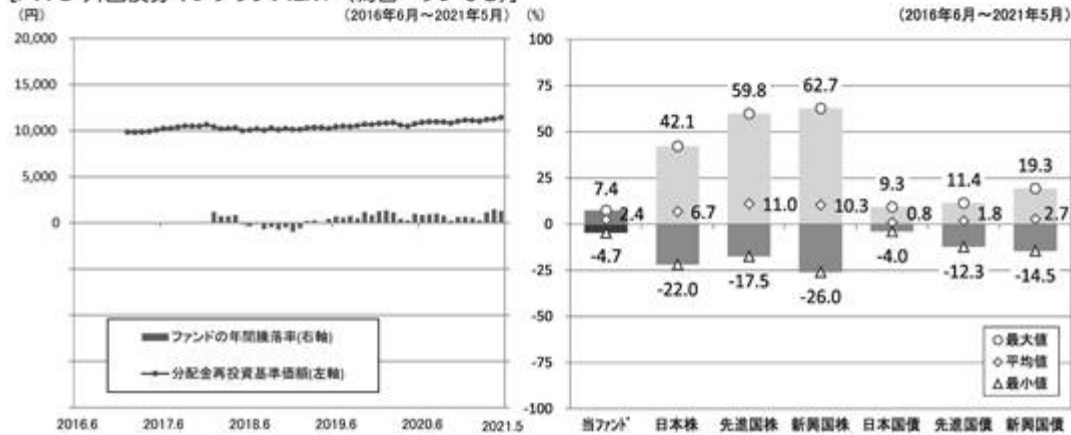
[FWO 日本債券インデックス]



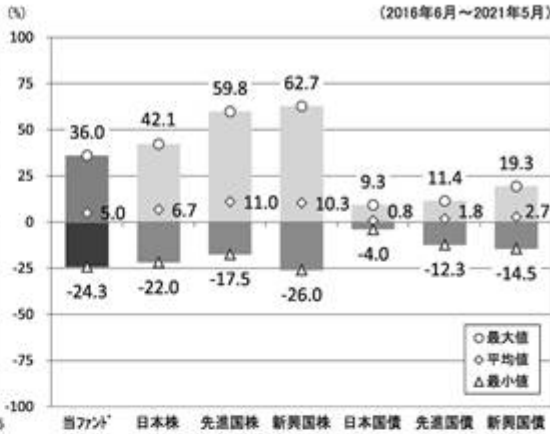
[FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)]



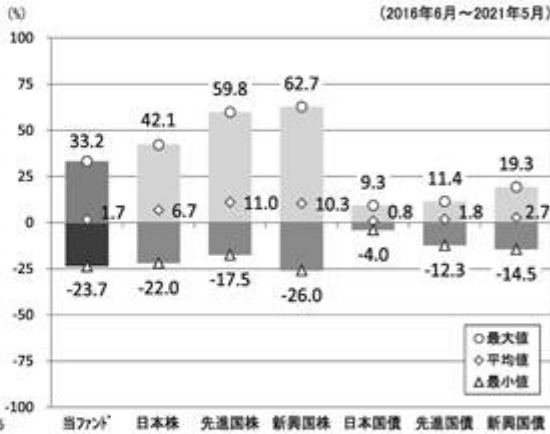
[FWO 外国債券インデックスEM+(為替ヘッジなし)]



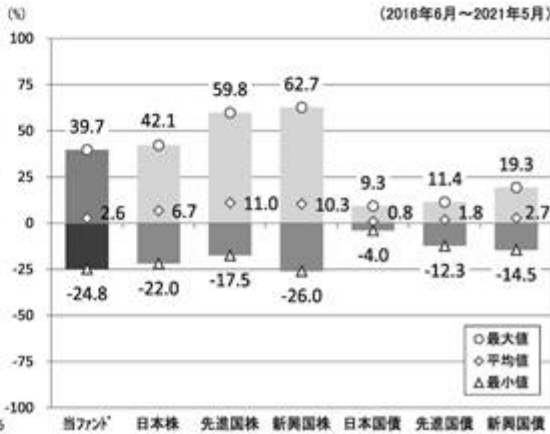
[FWO J-REITインデックス]



[FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)]



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

※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●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.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村證券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野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

取得申込時の申込手数料については、販売会社にお問合わせ下さい。

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

「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】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に次の率を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、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
FWO TOPIXインデックス	年率0.231%（税抜0.21%）
FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	年率0.3355%（税抜0.305%）
FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）	年率0.3465%（税抜0.315%）

FWO 日本債券インデックス	年率0.2255% (税抜0.205%) 以内 (*)
FWO 外国債券インデックス (為替ヘッジあり)	年率0.264% (税抜0.24%)
FWO 外国債券インデックス EM+ (為替ヘッジなし)	年率0.275% (税抜0.25%)
FWO J - R E I Tインデックス	年率0.231% (税抜0.21%)
FWO 外国 R E I Tインデックス (為替ヘッジあり)	年率0.3245% (税抜0.295%)
FWO 外国 R E I Tインデックス (為替ヘッジなし)	年率0.3245% (税抜0.295%)

(*) 毎月10日(休業日の場合翌営業日)(当初設定日から2017年2月10日(休業日の場合翌営業日)までの期間については当初設定日の前営業日)における新発10年国債の利回り(日本相互証券株式会社発表の終値)に応じて、純資産総額に対して以下の率とします。

(新発10年固定利付国債利回りが)

イ. 1%未満の場合 年率0.11%(税抜0.10%)

ロ. 1%以上の場合 年率0.2255%(税抜0.205%)

信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。
信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分については、次のとおりです。

< FWO T O P I Xインデックス >

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.14% (税抜)	年率0.05% (税抜)	年率0.02% (税抜)

< FWO 外国株式インデックス (為替ヘッジあり) >

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.235% (税抜)	年率0.05% (税抜)	年率0.02% (税抜)

< FWO 外国株式インデックス EM+ (為替ヘッジなし) >

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.245% (税抜)	年率0.05% (税抜)	年率0.02% (税抜)

< FWO 日本債券インデックス >

	委託会社	販売会社	受託会社
前 イ.の場合	年率0.065% (税抜)	年率0.025% (税抜)	年率0.01% (税抜)
前 ロ.の場合	年率0.135% (税抜)	年率0.05% (税抜)	年率0.02% (税抜)

< FWO 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0.17% (税抜)	年率0.05% (税抜)	年率0.02% (税抜)

< FWO 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0.18% （税抜）	年率0.05% （税抜）	年率0.02% （税抜）
-----------------	-----------------	-----------------

<FWO J-REITインデックス>

委託会社 年率0.14% （税抜）	販売会社 年率0.05% （税抜）	受託会社 年率0.02% （税抜）
-------------------------	-------------------------	-------------------------

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）>

委託会社 年率0.225% （税抜）	販売会社 年率0.05% （税抜）	受託会社 年率0.02% （税抜）
--------------------------	-------------------------	-------------------------

<FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）>

委託会社 年率0.225% （税抜）	販売会社 年率0.05% （税抜）	受託会社 年率0.02% （税抜）
--------------------------	-------------------------	-------------------------

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

< マザーファンドより支弁する手数料等 >

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

ハ．損益通算について

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

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

法人の投資者に対する課税

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

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

< 注1 > 個別元本について

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

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

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。

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

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

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

- () 外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- () 上記は、2021年5月31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オンライン TOPIXインデックス】

(1)【投資状況】（2021年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	3,231,363,979	99.99
内 日本	3,231,363,979	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	233,835	0.01
純資産総額	3,231,597,814	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】（2021年5月31日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
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	2,491,606,122	1.1913 2,968,338,441	1.2969 3,231,363,979	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	1,308,490,516	1,308,490,516	1.1827	1.1827
第2計算期間末 (2018年11月30日)	2,014,835,042	2,014,835,042	1.1209	1.1209
第3計算期間末 (2019年12月2日)	2,849,716,102	2,849,716,102	1.1793	1.1793
2020年5月末日	2,156,669,987	-	1.0896	-
6月末日	2,122,699,704	-	1.0877	-
7月末日	2,013,798,916	-	1.0437	-
8月末日	2,161,785,192	-	1.1288	-
9月末日	2,173,260,620	-	1.1431	-
10月末日	2,422,325,305	-	1.1106	-
第4計算期間末 (2020年11月30日)	2,646,152,629	2,646,152,629	1.2343	1.2343
12月末日	2,663,677,301	-	1.2708	-
2021年1月末日	2,631,557,950	-	1.2735	-
2月末日	2,711,440,820	-	1.3131	-
3月末日	2,877,605,997	-	1.3880	-
4月末日	3,115,855,932	-	1.3485	-
5月末日	3,231,597,814	-	1.3668	-

【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
2020年12月1日～ 2021年5月31日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	18.3
第2計算期間	5.2
第3計算期間	5.2
第4計算期間	4.7
2020年12月1日～ 2021年5月31日	10.7

(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	1,207,147,382	101,755,106
第2計算期間	1,072,657,156	381,496,133
第3計算期間	1,209,913,301	590,980,566
第4計算期間	931,798,024	1,204,458,870
2020年12月1日～ 2021年5月31日	545,537,609	325,018,416

(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 (2021年5月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	170,475,397,590	97.18
内 日本	170,475,397,590	97.18
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,943,816,984	2.82
純資産総額	175,419,214,574	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	4,956,245,000	2.83
内 日本	4,956,245,000	2.83

(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 (2021年5月31日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	654,500	7,099.10 4,646,361,823	9,115.00 5,965,767,500	3.40
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機 器	404,900	8,279.74 3,352,468,223	10,785.00 4,366,846,500	2.49
3	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	503,200	6,445.49 3,243,373,236	8,256.00 4,154,419,200	2.37
4	キーエンス	日本	株式	電気機 器	63,400	47,371.25 3,003,337,459	53,870.00 3,415,358,000	1.95
5	三菱UFJフィナンシャル G	日本	株式	銀行業	4,358,100	441.69 1,924,935,636	620.00 2,702,022,000	1.54
6	任天堂	日本	株式	その他 製品	37,000	60,456.05 2,236,874,185	67,700.00 2,504,900,000	1.43
7	リクルートホールディン グス	日本	株式	サービ ス業	442,300	4,308.51 1,905,654,509	5,555.00 2,456,976,500	1.40
8	信越化学	日本	株式	化学	117,000	14,464.89 1,692,393,019	18,855.00 2,206,035,000	1.26
9	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	741,500	2,247.72 1,666,691,835	2,931.50 2,173,707,250	1.24
10	武田薬品	日本	株式	医薬品	537,600	3,921.23 2,108,057,847	3,719.00 1,999,334,400	1.14
11	日本電産	日本	株式	電気機 器	155,500	9,811.66 1,525,714,040	12,530.00 1,948,415,000	1.11
12	KDDI	日本	株式	情報・通 信業	508,500	2,810.08 1,428,926,023	3,717.00 1,890,094,500	1.08
13	東京エレクトロン	日本	株式	電気機 器	37,900	27,215.41 1,031,464,361	48,660.00 1,844,214,000	1.05
14	HOYA	日本	株式	精密機 器	127,200	11,724.11 1,491,306,847	14,350.00 1,825,320,000	1.04

15	日立	日本	株式	電気機器	310,600	3,716.83 1,154,449,618	5,736.00 1,781,601,600	1.02
16	ダイキン工業	日本	株式	機械	82,300	19,605.27 1,613,514,015	21,605.00 1,778,091,500	1.01
17	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	440,900	3,084.40 1,359,915,395	3,951.00 1,741,995,900	0.99
18	本田技研	日本	株式	輸送用機器	508,700	2,552.90 1,298,663,973	3,353.00 1,705,671,100	0.97
19	村田製作所	日本	株式	電気機器	189,800	6,898.36 1,309,309,238	8,279.00 1,571,354,200	0.90
20	ファナック	日本	株式	電気機器	56,700	20,510.31 1,162,935,059	26,300.00 1,491,210,000	0.85
21	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	865,600	1,387.49 1,201,017,660	1,673.00 1,448,148,800	0.83
22	伊藤忠	日本	株式	卸売業	445,100	2,774.55 1,234,954,216	3,249.00 1,446,129,900	0.82
23	第一三共	日本	株式	医薬品	506,400	3,254.38 1,648,021,719	2,530.00 1,281,192,000	0.73
24	三井物産	日本	株式	卸売業	516,800	1,892.31 977,948,373	2,414.00 1,247,555,200	0.71
25	SMC	日本	株式	機械	18,900	58,247.88 1,100,885,063	65,520.00 1,238,328,000	0.71
26	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	248,900	3,388.78 843,468,941	4,736.00 1,178,790,400	0.67
27	三菱商事	日本	株式	卸売業	387,600	2,627.13 1,018,276,263	2,984.00 1,156,598,400	0.66
28	東京海上HD	日本	株式	保険業	211,200	4,858.87 1,026,194,829	5,179.00 1,093,804,800	0.62
29	三菱電機	日本	株式	電気機器	645,200	1,474.95 951,644,197	1,692.00 1,091,678,400	0.62
30	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	65,800	15,166.71 997,970,072	16,310.00 1,073,198,000	0.61

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.18%
合計	97.18%

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

八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.08%
鉱業	0.17%
建設業	2.25%
食料品	3.29%
繊維製品	0.47%
パルプ・紙	0.23%
化学	7.18%
医薬品	4.94%
石油・石炭製品	0.40%
ゴム製品	0.65%
ガラス・土石製品	0.77%
鉄鋼	0.82%
非鉄金属	0.74%
金属製品	0.60%
機械	5.47%
電気機器	17.29%
輸送用機器	7.43%
精密機器	2.63%
その他製品	2.47%
電気・ガス業	1.19%
陸運業	3.23%
海運業	0.27%
空運業	0.46%
倉庫・運輸関連業	0.17%
情報・通信業	8.77%
卸売業	4.60%
小売業	4.40%
銀行業	5.03%
証券、商品先物取引業	0.79%
保険業	1.90%
その他金融業	1.09%
不動産業	1.93%
サービス業	5.44%
合計	97.18%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 030 6月	買建	257	4,975,865,050	4,956,245,000	2.83%

(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

●FWO TOPIXインデックス

2021年5月31日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	13,668円
純資産総額	32億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.4%
3カ月間	4.1%
6カ月間	10.7%
1年間	25.4%
3年間	17.3%
5年間	-
設定来	36.7%

※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	直近1年間分配金合計額: 0円				設定来分配金合計額: 0円			
	第1期 17年11月	第2期 18年11月	第3期 19年12月	第4期 20年11月				
分配金	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

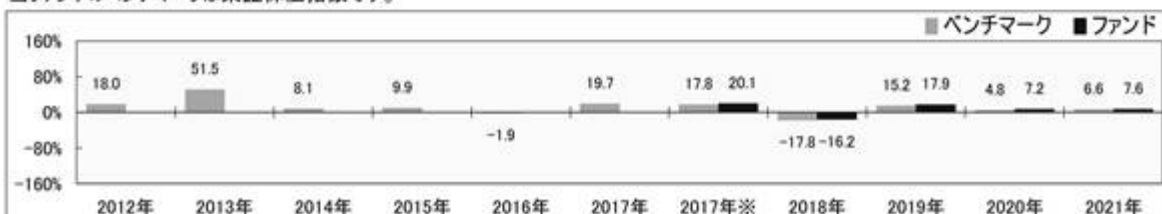
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	株式東証33業種別構成	比率	組入上位10銘柄	業種名	比率
国内株式	2,134	97.2%	電気機器	17.3%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.4%
国内株式先物	1	2.8%	情報・通信業	8.8%	TOPIX先物 0306月	-	2.8%
不動産投資信託等	-	-	輸送用機器	7.4%	ソニーグループ	電気機器	2.5%
コール・ローン、その他	-	2.8%	化学	7.2%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	2.4%
合計	2,135	-	機械	5.5%	キーエンス	電気機器	1.9%
株式市場・上場別構成			サービス業	5.4%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	1.5%
一部(東証・名証)		97.2%	銀行業	5.0%	任天堂	その他製品	1.4%
二部(東証・名証)		-	医薬品	4.9%	リクルートホールディングス	サービス業	1.4%
新興市場他		-	卸売業	4.6%	信越化学	化学	1.3%
その他		-	その他	31.0%	日本電信電話	情報・通信業	1.2%
合計		97.2%	合計	97.2%	合計		19.9%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証株価指数です。



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

・2017年※は設定日(1月11日)から年末、2021年は5月31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オンライン 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)】

(1) 【投資状況】（2021年5月31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	2,985,086,193	99.98
内 日本	2,985,086,193	99.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	449,694	0.02
純資産総額	2,985,535,887	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】（2021年5月31日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
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	1,099,357,785	2.3642 2,599,196,612	2.7153 2,985,086,193	99.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	1,294,661,850	1,294,661,850	1.1363	1.1363
第2計算期間末 (2018年11月30日)	2,198,184,300	2,198,184,300	1.1423	1.1423
第3計算期間末 (2019年12月2日)	2,353,172,110	2,353,172,110	1.3050	1.3050
2020年5月末日	2,978,167,335	-	1.2281	-
6月末日	2,953,811,832	-	1.2446	-
7月末日	3,024,960,505	-	1.3041	-
8月末日	3,157,905,319	-	1.3900	-
9月末日	3,009,508,835	-	1.3378	-
10月末日	3,069,335,770	-	1.3155	-
第4計算期間末 (2020年11月30日)	3,369,427,354	3,369,427,354	1.4661	1.4661
12月末日	3,320,329,142	-	1.5046	-
2021年1月末日	3,317,365,283	-	1.5224	-
2月末日	3,372,425,237	-	1.5442	-
3月末日	3,495,898,441	-	1.5933	-
4月末日	2,939,513,763	-	1.6810	-
5月末日	2,985,535,887	-	1.6889	-

【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
2020年12月1日～ 2021年5月31日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	13.6
第2計算期間	0.5

第3計算期間	14.2
第4計算期間	12.3
2020年12月1日～ 2021年5月31日	15.2

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	1,218,074,496	79,711,026
第2計算期間	1,148,408,392	363,438,941
第3計算期間	570,028,310	691,152,610
第4計算期間	1,186,063,315	691,086,927
2020年12月1日～ 2021年5月31日	276,680,902	807,115,290

(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 (2021年5月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	68,586,376,681	94.77
内 香港	756,364,229	1.05
内 シンガポール	222,771,581	0.31
内 イスラエル	140,461,134	0.19
内 ノルウェー	151,786,291	0.21
内 スウェーデン	882,839,632	1.22
内 デンマーク	587,233,322	0.81
内 イギリス	3,248,779,061	4.49
内 アイルランド	151,104,414	0.21
内 オランダ	966,651,978	1.34
内 ベルギー	217,657,255	0.30
内 フランス	2,590,481,179	3.58
内 ドイツ	2,149,184,449	2.97
内 スイス	2,150,791,852	2.97
内 ポルトガル	45,085,395	0.06
内 スペイン	594,558,576	0.82

	内 イタリア	578,711,668	0.80
	内 フィンランド	240,774,676	0.33
	内 オーストリア	47,673,599	0.07
	内 カナダ	2,563,753,215	3.54
	内 アメリカ	48,789,150,585	67.42
	内 オーストラリア	1,459,810,721	2.02
	内 ニュージーランド	50,751,869	0.07
投資証券		1,657,424,933	2.29
	内 香港	33,326,566	0.05
	内 シンガポール	30,143,589	0.04
	内 イギリス	44,406,972	0.06
	内 フランス	38,330,988	0.05
	内 カナダ	10,732,289	0.01
	内 アメリカ	1,335,200,123	1.84
	内 オーストラリア	160,188,350	0.22
	内 その他	5,096,056	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		2,125,927,989	2.94
純資産総額		72,369,729,603	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)	2,668,966,748	3.69
内 イギリス	142,071,358	0.20
内 ドイツ	404,410,856	0.56
内 カナダ	86,291,294	0.12
内 アメリカ	1,960,335,552	2.71
内 オーストラリア	75,857,688	0.10
為替予約取引(買建)	87,807,440	0.12
内 日本	87,807,440	0.12
為替予約取引(売建)	70,928,895,509	98.01
内 日本	70,928,895,509	98.01

(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 (2021年5月31日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	201,093	14,156.84 2,846,842,391	13,677.19 2,750,387,893	3.80
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	85,866	23,871.70 2,049,767,598	27,404.87 2,353,147,151	3.25
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	5,132	341,815.68 1,754,198,119	353,764.16 1,815,517,686	2.51
4	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	28,909	28,190.75 814,966,635	36,081.40 1,043,077,331	1.44
5	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	3,538	193,915.18 686,071,932	264,692.82 936,483,217	1.29
6	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	3,600	194,613.04 700,607,236	258,687.85 931,276,282	1.29
7	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	36,629	15,152.36 555,016,087	18,026.98 660,310,338	0.91
8	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	9,117	88,789.36 809,493,378	68,624.14 625,646,350	0.86
9	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	31,705	17,492.45 554,598,165	18,576.88 588,979,980	0.81
10	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	7,438	59,803.83 444,820,914	71,319.85 530,477,065	0.73
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	16,359	25,621.27 419,138,467	31,768.93 519,707,998	0.72
12	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	11,354	39,595.92 449,572,076	45,212.33 513,340,899	0.71

13	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	20,328	23,366.80 475,000,440	24,948.44 507,152,051	0.70
14	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	34,247	12,264.14 420,010,208	13,546.63 463,931,753	0.64
15	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	12,956	29,770.20 385,702,773	35,003.56 453,506,144	0.63
16	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	29,651	15,130.41 448,631,965	14,801.13 438,868,484	0.61
17	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	93,607	3,629.76 339,771,244	4,652.72 435,527,760	0.60
18	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	21,890	19,656.91 430,289,944	19,608.62 429,232,779	0.59
19	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	10,686	38,218.43 408,402,164	39,577.26 422,922,609	0.58
20	PAYPAL HOLDINGS INC	アメリカ	株式	情報技術	13,365	26,068.00 348,398,820	28,539.79 381,434,363	0.53
21	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	4,851	55,488.72 269,175,810	73,864.60 358,317,184	0.50
22	COMCAST CORP-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	54,643	5,654.83 308,997,160	6,293.63 343,903,283	0.48
23	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	8,619	38,139.54 328,724,725	38,474.79 331,614,267	0.46
24	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	51,519	5,141.15 264,867,340	6,406.69 330,066,324	0.46
25	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	5,684	52,052.58 295,866,878	55,382.70 314,795,271	0.43
26	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	49,124	5,657.03 277,895,961	6,269.49 307,982,486	0.43
27	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	49,301	6,306.80 310,932,020	6,200.34 305,683,081	0.42
28	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	49,697	5,509.95 273,828,085	6,068.63 301,592,725	0.42

29	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニケーショ ン・サー ビス	5,369	54,781.21 294,120,349	55,188.42 296,306,657	0.41
30	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必 需品	18,950	16,101.79 305,129,013	15,589.21 295,415,583	0.41

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	94.77%
投資証券	2.29%
合計	97.06%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	3.17%
素材	4.48%
資本財・サービス	9.79%
一般消費財・サービス	11.05%
生活必需品	7.00%
ヘルスケア	12.24%
金融	14.09%
情報技術	20.83%
コミュニケーション・サービス	8.75%
公益事業	2.92%
不動産	0.44%
合計	94.77%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
----	----	-----	-----------	----	----	----	----------

株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 EMINI FUT 202106	買建	85	1,905,060,142	1,960,335,552	2.71%
	イギリス	FTSE 100 IDX FUT 202106	買建	13	138,702,735	142,071,358	0.20%
	オーストラリア	SPI 200 FUTURES 202106	買建	5	72,971,184	75,857,688	0.10%
	カナダ	S&P/TSX 60 IX FUT 202106	買建	4	81,395,001	86,291,294	0.12%
	ドイツ	SWISS MKT IX FUTR 202106	買建	6	80,513,204	83,576,620	0.12%
		EURO STOXX 50 202106	買建	59	309,841,008	320,834,236	0.44%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2021年6月	買建	800,000	87,973,200	87,807,440	0.12%
		デンマーク・クローネ 売/円買 2021年6月	売建	31,804,800	561,163,891	571,936,176	0.79%
		イスラエル・シケル 売/円買 2021年6月	売建	2,493,900	83,464,348	84,269,878	0.12%
		ノルウェー・クローネ 売/円買 2021年6月	売建	11,474,000	150,161,385	150,538,880	0.21%
		スウェーデン・クローネ 売/円買 2021年6月	売建	66,728,900	859,273,619	880,821,480	1.22%
		スイス・フラン売/円買 2021年6月	売建	17,231,100	2,062,371,404	2,101,010,423	2.90%
		ニュージーランド・ドル 売/円買 2021年6月	売建	725,400	57,184,442	57,594,801	0.08%
		シンガポール・ドル売/ 円買 2021年6月	売建	3,118,000	255,056,141	258,504,961	0.36%
		豪ドル売/円買 2021年6月	売建	19,191,500	1,624,044,047	1,623,217,070	2.24%
		米ドル売/円買 2021年6月	売建	465,057,000	50,833,209,012	51,042,191,517	70.53%
		ユーロ売/円買 2021年6月	売建	56,261,400	7,385,269,040	7,525,147,912	10.40%
		英ポンド売/円買 2021年6月	売建	21,498,900	3,269,009,714	3,345,115,723	4.62%
		カナダ・ドル売/円買 2021年6月	売建	27,817,700	2,477,112,170	2,525,977,902	3.49%
香港ドル売/円買 2021年6月	売建	53,929,900	758,680,440	762,568,786	1.05%		

(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

●FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)

2021年5月31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	16,889円
純資産総額	29億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.5%
3カ月間	9.4%
6カ月間	15.2%
1年間	37.5%
3年間	44.9%
5年間	-
設定来	68.9%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、
 ※「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。
 ※「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
 ※基準価額の計算において運用管理費用(信託報酬)は控除しています。

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円				設定来分配金合計額: 0円			
	第1期 17年11月	第2期 18年11月	第3期 19年12月	第4期 20年11月				
分配金	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	通貨別構成	比率	株式業種別構成	比率	組入上位10銘柄	国・地域名	比率
外国株式・先物	1,230	98.4%	日本円	99.7%	情報技術	20.8%	APPLE INC	アメリカ	3.8%
外国リート	58	2.2%	ユーロ	0.3%	金融	14.1%	MICROSOFT CORP	アメリカ	3.3%
外国投資証券	6	0.1%	カナダ・ドル	0.1%	ヘルスクア	12.2%	S&P500 EMINI FUT 202106	アメリカ	2.7%
			スイス・フラン	0.1%	一般消費財・サービス	11.0%	AMAZON.COM INC	アメリカ	2.5%
コール・ローン、その他		3.0%	英ポンド	0.1%	資本財・サービス	9.8%	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	1.4%
合計	1,294	-	豪ドル	0.1%	コミュニケーション・サービス	8.8%	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.3%
国・地域別構成			デンマーク・クローネ	0.0%	生活必需品	7.0%	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.3%
アメリカ		72.0%	スウェーデン・クローネ	0.0%	素材	4.5%	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	0.9%
イギリス		4.7%	香港ドル	0.0%	エネルギー	3.2%	TESLA INC	アメリカ	0.9%
その他		24.0%	その他	-0.3%	公益事業、他	3.4%	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.8%
合計		100.7%	合計	100.0%	合計	94.8%	合計		18.9%

※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額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはMSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース)です。



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

・2017年※は設定日(1月11日)から年末、2021年は5月31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)】

(1) 【投資状況】（2021年5月31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	2,283,997,543	99.20
内 日本	2,283,997,543	99.20
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	18,326,852	0.80
純資産総額	2,302,324,395	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】（2021年5月31日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
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	492,937,597	3.0185 1,487,971,622	3.6946 1,821,207,245	79.10
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	244,590,824	1.5434 377,510,371	1.8921 462,790,298	20.10

(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。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	915,626,043	915,626,043	1.1391	1.1391
第2計算期間末 (2018年11月30日)	1,637,273,973	1,637,273,973	1.1550	1.1550
第3計算期間末 (2019年12月2日)	1,845,455,269	1,845,455,269	1.2622	1.2622
2020年5月末日	2,086,487,143	-	1.1347	-
6月末日	2,116,077,694	-	1.1640	-
7月末日	2,128,352,996	-	1.2015	-
8月末日	2,224,480,767	-	1.2789	-
9月末日	2,114,257,308	-	1.2246	-
10月末日	2,280,908,779	-	1.2002	-
第4計算期間末 (2020年11月30日)	2,513,652,732	2,513,652,732	1.3420	1.3420
12月末日	2,494,182,726	-	1.3819	-
2021年1月末日	2,540,998,519	-	1.4176	-
2月末日	2,638,819,641	-	1.4748	-
3月末日	2,790,421,954	-	1.5598	-
4月末日	2,235,609,863	-	1.6211	-
5月末日	2,302,324,395	-	1.6498	-

【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
2020年12月1日～ 2021年5月31日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	13.9
第2計算期間	1.4
第3計算期間	9.3
第4計算期間	6.3
2020年12月1日～ 2021年5月31日	22.9

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	866,066,727	72,233,916
第2計算期間	874,852,673	261,158,636
第3計算期間	481,206,327	436,632,747
第4計算期間	950,256,999	539,288,288
2020年12月1日～ 2021年5月31日	227,266,201	704,835,718

(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

(1) 投資状況 (2021年5月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	198,641,609,057	92.78
内 香港	2,238,174,804	1.05
内 シンガポール	677,721,263	0.32
内 イスラエル	413,772,532	0.19
内 ノルウェー	444,583,513	0.21
内 スウェーデン	2,624,313,489	1.23
内 デンマーク	1,758,224,779	0.82
内 イギリス	9,445,632,737	4.41
内 アイルランド	457,997,846	0.21
内 オランダ	2,776,782,199	1.30
内 ベルギー	623,121,560	0.29
内 フランス	7,430,206,927	3.47
内 ドイツ	6,143,989,874	2.87

	内 スイス	6,150,735,462	2.87
	内 ポルトガル	128,615,089	0.06
	内 スペイン	1,671,124,988	0.78
	内 イタリア	1,631,148,159	0.76
	内 フィンランド	677,280,023	0.32
	内 オーストリア	132,057,752	0.06
	内 カナダ	7,366,129,263	3.44
	内 アメリカ	141,563,324,415	66.12
	内 オーストラリア	4,123,436,341	1.93
	内 ニュージーランド	163,236,042	0.08
投資証券		4,785,831,584	2.24
	内 香港	94,418,083	0.04
	内 シンガポール	90,292,273	0.04
	内 イギリス	115,152,400	0.05
	内 フランス	113,386,043	0.05
	内 カナダ	23,623,314	0.01
	内 アメリカ	3,879,116,633	1.81
	内 オーストラリア	449,158,846	0.21
	内 その他	20,683,992	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		10,682,481,137	4.99
純資産総額		214,109,921,778	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)	10,990,945,523	5.13
内 イギリス	524,571,168	0.25
内 ドイツ	1,869,793,961	0.87
内 カナダ	453,029,296	0.21
内 アメリカ	7,749,091,123	3.62
内 オーストラリア	394,459,975	0.18
為替予約取引(買建)	11,263,127,671	5.26
内 日本	11,263,127,671	5.26

(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（2021年5月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	584,700	12,844.88 7,510,408,015	13,677.19 7,997,055,098	3.74
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	249,500	23,820.88 5,943,333,104	27,404.87 6,837,516,762	3.19
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	14,900	350,796.03 5,226,861,785	353,764.16 5,271,086,032	2.46
4	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	83,600	30,675.83 2,564,502,008	36,081.40 3,016,405,441	1.41
5	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	10,237	199,100.57 2,038,193,252	264,692.82 2,709,660,456	1.27
6	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	10,450	199,108.26 2,080,681,926	258,687.85 2,703,288,095	1.26
7	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	105,870	13,530.22 1,432,452,230	18,026.98 1,908,516,627	0.89
8	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	26,670	65,011.06 1,733,846,253	68,624.14 1,830,206,006	0.85
9	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	91,200	15,926.61 1,452,510,826	18,576.88 1,694,211,456	0.79
10	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	21,470	58,582.31 1,257,762,374	71,319.85 1,531,237,240	0.72
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	47,550	25,627.97 1,218,611,662	31,768.93 1,510,612,831	0.71

12	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルス ケア	32,916	37,328.16 1,228,695,098	45,212.33 1,488,209,357	0.70
13	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技 術	58,900	23,229.16 1,368,199,340	24,948.44 1,469,463,587	0.69
14	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必 需品	98,900	12,481.87 1,234,463,135	13,546.63 1,339,762,617	0.63
15	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消 費財・ サービ ス	37,400	30,454.22 1,138,988,850	35,003.56 1,309,133,204	0.61
16	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必 需品	85,467	15,175.52 1,297,013,161	14,801.13 1,265,008,691	0.59
17	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	269,301	3,241.65 873,003,599	4,652.72 1,252,983,872	0.59
18	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	62,862	16,389.91 1,030,309,004	19,608.62 1,232,637,322	0.58
19	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技 術	30,750	37,366.69 1,149,028,158	39,577.26 1,217,000,770	0.57
20	PAYPAL HOLDINGS INC	アメリカ	株式	情報技 術	38,600	23,500.49 907,121,014	28,539.79 1,101,636,095	0.51
21	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技 術	14,410	49,748.73 716,881,017	73,864.60 1,064,388,915	0.50
22	COMCAST CORP-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	158,690	5,701.92 904,843,933	6,293.63 998,737,478	0.47
23	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネル ギー	146,705	4,512.78 662,052,887	6,406.69 939,893,632	0.44
24	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルス ケア	24,130	36,898.25 890,356,123	38,474.79 928,396,827	0.43
25	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技 術	16,620	52,443.43 871,611,196	55,382.70 920,460,487	0.43
26	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	143,504	6,624.12 950,600,882	6,200.34 889,773,936	0.42
27	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技 術	141,200	5,233.24 738,935,711	6,269.49 885,252,157	0.41

28	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	141,900	5,786.65 821,130,475	6,068.63 861,138,654	0.40
29	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	146,250	4,732.74 692,165,988	5,806.30 849,171,960	0.40
30	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必需品	54,450	16,458.51 896,168,997	15,589.21 848,832,637	0.40

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	92.78%
投資証券	2.24%
合計	95.01%

(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

業種	投資比率
エネルギー	3.12%
素材	4.37%
資本財・サービス	9.57%
一般消費財・サービス	10.81%
生活必需品	6.82%
ヘルスケア	11.94%
金融	13.85%
情報技術	20.44%
コミュニケーション・サービス	8.58%
公益事業	2.86%
不動産	0.42%
合計	92.78%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
----	----	-----	-----------	----	----	----	----------

株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 EMINI FUT 202106	買建	336	7,651,308,903	7,749,091,123	3.62%
	イギリス	FTSE 100 IDX FUT 202106	買建	48	521,795,575	524,571,168	0.25%
	オーストラリア	SPI 200 FUTURES 202106	買建	26	381,916,084	394,459,975	0.18%
	カナダ	S&P/TSX 60 IX FUT 202106	買建	21	441,227,129	453,029,296	0.21%
	ドイツ	SWISS MKT IX FUTR 202106	買建	30	406,194,062	417,883,098	0.20%
		EURO STOXX 50 202106	買建	267	1,413,944,016	1,451,910,863	0.68%
為替予約取引	日本	スイス・フラン買/円売 2021年6月	買建	2,330,000	282,796,192	284,093,871	0.13%
		豪ドル買/円売 2021年6月	買建	2,820,000	238,521,931	238,515,600	0.11%
		米ドル買/円売 2021年6月	買建	83,390,000	9,127,342,890	9,152,657,027	4.27%
		英ポンド買/円売 2021年6月	買建	2,770,000	429,314,186	431,002,661	0.20%
		ユーロ買/円売 2021年6月	買建	6,470,000	859,964,512	865,373,499	0.40%
		カナダ・ドル買/円売 2021年6月	買建	3,210,000	289,759,784	291,485,013	0.14%

(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。

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 (2021年5月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	14,237,235,565	91.53
内 中国	4,628,479,586	29.76

内 台湾	2,102,535,891	13.52
内 タイ	609,025,020	3.92
内 シンガポール	17,628,573	0.11
内 マレーシア	82,492,113	0.53
内 インドネシア	203,409,504	1.31
内 インド	1,410,229,999	9.07
内 サウジアラビア	266,776,119	1.72
内 ロシア	1,321,675,695	8.50
内 トルコ	212,304,812	1.36
内 カナダ	9,991,892	0.06
内 メキシコ	391,925,210	2.52
内 チリ	74,029,526	0.48
内 ブラジル	2,324,695,143	14.95
内 南アフリカ	582,036,482	3.74
新株予約権証券	124,376	0.00
内 非上場	124,376	0.00
投資証券	913,077,635	5.87
内 アメリカ	913,077,635	5.87
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	403,478,429	2.59
純資産総額	15,553,916,005	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)	343,556,483	2.21
内 アメリカ	343,556,483	2.21
為替予約取引(買建)	216,261,606	1.39
内 日本	216,261,606	1.39
為替予約取引(売建)	1,144,485	0.01
内 日本	1,144,485	0.01

(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 (2021年5月31日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	アメリカ	投資証 券	-	351,600	2,476.73 870,841,245	2,596.92 913,077,635	5.87
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技 術	214,000	1,487.75 318,380,886	2,336.99 500,115,860	3.22
3	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	株式	金融	4,708,000	85.68 403,482,857	90.49 426,055,168	2.74
4	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技 術	916,902	407.14 373,311,367	439.67 403,135,219	2.59
5	IND & COMM BK OF CHINA-H	中国	株式	金融	5,490,000	70.47 386,932,983	72.11 395,905,860	2.55
6	GAZPROM PJSC-SPON ADR	ロシア	株式	エネ ル ギー	392,339	586.33 230,084,645	779.73 305,920,465	1.97
7	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	ブラジ ル	株式	金融	485,736	568.93 276,360,478	622.48 302,361,846	1.94
8	SBERBANK PJSC SPONSORED ADR	ロシア	株式	金融	156,977	1,423.80 223,516,231	1,852.20 290,752,799	1.87
9	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	中国	株式	一般消 費財・ サー ビス	95,100	3,277.31 311,673,129	2,932.63 278,893,684	1.79
10	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	ブラジ ル	株式	エネ ル ギー	443,800	487.27 216,251,232	567.01 251,643,216	1.62
11	BANCO BRADESCO SA- PREF	ブラジ ル	株式	金融	421,218	459.77 193,666,094	557.56 234,856,663	1.51
12	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	株式	金融	194,000	1,218.65 236,421,126	1,199.77 232,757,126	1.50
13	VALE SA	ブラジ ル	株式	素材	94,890	1,235.15 117,205,226	2,344.33 222,454,282	1.43
14	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	ブラジ ル	株式	エネ ル ギー	367,300	488.40 179,395,440	561.13 206,105,633	1.33
15	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	21,500	7,563.78 162,621,629	8,505.21 182,862,015	1.18
16	LUKOIL PJSC-SPON ADR	ロシア	株式	エネ ル ギー	20,288	8,069.88 163,723,857	8,941.04 181,396,014	1.17

17	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	株式	エネルギー	52,681	2,866.06 150,986,991	3,184.09 167,741,361	1.08
18	PTT PCL-NVDR	タイ	株式	エネルギー	1,036,800	137.24 142,297,295	137.76 142,837,344	0.92
19	BANK OF CHINA LTD-H	中国	株式	金融	3,350,000	41.26 138,266,390	41.57 139,264,860	0.90
20	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国	株式	エネルギー	2,079,800	48.61 101,124,268	59.52 123,809,246	0.80
21	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	中国	株式	金融	2,523,000	41.57 104,890,290	44.54 112,376,943	0.72
22	BANCO DO BRASIL S.A.	ブラジル	株式	金融	154,300	666.72 102,876,512	704.62 108,723,651	0.70
23	INFOSYS LTD	インド	株式	情報技術	48,724	1,280.46 62,389,333	2,135.67 104,058,677	0.67
24	CHINA MERCHANTS BANK-H	中国	株式	金融	101,000	559.27 56,488,213	1,013.83 102,397,638	0.66
25	PETROCHINA CO LTD-H	中国	株式	エネルギー	2,052,000	38.10 78,200,602	44.82 91,978,438	0.59
26	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	インド	株式	金融	21,890	2,977.15 65,170,010	3,862.85 84,557,830	0.54
27	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	中国	株式	不動産	318,000	320.22 101,837,180	265.83 84,534,576	0.54
28	CEMEX SAB-CPO	メキシコ	株式	素材	896,719	39.28 35,231,156	90.72 81,357,781	0.52
29	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	メキシコ	株式	コミュニケーション・サービス	896,500	80.76 72,406,760	84.33 75,609,194	0.49
30	AL RAJHI BANK	サウジアラビア	株式	金融	24,162	1,821.32 44,007,024	3,036.51 73,368,300	0.47

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 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	91.53%
新株予約権証券	0.00%
投資証券	5.87%
合計	97.41%

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

八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	14.32%
素材	10.11%
資本財・サービス	2.92%
一般消費財・サービス	6.26%
生活必需品	3.87%
ヘルスケア	0.85%
金融	30.73%
情報技術	11.73%
コミュニケーション・サービス	4.96%
公益事業	3.16%
不動産	2.62%
合計	91.53%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	MSCI EMGMKT 202106	買建	46	336,826,768	343,556,483	2.21%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2021年6 月	買建	1,970,408	215,037,870	216,261,606	1.39%
		シンガポール・ドル売/ 円買 2021年6月	売建	6,422	532,406	532,402	0.00%
		メキシコ・ペソ売/円買 2021年6月	売建	111,133	612,036	612,083	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

●FWO 外国株式インデックスEM+ (為替ヘッジなし)

2021年5月31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	16,498円
純資産総額	23億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.8%
3カ月間	11.9%
6カ月間	22.9%
1年間	45.4%
3年間	45.7%
5年間	-
設定来	65.0%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、
「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円

設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期				
	17年11月	18年11月	19年12月	20年11月				
分配金	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	通貨別構成	比率	株式業種別構成	比率	組入上位10銘柄	国・地域名	比率
外国株式・先物	1,640	96.3%	米ドル	60.4%	情報技術	18.5%	APPLE INC	アメリカ	3.0%
外国リート	58	1.7%	ユーロ	8.6%	金融	17.1%	S&P500 EMINI FUT 202106	アメリカ	2.9%
外国投資証券	7	1.3%	香港ドル	5.7%	一般消費財・サービス	9.8%	MICROSOFT CORP	アメリカ	2.5%
外国ワラント	2	0.0%	英ポンド	3.7%	ヘルスケア	9.6%	AMAZON.COM INC	アメリカ	1.9%
コール・ローン、その他		5.3%	ブラジル・リアル	3.1%	資本財・サービス	8.2%	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	アメリカ	1.2%
合計	1,707	-	カナダ・ドル	2.9%	コミュニケーション・サービス	7.8%	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	1.1%
国・地域別構成			台湾ドル	2.8%	生活必需品	6.2%	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.0%
アメリカ		58.2%	スイス・フラン	2.4%	素材	5.5%	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.0%
中国		6.0%	インド・ルピー	1.8%	エネルギー	5.3%	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	0.7%
その他		35.0%	その他	8.6%	公益事業、他	3.8%	TESLA INC	アメリカ	0.7%
合計		99.2%	合計	100.0%	合計	91.8%	合計		16.0%

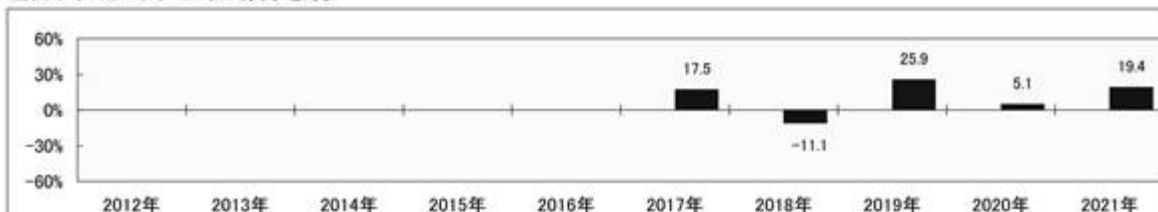
※株式業種別構成は、原則としてS&PとMSCI Incが共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

※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

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2017年は設定日(1月11日)から年末、2021年は5月31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オンライン 日本債券インデックス】

(1) 【投資状況】（2021年5月31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	2,890,280,955	99.90
内 日本	2,890,280,955	99.90
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,864,691	0.10
純資産総額	2,893,145,646	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】（2021年5月31日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
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	2,040,438,373	1.4177 2,892,919,049	1.4165 2,890,280,955	99.90

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	1,379,006,108	1,379,006,108	1.0010	1.0010
第2計算期間末 (2018年11月30日)	2,161,576,187	2,161,576,187	1.0025	1.0025
第3計算期間末 (2019年12月2日)	2,135,143,578	2,135,143,578	1.0249	1.0249
2020年5月末日	2,216,381,079	-	1.0187	-
6月末日	2,257,624,299	-	1.0144	-
7月末日	2,329,359,448	-	1.0180	-
8月末日	2,303,651,886	-	1.0130	-
9月末日	2,337,777,742	-	1.0159	-
10月末日	2,417,824,564	-	1.0140	-
第4計算期間末 (2020年11月30日)	2,402,441,089	2,402,441,089	1.0153	1.0153
12月末日	2,511,277,862	-	1.0153	-
2021年1月末日	2,551,104,364	-	1.0127	-
2月末日	2,563,115,765	-	1.0041	-
3月末日	2,615,051,062	-	1.0111	-
4月末日	2,874,602,932	-	1.0129	-
5月末日	2,893,145,646	-	1.0133	-

【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
2020年12月1日～ 2021年5月31日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)

第1計算期間	0.1
第2計算期間	0.1
第3計算期間	2.2
第4計算期間	0.9
2020年12月1日～ 2021年5月31日	0.2

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	1,498,842,558	122,203,095
第2計算期間	1,389,815,832	611,289,476
第3計算期間	844,707,447	917,630,059
第4計算期間	862,550,219	579,555,037
2020年12月1日～ 2021年5月31日	819,269,853	330,308,863

(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 (2021年5月31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	80,513,188,400	88.78
内 日本	80,513,188,400	88.78
地方債証券	3,812,142,600	4.20
内 日本	3,812,142,600	4.20
特殊債券	2,885,269,100	3.18
内 日本	2,885,269,100	3.18
社債券	2,680,207,800	2.96
内 日本	2,680,207,800	2.96
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	795,690,224	0.88
純資産総額	90,686,498,124	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 (2021年5月31日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	135 5年国債	日本	国債証券	1,550,000,000	100.54 1,558,463,000	100.42 1,556,572,000	0.100000 2023/03/20	1.72
2	138 5年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	100.75 1,209,010,000	100.60 1,207,224,000	0.100000 2023/12/20	1.33
3	349 10年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	101.38 1,064,532,000	101.05 1,061,046,000	0.100000 2027/12/20	1.17
4	342 10年国債	日本	国債証券	1,030,000,000	101.06 1,040,967,500	100.96 1,039,929,200	0.100000 2026/03/20	1.15
5	359 10年国債	日本	国債証券	980,000,000	100.85 988,387,440	100.54 985,301,800	0.100000 2030/06/20	1.09
6	360 10年国債	日本	国債証券	980,000,000	100.63 986,240,400	100.46 984,537,400	0.100000 2030/09/20	1.09
7	136 5年国債	日本	国債証券	950,000,000	100.60 955,709,500	100.48 954,588,500	0.100000 2023/06/20	1.05
8	134 5年国債	日本	国債証券	950,000,000	100.49 954,681,100	100.35 953,401,000	0.100000 2022/12/20	1.05
9	141 5年国債	日本	国債証券	920,000,000	100.91 928,436,400	100.74 926,863,200	0.100000 2024/09/20	1.02
10	334 10年国債	日本	国債証券	900,000,000	102.60 923,436,000	102.23 920,124,000	0.600000 2024/06/20	1.01
11	139 5年国債	日本	国債証券	900,000,000	100.78 907,109,500	100.66 905,940,000	0.100000 2024/03/20	1.00
12	132 5年国債	日本	国債証券	880,000,000	100.34 883,071,200	100.23 882,032,800	0.100000 2022/06/20	0.97
13	145 5年国債	日本	国債証券	870,000,000	100.97 878,506,600	100.95 878,273,700	0.100000 2025/09/20	0.97
14	142 5年国債	日本	国債証券	850,000,000	100.88 857,493,700	100.80 856,825,500	0.100000 2024/12/20	0.94
15	345 10年国債	日本	国債証券	830,000,000	101.18 839,852,900	101.00 838,333,200	0.100000 2026/12/20	0.92
16	344 10年国債	日本	国債証券	820,000,000	101.16 829,569,400	100.98 828,077,000	0.100000 2026/09/20	0.91
17	351 10年国債	日本	国債証券	800,000,000	101.36 810,936,000	101.02 808,200,000	0.100000 2028/06/20	0.89

18	137	5年国債	日本	国債証券	800,000,000	100.66 805,293,600	100.54 804,344,000	0.100000 2023/09/20	0.89
19	343	10年国債	日本	国債証券	780,000,000	101.08 788,437,800	100.96 787,519,200	0.100000 2026/06/20	0.87
20	340	10年国債	日本	国債証券	760,000,000	102.46 778,711,200	102.24 777,092,400	0.400000 2025/09/20	0.86
21	352	10年国債	日本	国債証券	750,000,000	101.33 759,997,500	100.98 757,410,000	0.100000 2028/09/20	0.84
22	415	2年国債	日本	国債証券	750,000,000	100.40 753,067,500	100.27 752,055,000	0.100000 2022/08/01	0.83
23	333	10年国債	日本	国債証券	700,000,000	102.43 717,045,000	102.06 714,455,000	0.600000 2024/03/20	0.79
24	346	10年国債	日本	国債証券	700,000,000	101.26 708,869,000	101.01 707,133,000	0.100000 2027/03/20	0.78
25	144	5年国債	日本	国債証券	700,000,000	101.00 707,007,500	100.91 706,412,000	0.100000 2025/06/20	0.78
26	143	5年国債	日本	国債証券	700,000,000	100.98 706,878,000	100.85 706,013,000	0.100000 2025/03/20	0.78
27	140	5年国債	日本	国債証券	700,000,000	100.85 705,968,000	100.70 704,928,000	0.100000 2024/06/20	0.78
28	335	10年国債	日本	国債証券	690,000,000	102.40 706,608,300	102.07 704,303,700	0.500000 2024/09/20	0.78
29	355	10年国債	日本	国債証券	690,000,000	101.20 698,286,900	100.84 695,830,500	0.100000 2029/06/20	0.77
30	358	10年国債	日本	国債証券	660,000,000	100.88 665,838,400	100.65 664,342,800	0.100000 2030/03/20	0.73

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	88.78%
地方債証券	4.20%
特殊債券	3.18%
社債券	2.96%
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。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（参考情報）運用実績

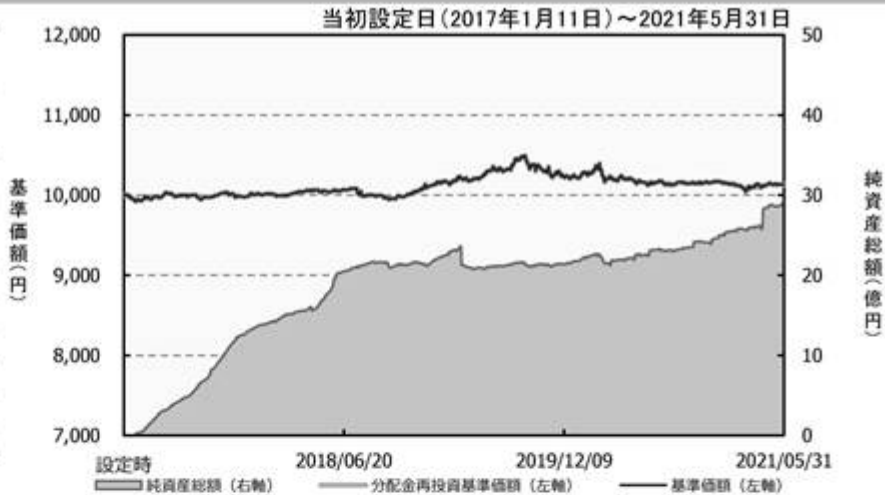
●FWO 日本債券インデックス

2021年5月31日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,133円
純資産総額	28億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.0%
3カ月間	0.9%
6カ月間	-0.2%
1年間	-0.5%
3年間	0.7%
5年間	-
設定来	1.3%

※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	第2期	第3期	第4期				
	17年11月	18年11月	19年12月	20年11月				
分配金	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	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	利率(%)	償還日	比率	
国内債券	341	99.0%	直接利回り(%)	135 5年国債	0.100	2023/03/20	1.7%	
国内債券先物	-	-	最終利回り(%)	138 5年国債	0.100	2023/12/20	1.3%	
コール・ローン、その他		1.0%	修正デュレーション	349 10年国債	0.100	2027/12/20	1.2%	
合計	341	100.0%	残存年数	342 10年国債	0.100	2026/03/20	1.1%	
債券種別構成		比率	格付別構成	比率				
国債		88.5%	AAA	92.0%	360 10年国債	0.100	2030/09/20	1.1%
地方債		5.0%	AA	3.7%	136 5年国債	0.100	2023/06/20	1.1%
事業債		3.4%	A	2.3%	134 5年国債	0.100	2022/12/20	1.1%
政府保証債		1.8%	BBB	-	141 5年国債	0.100	2024/09/20	1.0%
その他		0.3%	BB以下・無格付	2.0%	334 10年国債	0.600	2024/06/20	1.0%
合計		99.0%	合計	100.0%	合計			11.7%

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を2.0%保有しております。

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

年間収益率の推移

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



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

・2017年※は設定日(1月11日)から年末、2021年は5月31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オンライン 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)】

(1) 【投資状況】（2021年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	4,849,616,647	99.80
内 日本	4,849,616,647	99.80
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	9,525,953	0.20
純資産総額	4,859,142,600	100.00

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

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

(2) 【投資資産】（2021年5月31日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
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	4,687,431,517	1.0679 5,006,093,843	1.0346 4,849,616,647	99.80

(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
親投資信託受益証券	99.80%
合計	99.80%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	2,166,190,168	2,166,190,168	1.0078	1.0078
第2計算期間末 (2018年11月30日)	3,598,169,224	3,598,169,224	0.9860	0.9860
第3計算期間末 (2019年12月2日)	3,539,153,139	3,539,153,139	1.0567	1.0567
2020年5月末日	3,659,412,427	-	1.0952	-
6月末日	3,833,680,565	-	1.1027	-
7月末日	3,949,218,146	-	1.1134	-
8月末日	3,891,047,792	-	1.0993	-
9月末日	3,964,128,191	-	1.1109	-
10月末日	4,026,872,768	-	1.1085	-
第4計算期間末 (2020年11月30日)	3,993,652,896	3,993,652,896	1.1094	1.1094
12月末日	4,106,518,219	-	1.1080	-
2021年1月末日	4,181,684,401	-	1.1011	-
2月末日	4,116,491,010	-	1.0681	-
3月末日	4,185,901,242	-	1.0660	-
4月末日	4,790,196,268	-	1.0646	-
5月末日	4,859,142,600	-	1.0665	-

【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
2020年12月1日～ 2021年5月31日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.8
第2計算期間	2.2

第3計算期間	7.2
第4計算期間	5.0
2020年12月1日～ 2021年5月31日	3.9

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	2,296,791,192	148,346,007
第2計算期間	2,190,846,317	691,122,259
第3計算期間	1,134,630,067	1,434,493,694
第4計算期間	1,133,997,978	883,504,385
2020年12月1日～ 2021年5月31日	1,353,107,236	396,906,390

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

外国債券インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド

(1) 投資状況 (2021年5月31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	115,482,597,644	98.99
内 ユーロ	47,461,815,763	40.68
内 シンガポール	535,068,497	0.46
内 マレーシア	548,697,359	0.47
内 イスラエル	467,800,679	0.40
内 ノルウェー	214,743,595	0.18
内 スウェーデン	424,106,814	0.36
内 デンマーク	577,425,303	0.49
内 イギリス	7,609,833,848	6.52
内 ポーランド	778,141,195	0.67
内 カナダ	2,450,643,267	2.10
内 アメリカ	50,995,421,356	43.71
内 メキシコ	857,619,452	0.74
内 オーストラリア	2,561,280,516	2.20
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,182,477,959	1.01
純資産総額	116,665,075,603	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(売建)	116,872,761,772	100.18
内 日本	116,872,761,772	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) 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 (2021年5月31日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	34,000,000	102.84 3,837,998,163	102.21 3,814,313,664	1.625000 2022/11/15	3.27
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	25,220,000	103.18 2,856,281,363	102.20 2,829,240,208	1.750000 2022/09/30	2.43
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	15,000,000	108.62 1,788,437,707	106.78 1,758,042,384	2.750000 2024/02/15	1.51
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	15,520,000	104.39 1,778,379,559	103.16 1,757,373,155	1.750000 2023/05/15	1.51
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	14,820,000	108.44 1,763,999,833	105.80 1,721,118,637	2.000000 2025/08/15	1.48
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	13,905,000	108.08 1,649,657,089	106.25 1,621,707,934	2.750000 2023/11/15	1.39
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	13,800,000	109.83 1,663,593,751	107.00 1,620,716,160	2.250000 2025/11/15	1.39
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	13,500,000	112.38 1,665,322,561	107.09 1,586,920,507	2.250000 2027/08/15	1.36
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	13,300,000	110.01 1,606,029,350	107.44 1,568,490,705	2.500000 2025/01/31	1.34
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	12,200,000	107.60 1,440,854,862	105.59 1,413,966,296	2.125000 2024/07/31	1.21
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	12,000,000	105.69 1,392,085,215	104.14 1,371,648,768	1.625000 2026/02/15	1.18

12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	11,310,000	107.18 1,330,603,983	105.14 1,305,192,819	2.500000 2023/08/15	1.12
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	11,000,000	104.78 1,265,083,881	103.23 1,246,357,728	2.000000 2023/02/15	1.07
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,580,000	107.91 1,134,676,558	106.53 1,120,174,317	2.500000 2024/05/15	0.96
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	11,800,000	93.12 1,206,188,463	83.67 1,083,680,017	1.125000 2040/05/15	0.93
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,450,000	139.06 1,137,164,336	131.43 1,074,776,121	6.125000 2027/11/15	0.92
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,165,000	105.47 1,060,977,751	104.08 1,047,043,473	1.625000 2026/05/15	0.90
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,300,000	108.71 990,356,796	106.26 968,046,210	2.125000 2025/05/15	0.83
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,810,000	108.53 930,424,093	106.28 911,067,939	2.250000 2024/11/15	0.78
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	106.64 819,336,448	104.87 805,775,600	1.875000 2024/08/31	0.69
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,300,000	120.61 834,052,080	112.92 780,862,824	3.125000 2028/11/15	0.67
22	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,696,000	164.49 813,081,868	157.79 780,000,311	6.250000 2030/01/04	0.67
23	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,270,000	172.67 755,137,365	163.66 715,764,563	4.750000 2034/07/04	0.61
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,900,000	98.34 744,847,275	94.08 712,547,102	0.875000 2030/11/15	0.61
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	98.82 705,061,666	96.74 690,196,124	0.625000 2027/11/30	0.59
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,850,000	109.59 703,692,269	105.80 679,363,251	2.000000 2026/11/15	0.58
27	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,730,000	106.90 676,238,923	104.79 662,929,225	1.750000 2023/05/25	0.57
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,400,000	116.50 690,513,110	110.96 657,664,358	2.875000 2028/05/15	0.56
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,750,000	106.28 670,760,647	103.26 651,751,312	1.500000 2026/08/15	0.56
30	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,300,000	108.88 626,203,446	106.96 615,130,710	1.000000 2025/08/15	0.53

(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	98.99%
合計	98.99%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(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	カナダ・ドル売/円買 2021年6月	売建	27,341,000	2,429,172,437	2,482,762,389	2.13%
		英ポンド売/円買 2021年 6月	売建	49,975,000	7,562,131,500	7,775,975,067	6.67%
		マレーシア・リングギット 売/円買 2021年6月	売建	19,880,000	520,856,000	525,670,936	0.45%
		米ドル売/円買 2021年6 月	売建	469,304,000	51,281,756,311	51,509,539,918	44.15%
		豪ドル売/円買 2021年6 月	売建	30,592,000	2,582,732,659	2,587,471,360	2.22%
		シンガポール・ドル売/ 円買 2021年6月	売建	6,578,000	540,262,980	545,373,428	0.47%
		ユーロ売/円買 2021年6 月	売建	358,811,000	47,233,911,262	47,989,787,172	41.13%
		デンマーク・クローネ 売/円買 2021年6月	売建	32,876,000	581,852,599	591,153,218	0.51%
		イスラエル・シケル 売/円買 2021年6月	売建	14,802,000	498,854,043	500,169,941	0.43%
		ノルウェー・クローネ 売/円買 2021年6月	売建	16,732,000	220,094,401	219,523,840	0.19%
ポーランド・ズロチ売/ 円買 2021年6月	売建	27,284,000	786,996,066	814,154,560	0.70%		

スウェーデン・クローネ 売/円買 2021年6月	売建	32,897,000	425,272,677	434,240,400	0.37%
メキシコ・ペソ売/円買 2021年6月	売建	162,917,000	879,458,549	896,939,543	0.77%

(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

●FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

2021年5月31日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,665円
純資産総額	48億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.2%
3カ月間	-0.1%
6カ月間	-3.9%
1年間	-2.6%
3年間	7.4%
5年間	-
設定来	6.7%



※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	第2期	第3期	第4期				
	17年11月	18年11月	19年12月	20年11月				
分配金	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。

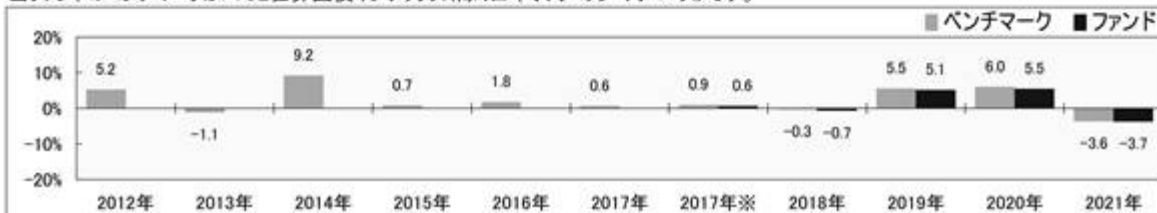
資産別構成		通貨別構成		債券ポートフォリオ特性値		組入上位10銘柄		
銘柄数	比率		比率			組入上位10銘柄	償還日	
外国債券	490	日本円	99.9%	直接利回り(%)	2.2	United States Treasury Note/Bond	2022/11/15	3.3%
		ユーロ	0.0%	最終利回り(%)	0.6	United States Treasury Note/Bond	2022/09/30	2.4%
コール・ローン、その他	1.2%	マレーシア・リンギット	0.0%	修正デュレーション	7.9	United States Treasury Note/Bond	2024/02/15	1.5%
合計	490	メキシコ・ペソ	0.0%	残存年数	9.7	United States Treasury Note/Bond	2023/05/15	1.5%
債券種別構成		米ドル <th colspan="2">格付別構成</th> <th colspan="2"></th>		格付別構成				
	比率		比率					
国債	98.8%	英ポンド	0.0%	AAA	79.6%	United States Treasury Note/Bond	2023/11/15	1.4%
		ノルウェー・クローネ	0.0%	AA	8.9%	United States Treasury Note/Bond	2025/11/15	1.4%
		南アフリカ・ランド	0.0%	A	11.5%	United States Treasury Note/Bond	2027/08/15	1.4%
		スウェーデン・クローネ	-0.0%	BBB	-	United States Treasury Note/Bond	2025/01/31	1.3%
		その他	-0.0%	BB	-	United States Treasury Note/Bond	2024/07/31	1.2%
合計	98.8%	合計	100.0%	合計	100.0%	合計		16.8%

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

年間収益率の推移

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



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

・2017年※は設定日(1月11日)から年末、2021年は5月31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) 【投資状況】（2021年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	3,119,463,752	99.81
内 日本	3,119,463,752	99.81
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	6,068,803	0.19
純資産総額	3,125,532,555	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】（2021年5月31日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
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	801,370,561	3.0205 2,420,547,447	3.1109 2,492,983,678	79.76
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	428,596,890	1.3855 593,830,122	1.4617 626,480,074	20.04

(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	99.81%
合計	99.81%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	1,406,787,686	1,406,787,686	1.0477	1.0477
第2計算期間末 (2018年11月30日)	2,442,336,372	2,442,336,372	1.0222	1.0222
第3計算期間末 (2019年12月2日)	2,833,746,066	2,833,746,066	1.0673	1.0673
2020年5月末日	2,269,334,065	-	1.0722	-
6月末日	2,381,012,578	-	1.0882	-
7月末日	2,434,737,131	-	1.0968	-
8月末日	2,424,787,069	-	1.0959	-
9月末日	2,431,264,622	-	1.0946	-
10月末日	2,442,221,919	-	1.0808	-
第4計算期間末 (2020年11月30日)	2,462,912,432	2,462,912,432	1.1005	1.1005
12月末日	2,542,824,148	-	1.1135	-
2021年1月末日	2,584,169,338	-	1.1107	-
2月末日	2,592,244,920	-	1.1022	-
3月末日	2,667,719,510	-	1.1207	-
4月末日	3,035,856,677	-	1.1246	-
5月末日	3,125,532,555	-	1.1417	-

【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
2020年12月1日～ 2021年5月31日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	4.8
第2計算期間	2.4
第3計算期間	4.4
第4計算期間	3.1
2020年12月1日～ 2021年5月31日	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	1,434,988,289	93,204,954
第2計算期間	1,446,419,314	399,973,906
第3計算期間	1,008,953,213	743,168,804
第4計算期間	695,143,661	1,112,174,309
2020年12月1日～ 2021年5月31日	741,439,357	241,696,912

(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 (2021年5月31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	221,706,401,058	98.82
内 ユーロ	90,956,369,227	40.54
内 シンガポール	924,396,011	0.41
内 マレーシア	1,061,833,109	0.47
内 イスラエル	988,854,397	0.44
内 ノルウェー	552,922,706	0.25
内 スウェーデン	784,676,071	0.35
内 デンマーク	1,090,784,452	0.49
内 イギリス	14,581,676,553	6.50
内 ポーランド	1,399,740,095	0.62
内 カナダ	4,541,272,415	2.02
内 アメリカ	98,215,325,770	43.78
内 メキシコ	1,775,745,502	0.79

	内 オーストラリア	4,832,804,750	2.15
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		2,649,023,182	1.18
純資産総額		224,355,424,240	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	1,076,503,767	0.48
内 日本	1,076,503,767	0.48

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

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

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

(2) 投資資産 (2021年5月31日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,700,000	95.68 1,123,724,732	95.96 1,127,078,901	1.125000 2031/02/15	0.50
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,000,000	98.10 1,076,756,576	92.22 1,012,228,672	0.625000 2030/08/15	0.45
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,800,000	99.33 1,068,512,496	94.08 1,012,023,420	0.875000 2030/11/15	0.45
4	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,864,000	189.46 979,080,282	172.52 891,570,124	4.500000 2041/04/25	0.40
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,729,000	105.20 892,479,948	104.08 882,989,526	1.625000 2026/05/15	0.39
6	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,087,000	128.09 871,475,605	122.44 833,050,262	2.500000 2030/05/25	0.37
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	116.60 857,474,425	111.11 817,145,528	2.875000 2028/08/15	0.36
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,500,000	99.60 819,981,288	98.73 812,811,216	0.250000 2025/06/30	0.36
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,800,000	98.33 841,873,468	92.56 792,483,444	0.625000 2030/05/15	0.35
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	115.31 835,338,577	109.36 792,243,070	2.625000 2029/02/15	0.35

11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,500,000	116.28 829,652,241	110.96 791,633,024	2.875000 2028/05/15	0.35
12	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	5,730,000	101.88 780,790,850	101.31 776,369,125	- 2023/04/14	0.35
13	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	3,571,000	173.86 830,363,650	161.46 771,138,268	4.000000 2037/01/04	0.34
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,350,000	114.92 801,025,199	110.19 768,060,582	2.750000 2028/02/15	0.34
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,400,000	111.71 784,722,534	107.83 757,480,980	2.375000 2027/05/15	0.34
16	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	4,920,000	119.56 786,738,656	113.85 749,179,970	1.500000 2031/05/25	0.33
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,668,000	102.86 752,833,395	102.21 748,054,220	1.625000 2022/11/15	0.33
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,000,000	96.94 744,811,637	97.22 747,006,803	0.750000 2028/01/31	0.33
19	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	5,086,000	110.45 751,316,721	108.58 738,576,544	2.250000 2024/05/25	0.33
20	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	5,101,000	108.38 739,431,325	106.64 727,533,622	1.000000 2025/11/25	0.32
21	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	3,448,000	163.79 755,316,924	156.40 721,229,787	5.500000 2031/01/04	0.32
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,162,000	107.84 729,386,554	106.48 720,222,131	2.375000 2024/08/15	0.32
23	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	4,499,000	123.39 742,445,049	119.60 719,682,879	2.750000 2027/10/25	0.32
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,287,000	103.67 715,448,468	102.85 709,789,967	2.000000 2022/11/30	0.32
25	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	4,899,000	109.92 720,239,747	108.13 708,505,254	1.750000 2024/11/25	0.32
26	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	4,950,000	110.17 729,372,822	106.69 706,301,669	0.750000 2028/11/25	0.31
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,500,000	99.51 709,979,816	98.39 701,953,616	0.250000 2025/09/30	0.31
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,900,000	111.12 719,627,720	107.09 693,543,036	2.250000 2027/08/15	0.31
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,921,000	107.71 700,047,389	106.28 690,708,485	2.250000 2024/11/15	0.31
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	5,840,000	109.21 700,085,632	107.00 685,868,288	2.250000 2025/11/15	0.31

(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	98.82%
合計	98.82%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	デンマーク・クローネ 買/円売 2021年7月	買建	361,000	6,502,158	6,494,390	0.00%
		米ドル買/円売 2021年7 月	買建	2,667,000	293,092,632	292,671,246	0.13%
		英ポンド買/円売 2021年 6月	買建	108,000	16,804,713	16,804,659	0.01%
		マレーシア・リングgit 買/円売 2021年6月	買建	200,000	5,295,800	5,296,360	0.00%
		ユーロ買/円売 2021年6 月	買建	973,000	130,187,159	130,131,878	0.06%
		ユーロ買/円売 2021年7 月	買建	3,236,000	433,497,537	432,953,177	0.19%
		豪ドル買/円売 2021年7 月	買建	237,000	20,163,888	20,045,460	0.01%
		スウェーデン・クローネ 買/円売 2021年7月	買建	1,680,000	22,289,608	22,176,000	0.01%
		米ドル買/円売 2021年6 月	買建	1,366,000	150,003,654	149,930,597	0.07%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

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（2021年5月31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	19,884,916,393	96.32
内 中国	2,017,498,057	9.77
内 タイ	1,741,958,905	8.44
内 マレーシア	1,457,540,080	7.06
内 フィリピン	27,519,089	0.13
内 インドネシア	1,955,211,052	9.47
内 ポーランド	1,589,249,833	7.70
内 ロシア	1,514,800,897	7.34
内 ハンガリー	805,496,544	3.90
内 ルーマニア	564,009,821	2.73
内 トルコ	327,229,251	1.59
内 チェコ	857,508,006	4.15
内 メキシコ	1,830,552,907	8.87
内 ドミニカ共和国	23,541,388	0.11
内 コロンビア	890,322,476	4.31
内 ペルー	458,114,526	2.22
内 チリ	450,104,768	2.18
内 ブラジル	1,722,235,226	8.34
内 ウルグアイ	24,662,732	0.12
内 南アフリカ	1,627,360,835	7.88
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	759,211,643	3.68
純資産総額	20,644,128,036	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)	399,935,611	1.94
内 日本	399,935,611	1.94
為替予約取引(売建)	17,588,840	0.09
内 日本	17,588,840	0.09

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

(注2) 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（2021年5月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証 券	25,700,000	84.32 455,265,914	82.64 446,231,800	- 2024/01/01	2.16
2	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリ カ	国債証 券	34,550,000	114.42 314,303,007	114.33 314,033,069	10.500000 2026/12/21	1.52
3	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証 券	12,210,000	112.78 289,311,613	104.60 268,326,244	10.000000 2023/01/01	1.30
4	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証 券	10,690,000	117.67 264,281,792	106.29 238,715,984	10.000000 2025/01/01	1.16
5	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証 券	12,700,000	87.56 233,641,053	86.27 230,183,222	- 2023/07/01	1.12
6	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証 券	9,150,000	117.27 225,439,525	106.32 204,382,337	10.000000 2027/01/01	0.99
7	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリ カ	国債証 券	26,900,000	91.92 196,582,726	94.63 202,390,233	8.000000 2030/01/31	0.98
8	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリ カ	国債証 券	29,520,000	77.49 181,861,325	83.65 196,324,900	8.750000 2048/02/28	0.95
9	Mexican Bonos	メキシコ	国債証 券	30,730,000	119.44 202,190,840	112.40 190,283,519	8.500000 2029/05/31	0.92
10	Poland Government Bond	ポーラン ド	国債証 券	5,990,000	109.48 195,696,803	106.22 189,863,538	2.500000 2026/07/25	0.92
11	Mexican Bonos	メキシコ	国債証 券	30,230,000	112.22 186,886,049	105.91 176,371,471	7.500000 2027/06/03	0.85
12	Mexican Bonos	メキシコ	国債証 券	31,450,000	103.41 179,163,322	101.71 176,223,293	6.500000 2022/06/09	0.85
13	Poland Government Bond	ポーラン ド	国債証 券	5,450,000	112.99 183,753,992	107.87 175,435,542	2.750000 2029/10/25	0.85

14	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	5,500,000	108.01 177,268,247	105.53 173,207,904	2.500000 2024/04/25	0.84
15	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	30,900,000	103.16 175,614,340	98.47 167,619,588	5.750000 2026/03/05	0.81
16	China Government Bond	中国	国債証券	9,400,000	95.88 155,384,051	96.41 156,252,252	2.680000 2030/05/21	0.76
17	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	24,150,000	120.74 160,631,907	113.33 150,779,327	10.000000 2024/12/05	0.73
18	China Government Bond	中国	国債証券	8,600,000	98.07 145,413,381	99.06 146,875,839	2.850000 2027/06/04	0.71
19	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	4,500,000	111.37 149,549,479	108.10 145,157,166	2.750000 2028/04/25	0.70
20	China Government Bond	中国	国債証券	8,200,000	101.87 144,024,386	101.79 143,913,714	3.290000 2029/05/23	0.70
21	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	19,600,000	86.71 135,126,500	90.68 141,297,576	8.250000 2032/03/31	0.68
22	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	20,900,000	79.37 131,877,873	85.02 141,269,965	8.500000 2037/01/31	0.68
23	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	4,500,000	105.82 142,098,257	103.56 139,067,548	2.500000 2023/01/25	0.67
24	China Government Bond	中国	国債証券	8,000,000	96.54 133,156,284	96.67 133,329,584	1.990000 2025/04/09	0.65
25	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	22,750,000	110.54 138,533,214	106.31 133,233,308	8.000000 2023/12/07	0.65
26	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	4,140,000	109.60 135,400,438	106.25 131,267,787	2.500000 2027/07/25	0.64
27	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証券	5,900,000	120.85 149,800,856	105.80 131,150,414	10.000000 2029/01/01	0.64
28	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	23,000,000	105.12 133,195,863	102.99 130,489,699	6.750000 2023/03/09	0.63
29	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	22,000,000	112.38 136,198,531	106.65 129,261,535	8.000000 2024/09/05	0.63
30	Indonesia Treasury Bond	インドネシア	国債証券	16,000,000,000	101.35 124,870,399	104.06 128,201,920	6.500000 2025/06/15	0.62

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	96.32%

合計	96.32%
----	--------

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	オフショア人民元買/ 円売 2021年6月	買建	1,300,000	22,410,700	22,408,230	0.11%
		タイ・パーツ買/円売 2021年6月	買建	7,050,000	24,738,450	24,745,500	0.12%
		米ドル買/円売 2021年 6月	買建	30,000	3,295,260	3,292,779	0.02%
		南アフリカ・ランド 買/円売 2021年6月	買建	5,132,000	39,836,886	40,778,872	0.20%
		インドネシア・ルピア 買/円売 2021年6月	買建	3,100,000,000	23,839,000	23,870,000	0.12%
		ハンガリー・フォリン ト買/円売 2021年6月	買建	19,033,000	7,234,443	7,319,730	0.04%
		メキシコ・ペソ買/円 売 2021年6月	買建	8,933,000	48,670,551	49,180,631	0.24%
		ウルグアイ・ペソ買/ 円売 2021年6月	買建	7,014,146	17,589,048	17,570,435	0.09%
		トルコ・リラ買/円売 2021年6月	買建	2,292,000	29,758,746	29,324,764	0.14%
		チェコ・コルナ買/円 売 2021年6月	買建	3,938,000	20,233,914	20,685,920	0.10%
		ポーランド・ズロチ 買/円売 2021年6月	買建	2,559,000	74,095,452	76,360,560	0.37%
		ルーマニア・レイ買/ 円売 2021年6月	買建	2,172,000	58,129,259	59,068,190	0.29%
ロシア・ルーブル買/ 円売 2021年6月	買建	17,000,000	25,263,700	25,330,000	0.12%		

	米ドル売/円買 2021年 6月	売建	160,250	17,589,048	17,588,840	0.09%
--	---------------------	----	---------	------------	------------	-------

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(参考情報) 運用実績

●FWO 外国債券インデックスEM+（為替ヘッジなし）

2021年5月31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	11,417円
純資産総額	31億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.5%
3カ月間	3.6%
6カ月間	3.7%
1年間	6.5%
3年間	14.2%
5年間	-
設定来	14.2%



※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)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円				設定来分配金合計額: 0円			
	第1期 17年11月	第2期 18年11月	第3期 19年12月	第4期 20年11月				
分配金	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。

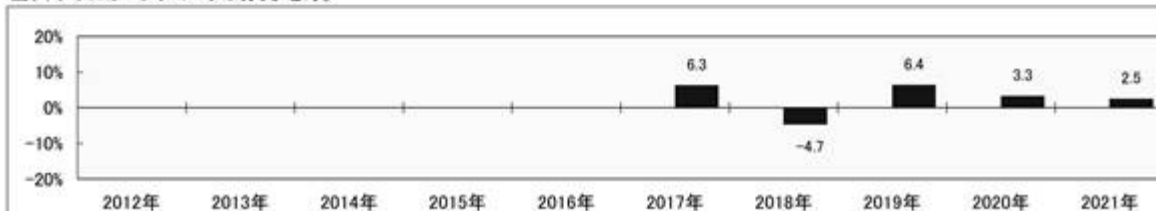
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	相入上位10銘柄	償還日	比率
外国債券	1,040	98.1%	米ドル	35.1%	直接利回り(%)	Brazil Letras do Tesouro Nacional	2024/01/01	0.4%
			ユーロ	32.8%	最終利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2031/02/15	0.4%
コール・ローン、その他		1.9%	英ポンド	5.3%	修正デュレーション	United States Treasury Note/Bond	2030/08/15	0.4%
合計	1,040	100.0%	メキシコ・ペソ	2.5%	残存年数	United States Treasury Note/Bond	2030/11/15	0.4%
債券種別構成			ポーランド・ズロチ	2.1%	格付別構成	FRENCH GOVERNMENT BOND	2041/04/25	0.3%
国債		98.1%	オフショア人民元	2.0%	AAA	United States Treasury Note/Bond	2026/05/15	0.3%
			インドネシア・ルピア	1.9%	AA	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2026/12/21	0.3%
			マレーシア・リンギット	1.8%	A	FRENCH GOVERNMENT BOND	2030/05/25	0.3%
			豪ドル	1.8%	BBB	United States Treasury Note/Bond	2028/08/15	0.3%
			その他	14.6%	BB	United States Treasury Note/Bond	2025/06/30	0.3%
合計		98.1%	合計	100.0%	合計	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、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2017年は設定日(1月11日)から年末、2021年は5月31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オンライン J-REITインデックス】

(1) 【投資状況】（2021年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	1,570,939,526	99.95
内 日本	1,570,939,526	99.95
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	783,991	0.05
純資産総額	1,571,723,517	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】（2021年5月31日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	ダイワJ-REITマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	465,560,124	2.7612 1,285,536,193	3.3743 1,570,939,526	99.95

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	564,311,815	564,311,815	0.9372	0.9372
第2計算期間末 (2018年11月30日)	1,027,403,305	1,027,403,305	1.0585	1.0585
第3計算期間末 (2019年12月2日)	1,183,900,381	1,183,900,381	1.3333	1.3333
2020年5月末日	1,123,715,555	-	1.0467	-
6月末日	1,099,350,319	-	1.0285	-
7月末日	1,100,248,464	-	1.0311	-
8月末日	1,151,642,149	-	1.0892	-
9月末日	1,136,976,263	-	1.0784	-
10月末日	1,155,784,293	-	1.0239	-
第4計算期間末 (2020年11月30日)	1,177,153,445	1,177,153,445	1.0596	1.0596
12月末日	1,294,465,603	-	1.1232	-
2021年1月末日	1,329,879,248	-	1.1665	-
2月末日	1,397,998,710	-	1.2263	-
3月末日	1,460,899,938	-	1.2814	-
4月末日	1,535,860,178	-	1.3159	-
5月末日	1,571,723,517	-	1.3249	-

【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
2020年12月1日～ 2021年5月31日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	6.3
第2計算期間	12.9

第3計算期間	26.0
第4計算期間	20.5
2020年12月1日～ 2021年5月31日	25.0

(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	639,909,329	38,785,261
第2計算期間	587,481,644	218,964,687
第3計算期間	281,360,657	364,052,038
第4計算期間	494,302,320	271,347,931
2020年12月1日～ 2021年5月31日	284,338,051	208,961,115

(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 (2021年5月31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	462,950,829,610	97.53
内 日本	462,950,829,610	97.53
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	11,706,923,858	2.47
純資産総額	474,657,753,468	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)	11,611,600,000	2.45
内 日本	11,611,600,000	2.45

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

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

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

(2) 投資資産 (2021年5月31日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	46,569	674,260.53 31,399,638,637	694,000.00 32,318,886,000	6.81
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	41,379	674,671.00 27,917,211,416	660,000.00 27,310,140,000	5.75
3	GLP投資法人	日本	投資証券	129,299	164,000.00 21,205,036,099	186,900.00 24,165,983,100	5.09
4	野村不動産マスターF	日本	投資証券	133,809	172,034.18 23,019,722,846	173,400.00 23,202,480,600	4.89
5	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	206,104	108,455.72 22,353,159,696	110,800.00 22,836,323,200	4.81
6	日本プロロジスリート	日本	投資証券	65,417	317,544.05 20,772,779,610	339,500.00 22,209,071,500	4.68
7	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	59,039	288,325.13 17,022,427,776	306,000.00 18,065,934,000	3.81
8	オリックス不動産投資	日本	投資証券	82,446	184,380.14 15,201,405,597	203,500.00 16,777,761,000	3.53
9	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	88,493	147,424.74 13,046,057,666	157,000.00 13,893,401,000	2.93
10	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	39,304	325,762.54 12,803,770,961	352,000.00 13,835,008,000	2.91
11	産業ファンド	日本	投資証券	58,490	178,607.70 10,446,764,513	196,000.00 11,464,040,000	2.42
12	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	25,762	395,399.62 10,186,285,089	430,500.00 11,090,541,000	2.34
13	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	121,704	86,352.98 10,509,503,533	90,600.00 11,026,382,400	2.32
14	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	12,800	755,406.06 9,669,197,589	812,000.00 10,393,600,000	2.19
15	API投資法人	日本	投資証券	20,734	473,568.21 9,818,963,299	498,500.00 10,335,899,000	2.18
16	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	14,261	609,217.73 8,688,054,100	634,000.00 9,041,474,000	1.90
17	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	133,304	60,792.05 8,103,824,459	67,200.00 8,958,028,800	1.89

18	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	50,053	161,439.73 8,080,543,247	178,500.00 8,934,460,500	1.88
19	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	27,036	302,833.68 8,187,411,482	309,000.00 8,354,124,000	1.76
20	三井不ロジパーク	日本	投資証券	14,442	513,306.10 7,413,166,726	562,000.00 8,116,404,000	1.71
21	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	173,017	40,355.23 6,982,141,576	44,600.00 7,716,558,200	1.63
22	森ヒルズリート	日本	投資証券	48,606	151,127.21 7,345,689,479	157,800.00 7,670,026,800	1.62
23	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	13,732	465,859.50 6,397,182,679	504,000.00 6,920,928,000	1.46
24	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	8,816	735,479.89 6,483,990,771	778,000.00 6,858,848,000	1.45
25	イオンリート投資	日本	投資証券	41,969	146,720.73 6,157,722,360	154,100.00 6,467,422,900	1.36
26	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	日本	投資証券	28,202	198,078.89 5,586,220,863	225,200.00 6,351,090,400	1.34
27	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	18,604	319,654.47 5,946,851,808	339,000.00 6,306,756,000	1.33
28	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	54,033	106,837.00 5,772,724,043	112,000.00 6,051,696,000	1.27
29	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	38,396	135,253.51 5,193,193,983	157,200.00 6,035,851,200	1.27
30	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	34,301	171,287.23 5,875,323,348	174,900.00 5,999,244,900	1.26

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	97.53%
合計	97.53%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	日本	TREIT先物 030 6月	買建	5,600	10,827,600,000	11,611,600,000	2.45%

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

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

(参考情報) 運用実績

●FWO J-REITインデックス

2021年5月31日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	13,249円
純資産総額	15億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.7%
3カ月間	8.0%
6カ月間	25.0%
1年間	26.6%
3年間	33.5%
5年間	-
設定来	32.5%

※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	直近1年間分配金合計額: 0円				設定来分配金合計額: 0円			
	第1期 17年11月	第2期 18年11月	第3期 19年12月	第4期 20年11月				
分配金	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。

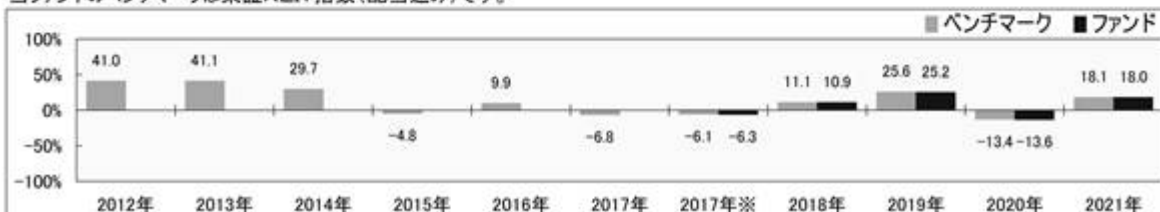
資産別構成	銘柄数	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	比率
国内リート	61	97.5%	オフィス不動産	29.8%	日本ビルファンド	オフィス不動産	6.8%
国内リート 先物	1	2.4%	各種不動産	24.3%	ジャパンリアルエステイト	オフィス不動産	5.8%
			工業用不動産	19.8%	GLP投資法人	工業用不動産	5.1%
			店舗用不動産	9.4%	野村不動産マスタード	各種不動産	4.9%
			住宅用不動産	9.1%	日本都市ファンド投資法人	店舗用不動産	4.8%
			ホテル・リゾート不動産	4.9%	日本プロロジリート	工業用不動産	4.7%
			ヘルスケア不動産	0.3%	大和ハウスリート投資法人	各種不動産	3.8%
					オリックス不動産投資	オフィス不動産	3.5%
					ユナイテッド・アーバン投資法人	各種不動産	2.9%
コール・ローン、その他		2.5%			アドバンス・レジデンス	住宅用不動産	2.9%
合計	62	-	合計	97.5%	合計		45.2%

※リート用途別構成の用途は、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額を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークは東証REIT指数(配当込み)です。



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

・2017年※は設定日(1月11日)から年末、2021年は5月31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オンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)】

(1) 【投資状況】(2021年5月31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	917,848,926	100.62
内 日本	917,848,926	100.62
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,618,430	0.62
純資産総額	912,230,496	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(売建)	905,724,767	99.29
内 日本	905,724,767	99.29

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

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

(注3) 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】(2021年5月31日現在)

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
			また は 額面金額			
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	332,421,472	2.2272 740,394,074	2.7611 917,848,926	100.62

(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	100.62%
合計	100.62%

(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。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	カナダ・ドル売/円買 2021年6月	売建	196,300	17,485,503	17,825,471	1.95%
		英ポンド売/円買 2021年 6月	売建	342,900	52,133,073	53,354,311	5.85%
		香港ドル売/円買 2021年 6月	売建	1,077,700	15,158,815	15,238,678	1.67%
		米ドル売/円買 2021年6 月	売建	6,147,300	671,864,491	674,711,043	73.96%
		ユーロ売/円買 2021年6 月	売建	325,200	42,692,645	43,494,426	4.77%
		シンガポール・ドル売/ 円買 2021年6月	売建	396,200	32,415,030	32,848,425	3.60%
		ニュージーランド・ドル 売/円買 2021年6月	売建	48,600	3,830,834	3,858,776	0.42%
		イスラエル・シュケル 売/円買 2021年6月	売建	12,100	405,175	408,867	0.04%
		豪ドル売/円買 2021年6 月	売建	756,500	64,022,684	63,984,770	7.01%

(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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	451,251,233	451,251,233	1.0301	1.0301
第2計算期間末 (2018年11月30日)	767,151,864	767,151,864	1.0317	1.0317

第3計算期間末 (2019年12月2日)	839,510,983	839,510,983	1.1735	1.1735
2020年5月末日	729,234,183	-	0.9194	-
6月末日	727,784,816	-	0.9238	-
7月末日	750,354,380	-	0.9585	-
8月末日	752,810,622	-	0.9777	-
9月末日	721,668,247	-	0.9393	-
10月末日	742,926,622	-	0.9192	-
第4計算期間末 (2020年11月30日)	822,409,605	822,409,605	1.0306	1.0306
12月末日	814,050,434	-	1.0395	-
2021年1月末日	833,155,510	-	1.0533	-
2月末日	863,283,437	-	1.0865	-
3月末日	898,150,809	-	1.1273	-
4月末日	891,868,110	-	1.1922	-
5月末日	912,230,496	-	1.2082	-

【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
2020年12月1日～ 2021年5月31日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	3.0
第2計算期間	0.2
第3計算期間	13.7
第4計算期間	12.2
2020年12月1日～ 2021年5月31日	17.2

(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	464,575,492	36,518,861
第2計算期間	460,818,025	155,301,672

第3計算期間	207,870,721	236,041,881
第4計算期間	336,517,235	253,930,894
2020年12月1日～ 2021年5月31日	126,602,402	169,580,271

(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 (2021年5月31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	290,514,963	0.71
内 アメリカ	290,514,963	0.71
投資証券	39,818,656,735	97.66
内 ガーンジー	99,838,226	0.24
内 韓国	49,211,119	0.12
内 香港	646,863,640	1.59
内 シンガポール	1,490,013,651	3.65
内 イスラエル	17,278,409	0.04
内 イギリス	2,258,758,226	5.54
内 アイルランド	47,104,916	0.12
内 オランダ	75,443,155	0.19
内 ベルギー	511,734,149	1.26
内 フランス	944,301,084	2.32
内 ドイツ	106,568,071	0.26
内 スペイン	185,069,438	0.45
内 イタリア	7,189,113	0.02
内 カナダ	797,965,812	1.96
内 アメリカ	29,576,760,460	72.54
内 オーストラリア	2,841,756,236	6.97
内 ニューゼaland	162,801,030	0.40
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	663,251,626	1.63
純資産総額	40,772,423,324	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)	698,509,448	1.71
内 ドイツ	184,569,224	0.45
内 アメリカ	513,940,224	1.26
為替予約取引(買建)	394,376,641	0.97
内 日本	394,376,641	0.97

(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 (2021年5月31日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	184,819	11,092.89 2,050,182,498	12,934.11 2,390,470,829	5.86
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	22,300	76,750.66 1,711,542,330	80,862.38 1,803,231,235	4.42
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	38,100	24,485.69 932,907,535	31,005.00 1,181,290,683	2.90
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	70,478	15,027.68 1,059,126,907	16,635.22 1,172,417,430	2.88
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	82,347	9,670.40 796,335,993	14,103.06 1,161,344,879	2.85
6	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	104,700	7,139.88 747,548,557	8,206.75 859,247,269	2.11
7	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	35,000	18,563.81 649,733,694	22,713.73 794,980,704	1.95
8	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	86,000	6,600.52 567,652,004	8,500.91 731,078,432	1.79
9	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	431,000	1,573.35 678,134,447	1,634.93 704,655,433	1.73
10	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	93,617	6,785.58 635,250,464	7,507.58 702,837,491	1.72
11	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	31,900	18,012.38 574,596,959	19,565.81 624,149,581	1.53
12	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	93,979	5,313.26 499,341,935	6,086.19 571,974,238	1.40

13	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	142,297	3,194.45 454,564,248	3,980.99 566,483,674	1.39
14	LINK REIT	香港	投資証券	533,700	974.65 520,179,134	1,058.37 564,856,872	1.39
15	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	33,100	12,334.93 408,289,770	16,443.14 544,268,119	1.33
16	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	16,267	27,574.45 448,554,729	32,411.03 527,230,232	1.29
17	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	28,000	15,529.06 434,815,722	18,376.01 514,528,538	1.26
18	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	28,728	13,816.47 396,920,654	17,638.43 506,716,874	1.24
19	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	135,100	3,294.77 445,124,743	3,663.78 494,977,867	1.21
20	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	299,800	1,419.69 425,630,026	1,623.68 486,781,063	1.19
21	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	93,700	4,260.11 399,176,661	5,099.44 477,818,428	1.17
22	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	134,600	2,853.43 384,085,034	3,416.82 459,905,156	1.13
23	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	35,600	11,215.05 399,258,871	12,903.38 459,360,527	1.13
24	UDR INC	アメリカ	投資証券	74,400	4,342.32 323,069,955	5,227.86 388,953,439	0.95
25	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	44,000	7,683.85 338,093,037	8,281.39 364,381,248	0.89
26	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	72,300	3,038.70 219,703,760	4,778.95 345,518,114	0.85
27	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	アメリカ	投資証券	145,500	2,184.33 317,825,962	2,323.61 338,086,594	0.83
28	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	24,500	10,869.64 266,308,800	13,761.70 337,161,866	0.83
29	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	176,900	1,619.06 286,425,657	1,884.57 333,382,060	0.82
30	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	42,500	6,523.14 277,234,837	7,777.59 330,547,728	0.81

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
-----------	------

投資信託受益証券	0.71%
投資証券	97.66%
合計	98.37%

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	アメリカ	DJ US REAL ESTATE 202106	買建	120	472,056,906	513,940,224	1.26%
	ドイツ	STOXX 600 REAL 202106	買建	153	169,422,441	184,569,224	0.45%
為替予約取引	日本	香港ドル買/円売 2021年 6月	買建	400,000	5,627,960	5,656,000	0.01%
		米ドル買/円売 2021年6 月	買建	2,490,000	271,949,055	273,297,577	0.67%
		ニュージーランド・ドル 買/円売 2021年6月	買建	70,000	5,507,734	5,557,909	0.01%
		ユーロ買/円売 2021年6 月	買建	560,000	73,918,412	74,898,152	0.18%
		英ポンド買/円売 2021年 6月	買建	20,000	3,122,102	3,111,946	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2021年6月	買建	90,000	8,129,997	8,172,657	0.02%
		豪ドル買/円売 2021年6 月	買建	280,000	23,694,546	23,682,400	0.06%

(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

●FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

2021年5月31日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	12,082円
純資産総額	9.1億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.3%
3カ月間	11.2%
6カ月間	17.2%
1年間	31.4%
3年間	19.7%
5年間	-
設定来	20.8%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円				設定来分配金合計額: 0円			
	第1期 17年11月	第2期 18年11月	第3期 19年12月	第4期 20年11月				
分配金	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。

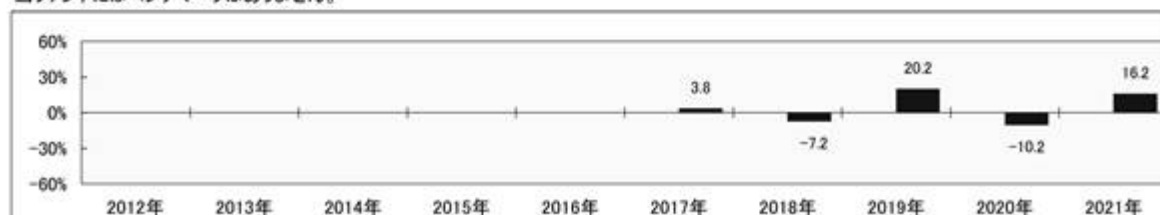
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	租入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	326	99.9%	日本円	98.6%	商業施設	17.2%	PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	5.9%
外国投資信託等	4	0.8%	米ドル	0.9%	産業施設	15.5%	EQUINIX INC	特殊用途施設	アメリカ	4.4%
コール・ローン、その他		1.0%	ユーロ	0.4%	住宅	15.1%	PUBLIC STORAGE	貸倉庫	アメリカ	2.9%
合計	330	-	韓国ウォン	0.1%	特殊用途施設	11.5%	DIGITAL REALTY TRUST INC	特殊用途施設	アメリカ	2.9%
国・地域別構成			豪ドル	0.1%	各種不動産	10.2%	SIMON PROPERTY GROUP INC	商業施設	アメリカ	2.9%
アメリカ		75.0%	香港ドル	0.0%	オフィス	9.7%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	2.1%
オーストラリア		7.0%	カナダドル	0.0%	ヘルスケア	9.0%	AVALONBAY COMMUNITIES INC	住宅	アメリカ	2.0%
イギリス		5.6%	イスラエル・シケル	0.0%	貸倉庫	6.9%	EQUITY RESIDENTIAL	住宅	アメリカ	1.8%
シンガポール		3.7%	英ポンド	-0.0%	ホテル/リゾート	2.9%	GOODMAN GROUP	産業施設	オーストラリア	1.7%
その他		9.5%	その他	-0.2%	その他	0.0%	REALTY INCOME CORP	商業施設	アメリカ	1.7%
合計		100.7%	合計	100.0%	合計	98.1%	合計			28.4%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2017年は設定日(1月11日)から年末、2021年は5月31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オンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)】

(1) 【投資状況】（2021年5月31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	768,429,738	99.99
内 日本	768,429,738	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	56,670	0.01
純資産総額	768,486,408	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】（2021年5月31日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
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	278,305,653	2.2436 624,433,789	2.7611 768,429,738	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年11月30日)	312,291,612	312,291,612	1.0273	1.0273
第2計算期間末 (2018年11月30日)	561,256,874	561,256,874	1.0501	1.0501
第3計算期間末 (2019年12月2日)	595,752,247	595,752,247	1.1725	1.1725
2020年5月末日	532,321,137	-	0.9006	-
6月末日	535,894,662	-	0.9105	-
7月末日	540,113,068	-	0.9279	-
8月末日	548,372,154	-	0.9564	-
9月末日	524,102,131	-	0.9176	-
10月末日	542,661,214	-	0.8873	-
第4計算期間末 (2020年11月30日)	602,823,641	602,823,641	0.9969	0.9969
12月末日	599,769,991	-	1.0071	-
2021年1月末日	621,194,700	-	1.0308	-
2月末日	654,720,966	-	1.0848	-
3月末日	701,486,773	-	1.1652	-
4月末日	743,206,396	-	1.2196	-
5月末日	768,486,408	-	1.2466	-

【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
2020年12月1日～ 2021年5月31日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.7
第2計算期間	2.2

第3計算期間	11.7
第4計算期間	15.0
2020年12月1日～ 2021年5月31日	25.0

(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	323,203,250	29,221,075
第2計算期間	333,551,014	103,078,923
第3計算期間	146,810,171	173,148,380
第4計算期間	262,282,042	165,703,268
2020年12月1日～ 2021年5月31日	124,636,540	112,859,596

(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

前記「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）」の記載と同じ。

(参考情報) 運用実績

●FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)

2021年5月31日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	12,466円
純資産総額	7.6億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	2.2%
3カ月間	14.9%
6カ月間	25.0%
1年間	38.4%
3年間	27.0%
5年間	-
設定来	24.7%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円				設定来分配金合計額: 0円			
	第1期 17年11月	第2期 18年11月	第3期 19年12月	第4期 20年11月				
分配金	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	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	326	99.3%	米ドル	74.4%	商業施設	17.1%	PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	5.9%
外国投資信託等	4	0.8%	豪ドル	7.0%	産業施設	15.4%	EQUINIX INC	特殊用途施設	アメリカ	4.4%
コール・ローン、その他		1.6%	英ポンド	5.8%	住宅	15.0%	PUBLIC STORAGE	貸倉庫	アメリカ	2.9%
合計	330	-	ユーロ	5.1%	特殊用途施設	11.5%	DIGITAL REALTY TRUST INC	特殊用途施設	アメリカ	2.9%
国・地域別構成			シンガポール・ドル	3.4%	各種不動産	10.1%	SIMON PROPERTY GROUP INC	商業施設	アメリカ	2.8%
アメリカ		74.5%	カナダ・ドル	2.0%	オフィス	9.7%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	2.1%
オーストラリア		7.0%	香港ドル	1.7%	ヘルスケア	9.0%	AVALONBAY COMMUNITIES INC	住宅	アメリカ	1.9%
イギリス		5.5%	ニュージーランド・ドル	0.4%	貸倉庫	6.9%	EQUITY RESIDENTIAL	住宅	アメリカ	1.8%
シンガポール		3.7%	韓国ウォン	0.1%	ホテル/リゾート	2.9%	GOODMAN GROUP	産業施設	オーストラリア	1.7%
その他		9.4%	その他	-0.0%	その他	0.0%	REALTY INCOME CORP	商業施設	アメリカ	1.7%
合計		100.1%	合計	100.0%	合計	97.5%	合計			28.2%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

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



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

・2017年※は設定日(1月11日)から年末、2021年は5月31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。

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け付けを行いません。

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

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

継続申込期間においては、委託会社の各営業日の午後3時までに受け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、翌営業日の扱いとなります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止（「FWO TOPIXインデックス」、「FWO 日本債券インデックス」および「FWO 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、取得申込みの受け付けを中止することができるほか、すでに受け付けた取得申込みを取消することができるものとします。

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

*「FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）」および「FWO 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】

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

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

<一部解約>

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

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

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

解約価額は、各ファンドについて後掲の別表Bに掲げる価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または下記にお問合せください。

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（「FWO TOPIXインデックス」、「FWO 日本債券インデックス」および「FWO 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け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、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
FWO TOPIXインデックス FWO 日本債券インデックス	4営業日目
FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし） FWO J-REITインデックス FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり） FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）	5営業日目

FWO 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。

* 「FWO 外国株式インデックス EM+ (為替ヘッジなし)」および「FWO 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
FWO 外国株式インデックス (為替ヘッジあり) FWO 外国株式インデックス EM+ (為替ヘッジなし)	ニューヨーク証券取引所の休業日
FWO 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
FWO 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
FWO 外国REITインデックス (為替ヘッジあり) FWO 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
FWO TOPIXインデックス FWO 日本債券インデックス FWO J-REITインデックス	申込受付日の基準価額

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

*「FWO 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(「FWO TOPIXインデックス」、「FWO 日本債券インデックス」および「FWO 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せ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

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

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

毎年12月1日から翌年11月30日までとします。ただし、第1計算期間は、2017年1月11日から2017年11月30日までとします。

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

(5)【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合、特定の指数が改廃された場合(「FWO 外国株式インデックス EM+(為替ヘッジなし)」および「FWO 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。)を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本の1. から7. までに定める以外の方法によって変更することができないものとし、
2. 委託会社は、前1. の事項(前1. の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1. の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2. の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前2. から前5. までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1. から前6. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。

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

反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

運用報告書

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

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

・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

公告

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

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

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

関係法人との契約の更改

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金および償還金にかかる請求権

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

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)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オンライン 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4期計算期間（2019年12月3日から2020年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 2019年12月2日現在	第4期 2020年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,206,818	3,906,545
親投資信託受益証券	2,849,521,064	2,645,962,803
未収入金	2,770,000	10,640,000
流動資産合計	2,855,497,882	2,660,509,348
資産合計	2,855,497,882	2,660,509,348
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,703,040	11,743,586
未払受託者報酬	286,284	243,054
未払委託者報酬	2,720,116	2,309,389
その他未払費用	72,340	60,690
流動負債合計	5,781,780	14,356,719
負債合計	5,781,780	14,356,719
純資産の部		
元本等		
元本	1 2,416,486,034	1 2,143,825,188
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	433,230,068	502,327,441
（分配準備積立金）	184,788,890	278,971,680
元本等合計	2,849,716,102	2,646,152,629
純資産合計	2,849,716,102	2,646,152,629
負債純資産合計	2,855,497,882	2,660,509,348

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第3期		第4期	
	自	2018年12月1日 至 2019年12月2日	自	2019年12月3日 至 2020年11月30日
営業収益				
受取利息		9		11
有価証券売買等損益		168,984,795		5,021,739
営業収益合計		168,984,804		5,021,750
営業費用				
支払利息		2,634		1,491
受託者報酬		518,930		515,190
委託者報酬		4,930,598		4,895,175
その他費用		130,525		128,694
営業費用合計		5,582,687		5,540,550
営業利益又は営業損失（ ）		163,402,117		518,800
経常利益又は経常損失（ ）		163,402,117		518,800
当期純利益又は当期純損失（ ）		163,402,117		518,800
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		17,114,351		173,865,472
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		217,281,743		433,230,068
剰余金増加額又は欠損金減少額		99,872,900		97,607,370
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		99,872,900		97,607,370
剰余金減少額又は欠損金増加額		64,441,043		201,856,669
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		64,441,043		201,856,669
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		433,230,068		502,327,441

(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4期	
	自 2019年12月3日	至 2020年11月30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 2019年11月30日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2019年12月2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3期	第4期
	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1. 1 期首元本額	1,797,553,299円	2,416,486,034円
期中追加設定元本額	1,209,913,301円	931,798,024円
期中一部解約元本額	590,980,566円	1,204,458,870円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,416,486,034口	2,143,825,188口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第3期	第4期
	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(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(103,549,056円)、投資信託約款に規定される収益調整金(248,443,498円)及び分配準備積立金(81,239,834円)より分配対象額は433,232,388円(1万口当たり1,792.82円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(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(173,346,475円)、投資信託約款に規定される収益調整金(253,250,081円)及び分配準備積立金(105,625,205円)より分配対象額は532,221,761円(1万口当たり2,482.58円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	--	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第4期 自 2019年12月3日 至 2020年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第4期
	2020年11月30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3期	第4期
	2019年12月2日現在	2020年11月30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	174,749,313	163,574,157
合計	174,749,313	163,574,157

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第3期	第4期
2019年12月2日現在	2020年11月30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4期
自 2019年12月3日
至 2020年11月30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3期	第4期
	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1793円 (11,793円)	1.2343円 (12,343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	2,261,893,318	2,645,962,803	
親投資信託受益証券 合計			2,645,962,803	
合計			2,645,962,803	

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

	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		

コール・ローン		15,866,424,459	12,212,008,294
株式	2 3	162,602,439,840	163,479,342,460
派生商品評価勘定		76,885,750	89,140,900
未収入金		44,835,510	-
未収配当金		717,704,956	1,010,955,223
未収利息		1,374,718	814,653
その他未収収益	4	32,184,457	33,720,594
差入委託証拠金		39,360,000	-
流動資産合計		179,381,209,690	176,825,982,124
資産合計		179,381,209,690	176,825,982,124
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	23,231,250
前受金		86,417,200	102,752,600
未払金		1,370,527,390	-
未払解約金		123,739,000	189,585,900
受入担保金		13,103,577,689	9,568,784,085
その他未払費用		10,575	-
流動負債合計		14,684,271,854	9,884,353,835
負債合計		14,684,271,854	9,884,353,835
純資産の部			
元本等			
元本	1	147,704,616,967	142,709,508,970
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		16,992,320,869	24,232,119,319
元本等合計		164,696,937,836	166,941,628,289
純資産合計		164,696,937,836	166,941,628,289
負債純資産合計		179,381,209,690	176,825,982,124

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1. 1 期首	2018年12月1日	2019年12月3日
期首元本額	134,890,694,102円	147,704,616,967円
期中追加設定元本額	33,001,020,844円	28,551,522,466円
期中一部解約元本額	20,187,097,979円	33,546,630,463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	3,765,431,907円	3,193,110,083円
ファンド		

ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	7,517,011,572円	6,674,458,363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	5,764,295円	930,834円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	59,609,321円	32,952,471円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	777,014,581円	668,546,231円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	46,976,403円	35,731,278円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	1,145,153,691円	908,394,726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)	46,927,453円	126,217,518円
D-I's TOPIXイン デックス	50,758,188円	38,327,788円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	16,362,055円	10,549,517円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	7,650,621円	23,213,652円
iFree TOPIXイン デックス	1,290,732,581円	2,041,017,760円
iFree 8資産バランス	1,996,082,570円	2,619,294,575円
iFree 年金バランス	64,246,554円	125,857,474円
DCダイワ日本株式インデッ クス	65,235,675,867円	64,944,239,094円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,856,480,263円	2,972,314,135円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,215,288,075円	3,751,798,888円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	2,971,577,942円	3,333,100,735円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	4,856,558,312円	5,191,048,366円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	13,563,401円	11,676,676円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	55,375,861円	46,996,347円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	24,888,377円	34,721,962円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	266,294,654円	817,787,252円
ダイワつみたてインデックス バランス30	431,467円	10,918,252円
ダイワつみたてインデックス バランス50	315,899円	7,976,371円
ダイワつみたてインデックス バランス70	2,320,710円	11,268,546円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	150,205,619円	141,666,674円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	158,266,050円	149,563,586円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	8,647,121,514円	7,748,159,579円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	730,190,060円	659,469,668円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	124,454,938円	99,902,437円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	216,391,069円	178,714,272円
ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	152,878,769円	149,232,217円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	10,075,963,979円	10,242,225,102円
ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	13,126,419,796円	9,426,768,765円
ダイワファンドラップオンラ インTOPPIXインデック ス	2,555,624,273円	2,261,893,318円
ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,351,353,152円	1,247,128,871円
ダイワライフスタイル25	182,799,162円	180,844,569円
ダイワライフスタイル50	662,351,711円	655,627,347円
ダイワライフスタイル75	530,142,751円	519,251,046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)	12,751,961,504円	11,416,612,625円
計		147,704,616,967円	142,709,508,970円
2.	期末日における受益権の総数	147,704,616,967口	142,709,508,970口
3.	2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 12,524,034,910円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 9,033,368,760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 565,900,000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 740,845,000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29,453,875円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32,214,780円が含まれております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 2019年12月3日 至 2020年11月30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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
--------------------------------	--

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年11月30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	2019年12月2日現在	2020年11月30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	8,993,918,872	9,890,799,472
合計	8,993,918,872	9,890,799,472

(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（2019年9月20日から2019年12月2日まで、及び2020年9月24日から2020年11月30日まで）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

	2019年12月2日 現在	2020年11月30日 現在

種類	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								
買建	2,308,972,800	-	2,385,935,000	76,962,200	2,900,792,400	-	2,966,795,000	66,002,600
合計	2,308,972,800	-	2,385,935,000	76,962,200	2,900,792,400	-	2,966,795,000	66,002,600

(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)

	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1150円 (11,150円)	1.1698円 (11,698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	3,300	2,795.00	9,223,500	
日本水産	91,600	401.00	36,731,600	
マルハニチロ	13,300	2,124.00	28,249,200	
ハウスイ	500	965.00	482,500	
カネコ種苗	2,800	1,543.00	4,320,400	
サカタのタネ	11,000	3,365.00	37,015,000	
ホクト	7,100	2,060.00	14,626,000	貸付株式数 2,800株
ホクリヨウ	1,600	693.00	1,108,800	

ヒノキヤグループ	2,300	2,175.00	5,002,500	
ショーボンドHD	14,300	5,200.00	74,360,000	
ミライト・ホールディングス	27,100	1,565.00	42,411,500	
タマホーム	5,000	1,439.00	7,195,000	貸付株式数 1,900株
サンヨーホームズ	500	697.00	348,500	貸付株式数 300株
日本アクア	3,800	635.00	2,413,000	貸付株式数 1,400株
ファーストコーポレーション	3,000	695.00	2,085,000	貸付株式数 600株 (600株)
ベステラ	1,600	1,533.00	2,452,800	貸付株式数 600株
キャンディル	1,400	508.00	711,200	
スペースバリューHD	11,100	611.00	6,782,100	
住石ホールディングス	18,400	117.00	2,152,800	
日鉄鉱業	2,100	5,290.00	11,109,000	
三井松島HLDGS	3,400	738.00	2,509,200	
国際石油開発帝石	336,200	584.00	196,340,800	
石油資源開発	12,100	1,758.00	21,271,800	貸付株式数 500株
K&Oエナジーグループ	4,500	1,460.00	6,570,000	
ダイセキ環境ソリューション	1,800	682.00	1,227,600	
第一カッター興業	1,100	2,218.00	2,439,800	
明豊ファシリティワークス	2,700	621.00	1,676,700	
安藤・間	54,700	688.00	37,633,600	
東急建設	27,100	469.00	12,709,900	
コムシスホールディングス	32,500	3,090.00	100,425,000	
ビーアールホールディングス	9,900	710.00	7,029,000	貸付株式数 3,900株 (3,900株)
高松コンストラクションGP	5,600	2,037.00	11,407,200	貸付株式数 2,100株
東建コーポレーション	2,800	8,090.00	22,652,000	貸付株式数 600株
ソネック	900	866.00	779,400	
ヤマウラ	4,000	906.00	3,624,000	貸付株式数 1,500株
大成建設	70,300	3,690.00	259,407,000	
大林組	210,600	920.00	193,752,000	
清水建設	213,700	793.00	169,464,100	
飛鳥建設	5,900	1,077.00	6,354,300	貸付株式数 1,900株
長谷工コーポレーション	81,600	1,129.00	92,126,400	
松井建設	8,300	733.00	6,083,900	
銭高組	900	4,595.00	4,135,500	
鹿島建設	165,400	1,373.00	227,094,200	

不動テトラ	5,500	1,678.00	9,229,000	
大末建設	2,300	893.00	2,053,900	
鉄建建設	4,600	1,803.00	8,293,800	
西松建設	16,400	1,940.00	31,816,000	貸付株式数 6,500株
三井住友建設	51,400	429.00	22,050,600	貸付株式数 1,000株
大豊建設	4,800	3,470.00	16,656,000	貸付株式数 1,900株
前田建設	52,700	818.00	43,108,600	
佐田建設	4,500	447.00	2,011,500	貸付株式数 800株
ナカノフドー建設	5,700	409.00	2,331,300	貸付株式数 1,300株
奥村組	9,900	2,441.00	24,165,900	
東鉄工業	9,000	2,800.00	25,200,000	
イチケン	1,500	1,755.00	2,632,500	
富士ピー・エス	3,000	606.00	1,818,000	貸付株式数 1,000株
浅沼組	2,400	3,975.00	9,540,000	
戸田建設	87,500	613.00	53,637,500	貸付株式数 35,000株
熊谷組	9,800	2,362.00	23,147,600	
北野建設	1,300	2,725.00	3,542,500	貸付株式数 400株
植木組	900	2,745.00	2,470,500	貸付株式数 300株
矢作建設	9,300	902.00	8,388,600	
ピーエス三菱	7,000	568.00	3,976,000	貸付株式数 2,700株
日本ハウスHLDGS	14,200	238.00	3,379,600	貸付株式数 1,400株
大東建託	23,000	10,240.00	235,520,000	
新日本建設	8,900	850.00	7,565,000	
NIPPO	17,400	2,727.00	47,449,800	
東亜道路	1,300	3,695.00	4,803,500	
前田道路	18,700	1,677.00	31,359,900	
日本道路	2,000	7,390.00	14,780,000	
東亜建設	6,700	1,990.00	13,333,000	貸付株式数 2,600株
日本国土開発	20,700	545.00	11,281,500	貸付株式数 8,200株
若築建設	3,700	1,151.00	4,258,700	
東洋建設	23,900	397.00	9,488,300	
五洋建設	83,800	777.00	65,112,600	貸付株式数 15,600株
世紀東急	10,200	807.00	8,231,400	
福田組	2,500	5,290.00	13,225,000	貸付株式数 900株
日本ドライケミカル	1,700	1,547.00	2,629,900	貸付株式数 600株
住友林業	53,500	1,901.00	101,703,500	
日本基礎技術	7,300	492.00	3,591,600	貸付株式数 800株
巴コーポレーション	9,200	424.00	3,900,800	
大和ハウス	208,700	3,200.00	667,840,000	
ライト工業	12,200	1,675.00	20,435,000	

積水ハウス	228,600	1,878.00	429,310,800	
日特建設	5,500	801.00	4,405,500	
北陸電気工事	3,700	1,195.00	4,421,500	
ユアテック	11,700	665.00	7,780,500	貸付株式数 1,200株
日本リーテック	4,500	2,489.00	11,200,500	貸付株式数 1,800株 (1,800株)
四電工	1,100	2,587.00	2,845,700	
中電工	8,200	2,132.00	17,482,400	
関電工	29,800	798.00	23,780,400	
きんでん	50,000	1,673.00	83,650,000	
東京エネシス	7,000	890.00	6,230,000	貸付株式数 1,300株
トーエネック	2,000	3,710.00	7,420,000	
住友電設	5,900	2,594.00	15,304,600	貸付株式数 500株
日本電設工業	11,500	2,157.00	24,805,500	
協和エクシオ	32,000	2,687.00	85,984,000	
新日本空調	5,600	2,239.00	12,538,400	貸付株式数 2,200株
日本工営	4,400	2,835.00	12,474,000	
九電工	14,800	2,985.00	44,178,000	貸付株式数 800株
三機工業	15,200	1,149.00	17,464,800	
日揮ホールディングス	64,900	935.00	60,681,500	貸付株式数 4,100株
中外炉工業	2,300	1,612.00	3,707,600	
ヤマト	6,800	741.00	5,038,800	
太平電業	5,100	2,411.00	12,296,100	貸付株式数 100株
高砂熱学	16,200	1,433.00	23,214,600	
三晃金属	800	2,632.00	2,105,600	
NEC ネットエスアイ	18,900	1,837.00	34,719,300	貸付株式数 7,500株
朝日工業社	1,400	3,220.00	4,508,000	
明星工業	13,600	777.00	10,567,200	
大気社	10,200	2,777.00	28,325,400	貸付株式数 1,900株
ダイダン	5,000	2,782.00	13,910,000	貸付株式数 100株
日比谷総合設備	6,900	1,833.00	12,647,700	貸付株式数 100株
日本製粉	20,000	1,627.00	32,540,000	貸付株式数 7,900株
日清製粉G本社	76,400	1,697.00	129,650,800	
日東富士製粉	500	6,550.00	3,275,000	
昭和産業	6,300	3,160.00	19,908,000	
鳥越製粉	6,000	1,051.00	6,306,000	貸付株式数 2,400株
中部飼料	8,400	1,397.00	11,734,800	
フィード・ワン	9,100	885.00	8,053,500	
東洋精糖	1,200	1,211.00	1,453,200	
日本甜菜糖	3,500	1,596.00	5,586,000	

三井製糖	6,000	1,789.00	10,734,000	貸付株式数	2,200株
塩水港精糖	6,900	224.00	1,545,600	貸付株式数	2,100株
日新製糖	3,100	1,850.00	5,735,000	貸付株式数	700株
L I F U L L	22,600	391.00	8,836,600		
ミクシィ	12,400	2,851.00	35,352,400		
ジェイエシーリクルート メント	4,300	1,854.00	7,972,200	貸付株式数	1,700株
日本M&Aセンター	49,300	7,300.00	359,890,000		
メンバーズ	1,900	2,290.00	4,351,000		
中広	600	385.00	231,000	貸付株式数	200株
UTグループ	10,200	3,295.00	33,609,000	貸付株式数	4,000株 (800株)
アイティメディア	2,600	2,560.00	6,656,000	貸付株式数	1,000株
タケエイ	6,200	1,303.00	8,078,600		
E・Jホールディングス	2,400	1,034.00	2,481,600	貸付株式数	400株
ビーネックスグループ	8,100	1,140.00	9,234,000		
コシダカホールディングス	15,500	397.00	6,153,500	貸付株式数	6,100株
アルトナー	1,800	896.00	1,612,800		
パソナグループ	7,000	1,804.00	12,628,000	貸付株式数	2,500株
C D S	1,600	1,290.00	2,064,000	貸付株式数	400株
リンクアンドモチベーショ ン	12,300	558.00	6,863,400	貸付株式数	5,600株
G C A	7,800	711.00	5,545,800		
エス・エム・エス	20,100	3,785.00	76,078,500	貸付株式数	8,000株
サニーサイドアップG	2,100	653.00	1,371,300	貸付株式数	800株
パーソルホールディングス	64,400	1,912.00	123,132,800		
リニカル	3,200	706.00	2,259,200	貸付株式数	1,200株
クックパッド	22,400	320.00	7,168,000	貸付株式数	8,600株
エスクリ	2,000	310.00	620,000	貸付株式数	200株
アイ・ケイ・ケイ	3,100	617.00	1,912,700		
森永製菓	15,900	3,810.00	60,579,000		
中村屋	1,800	4,045.00	7,281,000		
江崎グリコ	18,700	4,345.00	81,251,500		
名糖産業	3,300	1,470.00	4,851,000	貸付株式数	1,300株
井村屋グループ	3,800	2,568.00	9,758,400		
不二家	3,800	2,364.00	8,983,200	貸付株式数	1,500株
山崎製パン	50,800	1,732.00	87,985,600	貸付株式数	19,800株
第一屋製パン	1,300	997.00	1,296,100	貸付株式数	500株
モロゾフ	1,100	6,210.00	6,831,000		
亀田製菓	3,900	4,915.00	19,168,500		

寿スピリッツ	6,500	5,340.00	34,710,000	貸付株式数	2,600株
カルビー	31,000	3,085.00	95,635,000		
森永乳業	12,600	5,070.00	63,882,000		
六甲バター	4,500	1,887.00	8,491,500	貸付株式数	400株
ヤクルト	46,500	4,975.00	231,337,500		
明治ホールディングス	44,700	7,380.00	329,886,000		
雪印メグミルク	16,300	2,237.00	36,463,100	貸付株式数	4,900株
プリマハム	10,700	2,887.00	30,890,900		
日本ハム	25,800	4,455.00	114,939,000		
林兼産業	2,300	604.00	1,389,200		
丸大食品	7,300	1,657.00	12,096,100	貸付株式数	1,500株
S Foods	5,500	3,140.00	17,270,000		
柿安本店	2,300	2,510.00	5,773,000	貸付株式数	400株 (400株)
伊藤ハム米久HLDGS	43,400	654.00	28,383,600		
学情	2,400	1,088.00	2,611,200		
スタジオアリス	3,200	1,883.00	6,025,600	貸付株式数	1,200株
クロスキャット	1,800	1,380.00	2,484,000	貸付株式数	700株
シミックホールディングス	3,300	1,371.00	4,524,300	貸付株式数	400株
エプロ	1,300	1,010.00	1,313,000		
システナ	23,700	2,150.00	50,955,000	貸付株式数	5,300株
NJS	1,400	1,951.00	2,731,400	貸付株式数	400株
デジタルアーツ	3,300	8,930.00	29,469,000	貸付株式数	1,100株
日鉄ソリューションズ	9,800	3,085.00	30,233,000		
総合警備保障	25,500	5,590.00	142,545,000		
キューブシステム	3,500	1,446.00	5,061,000	貸付株式数	1,400株
いちご	84,900	330.00	28,017,000		
エイジア	1,400	2,074.00	2,903,600	貸付株式数	300株
日本駐車場開発	66,200	127.00	8,407,400		
コア	2,800	1,395.00	3,906,000		
カカクコム	47,800	2,929.00	140,006,200	貸付株式数	19,100株
アイロムグループ	2,400	1,815.00	4,356,000	貸付株式数	900株 (100株)
セントケア・ホールディング	4,000	899.00	3,596,000	貸付株式数	1,500株
サイネックス	1,100	738.00	811,800		
ルネサンス	3,500	865.00	3,027,500		
ディップ	9,100	2,434.00	22,149,400	貸付株式数	3,600株
SBSホールディングス	5,100	2,518.00	12,841,800		
デジタルホールディングス	3,800	1,867.00	7,094,600		

新日本科学	7,100	677.00	4,806,700	貸付株式数	2,700株
ツクイホールディングス	15,200	578.00	8,785,600		
キャリアデザインセンター	1,700	987.00	1,677,900		
ベネフィット・ワン	23,500	3,370.00	79,195,000	貸付株式数	9,400株
エムスリー	142,000	9,622.00	1,366,324,000		
ツカダ・グローバルHOLD	4,000	256.00	1,024,000	貸付株式数	1,600株
プラス	700	400.00	280,000		
アウトソーシング	37,000	1,434.00	53,058,000	貸付株式数	14,800株
ウェルネット	6,600	491.00	3,240,600	貸付株式数	2,600株
ワールドホールディングス	2,300	2,034.00	4,678,200	貸付株式数	100株 (100株)
ディー・エヌ・エー	27,500	1,830.00	50,325,000		
博報堂DYHLDGS	89,200	1,510.00	134,692,000	貸付株式数	6,900株
ぐるなび	11,300	517.00	5,842,100	貸付株式数	2,000株
タカミヤ	6,700	547.00	3,664,900		
ジャパンベストレスキューS	5,000	960.00	4,800,000	貸付株式数	2,000株
ファンコミュニケーションズ	17,800	418.00	7,440,400		
ライク	2,200	2,093.00	4,604,600	貸付株式数	900株
ビジネス・ブレークスルー	3,200	421.00	1,347,200	貸付株式数	700株
エスプール	16,600	761.00	12,632,600	貸付株式数	6,600株
WDBホールディングス	3,000	2,840.00	8,520,000		
手間いらず	400	5,320.00	2,128,000	貸付株式数	100株
ティア	3,600	413.00	1,486,800		
CDG	700	1,498.00	1,048,600	貸付株式数	200株 (200株)
バリューコマース	4,100	3,480.00	14,268,000	貸付株式数	100株
インフォマート	65,200	1,071.00	69,829,200	貸付株式数	27,600株
サッポロホールディングス	23,200	1,950.00	45,240,000		
アサヒグループホールディング	147,600	4,037.00	595,861,200	貸付株式数	55,400株
麒麟HD	286,400	2,273.50	651,130,400		
宝ホールディングス	50,200	1,199.00	60,189,800	貸付株式数	3,500株
オエノンホールディングス	18,000	411.00	7,398,000		
養命酒	2,100	1,879.00	3,945,900	貸付株式数	800株
コカ・コーラボトラーズJHD	51,300	1,606.00	82,387,800		
サントリー食品インター	45,200	3,815.00	172,438,000		

ダイドーグループHD	3,500	5,580.00	19,530,000	貸付株式数	1,300株
伊藤園	20,600	8,060.00	166,036,000	貸付株式数	8,100株
キーコーヒー	6,700	2,108.00	14,123,600	貸付株式数	2,600株
ユニカフェ	1,600	1,145.00	1,832,000	貸付株式数	600株
ジャパンフーズ	900	1,251.00	1,125,900		
日清オイリオグループ	8,800	2,906.00	25,572,800		
不二製油グループ	16,600	2,796.00	46,413,600	貸付株式数	6,600株
かどや製油	800	3,880.00	3,104,000		
J-オイルミルズ	3,600	3,560.00	12,816,000		
ローソン	16,800	4,730.00	79,464,000		
サンエー	5,500	4,035.00	22,192,500	貸付株式数	400株
カワチ薬品	5,200	2,998.00	15,589,600	貸付株式数	1,600株
エービーシー・マート	10,300	5,440.00	56,032,000		
ハードオフコーポレーション	2,500	674.00	1,685,000		
高千穂交易	2,500	1,091.00	2,727,500	貸付株式数	300株
アスクル	7,000	4,175.00	29,225,000	貸付株式数	2,600株
ゲオホールディングス	11,900	1,269.00	15,101,100		
アダストリア	9,300	1,700.00	15,810,000		
ジーフット	4,400	436.00	1,918,400	貸付株式数	1,600株
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1,000	423.00	423,000	貸付株式数	300株
カワニシホールディングス	700	1,424.00	996,800		
伊藤忠食品	1,600	5,620.00	8,992,000		
くら寿司	3,700	5,650.00	20,905,000		
キャンドウ	3,200	1,842.00	5,894,400	貸付株式数	1,200株
エレマテック	6,200	958.00	5,939,600		
パルグループHLDGS	6,900	1,140.00	7,866,000		
JALUX	1,800	1,345.00	2,421,000	貸付株式数	700株
エディオン	30,400	975.00	29,640,000	貸付株式数	12,300株 (400株)
あらた	5,300	4,960.00	26,288,000		
サーラコーポレーション	13,400	564.00	7,557,600	貸付株式数	5,300株
ワッツ	2,800	818.00	2,290,400		
トーメンデバイス	1,000	3,335.00	3,335,000		
ハローズ	2,500	3,460.00	8,650,000	貸付株式数	900株
J Pホールディングス	20,200	281.00	5,676,200	貸付株式数	7,800株
フジオフードG本社	5,600	1,422.00	7,963,200	貸付株式数	2,200株
あみやき亭	1,400	2,852.00	3,992,800	貸付株式数	500株
東京エレクトロニクスデバイス	2,400	3,130.00	7,512,000		

ひらまつ	11,800	184.00	2,171,200	貸付株式数	300株
フィールズ	4,900	372.00	1,822,800		
双日	366,900	229.00	84,020,100		
アルフレッサホールディングス	73,600	2,090.00	153,824,000		
大黒天物産	1,600	5,740.00	9,184,000	貸付株式数	600株
ハニーズホールディングス	5,800	955.00	5,539,000	貸付株式数	2,200株
ファーマライズHD	1,500	780.00	1,170,000	貸付株式数	600株
キッコーマン	48,600	6,490.00	315,414,000		
味の素	149,200	2,180.50	325,330,600		
キューピー	37,700	2,174.00	81,959,800	貸付株式数	200株
ハウス食品G本社	25,300	3,600.00	91,080,000		
カゴメ	27,500	3,810.00	104,775,000	貸付株式数	1,600株
焼津水産化工	3,200	991.00	3,171,200		
アリアケジャパン	6,200	6,910.00	42,842,000	貸付株式数	1,000株
ピエトロ	800	1,705.00	1,364,000	貸付株式数	300株
エバラ食品工業	1,700	2,380.00	4,046,000	貸付株式数	500株
やまみ	600	2,033.00	1,219,800		
ニチレイ	32,300	2,834.00	91,538,200		
横浜冷凍	17,500	850.00	14,875,000		
東洋水産	34,900	5,130.00	179,037,000	貸付株式数	5,100株
イトアンドHLDGS	2,300	1,820.00	4,186,000	貸付株式数	800株
大冷	800	1,982.00	1,585,600		
ヨシムラ・フード・HLDGS	3,800	868.00	3,298,400	貸付株式数	1,300株 (800株)
日清食品HD	28,800	8,620.00	248,256,000		
永谷園ホールディングス	3,400	2,250.00	7,650,000		
一正蒲鉾	2,600	1,153.00	2,997,800		
フジッコ	7,400	1,959.00	14,496,600		
ロックフィールド	7,300	1,457.00	10,636,100	貸付株式数	500株
日本たばこ産業	361,800	2,120.00	767,016,000	貸付株式数	150,400株
ケンコーマヨネーズ	3,800	1,786.00	6,786,800	貸付株式数	1,300株
わらべや日洋HD	4,400	1,392.00	6,124,800		
なとり	3,900	1,990.00	7,761,000		
イフジ産業	1,000	826.00	826,000	貸付株式数	100株
ピックルスコーポレーション	1,500	2,924.00	4,386,000		
北の達人コーポ	23,800	509.00	12,114,200	貸付株式数	9,500株
ユーグレナ	29,400	821.00	24,137,400	貸付株式数	11,700株

スター・マイカ・HLDGS	3,300	1,380.00	4,554,000	貸付株式数	1,300株
ADワークスグループ	14,300	155.00	2,216,500		
片倉工業	8,900	1,368.00	12,175,200	貸付株式数	3,500株
グンゼ	4,800	3,600.00	17,280,000		
ヒューリック	140,400	1,057.00	148,402,800	貸付株式数	56,600株
神栄	1,000	691.00	691,000	貸付株式数	100株
ラサ商事	3,400	902.00	3,066,800		
アルペン	5,100	2,185.00	11,143,500	貸付株式数	2,000株
ハブ	1,900	593.00	1,126,700	貸付株式数	700株
ラクーンホールディングス	3,200	2,175.00	6,960,000	貸付株式数	1,200株
クオールホールディングス	9,800	1,042.00	10,211,600	貸付株式数	3,700株
アルコニックス	7,100	1,379.00	9,790,900		
神戸物産	45,900	3,640.00	167,076,000	貸付株式数	18,400株
ソリトンシステムズ	3,100	2,153.00	6,674,300		
ジンスホールディングス	3,500	7,110.00	24,885,000	貸付株式数	1,400株
ビックカメラ	39,400	1,121.00	44,167,400	貸付株式数	6,900株
DCMホールディングス	39,800	1,186.00	47,202,800		
ペッパーフードサービス	5,700	282.00	1,607,400	貸付株式数	2,200株 (300株)
ハイパー	900	584.00	525,600		
Monotaro	47,200	6,370.00	300,664,000		
東京一番フーズ	1,500	555.00	832,500	貸付株式数	600株 (600株)
DDホールディングス	2,700	619.00	1,671,300	貸付株式数	1,000株
あいホールディングス	9,500	1,947.00	18,496,500	貸付株式数	800株
ディーブイエックス	2,300	1,028.00	2,364,400		
きちりホールディングス	1,700	651.00	1,106,700	貸付株式数	600株
アークランドサービスHD	4,900	2,061.00	10,098,900	貸付株式数	1,900株
J.フロントリテイリング	79,300	837.00	66,374,100	貸付株式数	32,000株
ドトール・日レスHD	9,700	1,443.00	13,997,100	貸付株式数	4,000株
マツモトキヨシHLDGS	27,400	4,885.00	133,849,000		
ブロンコビリー	3,500	2,301.00	8,053,500	貸付株式数	1,400株
ZOZO	45,700	2,604.00	119,002,800	貸付株式数	15,100株
トレジャー・ファクトリー	2,000	693.00	1,386,000	貸付株式数	400株
物語コーポレーション	1,800	11,530.00	20,754,000	貸付株式数	700株 (100株)
ココカラファイン	6,900	7,590.00	52,371,000		
三越伊勢丹HD	116,400	561.00	65,300,400	貸付株式数	42,000株

東洋紡	26,200	1,305.00	34,191,000	
ユニチカ	19,800	378.00	7,484,400	貸付株式数 7,900株
富士紡ホールディングス	3,200	3,605.00	11,536,000	
日清紡ホールディングス	40,900	740.00	30,266,000	
倉敷紡績	6,600	1,842.00	12,157,200	貸付株式数 1,200株
ダイワボウHD	5,700	6,520.00	37,164,000	
シキボウ	4,000	1,041.00	4,164,000	貸付株式数 400株
日東紡績	10,100	4,250.00	42,925,000	貸付株式数 3,100株
トヨタ紡織	19,500	1,370.00	26,715,000	
マクニカ・富士エレHLDGS	15,800	2,067.00	32,658,600	貸付株式数 4,900株
Hamee	2,400	1,763.00	4,231,200	貸付株式数 900株
ラクト・ジャパン	2,600	2,943.00	7,651,800	貸付株式数 1,000株
ウエルシアHD	39,500	4,195.00	165,702,500	貸付株式数 10,600株
クリエイトSDH	11,200	3,710.00	41,552,000	
バイタルKSKHD	12,700	861.00	10,934,700	
八洲電機	5,100	942.00	4,804,200	貸付株式数 100株
メディアスホールディングス	3,700	901.00	3,333,700	
レスターホールディングス	6,900	2,242.00	15,469,800	
ジューテックHD	1,300	1,014.00	1,318,200	貸付株式数 100株
丸善CHIHD	7,200	360.00	2,592,000	貸付株式数 2,800株
大光	2,800	680.00	1,904,000	貸付株式数 1,100株
OCHIホールディングス	1,900	1,305.00	2,479,500	貸付株式数 100株
TOKAIホールディングス	34,900	991.00	34,585,900	
黒谷	1,600	621.00	993,600	
ミサワ	1,600	812.00	1,299,200	
ティーライフ	900	1,330.00	1,197,000	
Cominix	1,100	774.00	851,400	貸付株式数 400株
エー・ピーホールディングス	1,500	412.00	618,000	貸付株式数 400株
三洋貿易	6,700	1,019.00	6,827,300	
チムニー	2,000	1,231.00	2,462,000	貸付株式数 400株
シュッピン	4,600	833.00	3,831,800	
ビューティガレージ	1,100	3,050.00	3,355,000	貸付株式数 400株
オイシックス・ラ・大地	6,600	3,225.00	21,285,000	貸付株式数 2,600株
ウイン・パートナーズ	4,700	1,145.00	5,381,500	
ネクステージ	10,500	1,388.00	14,574,000	
ジョイフル本田	19,400	1,453.00	28,188,200	貸付株式数 7,400株

鳥貴族	2,200	1,372.00	3,018,400	貸付株式数	700株
キリン堂ホールディングス	1,300	3,485.00	4,530,500		
ホットランド	4,500	1,252.00	5,634,000	貸付株式数	1,800株
すかいらーくHD	74,400	1,581.00	117,626,400	貸付株式数	29,900株 (2,800株)
SFPホールディングス	3,800	1,274.00	4,841,200	貸付株式数	1,500株
綿半ホールディングス	5,000	1,375.00	6,875,000	貸付株式数	300株
日本毛織	21,300	1,056.00	22,492,800	貸付株式数	5,700株
ダイトウボウ	12,100	115.00	1,391,500	貸付株式数	4,300株
トーア紡コーポレーション	2,600	488.00	1,268,800	貸付株式数	1,000株
ダイドーリミテッド	9,700	197.00	1,910,900	貸付株式数	2,700株
ヨシックス	1,100	1,732.00	1,905,200		
ユナイテッド・スーパー マーケ	19,300	1,081.00	20,863,300	貸付株式数	7,700株
三栄建築設計	2,700	1,735.00	4,684,500		
野村不動産HLDS	40,200	2,260.00	90,852,000		
三重交通グループHD	13,100	467.00	6,117,700	貸付株式数	3,500株
サムティ	9,500	1,654.00	15,713,000	貸付株式数	3,800株
日本商業開発	4,500	1,712.00	7,704,000	貸付株式数	1,600株
プレサンスコーポレーシ ョン	11,000	1,754.00	19,294,000	貸付株式数	4,300株
フィル・カンパニー	1,200	2,062.00	2,474,400	貸付株式数	400株
ハウスコム	900	1,295.00	1,165,500		
日本管理センター	3,800	1,301.00	4,943,800		
サンセイランディック	2,500	735.00	1,837,500		
エストラスト	1,400	726.00	1,016,400	貸付株式数	300株
フージャースHD	13,300	674.00	8,964,200	貸付株式数	600株
オープンハウス	20,700	4,135.00	85,594,500		
東急不動産HD	180,200	506.00	91,181,200		
飯田GHHD	55,200	2,098.00	115,809,600	貸付株式数	8,700株
イーグランド	1,000	782.00	782,000		
帝国繊維	7,500	2,573.00	19,297,500	貸付株式数	2,900株
日本コークス工業	56,000	71.00	3,976,000		
ゴルフダイジェスト・オン	2,900	925.00	2,682,500	貸付株式数	1,100株
ミタチ産業	2,000	602.00	1,204,000	貸付株式数	600株
B E E N O S	3,000	2,535.00	7,605,000	貸付株式数	200株
あさひ	5,000	1,559.00	7,795,000	貸付株式数	1,900株
日本調剤	4,100	1,515.00	6,211,500		
コスモス薬品	5,900	18,000.00	106,200,000	貸付株式数	2,000株
シップヘルスケアHD	10,700	5,200.00	55,640,000	貸付株式数	4,200株

トーエル	3,200	768.00	2,457,600	貸付株式数	1,100株
ソフトクリエイイトHD	2,900	3,185.00	9,236,500	貸付株式数	1,100株
オンリー	1,100	465.00	511,500	貸付株式数	300株
セブン&アイ・HLDGS	259,200	3,313.00	858,729,600		
クリエイイト・レストランツ・ホール	36,000	551.00	19,836,000	貸付株式数	14,400株 (800株)
明治電機工業	2,100	1,414.00	2,969,400		
ツルハホールディングス	14,500	15,280.00	221,560,000		
デリカフーズHLDGS	2,200	609.00	1,339,800		
スターティアホールディングス	1,700	726.00	1,234,200	貸付株式数	500株
サンマルクホールディングス	5,300	1,437.00	7,616,100		
フェリシモ	1,400	1,358.00	1,901,200	貸付株式数	400株
トリドールホールディングス	16,500	1,402.00	23,133,000	貸付株式数	6,100株 (4,500株)
帝人	53,600	1,784.00	95,622,400		
東レ	476,400	566.10	269,690,040		
クラレ	103,600	1,036.00	107,329,600		
旭化成	436,400	957.10	417,678,440	貸付株式数	5,600株
サカイオーベックス	1,700	2,039.00	3,466,300		
TOKYO BASE	6,000	487.00	2,922,000	貸付株式数	2,400株
稲葉製作所	3,700	1,362.00	5,039,400	貸付株式数	1,400株
宮地エンジニアリングG	2,000	2,160.00	4,320,000	貸付株式数	700株
トーカロ	18,600	1,245.00	23,157,000		
アルファCO	2,200	970.00	2,134,000		
SUMCO	84,300	2,114.00	178,210,200	貸付株式数	33,700株
川田テクノロジーズ	1,400	4,215.00	5,901,000		
RS TECHNOLOGIES	1,900	4,465.00	8,483,500	貸付株式数	700株
信和	3,600	684.00	2,462,400		
ビーロット	3,400	830.00	2,822,000		
ファーストブラザーズ	1,500	945.00	1,417,500	貸付株式数	500株
ハウスドゥ	3,500	1,183.00	4,140,500	貸付株式数	1,300株
シーアールイー	1,800	1,315.00	2,367,000	貸付株式数	700株
プロパティエージェント	1,100	1,574.00	1,731,400		
ケイアイスター不動産	2,200	2,539.00	5,585,800		
アグレ都市デザイン	1,700	645.00	1,096,500	貸付株式数	400株
ジェイ・エス・ビー	1,300	3,265.00	4,244,500		
テンポイノベーション	1,700	844.00	1,434,800	貸付株式数	600株

グローバルリンクマネジメン ト	1,400	828.00	1,159,200	貸付株式数	400株
住江織物	1,400	2,178.00	3,049,200	貸付株式数	400株
日本フエルト	3,500	455.00	1,592,500		
イチカワ	900	1,347.00	1,212,300		
エコナックホールディング ス	13,500	90.00	1,215,000		
日東製網	800	1,483.00	1,186,400	貸付株式数	200株
芦森工業	1,300	982.00	1,276,600	貸付株式数	500株
アツギ	5,300	525.00	2,782,500		
ウイルプラスHLDGS	1,100	674.00	741,400		
JMホールディングス	5,100	2,435.00	12,418,500	貸付株式数	1,300株
コマダホールディングス	14,600	1,860.00	27,156,000	貸付株式数	5,600株
サツドラホールディングス	900	2,020.00	1,818,000		
アレンザホールディングス	3,300	1,382.00	4,560,600	貸付株式数	300株 (300株)
串カツ田中HLDGS	1,300	1,600.00	2,080,000	貸付株式数	500株 (400株)
バロックジャパン	4,600	673.00	3,095,800		
クスリのアオキHLDGS	6,000	8,700.00	52,200,000	貸付株式数	2,300株
ダイニック	2,400	871.00	2,090,400		
共和レザー	3,600	605.00	2,178,000		
ピーバンドットコム	600	912.00	547,200		
力の源HD	3,000	588.00	1,764,000	貸付株式数	100株
スシローグローバルHLD GS	36,500	3,320.00	121,180,000		
アセンテック	1,400	1,938.00	2,713,200	貸付株式数	500株
セーレン	16,300	1,526.00	24,873,800	貸付株式数	5,600株
ソトー	2,400	926.00	2,222,400	貸付株式数	200株
東海染工	900	1,112.00	1,000,800	貸付株式数	200株
小松マテーレ	10,800	953.00	10,292,400		
ワコールホールディングス	16,400	2,001.00	32,816,400		
ホギメディカル	7,500	3,160.00	23,700,000		
クラウドディアHLDGS	1,700	302.00	513,400	貸付株式数	600株
TSIホールディングス	20,900	201.00	4,200,900		
マツオカコーポレーション	1,900	2,532.00	4,810,800	貸付株式数	700株
ワールド	9,400	1,282.00	12,050,800		
TIS	66,100	2,078.00	137,355,800		
JNSホールディングス	2,800	607.00	1,699,600		
電算システム	2,500	3,325.00	8,312,500	貸付株式数	900株

グリー	40,900	585.00	23,926,500	
コーエーテクモHD	13,600	5,550.00	75,480,000	
三菱総合研究所	2,800	4,160.00	11,648,000	
ボルテージ	1,900	554.00	1,052,600	貸付株式数 600株
電算	700	2,412.00	1,688,400	
AGS	3,700	862.00	3,189,400	
ファインデックス	5,700	1,362.00	7,763,400	貸付株式数 2,100株
ブレインパッド	1,700	4,275.00	7,267,500	貸付株式数 100株
KLab	12,200	1,018.00	12,419,600	
ポルトゥウィン・ピット クル	8,000	960.00	7,680,000	貸付株式数 3,200株
イーブックイニシアティブ	900	2,921.00	2,628,900	貸付株式数 300株
ネクソン	166,700	3,155.00	525,938,500	
アイスタイル	18,400	453.00	8,335,200	貸付株式数 7,300株
エムアップホールディング ス	1,900	2,629.00	4,995,100	貸付株式数 700株
エイチーム	4,500	977.00	4,396,500	貸付株式数 1,800株
エニグモ	6,300	1,325.00	8,347,500	
テクノスジャパン	5,300	759.00	4,022,700	
enish	3,500	473.00	1,655,500	貸付株式数 200株
コロブラ	21,700	914.00	19,833,800	貸付株式数 8,700株 (8,700株)
オルトプラス	4,400	442.00	1,944,800	貸付株式数 1,500株
ブロードリーフ	32,900	648.00	21,319,200	貸付株式数 13,100株
クロス・マーケティングG	3,200	354.00	1,132,800	
デジタルハーツHLDGS	3,700	1,185.00	4,384,500	貸付株式数 1,400株
システム情報	4,900	1,170.00	5,733,000	貸付株式数 1,900株
メディアドゥ	2,100	7,500.00	15,750,000	貸付株式数 800株
じげん	16,500	327.00	5,395,500	
ブイキューブ	3,600	3,370.00	12,132,000	貸付株式数 1,400株
エンカレッジ・テクノロジ	1,300	779.00	1,012,700	貸付株式数 500株
サイバーリンクス	1,200	6,670.00	8,004,000	貸付株式数 400株
ディー・エル・イー	4,300	346.00	1,487,800	
フィックスターズ	7,100	1,039.00	7,376,900	貸付株式数 2,700株
CARTA HOLDING GS	2,900	1,274.00	3,694,600	貸付株式数 1,200株
オプティム	3,500	3,080.00	10,780,000	貸付株式数 1,300株
セレス	2,300	2,817.00	6,479,100	貸付株式数 800株
SHIFT	2,700	15,470.00	41,769,000	貸付株式数 1,000株
特種東海製紙	4,100	5,350.00	21,935,000	貸付株式数 300株

ティーガイア	5,900	1,839.00	10,850,100	
セック	1,000	3,030.00	3,030,000	
日本アジアグループ	7,300	835.00	6,095,500	貸付株式数 2,900株
テクマトリックス	9,400	2,296.00	21,582,400	
プロシップ	1,900	1,423.00	2,703,700	貸付株式数 700株
ガンホー・オンライン・エンター	16,000	2,653.00	42,448,000	
GMOペイメントゲートウェイ	14,000	14,640.00	204,960,000	貸付株式数 3,700株
ザッパラス	2,900	484.00	1,403,600	貸付株式数 1,300株
システムリサーチ	1,800	1,634.00	2,941,200	貸付株式数 300株
インターネットイニシアティブ	9,900	4,975.00	49,252,500	
さくらインターネット	7,000	736.00	5,152,000	貸付株式数 2,800株
ヴィンクス	1,900	1,245.00	2,365,500	貸付株式数 700株
GMOグローバルサインHD	1,400	10,320.00	14,448,000	貸付株式数 500株 (400株)
SRAホールディングス	3,500	2,480.00	8,680,000	
システムインテグレータ	2,300	664.00	1,527,200	貸付株式数 800株
朝日ネット	4,700	877.00	4,121,900	
eBASE	8,000	1,059.00	8,472,000	貸付株式数 3,100株
アバント	6,300	1,105.00	6,961,500	貸付株式数 2,500株
アドソル日進	2,400	2,958.00	7,099,200	
フリービット	3,700	920.00	3,404,000	貸付株式数 1,300株
コムチュア	7,500	3,230.00	24,225,000	
サイバーコム	1,200	1,769.00	2,122,800	貸付株式数 400株
アステリア	4,400	1,095.00	4,818,000	貸付株式数 1,600株
アイル	3,700	1,428.00	5,283,600	貸付株式数 1,400株
王子ホールディングス	275,600	474.00	130,634,400	
日本製紙	29,300	1,125.00	32,962,500	貸付株式数 11,700株
三菱製紙	7,300	321.00	2,343,300	
北越コーポレーション	39,900	351.00	14,004,900	
中越パルプ	2,800	1,347.00	3,771,600	
巴川製紙	2,100	885.00	1,858,500	
大王製紙	30,500	1,806.00	55,083,000	貸付株式数 200株
阿波製紙	2,000	452.00	904,000	
マークライنز	3,000	2,717.00	8,151,000	
メディカル・データ・ビジ	7,400	3,120.00	23,088,000	貸付株式数 2,900株
gumi	8,600	868.00	7,464,800	
ショーケース	1,600	750.00	1,200,000	貸付株式数 600株

モバイルファクトリー	1,600	993.00	1,588,800	貸付株式数	500株
テラスカイ	2,400	4,890.00	11,736,000	貸付株式数	900株
デジタル・インフォメーション	2,900	1,509.00	4,376,100	貸付株式数	1,000株
P C Iホールディングス	2,800	1,320.00	3,696,000	貸付株式数	1,000株
パイプドHD	900	1,697.00	1,527,300	貸付株式数	200株 (200株)
アイビーシー	1,400	1,191.00	1,667,400	貸付株式数	400株
ネオジャパン	1,200	2,756.00	3,307,200		
P R T I M E S	1,200	3,550.00	4,260,000	貸付株式数	400株
ランドコンピュータ	1,000	1,126.00	1,126,000	貸付株式数	400株
ダブルスタンダード	900	4,425.00	3,982,500		
オープンドア	3,400	1,261.00	4,287,400	貸付株式数	1,300株
マイネット	2,100	961.00	2,018,100	貸付株式数	800株
アカツキ	2,400	4,485.00	10,764,000	貸付株式数	900株
ベネフィットジャパン	500	2,074.00	1,037,000		
UBICOMホールディングス	1,600	3,580.00	5,728,000		
L I N E	15,300	5,380.00	82,314,000		
カナミックネットワーク	6,000	814.00	4,884,000		
ノムラシステムコーポレーション	3,400	387.00	1,315,800	貸付株式数	1,100株
レンゴー	62,500	795.00	49,687,500		
トーモク	4,100	1,730.00	7,093,000	貸付株式数	1,100株
ザ・パック	5,000	2,892.00	14,460,000	貸付株式数	800株
チェンジ	4,600	8,100.00	37,260,000		
シンクロ・フード	2,700	310.00	837,000	貸付株式数	400株
オークネット	3,600	1,369.00	4,928,400	貸付株式数	1,400株
セグエグループ	1,300	1,357.00	1,764,100		
エイトレッド	1,100	2,799.00	3,078,900	貸付株式数	100株
A O I T Y O H O L D I N G S	6,700	417.00	2,793,900	貸付株式数	2,600株
マクロミル	13,500	650.00	8,775,000	貸付株式数	5,200株
ビーグリー	1,300	1,970.00	2,561,000	貸付株式数	500株
オロ	1,900	3,890.00	7,391,000	貸付株式数	700株
ユーザーローカル	600	4,045.00	2,427,000		
テモナ	1,300	1,377.00	1,790,100	貸付株式数	500株
ニーズウェル	1,000	753.00	753,000	貸付株式数	100株
サインポスト	1,300	988.00	1,284,400	貸付株式数	500株
昭和電工	49,800	1,937.00	96,462,600		

住友化学	482,900	370.00	178,673,000	
住友精化	3,000	4,150.00	12,450,000	
日産化学	36,400	6,240.00	227,136,000	
ラサ工業	2,300	1,999.00	4,597,700	貸付株式数 800株
クレハ	5,600	5,300.00	29,680,000	
多木化学	2,600	6,650.00	17,290,000	貸付株式数 1,000株
テイカ	4,900	1,463.00	7,168,700	
石原産業	11,900	576.00	6,854,400	
片倉コープアグリ	1,600	1,247.00	1,995,200	
日本曹達	9,800	2,747.00	26,920,600	
東ソー	101,800	1,646.00	167,562,800	
トクヤマ	19,000	2,217.00	42,123,000	
セントラル硝子	13,400	2,224.00	29,801,600	貸付株式数 400株
東亜合成	41,100	1,250.00	51,375,000	貸付株式数 900株
大阪ソーダ	6,700	2,447.00	16,394,900	
関東電化	15,800	702.00	11,091,600	
デンカ	24,100	3,230.00	77,843,000	
イビデン	41,300	4,890.00	201,957,000	
信越化学	113,100	17,135.00	1,937,968,500	
日本カ - バイド	2,100	1,309.00	2,748,900	
堺 化 学	4,200	1,943.00	8,160,600	
第一稀元素化学工	7,100	697.00	4,948,700	
エア・ウォーター	61,300	1,721.00	105,497,300	
日本酸素HLDGS	63,300	1,744.00	110,395,200	貸付株式数 25,400株
日本化学工業	2,100	2,554.00	5,363,400	
東邦アセチレン	800	1,231.00	984,800	
日本パ - カライジング	33,000	1,095.00	36,135,000	貸付株式数 5,500株
高压ガス	10,400	757.00	7,872,800	
チタン工業	900	1,947.00	1,752,300	貸付株式数 300株
四国化成	9,600	1,192.00	11,443,200	
戸田工業	1,500	2,185.00	3,277,500	貸付株式数 500株
ステラ ケミファ	3,600	3,350.00	12,060,000	貸付株式数 1,400株 (100株)
保土谷化学	2,500	4,605.00	11,512,500	
日本触媒	10,200	5,220.00	53,244,000	
大日精化	5,800	2,388.00	13,850,400	
カネカ	17,100	3,140.00	53,694,000	
協和キリン	67,600	2,835.00	191,646,000	
三菱瓦斯化学	61,400	2,214.00	135,939,600	
三井化学	61,100	2,933.00	179,206,300	

J S R	61,500	2,885.00	177,427,500	
東京応化工業	11,400	6,580.00	75,012,000	貸付株式数 3,600株 (100株)
大阪有機化学	6,100	2,899.00	17,683,900	
三菱ケミカルH L D G S	439,800	577.50	253,984,500	
K H ネオケム	10,900	2,787.00	30,378,300	
ダイセル	82,400	734.00	60,481,600	貸付株式数 28,100株
住友ベークライト	10,400	3,220.00	33,488,000	
積水化学	139,000	1,803.00	250,617,000	
日本ゼオン	59,600	1,293.00	77,062,800	
アイカ工業	19,800	3,690.00	73,062,000	
宇部興産	33,200	1,775.00	58,930,000	
積水樹脂	11,800	2,190.00	25,842,000	貸付株式数 2,200株
タキロンシーアイ	14,000	708.00	9,912,000	
旭有機材	3,800	1,457.00	5,536,600	
ニチバン	3,500	1,621.00	5,673,500	貸付株式数 100株
リケンテクノス	16,400	446.00	7,314,400	貸付株式数 2,800株
大倉工業	3,100	1,877.00	5,818,700	貸付株式数 900株
積水化成成品	8,900	538.00	4,788,200	
群栄化学	1,400	2,533.00	3,546,200	
タイガース ポリマー	3,400	422.00	1,434,800	
ミライアル	2,300	1,211.00	2,785,300	貸付株式数 800株
ダイキアクシス	2,400	1,047.00	2,512,800	貸付株式数 800株
ダイキョーニシカワ	13,800	685.00	9,453,000	貸付株式数 5,100株
竹本容器	2,200	983.00	2,162,600	貸付株式数 800株
森六ホールディングス	3,600	1,989.00	7,160,400	
日本化薬	41,000	917.00	37,597,000	
カーリットホールディングス	6,900	600.00	4,140,000	貸付株式数 2,700株
E P S ホールディングス	8,800	959.00	8,439,200	
ソルクシーズ	2,900	1,056.00	3,062,400	貸付株式数 1,000株
レグス	1,700	1,493.00	2,538,100	貸付株式数 600株
プレステージ・インター	24,300	962.00	23,376,600	
フェイス	2,300	798.00	1,835,400	
プロトコーポレーション	6,000	1,053.00	6,318,000	
ハイマックス	1,600	1,158.00	1,852,800	
アミューズ	3,500	2,575.00	9,012,500	
野村総合研究所	93,500	3,525.00	329,587,500	
ドリームインキュベータ	1,900	1,451.00	2,756,900	
サイバネットシステム	5,100	968.00	4,936,800	

クイック	3,900	1,125.00	4,387,500	貸付株式数	600株
T A C	4,400	219.00	963,600		
C Eホールディングス	4,000	601.00	2,404,000	貸付株式数	900株
ケネディクス	55,800	759.00	42,352,200		
日本システム技術	1,200	1,588.00	1,905,600		
電通グループ	72,200	3,400.00	245,480,000	貸付株式数	28,800株
インテージホールディングス	8,300	1,035.00	8,590,500	貸付株式数	3,300株
テイクアンドギヴニーズ	2,400	576.00	1,382,400	貸付株式数	900株
東邦システムサイエンス	1,700	932.00	1,584,400		
びあ	1,800	2,715.00	4,887,000	貸付株式数	700株
イオンファンタジー	2,500	2,200.00	5,500,000	貸付株式数	700株
ソースネクスト	31,600	313.00	9,890,800	貸付株式数	9,200株
シーティーエス	7,300	940.00	6,862,000	貸付株式数	2,900株
ネクシィーズグループ	2,200	858.00	1,887,600	貸付株式数	800株
インフォコム	7,300	3,660.00	26,718,000		
メディカルシステムネットワーク	6,400	626.00	4,006,400		
日本精化	5,400	1,453.00	7,846,200	貸付株式数	1,100株
扶桑化学工業	6,700	3,455.00	23,148,500		
トリケミカル	1,500	14,110.00	21,165,000		
H E R O Z	900	2,908.00	2,617,200	貸付株式数	300株 (300株)
ラクスル	5,300	5,070.00	26,871,000	貸付株式数	2,100株
F I G	7,700	273.00	2,102,100	貸付株式数	2,800株
システムサポート	1,400	1,487.00	2,081,800	貸付株式数	200株
A D E K A	30,300	1,658.00	50,237,400		
日油	24,800	4,630.00	114,824,000	貸付株式数	300株
ミヨシ油脂	2,500	1,233.00	3,082,500		
新日本理化	10,700	166.00	1,776,200	貸付株式数	2,100株
ハリマ化成グループ	5,500	1,022.00	5,621,000	貸付株式数	1,200株
イーソル	3,100	1,416.00	4,389,600	貸付株式数	1,200株
アルテリア・ネットワークス	7,400	1,591.00	11,773,400		
東海ソフト	400	1,117.00	446,800	貸付株式数	100株
ヒト・コミュニケーションズHD	1,300	1,500.00	1,950,000		
トピラスシステムズ	800	1,728.00	1,382,400		
花 王	161,000	7,808.00	1,257,088,000		
第一工業製薬	2,500	4,510.00	11,275,000	貸付株式数	900株

石原ケミカル	1,800	2,097.00	3,774,600	貸付株式数	700株
日華化学	2,200	959.00	2,109,800	貸付株式数	800株
ニイタカ	1,400	3,110.00	4,354,000	貸付株式数	500株
三洋化成	3,900	4,480.00	17,472,000		
武田薬品	559,600	3,745.00	2,095,702,000		
アステラス製薬	583,100	1,483.50	865,028,850		
大日本住友製薬	49,700	1,323.00	65,753,100		
塩野義製薬	84,600	5,593.00	473,167,800		
わかもと製薬	8,500	273.00	2,320,500		
あすか製薬	7,700	1,704.00	13,120,800		
日本新薬	17,600	7,460.00	131,296,000		
バイオフェルミン製薬	1,200	2,401.00	2,881,200		
中外製薬	210,400	5,044.00	1,061,257,600		
科研製薬	11,600	3,810.00	44,196,000		
エーザイ	80,600	7,887.00	635,692,200	貸付株式数	32,400株
理研ビタミン	6,500	1,332.00	8,658,000		
ロート製薬	34,600	3,425.00	118,505,000		
小野薬品	154,500	3,303.00	510,313,500		
久光製薬	17,700	6,120.00	108,324,000		
有機合成薬品	5,900	306.00	1,805,400	貸付株式数	2,000株
持田製薬	9,300	4,010.00	37,293,000		
参天製薬	125,600	1,735.00	217,916,000	貸付株式数	19,900株
扶桑薬品	2,400	2,833.00	6,799,200		
日本ケミファ	900	2,470.00	2,223,000		
ツムラ	20,800	3,045.00	63,336,000		
日医工	19,200	1,000.00	19,200,000	貸付株式数	7,600株
テルモ	190,300	4,147.00	789,174,100		
HUGグループHD	18,100	2,826.00	51,150,600		
キッセイ薬品工業	11,800	2,090.00	24,662,000		
生化学工業	13,000	993.00	12,909,000		
栄研化学	11,900	1,937.00	23,050,300		
日水製薬	2,800	989.00	2,769,200		
鳥居薬品	4,200	3,165.00	13,293,000		
JCRファーマ	19,100	2,720.00	51,952,000		
東和薬品	8,600	1,901.00	16,348,600		
富士製薬工業	4,600	1,248.00	5,740,800	貸付株式数	900株
沢井製薬	13,800	4,715.00	65,067,000		
ゼリア新薬工業	12,100	1,868.00	22,602,800	貸付株式数	2,900株
第一三共	577,500	3,694.00	2,133,285,000		
キョーリン製薬HD	15,000	1,877.00	28,155,000	貸付株式数	100株

大幸薬品	8,300	1,685.00	13,985,500	貸付株式数	3,300株
ダイト	4,200	3,620.00	15,204,000		
大塚ホールディングス	139,700	4,242.00	592,607,400	貸付株式数	3,100株
大正製薬HD	14,100	6,640.00	93,624,000		
ペプチドリーム	34,200	5,320.00	181,944,000	貸付株式数	13,800株
大日本塗料	7,500	923.00	6,922,500		
日本ペイントHOLD	54,400	13,370.00	727,328,000		
関西ペイント	74,000	3,165.00	234,210,000	貸付株式数	29,800株
神東塗料	6,800	181.00	1,230,800	貸付株式数	2,000株
中国塗料	18,800	994.00	18,687,200		
日本特殊塗料	5,000	1,145.00	5,725,000		
藤倉化成	8,900	507.00	4,512,300		
太陽ホールディングス	4,900	6,410.00	31,409,000		
D I C	27,800	2,567.00	71,362,600	貸付株式数	10,800株
サカタインクス	14,400	1,158.00	16,675,200	貸付株式数	5,800株
東洋インキSCホールディングン	13,700	1,961.00	26,865,700		
T & K TOKA	5,000	860.00	4,300,000	貸付株式数	1,900株
アルプス技研	5,700	2,095.00	11,941,500		
サニックス	11,400	278.00	3,169,200	貸付株式数	4,500株
ダイオーズ	1,200	943.00	1,131,600	貸付株式数	400株
日本空調サービス	6,800	762.00	5,181,600		
オリエンタルランド	68,400	17,765.00	1,215,126,000	貸付株式数	4,900株
フォーカスシステムズ	4,200	903.00	3,792,600	貸付株式数	1,600株
ダスキン	15,900	2,774.00	44,106,600	貸付株式数	2,600株
パーク24	35,800	1,556.00	55,704,800	貸付株式数	14,300株
明光ネットワークジャパン	8,100	528.00	4,276,800	貸付株式数	3,200株
ファルコホールディングス	3,500	1,587.00	5,554,500		
クレスコ	4,000	1,280.00	5,120,000		
フジ・メディア・HD	63,500	1,087.00	69,024,500		
秀英予備校	1,400	420.00	588,000	貸付株式数	500株
田谷	1,200	547.00	656,400	貸付株式数	400株
ラウンドワン	18,100	859.00	15,547,900	貸付株式数	7,200株
リゾートトラスト	29,600	1,628.00	48,188,800		
オービック	22,900	23,470.00	537,463,000		
ジャストシステム	10,800	7,030.00	75,924,000		
TDCソフト	5,900	1,044.00	6,159,600		
Zホールディングス	908,800	657.00	597,081,600		
ビー・エム・エル	8,300	3,280.00	27,224,000		
ワタベウェディング	1,000	289.00	289,000	貸付株式数	300株

トレンドマイクロ	35,200	5,670.00	199,584,000	
りらいあコミュニケーション	11,400	1,234.00	14,067,600	貸付株式数 4,400株
IDホールディングス	2,500	1,224.00	3,060,000	
リソー教育	29,600	315.00	9,324,000	
日本オラクル	13,400	11,570.00	155,038,000	
早稲田アカデミー	2,800	953.00	2,668,400	
アルファシステムズ	2,100	3,520.00	7,392,000	貸付株式数 800株
フューチャー	8,000	1,777.00	14,216,000	
CAC HOLDINGS	4,400	1,470.00	6,468,000	
SBテクノロジー	2,400	3,620.00	8,688,000	
トーセ	1,800	872.00	1,569,600	貸付株式数 300株
ユー・エス・エス	71,800	2,184.00	156,811,200	
オービックビジネスC	6,700	7,400.00	49,580,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	30,100	3,685.00	110,918,500	
アイティフォー	8,100	921.00	7,460,100	貸付株式数 200株
東京個別指導学院	2,300	613.00	1,409,900	
東計電算	1,000	4,355.00	4,355,000	貸付株式数 300株
サイバーエージェント	39,800	7,150.00	284,570,000	貸付株式数 15,900株
楽天	300,700	1,169.00	351,518,300	
エクスネット	1,100	981.00	1,079,100	
クリーク・アンド・リバー社	3,400	1,034.00	3,515,600	
テー・オー・ダブリュー	10,400	280.00	2,912,000	
大塚商会	35,700	5,060.00	180,642,000	
サイボウズ	7,800	2,870.00	22,386,000	貸付株式数 3,100株
山田コンサルティンググループ	4,100	970.00	3,977,000	
セントラルスポーツ	2,400	2,150.00	5,160,000	貸付株式数 300株
パラカ	1,700	1,642.00	2,791,400	貸付株式数 600株
電通国際情報サービス	4,100	6,990.00	28,659,000	
ACCESS	6,100	820.00	5,002,000	貸付株式数 2,400株
デジタルガレージ	11,900	4,225.00	50,277,500	貸付株式数 4,700株
イーエムシステムズ	9,300	820.00	7,626,000	貸付株式数 3,600株
ウェザーニューズ	2,300	5,600.00	12,880,000	貸付株式数 800株
CIJ	4,700	973.00	4,573,100	
ビジネスエンジニアリング	800	3,465.00	2,772,000	貸付株式数 200株
日本エンタープライズ	7,300	224.00	1,635,200	貸付株式数 2,800株
WOWOW	3,200	2,837.00	9,078,400	貸付株式数 800株
スカラ	4,600	865.00	3,979,000	貸付株式数 1,800株 (100株)

インテリジェント ウェイブ	3,700	710.00	2,627,000		
フルキャストホールディングス	5,800	1,693.00	9,819,400	貸付株式数	2,400株
エン・ジャパン	11,500	3,250.00	37,375,000	貸付株式数	2,200株
富士フイルムHLDGS	129,000	5,625.00	725,625,000		
コニカミノルタ	148,300	334.00	49,532,200		
資生堂	133,700	7,360.00	984,032,000		
ライオン	87,500	2,468.00	215,950,000	貸付株式数	7,000株
高砂香料	4,200	2,520.00	10,584,000		
マンダム	15,300	1,637.00	25,046,100	貸付株式数	6,100株
ミルボン	9,000	5,960.00	53,640,000	貸付株式数	200株
ファンケル	27,300	4,235.00	115,615,500	貸付株式数	11,000株
コーセー	12,700	15,940.00	202,438,000	貸付株式数	4,600株
コタ	3,900	1,359.00	5,300,100		
シーボン	800	1,972.00	1,577,600		
ポーラ・オルビスHD	28,800	2,085.00	60,048,000	貸付株式数	11,500株
ノエビアホールディングス	5,700	4,295.00	24,481,500		
アジュバンコスメジャパン	1,400	1,018.00	1,425,200		
エステー	4,400	2,037.00	8,962,800		
アグロカネショウ	2,600	1,745.00	4,537,000	貸付株式数	1,000株
コニシ	11,000	1,592.00	17,512,000		
長谷川香料	11,700	2,012.00	23,540,400	貸付株式数	4,000株
星光PMC	3,800	718.00	2,728,400		
小林製薬	18,900	12,550.00	237,195,000	貸付株式数	2,800株
荒川化学工業	6,000	1,120.00	6,720,000		
メック	4,600	2,279.00	10,483,400	貸付株式数	1,800株 (1,500株)
日本高純度化学	1,800	2,695.00	4,851,000	貸付株式数	400株
タカラバイオ	17,700	2,973.00	52,622,100	貸付株式数	7,100株
JCU	8,200	3,685.00	30,217,000		
新田ゼラチン	4,000	702.00	2,808,000	貸付株式数	200株
OATアグリオ	1,200	1,422.00	1,706,400	貸付株式数	200株
デクセリアルズ	17,600	1,275.00	22,440,000		
アース製薬	4,800	6,150.00	29,520,000	貸付株式数	1,900株
北興化学	6,500	1,124.00	7,306,000	貸付株式数	2,600株
大成ラミック	2,200	2,904.00	6,388,800		
クミアイ化学	28,000	1,021.00	28,588,000	貸付株式数	11,200株
日本農薬	12,000	531.00	6,372,000	貸付株式数	1,900株
富士興産	2,200	920.00	2,024,000	貸付株式数	400株

ニチレキ	8,000	1,636.00	13,088,000	
ユシロ化学	3,700	1,164.00	4,306,800	
ビーピー・カストロール	2,400	1,266.00	3,038,400	貸付株式数 900株
富士石油	17,700	184.00	3,256,800	
MORESCO	2,300	1,011.00	2,325,300	貸付株式数 900株
出光興産	74,700	2,174.00	162,397,800	
ENEOSホールディングス	1,011,500	358.50	362,622,750	
コスモエネルギーHLDGS	19,600	1,774.00	34,770,400	貸付株式数 2,300株
横浜ゴム	39,000	1,523.00	59,397,000	
TOYO TIRE	35,500	1,647.00	58,468,500	貸付株式数 1,200株
ブリヂストン	178,700	3,644.00	651,182,800	貸付株式数 800株
住友ゴム	60,500	923.00	55,841,500	貸付株式数 1,000株
藤倉コンポジット	6,200	386.00	2,393,200	
オカモト	4,100	4,075.00	16,707,500	
アキレス	4,700	1,424.00	6,692,800	
フコク	3,000	697.00	2,091,000	貸付株式数 1,100株
ニッタ	7,600	2,206.00	16,765,600	
クリエートメディック	2,100	962.00	2,020,200	
住友理工	12,800	513.00	6,566,400	
三ツ星ベルト	8,800	1,631.00	14,352,800	
バンドー化学	11,800	576.00	6,796,800	
AGC	61,800	3,475.00	214,755,000	貸付株式数 12,500株
日本板硝子	32,300	401.00	12,952,300	貸付株式数 12,900株
石塚硝子	1,200	1,917.00	2,300,400	
有沢製作所	10,700	917.00	9,811,900	貸付株式数 700株
日本山村硝子	2,800	863.00	2,416,400	
日本電気硝子	25,000	2,282.00	57,050,000	
オハラ	2,700	1,508.00	4,071,600	貸付株式数 100株
住友大阪セメント	12,700	3,090.00	39,243,000	
太平洋セメント	42,400	2,806.00	118,974,400	
リソルホールディングス	700	3,765.00	2,635,500	貸付株式数 200株
日本ヒューム	6,700	780.00	5,226,000	貸付株式数 2,400株
日本コンクリート	14,600	318.00	4,642,800	
三谷セキサン	3,100	4,175.00	12,942,500	
アジアパイルHD	9,600	455.00	4,368,000	
東海カーボン	66,100	1,146.00	75,750,600	貸付株式数 26,500株
日本カーボン	3,500	3,735.00	13,072,500	貸付株式数 1,100株
東洋炭素	4,000	1,784.00	7,136,000	

ノリタケ	3,700	2,931.00	10,844,700		
TOTO	48,000	5,910.00	283,680,000		
日本碍子	80,600	1,659.00	133,715,400		
日本特殊陶業	51,400	1,891.00	97,197,400	貸付株式数	8,700株
ダントーホールディングス	5,600	487.00	2,727,200	貸付株式数	2,000株
MARUWA	2,600	11,080.00	28,808,000	貸付株式数	1,000株
品川リフラクトリーズ	1,700	2,459.00	4,180,300		
黒崎播磨	1,300	3,595.00	4,673,500		
ヨータイ	5,300	825.00	4,372,500	貸付株式数	2,000株
イソライト	3,400	442.00	1,502,800		
東京窯業	8,400	345.00	2,898,000	貸付株式数	3,300株
ニッカトー	3,000	708.00	2,124,000		
フジインコーポレーテッド	6,100	3,640.00	22,204,000		
クニミネ工業	2,800	1,098.00	3,074,400	貸付株式数	100株
エーアンドエーマテリアル	1,100	1,034.00	1,137,400		
ニチアス	18,500	2,437.00	45,084,500		
日本製鉄	297,600	1,276.50	379,886,400		
神戸製鋼所	122,100	505.00	61,660,500	貸付株式数	48,400株
中山製鋼所	8,700	376.00	3,271,200		
合同製鐵	3,600	1,855.00	6,678,000	貸付株式数	300株
JFEホールディングス	179,700	956.00	171,793,200		
東京製鐵	32,600	656.00	21,385,600	貸付株式数	5,300株
共英製鋼	7,600	1,494.00	11,354,400	貸付株式数	1,500株
大和工業	14,200	2,646.00	37,573,200		
東京鐵鋼	2,700	2,207.00	5,958,900		
大阪製鐵	3,500	1,188.00	4,158,000		
淀川製鋼所	8,900	1,973.00	17,559,700		
丸一鋼管	21,700	2,196.00	47,653,200	貸付株式数	8,600株
モリ工業	2,000	2,441.00	4,882,000		
大同特殊鋼	10,800	4,340.00	46,872,000		
日本高周波	2,400	337.00	808,800		
日本冶金工	5,500	1,650.00	9,075,000		
山陽特殊製鋼	4,500	1,250.00	5,625,000		
愛知製鋼	3,600	2,550.00	9,180,000		
日立金属	71,800	1,533.00	110,069,400		
日本金属	1,600	1,221.00	1,953,600	貸付株式数	400株
大平洋金属	4,500	1,850.00	8,325,000		
新日本電工	43,600	228.00	9,940,800		
栗本鉄工所	3,300	1,711.00	5,646,300		

虹 技	1,000	1,257.00	1,257,000	
日本鑄鉄管	800	1,316.00	1,052,800	
日本製鋼所	20,300	2,550.00	51,765,000	
三菱製鋼	4,900	554.00	2,714,600	貸付株式数 1,800株
日亜鋼業	9,600	308.00	2,956,800	貸付株式数 2,600株
日本精線	1,100	3,310.00	3,641,000	貸付株式数 100株
エンピプロHD	3,000	559.00	1,677,000	貸付株式数 1,000株
大紀アルミニウム	11,000	681.00	7,491,000	
日本軽金属HD	16,900	1,792.00	30,284,800	
三井金属	18,000	2,958.00	53,244,000	
東邦亜鉛	3,400	2,040.00	6,936,000	貸付株式数 1,300株
三菱マテリアル	44,000	1,982.00	87,208,000	
住友鉱山	85,000	3,887.00	330,395,000	
DOWAホールディングス	16,800	3,450.00	57,960,000	
古河機金	11,800	1,136.00	13,404,800	
エス・サイエンス	37,600	44.00	1,654,400	貸付株式数 11,500株
大阪チタニウム	6,900	840.00	5,796,000	貸付株式数 2,700株
東邦チタニウム	12,000	689.00	8,268,000	貸付株式数 3,700株
UACJ	10,100	1,791.00	18,089,100	
CKサンエツ	1,400	3,855.00	5,397,000	貸付株式数 500株
古河電工	20,800	2,644.00	54,995,200	
住友電工	248,200	1,194.00	296,350,800	
フジクラ	81,000	407.00	32,967,000	
昭和電線HLDGS	7,800	1,612.00	12,573,600	貸付株式数 2,100株
東京特殊電線	1,000	2,407.00	2,407,000	貸付株式数 400株
タツタ電線	13,300	620.00	8,246,000	
カナレ電気	1,100	1,763.00	1,939,300	貸付株式数 400株
平河ヒューテック	3,300	1,060.00	3,498,000	
リョービ	8,200	1,216.00	9,971,200	貸付株式数 900株
アーステイ	8,600	322.00	2,769,200	
アサヒHD	11,800	3,105.00	36,639,000	
東洋製罐グループHD	42,400	1,007.00	42,696,800	
ホッカンホールディングス	3,700	1,380.00	5,106,000	
コロナ	3,400	903.00	3,070,200	
横河ブリッジHLDGS	12,500	1,982.00	24,775,000	
OSJBHD	33,300	236.00	7,858,800	
駒井ハルテック	1,200	1,658.00	1,989,600	
高田機工	600	2,549.00	1,529,400	貸付株式数 100株
三和ホールディングス	62,900	1,270.00	79,883,000	
文化シャッター-	19,800	912.00	18,057,600	貸付株式数 7,800株

三協立山	8,700	765.00	6,655,500	貸付株式数	3,400株
アルインコ	4,900	908.00	4,449,200		
東洋シャツタ -	1,700	744.00	1,264,800		
LIIXILグループ	98,200	2,505.00	245,991,000	貸付株式数	7,700株
日本フィルコン	5,000	529.00	2,645,000		
ノーリツ	13,800	1,611.00	22,231,800		
長府製作所	6,800	2,040.00	13,872,000	貸付株式数	2,700株
リンナイ	13,000	12,180.00	158,340,000		
ユニプレス	13,200	895.00	11,814,000		
ダイニチ工業	3,500	960.00	3,360,000		
日東精工	8,900	430.00	3,827,000		
三洋工業	800	1,916.00	1,532,800		
岡 部	13,700	806.00	11,042,200	貸付株式数	5,400株
ジーテクト	8,200	1,390.00	11,398,000	貸付株式数	3,300株
東 プ レ	12,500	1,304.00	16,300,000		
高周波熱錬	12,900	446.00	5,753,400		
東京製網	4,700	747.00	3,510,900		
サンコール	4,900	416.00	2,038,400		
モリテックスチル	5,400	495.00	2,673,000	貸付株式数	2,100株
パイオラックス	9,900	1,561.00	15,453,900	貸付株式数	3,900株
エイチワン	6,400	700.00	4,480,000		
日本発条	71,000	633.00	44,943,000		
中央発條	700	2,964.00	2,074,800		
アドバネクス	900	1,290.00	1,161,000		
三浦工業	28,800	5,490.00	158,112,000		
タ ク マ	22,700	1,793.00	40,701,100		
テクノプロ・ホールディング グ	12,900	8,800.00	113,520,000		
アトラ	1,700	268.00	455,600	貸付株式数	500株
インターワークス	1,600	323.00	516,800		
アイ・アールジャパンHD	2,600	16,650.00	43,290,000	貸付株式数	1,000株
Keep er 技研	4,800	2,105.00	10,104,000		
ファーストロジック	1,400	818.00	1,145,200	貸付株式数	400株
三機サービス	1,300	999.00	1,298,700		
Gunosy	4,000	751.00	3,004,000	貸付株式数	100株
デザインワン・ジャパン	1,500	224.00	336,000	貸付株式数	600株
イー・ガーディアン	3,200	3,170.00	10,144,000		
リブセンス	4,400	251.00	1,104,400		
ジャパンマテリアル	19,900	1,451.00	28,874,900	貸付株式数	7,900株
ベクトル	8,200	920.00	7,544,000	貸付株式数	3,200株

ウチヤマホールディングス	3,200	298.00	953,600	
チャームケアコーポレーション	5,500	1,349.00	7,419,500	
キャリアリンク	2,300	1,948.00	4,480,400	貸付株式数 800株
I B J	4,500	767.00	3,451,500	貸付株式数 1,200株
アサンテ	2,700	1,407.00	3,798,900	貸付株式数 1,000株
N・フィールド	4,300	785.00	3,375,500	貸付株式数 1,700株
バリューHR	2,600	1,856.00	4,825,600	貸付株式数 1,000株
M&Aキャピタルパートナー	5,300	6,300.00	33,390,000	貸付株式数 2,000株 (1,700株)
ライドオンエクスプレスHD	2,500	2,021.00	5,052,500	貸付株式数 900株
E R Iホールディングス	1,800	692.00	1,245,600	貸付株式数 600株
アピスト	900	2,997.00	2,697,300	貸付株式数 300株 (300株)
シグマクシス	4,400	1,640.00	7,216,000	貸付株式数 1,700株
ウィルグループ	4,300	979.00	4,209,700	貸付株式数 1,600株
エスクローAJ	9,000	331.00	2,979,000	
リクルートホールディングス	460,500	4,400.00	2,026,200,000	
エラン	4,200	3,190.00	13,398,000	
ツガミ	13,900	1,650.00	22,935,000	貸付株式数 5,500株
オークマ	7,800	6,020.00	46,956,000	
芝浦機械	7,600	2,301.00	17,487,600	貸付株式数 3,000株
アマダ	82,500	1,006.00	82,995,000	
アイダエンジニア	17,400	884.00	15,381,600	
滝澤鉄工所	2,000	1,003.00	2,006,000	貸付株式数 100株
F U J I	28,700	2,529.00	72,582,300	
牧野フライス	7,800	4,200.00	32,760,000	
オーエスジー	31,500	1,887.00	59,440,500	貸付株式数 1,200株
ダイジェット	700	1,412.00	988,400	
旭ダイヤモンド	17,600	424.00	7,462,400	
D M G 森精機	42,200	1,542.00	65,072,400	貸付株式数 700株
ソディック	14,900	833.00	12,411,700	
ディスコ	9,000	33,250.00	299,250,000	
日東工器	3,700	1,664.00	6,156,800	
日進工具	2,600	2,931.00	7,620,600	貸付株式数 700株
パンチ工業	5,900	440.00	2,596,000	
富士ダイス	2,900	664.00	1,925,600	貸付株式数 1,100株
土木管理総合試験	2,900	360.00	1,044,000	貸付株式数 100株

ネットマーケティング	2,300	579.00	1,331,700	貸付株式数	900株
日本郵政	525,500	772.70	406,053,850		
ベルシステム24HLDGS	10,900	1,603.00	17,472,700		
鎌倉新書	4,900	1,072.00	5,252,800	貸付株式数	1,900株 (400株)
SMN	1,300	768.00	998,400		
一蔵	700	368.00	257,600	貸付株式数	200株
LITALICO	2,200	3,550.00	7,810,000		
グローバルキッズCOMP	1,000	922.00	922,000		
エアトリ	3,300	1,227.00	4,049,100	貸付株式数	1,300株 (200株)
アトラエ	1,900	3,070.00	5,833,000	貸付株式数	700株
ストライク	2,400	6,320.00	15,168,000	貸付株式数	900株
ソラスト	17,900	1,517.00	27,154,300		
セラク	2,100	2,479.00	5,205,900	貸付株式数	800株
インソース	2,800	3,690.00	10,332,000	貸付株式数	1,000株 (900株)
豊田自動織機	54,400	7,540.00	410,176,000	貸付株式数	21,900株
豊和工業	3,900	810.00	3,159,000		
OKK	2,700	384.00	1,036,800		
石川製作所	1,700	1,689.00	2,871,300	貸付株式数	600株 (600株)
東洋機械金属	4,600	405.00	1,863,000		
津田駒工業	1,200	906.00	1,087,200	貸付株式数	400株
エンシュウ	1,500	915.00	1,372,500		
島精機製作所	10,500	1,741.00	18,280,500	貸付株式数	600株
オプトラン	7,900	2,184.00	17,253,600		
NCホールディングス	2,000	604.00	1,208,000		
イワキポンプ	4,200	801.00	3,364,200	貸付株式数	500株
フリーー	6,500	1,181.00	7,676,500	貸付株式数	2,400株
ヤマシンフィルタ	14,600	1,066.00	15,563,600	貸付株式数	5,800株
日阪製作所	8,400	838.00	7,039,200		
やまびこ	13,000	1,414.00	18,382,000	貸付株式数	700株
平田機工	3,100	8,340.00	25,854,000	貸付株式数	1,200株
ペガサスミシン製造	6,600	293.00	1,933,800		
マルマエ	2,700	1,072.00	2,894,400	貸付株式数	900株
タツモ	3,000	1,506.00	4,518,000		
ナブテスコ	39,200	4,310.00	168,952,000		
三井海洋開発	7,100	1,770.00	12,567,000		

レオン自動機	6,600	1,107.00	7,306,200	
S M C	21,100	66,320.00	1,399,352,000	
ホソカワミクロン	2,400	6,330.00	15,192,000	
ユニオンツール	2,400	3,065.00	7,356,000	貸付株式数 100株
オイレス工業	8,600	1,594.00	13,708,400	
日精エーエスビー	2,000	5,700.00	11,400,000	
サト - ホールディングス	9,600	2,023.00	19,420,800	
技研製作所	5,900	4,100.00	24,190,000	
日本エアーテック	2,300	1,589.00	3,654,700	貸付株式数 800株
カワタ	1,900	916.00	1,740,400	
日精樹脂工業	5,600	862.00	4,827,200	貸付株式数 2,200株
オカダアイヨン	2,000	997.00	1,994,000	貸付株式数 800株
ワイエイシイホールディングス	2,800	865.00	2,422,000	
小松製作所	304,800	2,540.00	774,192,000	貸付株式数 100株
住友重機械	38,600	2,253.00	86,965,800	貸付株式数 15,500株
日立建機	27,200	2,891.00	78,635,200	
日工	9,200	663.00	6,099,600	
巴工業	2,700	1,919.00	5,181,300	貸付株式数 300株
井関農機	6,800	1,369.00	9,309,200	貸付株式数 1,300株
T O W A	6,800	1,814.00	12,335,200	貸付株式数 100株
丸山製作所	1,700	1,356.00	2,305,200	
北川鉄工所	3,000	1,279.00	3,837,000	
シンニッタン	10,400	183.00	1,903,200	
ローツェ	3,000	5,420.00	16,260,000	貸付株式数 1,100株
タカキタ	2,500	691.00	1,727,500	貸付株式数 500株
クボタ	357,000	2,070.50	739,168,500	貸付株式数 18,600株
荏原実業	1,700	3,670.00	6,239,000	
東洋エンジニア	8,700	351.00	3,053,700	
三菱化工機	2,300	2,245.00	5,163,500	
月島機械	12,300	1,201.00	14,772,300	
帝国電機製作所	5,600	1,245.00	6,972,000	
東京機械	3,100	265.00	821,500	貸付株式数 1,200株
新東工業	16,000	711.00	11,376,000	
渋谷工業	5,900	3,650.00	21,535,000	
アイチ コーポレーション	11,600	928.00	10,764,800	
小森コーポレーション	17,200	713.00	12,263,600	
鶴見製作所	5,100	1,711.00	8,726,100	
住友精密	1,000	2,003.00	2,003,000	
日本ギア工業	2,400	314.00	753,600	貸付株式数 700株

酒井重工業	1,200	2,485.00	2,982,000	貸付株式数	300株
荏原製作所	27,900	3,340.00	93,186,000		
石井鉄工所	900	2,790.00	2,511,000		
西島製作所	6,800	840.00	5,712,000		
北越工業	7,000	1,041.00	7,287,000	貸付株式数	100株
ダイキン工業	85,700	23,665.00	2,028,090,500		
オルガノ	2,400	5,930.00	14,232,000		
ト - ヨ - カネツ	3,000	2,131.00	6,393,000		
栗田工業	36,500	3,850.00	140,525,000		
椿本チエイン	9,500	2,529.00	24,025,500		
大同工業	3,200	676.00	2,163,200		
日 機 装	20,600	995.00	20,497,000		
木村化工機	5,700	503.00	2,867,100	貸付株式数	300株
レイズネクスト	11,200	1,111.00	12,443,200		
アネスト岩田	10,500	987.00	10,363,500	貸付株式数	2,500株
ダイフク	34,400	12,100.00	416,240,000	貸付株式数	11,600株
サムコ	1,800	3,565.00	6,417,000	貸付株式数	700株
加藤製作所	3,700	1,016.00	3,759,200		
油研工業	1,100	1,514.00	1,665,400		
タダノ	32,800	823.00	26,994,400	貸付株式数	12,700株
フジテック	24,600	2,132.00	52,447,200		
C K D	18,500	2,225.00	41,162,500		
キトー	5,200	1,586.00	8,247,200		
平和	18,600	1,421.00	26,430,600		
理想科学工業	6,000	1,291.00	7,746,000		
S A N K Y O	15,000	2,568.00	38,520,000	貸付株式数	1,900株
日本金銭機械	7,300	541.00	3,949,300	貸付株式数	2,900株
マースグループH L D G S	4,100	1,598.00	6,551,800		
フクシマガリレイ	4,200	4,395.00	18,459,000	貸付株式数	200株
オーイズミ	2,800	399.00	1,117,200		
ダイコク電機	3,100	881.00	2,731,100		
竹内製作所	11,400	2,457.00	28,009,800		
ア マ ノ	17,800	2,454.00	43,681,200	貸付株式数	7,000株
J U K I	9,300	542.00	5,040,600		
サンデンホールディングス	9,000	372.00	3,348,000	貸付株式数	2,700株
蛇の目ミシン	6,000	854.00	5,124,000		
ブラザー工業	82,100	2,000.00	164,200,000		
マックス	10,400	1,400.00	14,560,000		
モリタホールディングス	11,800	1,784.00	21,051,200		
グローリー	17,500	2,100.00	36,750,000		

新晃工業	6,300	1,718.00	10,823,400	貸付株式数	2,200株
大和冷機工業	9,800	1,026.00	10,054,800		
セガサミーホールディングス	66,600	1,467.00	97,702,200	貸付株式数	8,000株
日本ピストンリング	2,400	935.00	2,244,000		
リケン	3,100	2,215.00	6,866,500	貸付株式数	400株
T P R	9,100	1,308.00	11,902,800	貸付株式数	3,300株
ツバキ・ナカシマ	13,300	881.00	11,717,300		
ホシザキ	21,200	10,330.00	218,996,000		
大豊工業	5,400	608.00	3,283,200		
日本精工	126,600	845.00	106,977,000		
N T N	157,300	218.00	34,291,400		
ジェイテクト	64,500	811.00	52,309,500		
不二越	6,200	4,310.00	26,722,000	貸付株式数	1,900株
ミネベアミツミ	124,800	2,174.00	271,315,200		
日本トムソン	19,900	328.00	6,527,200		
T H K	41,400	3,225.00	133,515,000	貸付株式数	15,800株
ユーシン精機	5,300	787.00	4,171,100		
前澤給装工業	2,400	2,310.00	5,544,000		
イーグル工業	8,500	903.00	7,675,500		
前澤工業	4,000	458.00	1,832,000		
日本ピラ - 工業	6,800	1,621.00	11,022,800		
キッツ	27,500	563.00	15,482,500	貸付株式数	1,100株
日立	323,100	3,966.00	1,281,414,600		
三菱電機	672,100	1,533.50	1,030,665,350		
富士電機	40,600	3,710.00	150,626,000		
東洋電機製造	2,400	1,105.00	2,652,000	貸付株式数	500株
安川電機	72,400	5,030.00	364,172,000	貸付株式数	29,300株
シンフォニアテクノロジー	8,700	1,318.00	11,466,600		
明電舎	12,400	1,818.00	22,543,200		
オリジン	1,800	1,371.00	2,467,800	貸付株式数	100株
山洋電気	3,300	5,160.00	17,028,000		
デンヨー	5,800	2,089.00	12,116,200	貸付株式数	500株
ベイカレントコンサルティング	3,900	17,380.00	67,782,000	貸付株式数	1,500株
ORCHESTRA HLDGS	1,600	2,530.00	4,048,000	貸付株式数	500株
アイモバイル	2,200	1,303.00	2,866,600	貸付株式数	800株
キャリアインデックス	2,800	726.00	2,032,800	貸付株式数	1,000株

MS - J a p a n	2,200	792.00	1,742,400	貸付株式数	800株
船場	1,100	905.00	995,500	貸付株式数	200株
グレイステクノロジー	3,000	8,330.00	24,990,000		
ジャパンエレベーターSH D	7,100	4,865.00	34,541,500		
フルテック	900	1,441.00	1,296,900	貸付株式数	300株
グリーンズ	1,800	458.00	824,400	貸付株式数	600株
ツナググループHLDGS	900	354.00	318,600	貸付株式数	300株
GAMEWITH	1,700	576.00	979,200	貸付株式数	600株
ソウルドアウト	1,300	1,555.00	2,021,500	貸付株式数	500株
MS&CONSULTIN G	1,000	620.00	620,000	貸付株式数	300株
ミダック	800	3,385.00	2,708,000		
日総工産	4,500	752.00	3,384,000		
キュービーネットHLDG S	2,900	1,587.00	4,602,300	貸付株式数	1,000株
RPAホールディングス	4,800	673.00	3,230,400	貸付株式数	1,900株
三桜工業	8,600	661.00	5,684,600	貸付株式数	3,400株
マキタ	87,700	5,400.00	473,580,000	貸付株式数	3,200株
東芝テック	8,500	3,750.00	31,875,000		
芝浦メカトロニクス	1,200	3,885.00	4,662,000		
マブチモーター	18,700	4,660.00	87,142,000		
日本電産	161,900	13,305.00	2,154,079,500	貸付株式数	5,000株
ユーエムシーエレクトロニ クス	4,200	409.00	1,717,800	貸付株式数	1,600株
トレックス・セミコンダク ター	3,900	1,305.00	5,089,500		
東光高岳	3,700	1,332.00	4,928,400		
ダブル・スコープ	10,700	786.00	8,410,200	貸付株式数	4,200株
宮越ホールディングス	2,600	685.00	1,781,000	貸付株式数	900株
ダイヘン	7,400	4,540.00	33,596,000	貸付株式数	300株
ヤーマン	11,100	2,324.00	25,796,400	貸付株式数	1,000株
JVCケンウッド	55,100	141.00	7,769,100		
ミマキエンジニアリング	6,000	510.00	3,060,000	貸付株式数	2,100株
I - P E X	2,800	1,965.00	5,502,000	貸付株式数	500株 (500株)
日新電機	15,700	1,165.00	18,290,500		
大崎電気	13,300	552.00	7,341,600	貸付株式数	5,300株
オムロン	60,300	9,430.00	568,629,000		
日東工業	10,000	1,856.00	18,560,000		

I D E C	9,800	1,845.00	18,081,000	貸付株式数	3,900株
正興電機製作所	1,700	2,146.00	3,648,200	貸付株式数	600株
不二電機工業	1,000	1,301.00	1,301,000	貸付株式数	200株 (200株)
ジーエス・ユアサ コーポ	22,600	2,524.00	57,042,400		
サクサホールディングス	1,500	1,441.00	2,161,500		
メルコホールディングス	2,300	3,060.00	7,038,000		
テクノメディカ	1,500	1,491.00	2,236,500	貸付株式数	300株
ダイヤモンドエレクトリック HD	1,400	1,292.00	1,808,800		
日本電気	81,600	5,630.00	459,408,000		
富士通	64,800	14,505.00	939,924,000		
沖電気	27,700	906.00	25,096,200		
岩崎通信機	3,000	850.00	2,550,000		
電気興業	3,300	2,900.00	9,570,000	貸付株式数	800株
サンケン電気	7,400	3,815.00	28,231,000		
ナカヨ	1,300	1,475.00	1,917,500		
アイホン	3,800	1,539.00	5,848,200		
ルネサスエレクトロニクス	287,900	928.00	267,171,200		
セイコーエプソン	83,600	1,557.00	130,165,200		
ワコム	45,600	965.00	44,004,000		
アルバック	12,400	4,220.00	52,328,000		
アクセル	2,700	807.00	2,178,900		
E I Z O	5,300	3,630.00	19,239,000		
ジャパンディスプレイ	61,700	50.00	3,085,000		
日本信号	17,400	931.00	16,199,400		
京三製作所	15,800	421.00	6,651,800		
能美防災	8,900	2,263.00	20,140,700		
ホーチキ	4,900	1,246.00	6,105,400		
星和電機	3,500	614.00	2,149,000		
エレコム	7,600	4,775.00	36,290,000		
パナソニック	768,700	1,112.50	855,178,750	貸付株式数	309,300株
シャープ	78,200	1,400.00	109,480,000	貸付株式数	31,300株
アンリツ	43,500	2,379.00	103,486,500	貸付株式数	17,500株
富士通ゼネラル	18,500	3,165.00	58,552,500		
ソニー	421,400	9,704.00	4,089,265,600		
T D K	32,500	14,720.00	478,400,000		
帝国通信工業	3,000	1,168.00	3,504,000		
タムラ製作所	22,700	535.00	12,144,500		
アルプスアルパイン	59,800	1,308.00	78,218,400		

池上通信機	2,100	949.00	1,992,900	
日本電波工業	6,300	511.00	3,219,300	貸付株式数 2,400株
鈴木	3,300	897.00	2,960,100	
日本トリム	900	4,065.00	3,658,500	
ローランド ディー . ジー .	3,700	1,707.00	6,315,900	貸付株式数 1,400株
フオスタ - 電機	7,100	1,118.00	7,937,800	
S M K	1,700	3,045.00	5,176,500	貸付株式数 100株
ヨコオ	4,400	2,428.00	10,683,200	貸付株式数 1,700株
ティアック	4,900	106.00	519,400	貸付株式数 1,300株
ホシデン	18,600	876.00	16,293,600	
ヒロセ電機	10,400	14,760.00	153,504,000	貸付株式数 4,100株
日本航空電子	15,500	1,400.00	21,700,000	
T O A	7,200	870.00	6,264,000	
マクセルホールディングス	14,600	1,200.00	17,520,000	
古野電気	8,700	1,188.00	10,335,600	
ユニデンホールディングス	1,900	2,389.00	4,539,100	貸付株式数 200株
スミダコーポレーション	5,200	1,052.00	5,470,400	
アイコム	3,800	2,658.00	10,100,400	貸付株式数 100株
リオン	2,800	3,205.00	8,974,000	
本多通信工業	5,800	473.00	2,743,400	
船井電機	6,800	420.00	2,856,000	
横河電機	61,700	1,844.00	113,774,800	
新電元工業	2,400	2,346.00	5,630,400	
アズビル	42,500	4,685.00	199,112,500	
東亜ディーケーケー	3,300	851.00	2,808,300	貸付株式数 1,300株
日本光電工業	27,800	3,300.00	91,740,000	
チ ノ ー	2,300	1,424.00	3,275,200	貸付株式数 700株
共和電業	6,900	402.00	2,773,800	
日本電子材料	2,700	1,567.00	4,230,900	貸付株式数 1,000株
堀場製作所	13,300	5,600.00	74,480,000	貸付株式数 3,700株
アドバンテスト	50,100	7,260.00	363,726,000	
小野測器	2,700	522.00	1,409,400	
エスペック	6,000	1,940.00	11,640,000	
キーエンス	61,000	53,290.00	3,250,690,000	貸付株式数 5,300株
日置電機	3,300	3,925.00	12,952,500	貸付株式数 800株
シスメックス	48,100	10,930.00	525,733,000	
日本マイクロニクス	11,800	985.00	11,623,000	
メガチップス	6,300	2,857.00	17,999,100	
O B A R A G R O U P	4,000	3,390.00	13,560,000	貸付株式数 1,600株

IMAGICA GROUP	5,700	403.00	2,297,100	貸付株式数 2,200株 (2,000株)
澤藤電機	900	1,813.00	1,631,700	貸付株式数 300株
デンソー	148,000	4,929.00	729,492,000	
原田工業	3,200	851.00	2,723,200	貸付株式数 1,200株
コーセル	9,000	1,105.00	9,945,000	
イリソ電子工業	5,700	4,225.00	24,082,500	貸付株式数 2,200株
オプテックスグループ	11,100	1,887.00	20,945,700	
千代田インテグレ	2,900	1,527.00	4,428,300	
アイ・オー・データ	2,300	969.00	2,228,700	貸付株式数 800株
レーザーテック	29,600	11,000.00	325,600,000	
スタンレー電気	47,200	3,070.00	144,904,000	
岩崎電気	2,600	1,386.00	3,603,600	
ウシオ電機	37,300	1,315.00	49,049,500	
岡谷電機	5,200	428.00	2,225,600	
ヘリオステクノH	6,300	302.00	1,902,600	貸付株式数 200株
エノモト	2,000	1,272.00	2,544,000	貸付株式数 800株
日本セラミック	6,900	2,867.00	19,782,300	
遠藤照明	3,300	565.00	1,864,500	
古河電池	4,800	1,696.00	8,140,800	貸付株式数 1,900株
双信電機	3,300	498.00	1,643,400	貸付株式数 1,200株
山一電機	4,900	1,513.00	7,413,700	
函 研	4,400	2,642.00	11,624,800	貸付株式数 300株
日本電子	13,300	4,095.00	54,463,500	
カ シ オ	59,700	1,875.00	111,937,500	貸付株式数 2,000株
ファナック	63,300	25,365.00	1,605,604,500	
日本シイエムケイ	15,900	401.00	6,375,900	貸付株式数 6,300株
エンプラス	3,500	2,829.00	9,901,500	
大真空	2,500	2,146.00	5,365,000	
ロ - ム	28,000	8,710.00	243,880,000	
浜松ホトニクス	48,300	5,870.00	283,521,000	貸付株式数 4,300株
三井ハイテック	7,500	2,879.00	21,592,500	貸付株式数 2,600株
新光電気工業	22,700	2,311.00	52,459,700	
京 セ ラ	94,600	5,963.00	564,099,800	
協栄産業	700	1,292.00	904,400	
太陽誘電	30,000	4,735.00	142,050,000	
村田製作所	197,600	9,129.00	1,803,890,400	
双葉電子工業	10,800	865.00	9,342,000	
日東電工	46,400	8,640.00	400,896,000	
北陸電気工業	2,700	915.00	2,470,500	

東海理化電機	17,800	1,597.00	28,426,600	
ニチコン	22,900	1,094.00	25,052,600	
日本ケミコン	5,100	1,512.00	7,711,200	
K O A	10,200	1,431.00	14,596,200	
三井E & S H D	21,700	341.00	7,399,700	
日立造船	53,500	402.00	21,507,000	
三菱重工業	112,700	2,351.50	265,014,050	
川崎重工業	52,500	1,515.00	79,537,500	貸付株式数 17,400株
I H I	48,600	1,551.00	75,378,600	貸付株式数 19,500株
名村造船所	22,200	151.00	3,352,200	貸付株式数 8,700株
サノヤホールディングス	9,400	156.00	1,466,400	
スプリックス	2,100	842.00	1,768,200	貸付株式数 500株
マネジメントソリューションズ	2,800	1,508.00	4,222,400	貸付株式数 1,100株
プロレド・パートナーズ	900	4,870.00	4,383,000	貸付株式数 300株
A N D F A C T O R Y	500	791.00	395,500	貸付株式数 200株
ギークス	600	1,202.00	721,200	貸付株式数 200株
カーブスホールディングス	17,800	722.00	12,851,600	貸付株式数 7,100株
フォーラムエンジニアリング	3,300	816.00	2,692,800	
日本車輛	2,500	2,482.00	6,205,000	貸付株式数 900株
三菱ロジスネクスト	9,000	1,108.00	9,972,000	貸付株式数 2,000株
近畿車輛	1,000	1,303.00	1,303,000	貸付株式数 200株
F P G	20,600	497.00	10,238,200	貸付株式数 8,200株 (200株)
島根銀行	1,500	637.00	955,500	
じもとホールディングス	4,500	897.00	4,036,500	
全国保証	18,800	4,775.00	89,770,000	貸付株式数 6,800株
めぶきフィナンシャルG	344,900	214.00	73,808,600	
東京きらぼしF G	9,000	1,140.00	10,260,000	
九州フィナンシャルG	145,000	510.00	73,950,000	
かんぼ生命保険	23,400	1,740.00	40,716,000	
ゆうちょ銀行	187,100	822.00	153,796,200	貸付株式数 75,800株
富山第一銀行	15,700	292.00	4,584,400	
コンコルディア・フィナンシャル	378,600	371.00	140,460,600	
ジェイリース	2,300	672.00	1,545,600	貸付株式数 700株
西日本フィナンシャルH D	44,300	723.00	32,028,900	貸付株式数 1,500株
マーキュリアインベストメント	2,800	656.00	1,836,800	貸付株式数 1,100株

イントラスト	2,500	898.00	2,245,000	貸付株式数	900株
日本モーゲージサービス	2,800	1,139.00	3,189,200		
C a s a	2,300	1,280.00	2,944,000	貸付株式数	800株
アルヒ	10,700	1,921.00	20,554,700	貸付株式数	3,800株
プレミアグループ	3,600	2,245.00	8,082,000		
日産自動車	793,300	492.50	390,700,250		
いすゞ自動車	195,000	1,018.00	198,510,000		
トヨタ自動車	750,500	6,999.00	5,252,749,500		
日野自動車	84,100	905.00	76,110,500		
三菱自動車工業	250,500	188.00	47,094,000	貸付株式数	100,900株
エフテック	4,800	568.00	2,726,400	貸付株式数	1,800株
レシップホールディングス	2,600	543.00	1,411,800		
G M B	1,500	634.00	951,000		
ファルテック	1,400	587.00	821,800		
武蔵精密工業	15,100	1,539.00	23,238,900		
日産車体	13,100	902.00	11,816,200	貸付株式数	3,900株
新明和工業	18,300	826.00	15,115,800		
極東開発工業	12,500	1,381.00	17,262,500		
トピー工業	5,600	1,078.00	6,036,800	貸付株式数	1,100株
ティラド	2,400	1,279.00	3,069,600		
タチエス	11,100	1,125.00	12,487,500		
N O K	36,100	1,152.00	41,587,200		
フタバ産業	18,900	505.00	9,544,500	貸付株式数	7,400株
K Y B	7,600	2,518.00	19,136,800	貸付株式数	2,500株
市光工業	10,200	528.00	5,385,600	貸付株式数	4,000株
大同メタル工業	13,100	467.00	6,117,700		
プレス工業	33,600	303.00	10,180,800		
ミクニ	8,400	277.00	2,326,800	貸付株式数	2,200株
太平洋工業	14,300	1,073.00	15,343,900	貸付株式数	4,400株
河西工業	9,200	347.00	3,192,400	貸付株式数	3,400株
アイシン精機	55,400	3,095.00	171,463,000		
マ ッ ダ	198,200	617.00	122,289,400		
今仙電機製作所	6,100	872.00	5,319,200	貸付株式数	2,400株
本田技研	529,500	2,871.50	1,520,459,250		
スズキ	133,400	5,604.00	747,573,600		
S U B A R U	208,800	2,073.00	432,842,400		
安永	3,300	1,150.00	3,795,000	貸付株式数	1,300株
ヤマハ発動機	94,300	2,010.00	189,543,000		
小糸製作所	40,300	6,280.00	253,084,000	貸付株式数	7,300株
T B K	7,900	452.00	3,570,800		

エクセディ	9,300	1,234.00	11,476,200	
ミツバ	12,400	513.00	6,361,200	
豊田合成	21,800	2,832.00	61,737,600	
愛三工業	10,600	443.00	4,695,800	
盟和産業	1,000	873.00	873,000	貸付株式数 200株
日本プラスト	5,000	450.00	2,250,000	
ヨロズ	6,400	1,130.00	7,232,000	貸付株式数 2,500株
エフ・シー・シー	11,200	1,992.00	22,310,400	貸付株式数 4,200株
新家工業	1,500	1,152.00	1,728,000	
シマノ	25,200	24,740.00	623,448,000	貸付株式数 1,000株
テイ・エス テック	15,700	3,050.00	47,885,000	貸付株式数 5,500株
関西みらいFG	39,500	522.00	20,619,000	貸付株式数 400株
33FG	6,200	1,281.00	7,942,200	
第四北越フィナンシャルG	11,500	2,364.00	27,186,000	貸付株式数 600株
ひろぎんHLDGS	98,300	581.00	57,112,300	貸付株式数 30,000株
ジャムコ	3,300	621.00	2,049,300	貸付株式数 1,200株 (1,200株)
小野建	5,500	1,215.00	6,682,500	貸付株式数 2,200株
はるやまHLDGS	3,100	690.00	2,139,000	貸付株式数 1,000株
南陽	1,400	1,755.00	2,457,000	
ノジマ	12,000	2,730.00	32,760,000	
佐鳥電機	4,500	773.00	3,478,500	貸付株式数 1,600株
カップ・クリエイト	9,400	1,407.00	13,225,800	貸付株式数 3,500株
エコートレーディング	1,500	618.00	927,000	貸付株式数 600株 (100株)
伯東	4,100	1,056.00	4,329,600	
コンドーテック	5,200	1,016.00	5,283,200	貸付株式数 1,800株
中山福	3,700	502.00	1,857,400	
ライトオン	4,900	618.00	3,028,200	貸付株式数 1,800株 (1,400株)
ナガイレーベン	8,700	2,702.00	23,507,400	
ジーンズメイト	2,700	336.00	907,200	貸付株式数 900株 (200株)
三菱食品	7,200	2,758.00	19,857,600	
良品計画	88,100	2,147.00	189,150,700	
三城ホールディングス	6,900	291.00	2,007,900	貸付株式数 2,700株
松田産業	4,900	1,721.00	8,432,900	
第一興商	9,900	3,370.00	33,363,000	
メディパルHD	71,400	1,963.00	140,158,200	
アドヴァン	10,300	1,301.00	13,400,300	

S P K	2,800	1,248.00	3,494,400	貸付株式数	1,000株
萩原電気H L D G S	2,500	2,416.00	6,040,000		
アルビス	2,500	2,556.00	6,390,000	貸付株式数	600株
アズワン	4,300	16,040.00	68,972,000		
スズデン	2,300	1,200.00	2,760,000	貸付株式数	800株
尾家産業	1,900	1,476.00	2,804,400	貸付株式数	700株
シモジマ	4,100	1,329.00	5,448,900	貸付株式数	900株
ドウシシャ	6,300	2,009.00	12,656,700		
小津産業	1,500	1,840.00	2,760,000		
コナカ	7,700	258.00	1,986,600	貸付株式数	3,000株
高速	4,000	1,576.00	6,304,000		
ハウス ローゼ	800	1,667.00	1,333,600		
G - 7ホールディングス	3,900	2,436.00	9,500,400		
たけびし	2,400	1,498.00	3,595,200	貸付株式数	900株
イオン北海道	8,600	956.00	8,221,600	貸付株式数	1,400株
コジマ	11,400	755.00	8,607,000	貸付株式数	4,300株
ヒマラヤ	2,200	906.00	1,993,200		
コーナン商事	9,500	3,230.00	30,685,000	貸付株式数	300株
ネットワンシステムズ	25,200	3,720.00	93,744,000	貸付株式数	10,100株
エコス	2,400	2,304.00	5,529,600		
ワタミ	7,900	887.00	7,007,300	貸付株式数	3,000株
マルシェ	1,500	505.00	757,500	貸付株式数	600株
リックス	1,500	1,650.00	2,475,000	貸付株式数	500株
システムソフト	20,300	92.00	1,867,600		
パンパシフィックHD	145,800	2,467.00	359,688,600		
丸文	5,600	487.00	2,727,200		
西松屋チェーン	14,700	1,572.00	23,108,400	貸付株式数	5,600株
ゼンショーホールディングス	31,700	2,610.00	82,737,000		
ハピネット	5,500	1,426.00	7,843,000		
幸楽苑ホールディングス	4,200	1,774.00	7,450,800	貸付株式数	1,600株 (1,600株)
ハークスレイ	1,400	914.00	1,279,600	貸付株式数	500株
橋本総業H L D G S	1,300	2,317.00	3,012,100		
日本ライフライン	19,700	1,438.00	28,328,600		
サイゼリヤ	10,000	1,790.00	17,900,000	貸付株式数	500株
タカショー	3,900	805.00	3,139,500	貸付株式数	1,500株
V Tホールディングス	27,600	375.00	10,350,000		
マルカ	2,300	1,980.00	4,554,000	貸付株式数	900株
アルゴグラフィックス	5,700	3,200.00	18,240,000		

魚力	1,900	1,704.00	3,237,600		
I D O M	18,000	572.00	10,296,000	貸付株式数	5,100株
日本エム・ディ・エム	3,900	2,345.00	9,145,500	貸付株式数	1,500株
ポプラ	1,800	408.00	734,400	貸付株式数	700株
フジ・コーポレーション	1,800	2,331.00	4,195,800	貸付株式数	700株 (700株)
ユナイテッドアローズ	7,000	1,463.00	10,241,000	貸付株式数	2,800株
進和	4,000	2,157.00	8,628,000	貸付株式数	1,400株
エスケイジャパン	1,600	451.00	721,600	貸付株式数	500株
ダイトロン	2,800	1,475.00	4,130,000	貸付株式数	1,000株
ハイデイ日高	9,600	1,693.00	16,252,800	貸付株式数	2,700株
シークス	8,500	1,566.00	13,311,000	貸付株式数	1,600株
京都きもの友禅	3,900	226.00	881,400	貸付株式数	1,600株
コロワイド	22,100	1,542.00	34,078,200	貸付株式数	8,800株 (300株)
ピーシーデポコーポ	8,800	597.00	5,253,600	貸付株式数	3,500株
田中商事	2,100	696.00	1,461,600		
オーハシテクニカ	3,500	1,350.00	4,725,000		
壱番屋	4,600	5,120.00	23,552,000	貸付株式数	1,800株
白銅	2,300	1,433.00	3,295,900	貸付株式数	800株
トップカルチャー	2,400	359.00	861,600		
P L A N T	1,600	774.00	1,238,400	貸付株式数	600株
スギホールディングス	13,300	6,930.00	92,169,000		
ダイコー通産	400	1,403.00	561,200	貸付株式数	100株
薬王堂ホールディングス	2,900	2,401.00	6,962,900		
島津製作所	80,400	3,755.00	301,902,000		
J M S	5,700	939.00	5,352,300		
クボテック	1,900	369.00	701,100	貸付株式数	600株
長野計器	5,000	785.00	3,925,000		
ブイ・テクノロジー	3,200	5,270.00	16,864,000	貸付株式数	1,200株
スター精密	10,500	1,471.00	15,445,500		
東京計器	4,200	893.00	3,750,600	貸付株式数	200株
愛知時計	900	4,405.00	3,964,500		
インターアクション	3,600	1,880.00	6,768,000	貸付株式数	1,400株
オーバル	6,400	229.00	1,465,600	貸付株式数	1,200株
東京精密	12,300	4,605.00	56,641,500		
マニー	26,800	2,558.00	68,554,400		
ニコン	102,700	649.00	66,652,300		
トプコン	34,000	1,327.00	45,118,000	貸付株式数	13,600株
オリンパス	372,300	2,256.50	840,094,950		

理研計器	6,000	2,798.00	16,788,000	
S C R E E Nホールディングス	11,700	6,960.00	81,432,000	
キヤノン電子	6,100	1,453.00	8,863,300	貸付株式数 700株
タムロン	5,500	1,599.00	8,794,500	
H O Y A	133,500	13,910.00	1,856,985,000	
シード	2,900	598.00	1,734,200	貸付株式数 1,100株
ノーリツ鋼機	4,600	2,228.00	10,248,800	貸付株式数 1,100株
エー・アンド・デイ	6,100	910.00	5,551,000	
朝日インテック	76,300	3,825.00	291,847,500	
キヤノン	334,300	1,853.50	619,625,050	貸付株式数 141,500株
リコー	172,100	697.00	119,953,700	貸付株式数 68,900株
シチズン時計	79,600	275.00	21,890,000	貸付株式数 31,600株
リズム	2,100	637.00	1,337,700	
大研医器	5,100	512.00	2,611,200	
メニコン	9,600	6,480.00	62,208,000	貸付株式数 2,400株
シンシア	900	383.00	344,700	
中本パックス	1,600	1,587.00	2,539,200	貸付株式数 600株
スノーピーク	3,500	1,565.00	5,477,500	貸付株式数 1,400株
パラマウントベッドHD	7,100	4,265.00	30,281,500	
トランザクション	4,000	938.00	3,752,000	貸付株式数 1,400株
粧美堂	2,000	392.00	784,000	貸付株式数 300株
ニホンフラッシュ	6,300	1,364.00	8,593,200	
前田工織	7,500	2,597.00	19,477,500	貸付株式数 2,300株
永大産業	8,600	290.00	2,494,000	
アートネイチャー	7,200	669.00	4,816,800	
バンダイナムコHLDGS	69,600	9,530.00	663,288,000	
アイフィスジャパン	1,800	792.00	1,425,600	貸付株式数 600株
共立印刷	11,300	124.00	1,401,200	
S H O E I	6,000	3,605.00	21,630,000	
フランスベッドHLDGS	9,200	851.00	7,829,200	貸付株式数 3,600株
マーベラス	10,000	907.00	9,070,000	
パイロットコーポレーション	11,500	2,959.00	34,028,500	
萩原工業	3,700	1,533.00	5,672,100	
エイベックス	11,500	942.00	10,833,000	
トッパン・フォームズ	14,400	998.00	14,371,200	
フジシールインターナショナル	15,200	1,937.00	29,442,400	
タカラトミー	30,300	933.00	28,269,900	

廣濟堂	4,900	631.00	3,091,900	
エステールホールディングス	2,000	617.00	1,234,000	貸付株式数 700株
レック	7,200	1,548.00	11,145,600	
タカノ	2,600	597.00	1,552,200	貸付株式数 1,000株
三光合成	7,500	292.00	2,190,000	
プロネクサス	5,700	1,075.00	6,127,500	貸付株式数 100株
ホクシン	5,700	110.00	627,000	
ウッドワン	2,400	1,168.00	2,803,200	
大建工業	4,500	1,975.00	8,887,500	
きもと	12,400	182.00	2,256,800	貸付株式数 4,400株
凸版印刷	94,700	1,425.00	134,947,500	
大日本印刷	87,800	1,956.00	171,736,800	
共同印刷	2,100	2,918.00	6,127,800	貸付株式数 700株
N I S S H A	13,900	1,376.00	19,126,400	貸付株式数 5,500株
光村印刷	600	1,795.00	1,077,000	貸付株式数 200株
藤森工業	6,000	4,725.00	28,350,000	貸付株式数 400株
ヴィア・ホールディングス	8,100	249.00	2,016,900	貸付株式数 3,200株
TAKARA & COMPANY	3,300	1,938.00	6,395,400	貸付株式数 1,300株 (100株)
前澤化成工業	4,300	982.00	4,222,600	
未来工業	3,600	1,880.00	6,768,000	貸付株式数 900株
アシックス	59,200	1,880.00	111,296,000	貸付株式数 800株
ツツミ	2,100	2,111.00	4,433,100	
ウェーブロックHLDGS	2,300	738.00	1,697,400	
ジェイ エス ピー	3,900	1,507.00	5,877,300	貸付株式数 1,500株
ニチハ	9,400	3,260.00	30,644,000	貸付株式数 400株
エフピコ	14,200	4,185.00	59,427,000	
小松ウオール工業	1,900	1,742.00	3,309,800	
ヤマハ	40,000	5,960.00	238,400,000	
河合楽器	2,100	2,700.00	5,670,000	
クリナップ	6,300	462.00	2,910,600	
ビジョン	43,300	4,660.00	201,778,000	
天馬	4,500	1,907.00	8,581,500	
オリバー	1,400	2,361.00	3,305,400	貸付株式数 100株
兼松サステック	400	1,610.00	644,000	
キングジム	5,700	895.00	5,101,500	
象印マホービン	18,400	1,886.00	34,702,400	
リンテック	16,000	2,155.00	34,480,000	
信越ポリマー	12,100	940.00	11,374,000	

東リ	16,800	256.00	4,300,800	
イトーキ	13,700	338.00	4,630,600	
任天堂	41,300	59,260.00	2,447,438,000	
三菱鉛筆	10,800	1,442.00	15,573,600	貸付株式数 800株
松風	3,000	1,823.00	5,469,000	
タカラスタンダ-ド	13,700	1,380.00	18,906,000	
コクヨ	32,200	1,342.00	43,212,400	
ナカバヤシ	6,600	607.00	4,006,200	貸付株式数 200株
ニフコ	24,700	3,675.00	90,772,500	貸付株式数 7,300株
立川ブラインド	3,000	1,246.00	3,738,000	貸付株式数 1,100株
グローブライド	3,000	4,045.00	12,135,000	
オカムラ	23,400	937.00	21,925,800	貸付株式数 1,000株
バルカー	5,500	1,870.00	10,285,000	
MUTOHホールディングス	1,000	1,461.00	1,461,000	貸付株式数 300株
伊藤忠	463,600	2,758.50	1,278,840,600	
丸紅	689,300	608.50	419,439,050	
スクロール	10,100	773.00	7,807,300	貸付株式数 600株
高島	1,000	1,574.00	1,574,000	
ヨンドシーホールディングス	6,800	1,864.00	12,675,200	
三陽商会	3,500	529.00	1,851,500	貸付株式数 1,400株
長瀬産業	36,900	1,435.00	52,951,500	
ナイガイ	2,500	353.00	882,500	
蝶理	4,300	1,540.00	6,622,000	貸付株式数 100株
豊田通商	73,900	3,610.00	266,779,000	貸付株式数 29,800株
オンワードホールディングス	40,100	185.00	7,418,500	
三共生興	9,300	437.00	4,064,100	
兼松	25,000	1,205.00	30,125,000	
美津濃	6,100	1,812.00	11,053,200	
ツカモトコーポレーション	1,300	1,401.00	1,821,300	
ルックホールディングス	2,100	976.00	2,049,600	貸付株式数 800株
三井物産	573,900	1,780.00	1,021,542,000	
日本紙パルプ	3,800	3,445.00	13,091,000	貸付株式数 100株
東京エレクトロン	42,700	35,470.00	1,514,569,000	貸付株式数 17,200株
カメイ	8,500	1,173.00	9,970,500	貸付株式数 1,400株
東都水産	800	4,550.00	3,640,000	貸付株式数 300株
OUGホールディングス	1,100	2,844.00	3,128,400	
スターゼン	2,500	4,245.00	10,612,500	

セイコーHD	9,500	1,344.00	12,768,000	貸付株式数	1,800株
山 善	26,100	994.00	25,943,400		
椿本興業	1,200	3,645.00	4,374,000		
住友商事	418,200	1,286.50	538,014,300		
日本ユニシス	20,600	3,860.00	79,516,000		
内田洋行	2,600	5,130.00	13,338,000	貸付株式数	1,000株
三菱商事	434,600	2,433.00	1,057,381,800		
第一実業	3,300	4,025.00	13,282,500		
キャノンマーケティングJ PN	16,500	2,183.00	36,019,500	貸付株式数	6,400株
西華産業	3,700	1,260.00	4,662,000		
佐藤商事	5,400	1,028.00	5,551,200		
菱洋エレクトロ	6,800	2,752.00	18,713,600	貸付株式数	2,400株
東京産業	6,000	557.00	3,342,000		
ユアサ商事	6,400	3,275.00	20,960,000		
神鋼商事	1,600	1,860.00	2,976,000		
トルク	3,900	275.00	1,072,500		
阪和興業	12,500	2,500.00	31,250,000		
正栄食品	4,300	3,770.00	16,211,000	貸付株式数	1,700株
カナデン	5,400	1,289.00	6,960,600	貸付株式数	1,900株
菱電商事	4,800	1,508.00	7,238,400	貸付株式数	1,600株
ニプロ	46,400	1,120.00	51,968,000	貸付株式数	500株
フルサト工業	3,400	1,253.00	4,260,200	貸付株式数	1,300株
岩谷産業	14,900	5,680.00	84,632,000		
ナイス	2,500	1,561.00	3,902,500		
昭光通商	2,300	607.00	1,396,100		
ニチモウ	1,000	1,976.00	1,976,000		
極東貿易	1,900	1,377.00	2,616,300	貸付株式数	700株
イ ワ キ	8,700	526.00	4,576,200	貸付株式数	3,300株
兼松エレクトロニクス	3,600	4,040.00	14,544,000		
三愛石油	16,300	1,154.00	18,810,200	貸付株式数	6,500株
稲畑産業	14,800	1,378.00	20,394,400	貸付株式数	5,900株
G S Iクレオス	1,600	1,799.00	2,878,400	貸付株式数	600株
明和産業	6,300	407.00	2,564,100	貸付株式数	2,300株
クワザワホールディングス	2,300	583.00	1,340,900		
ヤマエ久野	4,900	1,191.00	5,835,900		
ゴ-ルドウイン	11,900	7,020.00	83,538,000	貸付株式数	4,100株
ユニ・チャ-ム	142,700	5,063.00	722,490,100	貸付株式数	27,300株
デサント	12,800	1,724.00	22,067,200		
キ ン グ	3,000	546.00	1,638,000		

ワキタ	14,200	1,145.00	16,259,000		
ヤマトインタ - ナショナル	5,700	337.00	1,920,900	貸付株式数	100株
東邦ホールディングス	21,200	1,903.00	40,343,600		
サンゲツ	17,700	1,465.00	25,930,500		
ミツウロコグループ	9,800	1,292.00	12,661,600	貸付株式数	3,700株
シナネンホールディングス	2,800	2,958.00	8,282,400	貸付株式数	400株
伊藤忠エネクス	14,700	1,000.00	14,700,000		
サンリオ	18,600	1,575.00	29,295,000	貸付株式数	300株
サンワテクノス	4,700	941.00	4,422,700		
リョーサン	7,200	1,855.00	13,356,000		
新光商事	10,000	768.00	7,680,000		
トーヨー	3,000	2,034.00	6,102,000	貸付株式数	100株
三信電気	3,600	2,146.00	7,725,600		
東陽テクニカ	7,400	1,058.00	7,829,200		
モスフードサービス	8,700	2,703.00	23,516,100	貸付株式数	3,100株
加賀電子	6,600	2,165.00	14,289,000	貸付株式数	500株
三益半導体	5,300	2,800.00	14,840,000		
ソーダニツカ	6,800	540.00	3,672,000	貸付株式数	600株
立花エレテック	4,900	1,647.00	8,070,300	貸付株式数	1,600株
木曽路	8,800	2,359.00	20,759,200	貸付株式数	1,800株
S R Sホールディングス	8,100	868.00	7,030,800	貸付株式数	3,100株
千趣会	12,200	332.00	4,050,400	貸付株式数	4,800株
タカキユー	6,100	139.00	847,900	貸付株式数	2,200株 (1,600株)
リテールパートナーズ	8,900	1,481.00	13,180,900	貸付株式数	400株
ケーヨー	13,700	742.00	10,165,400		
上新電機	7,700	2,742.00	21,113,400	貸付株式数	2,800株
日本瓦斯	10,500	5,280.00	55,440,000		
ロイヤルホールディングス	11,700	1,782.00	20,849,400	貸付株式数	4,600株
東天紅	500	926.00	463,000		
いなげや	8,200	2,039.00	16,719,800		
島忠	12,500	5,480.00	68,500,000	貸付株式数	5,000株
チヨダ	7,000	893.00	6,251,000	貸付株式数	2,800株
ライフコーポレーション	5,100	3,685.00	18,793,500	貸付株式数	2,000株
リンガーハット	8,300	2,212.00	18,359,600	貸付株式数	3,100株 (1,700株)
MrMaxHD	9,200	854.00	7,856,800		
テンアライド	5,900	350.00	2,065,000	貸付株式数	2,300株
AOKIホールディングス	13,500	409.00	5,521,500		
オークワ	10,500	1,339.00	14,059,500		

コメリ	10,300	2,835.00	29,200,500	
青山商事	13,800	446.00	6,154,800	貸付株式数 5,500株
しまむら	7,700	10,800.00	83,160,000	
はせがわ	3,400	296.00	1,006,400	貸付株式数 300株
高島屋	48,700	803.00	39,106,100	貸付株式数 19,500株
松屋	13,500	719.00	9,706,500	貸付株式数 2,800株
エイチ・ツー・オーリテイ リング	31,800	643.00	20,447,400	
近鉄百貨店	2,500	3,295.00	8,237,500	貸付株式数 1,000株
丸井グループ	60,800	1,906.00	115,884,800	
クレディセゾン	46,600	1,195.00	55,687,000	
アクシアル リテイリング	5,500	4,745.00	26,097,500	
井筒屋	4,000	179.00	716,000	
イオン	254,900	3,105.00	791,464,500	貸付株式数 102,600株
イズミ	13,500	3,600.00	48,600,000	貸付株式数 5,400株
フオーバル	2,900	879.00	2,549,100	貸付株式数 100株
平和堂	13,400	2,124.00	28,461,600	貸付株式数 5,200株
フジ	8,000	1,921.00	15,368,000	貸付株式数 2,100株
ヤオコー	7,600	7,140.00	54,264,000	貸付株式数 3,000株
ゼビオホールディングス	8,000	760.00	6,080,000	貸付株式数 3,200株
ケースホールディングス	64,000	1,268.00	81,152,000	貸付株式数 25,700株
PALTAC	10,600	5,980.00	63,388,000	
三谷産業	8,700	423.00	3,680,100	
OLYMPICグループ	3,400	1,000.00	3,400,000	貸付株式数 1,300株
日産東京販売HD	9,700	250.00	2,425,000	
新生銀行	48,900	1,242.00	60,733,800	
あおぞら銀行	39,800	1,895.00	75,421,000	
三菱UFJフィナンシャル G	4,537,800	448.50	2,035,203,300	
りそなホールディングス	722,200	365.70	264,108,540	
三井住友トラストHD	125,400	3,051.00	382,595,400	
三井住友フィナンシャルG	458,800	3,032.00	1,391,081,600	
千葉銀行	221,400	592.00	131,068,800	
群馬銀行	127,500	325.00	41,437,500	
武蔵野銀行	9,900	1,588.00	15,721,200	
千葉興業銀行	18,000	263.00	4,734,000	
筑波銀行	28,100	196.00	5,507,600	
七十七銀行	22,400	1,466.00	32,838,400	
青森銀行	5,200	2,433.00	12,651,600	

秋田銀行	4,300	1,393.00	5,989,900	貸付株式数	1,600株
山形銀行	7,500	1,181.00	8,857,500	貸付株式数	3,000株
岩手銀行	4,400	2,216.00	9,750,400		
東邦銀行	59,500	227.00	13,506,500		
東北銀行	3,100	1,076.00	3,335,600	貸付株式数	1,000株
みちのく銀行	4,400	1,183.00	5,205,200		
ふくおかフィナンシャルG	56,000	1,863.00	104,328,000		
静岡銀行	161,600	742.00	119,907,200		
十六銀行	8,300	1,983.00	16,458,900		
スルガ銀行	63,000	337.00	21,231,000		
八十二銀行	160,200	371.00	59,434,200		
山梨中央銀行	7,800	739.00	5,764,200		
大垣共立銀行	13,100	2,348.00	30,758,800		
福井銀行	5,700	1,995.00	11,371,500		
北國銀行	6,600	2,884.00	19,034,400		
清水銀行	2,700	1,890.00	5,103,000		
富山銀行	1,300	3,460.00	4,498,000		
滋賀銀行	13,300	2,373.00	31,560,900	貸付株式数	1,900株
南都銀行	11,200	1,871.00	20,955,200		
百五銀行	59,500	317.00	18,861,500		
京都銀行	23,800	5,210.00	123,998,000	貸付株式数	9,500株
紀陽銀行	23,500	1,590.00	37,365,000	貸付株式数	2,100株
ほくほくフィナンシャルG	44,000	1,037.00	45,628,000	貸付株式数	1,200株
山陰合同銀行	39,500	545.00	21,527,500		
中国銀行	57,000	921.00	52,497,000	貸付株式数	9,900株
鳥取銀行	2,200	1,185.00	2,607,000		
伊予銀行	94,800	692.00	65,601,600		
百十四銀行	7,100	1,618.00	11,487,800	貸付株式数	1,700株
四国銀行	10,200	708.00	7,221,600	貸付株式数	2,700株
阿波銀行	10,800	2,568.00	27,734,400	貸付株式数	400株
大分銀行	3,900	2,325.00	9,067,500		
宮崎銀行	4,500	2,300.00	10,350,000		
佐賀銀行	4,000	1,370.00	5,480,000	貸付株式数	300株
沖縄銀行	6,100	2,953.00	18,013,300	貸付株式数	600株
琉球銀行	15,500	873.00	13,531,500		
セブン銀行	222,800	229.00	51,021,200	貸付株式数	51,800株
みずほフィナンシャルG	901,100	1,327.50	1,196,210,250		
高知銀行	2,500	786.00	1,965,000		
山口フィナンシャルG	82,600	652.00	53,855,200		
芙蓉総合リース	7,000	6,380.00	44,660,000		

みずほリース	10,200	2,777.00	28,325,400		
東京センチュリー	13,400	6,910.00	92,594,000	貸付株式数	3,000株
SBIホールディングス	75,100	2,830.00	212,533,000	貸付株式数	4,400株
日本証券金融	29,500	500.00	14,750,000	貸付株式数	7,900株
アイフル	102,000	267.00	27,234,000		
日本アジア投資	6,300	225.00	1,417,500		
長野銀行	2,100	1,450.00	3,045,000		
名古屋銀行	5,100	2,706.00	13,800,600		
北洋銀行	101,000	233.00	23,533,000		
愛知銀行	2,400	3,080.00	7,392,000		
中京銀行	2,700	2,139.00	5,775,300	貸付株式数	1,000株
大光銀行	2,200	1,253.00	2,756,600		
愛媛銀行	9,000	1,075.00	9,675,000	貸付株式数	2,200株
トマト銀行	2,500	1,101.00	2,752,500		
京葉銀行	28,000	457.00	12,796,000		
栃木銀行	31,600	183.00	5,782,800		
北日本銀行	2,000	2,041.00	4,082,000		
東和銀行	11,700	642.00	7,511,400	貸付株式数	1,500株
福島銀行	7,300	225.00	1,642,500	貸付株式数	2,500株
大東銀行	3,300	615.00	2,029,500		
リコーリース	5,200	2,901.00	15,085,200	貸付株式数	2,100株
イオンフィナンシャルサー ビス	40,900	1,138.00	46,544,200	貸付株式数	16,400株
アコム	133,000	501.00	66,633,000		
ジャックス	7,400	1,816.00	13,438,400		
オリコ	180,900	115.00	20,803,500		
日立キャピタル	15,700	2,394.00	37,585,800		
オリックス	411,500	1,553.00	639,059,500		
三菱UFJリース	167,900	479.00	80,424,100		
ジャフコグループ	10,300	4,480.00	46,144,000		
九州リースサービス	2,900	608.00	1,763,200	貸付株式数	1,200株
トモニホールディングス	51,500	334.00	17,201,000		
大和証券G本社	534,400	454.10	242,671,040		
野村ホールディングス	1,166,900	524.00	611,455,600		
岡三証券グループ	56,400	369.00	20,811,600	貸付株式数	2,500株
丸三証券	19,700	474.00	9,337,800		
東洋証券	24,300	133.00	3,231,900	貸付株式数	500株
東海東京HD	76,600	308.00	23,592,800	貸付株式数	30,600株
光世証券	1,800	682.00	1,227,600		
水戸証券	19,100	236.00	4,507,600	貸付株式数	7,200株

いちよし証券	12,200	470.00	5,734,000	
松井証券	37,700	840.00	31,668,000	
S O M P Oホールディングス	124,800	4,010.00	500,448,000	
日本取引所グループ	190,600	2,583.50	492,415,100	
マネックスG	50,000	349.00	17,450,000	貸付株式数 19,900株
極東証券	8,700	722.00	6,281,400	貸付株式数 2,100株
岩井コスモホールディング	6,300	1,332.00	8,391,600	
藍澤證券	12,000	724.00	8,688,000	
フィデアホール	64,400	109.00	7,019,600	
池田泉州HD	76,900	152.00	11,688,800	
アニコム ホールディングス	22,000	1,093.00	24,046,000	
M S & A D	173,500	3,035.00	526,572,500	
マネーパートナーズGP	6,600	205.00	1,353,000	
スパークス・グループ	30,800	235.00	7,238,000	貸付株式数 6,600株
小林洋行	2,800	266.00	744,800	
第一生命HLDGS	375,500	1,644.50	617,509,750	
東京海上HD	234,600	5,190.00	1,217,574,000	
アドバンテッジリスクマネ	3,300	692.00	2,283,600	貸付株式数 1,300株
イー・ギャランティ	7,400	2,067.00	15,295,800	貸付株式数 400株
アサックス	3,500	706.00	2,471,000	貸付株式数 300株
NECキャピタルソリューション	2,700	1,813.00	4,895,100	
T & Dホールディングス	198,400	1,219.00	241,849,600	
アドバンスクリエイト	1,600	1,920.00	3,072,000	貸付株式数 500株
三井不動産	322,400	2,181.50	703,315,600	
三菱地所	464,700	1,804.00	838,318,800	
平和不動産	12,200	3,420.00	41,724,000	
東京建物	65,300	1,433.00	93,574,900	
ダイビル	17,000	1,343.00	22,831,000	貸付株式数 6,800株
京阪神ビルディング	10,500	1,918.00	20,139,000	貸付株式数 400株
住友不動産	149,000	3,405.00	507,345,000	
太平洋興発	2,600	618.00	1,606,800	貸付株式数 300株
テーオーシー	12,500	639.00	7,987,500	
東京楽天地	1,100	4,355.00	4,790,500	貸付株式数 200株
スターツコーポレーション	8,900	2,819.00	25,089,100	貸付株式数 3,300株
フジ住宅	7,700	615.00	4,735,500	貸付株式数 2,200株
空港施設	6,300	464.00	2,923,200	
明和地所	4,000	533.00	2,132,000	

ゴールドクレスト	5,000	1,405.00	7,025,000	貸付株式数	2,000株
リログループ	35,200	2,913.00	102,537,600	貸付株式数	500株
エスリード	2,700	1,317.00	3,555,900		
日神グループHLDGS	10,300	377.00	3,883,100	貸付株式数	3,700株
日本エスコ	12,200	922.00	11,248,400		
タカラレーベン	30,200	296.00	8,939,200	貸付株式数	3,800株
AVANTIA	3,800	805.00	3,059,000	貸付株式数	600株
イオンモール	33,100	1,675.00	55,442,500	貸付株式数	13,300株
毎日コムネット	2,000	715.00	1,430,000		
ファースト住建	2,900	1,069.00	3,100,100	貸付株式数	1,100株 (100株)
ランド	378,100	9.00	3,402,900		
カチタス	16,500	3,100.00	51,150,000	貸付株式数	5,000株
東祥	4,000	1,330.00	5,320,000		
トーセイ	9,400	1,163.00	10,932,200	貸付株式数	3,700株
穴吹興産	1,500	1,681.00	2,521,500	貸付株式数	600株
サンフロンティア不動産	9,400	921.00	8,657,400		
インテリックス	2,400	560.00	1,344,000	貸付株式数	100株
ランドビジネス	2,600	336.00	873,600		
サンネクスタグループ	1,900	1,025.00	1,947,500		
グランディハウス	5,300	380.00	2,014,000		
東武鉄道	70,000	3,130.00	219,100,000		
相鉄ホールディングス	21,400	2,549.00	54,548,600	貸付株式数	1,600株
東急	169,400	1,267.00	214,629,800		
京浜急行	86,200	1,787.00	154,039,400	貸付株式数	27,100株
小田急電鉄	100,000	3,165.00	316,500,000		
京王電鉄	34,900	7,410.00	258,609,000		
京成電鉄	46,800	3,505.00	164,034,000		
富士急行	9,200	4,825.00	44,390,000	貸付株式数	3,600株
新京成電鉄	1,700	2,150.00	3,655,000	貸付株式数	600株
東日本旅客鉄道	118,400	6,488.00	768,179,200		
西日本旅客鉄道	60,000	4,764.00	285,840,000		
東海旅客鉄道	55,900	13,300.00	743,470,000		
西武ホールディングス	88,200	1,035.00	91,287,000		
鴻池運輸	10,600	1,037.00	10,992,200		
西日本鉄道	18,600	2,959.00	55,037,400	貸付株式数	4,200株
ハマキョウレックス	5,200	2,921.00	15,189,200		
サカイ引越センター	3,600	5,170.00	18,612,000		
近鉄グループHLDGS	63,700	4,630.00	294,931,000		
阪急阪神HLDGS	84,700	3,410.00	288,827,000		

南海電鉄	30,100	2,622.00	78,922,200	貸付株式数	4,800株
京阪ホールディングス	28,300	4,915.00	139,094,500	貸付株式数	3,100株
神戸電鉄	1,500	3,595.00	5,392,500		
名古屋鉄道	52,300	2,872.00	150,205,600	貸付株式数	5,300株
山陽電鉄	4,600	2,033.00	9,351,800		
トランコム	1,800	8,380.00	15,084,000		
日本通運	22,000	6,980.00	153,560,000		
ヤマトホールディングス	111,800	2,637.00	294,816,600		
山 九	17,700	3,845.00	68,056,500		
日 新	5,600	1,212.00	6,787,200		
丸 運	3,500	248.00	868,000	貸付株式数	800株
丸全昭和運輸	5,200	3,345.00	17,394,000	貸付株式数	800株
センコーグループHLDGS	35,100	970.00	34,047,000	貸付株式数	13,900株
トナミホールディングス	1,500	5,850.00	8,775,000		
ニッコンホールディングス	22,700	2,032.00	46,126,400		
日石輸送	600	2,583.00	1,549,800		
福山通運	8,100	4,630.00	37,503,000	貸付株式数	2,100株
セイノーホールディングス	47,800	1,462.00	69,883,600		
エスライン	2,000	932.00	1,864,000	貸付株式数	500株
神奈川中央交通	1,600	3,860.00	6,176,000	貸付株式数	500株
日立物流	11,700	3,110.00	36,387,000		
丸和運輸機関	6,800	4,625.00	31,450,000		
C & F ロジホールディングス	6,400	1,858.00	11,891,200		
日本郵船	53,400	2,276.00	121,538,400		
商船三井	40,400	2,728.00	110,211,200		
川崎汽船	19,700	1,689.00	33,273,300	貸付株式数	7,800株
NSユニテッド海運	3,600	1,325.00	4,770,000		
明治海運	6,600	409.00	2,699,400		
飯野海運	30,200	387.00	11,687,400		
共栄タンカー	1,200	816.00	979,200		
九州旅客鉄道	55,900	2,198.00	122,868,200		
SGホールディングス	133,900	3,120.00	417,768,000		
日本航空	142,600	1,977.00	281,920,200		
ANAホールディングス	116,600	2,517.50	293,540,500		
パスコ	1,300	1,283.00	1,667,900		
西本WISMETTACHD	1,200	2,255.00	2,706,000	貸付株式数	400株
シルバーライフ	900	1,970.00	1,773,000		

ヤマシタヘルスケアHLD GS	700	1,419.00	993,300	貸付株式数	100株
一家ダイニングプロジ	500	551.00	275,500	貸付株式数	200株
GENKY DRUGS STORES	2,900	4,150.00	12,035,000		
国際紙パルプ商事	15,900	255.00	4,054,500		
ナルミヤ・インターナシヨ ナル	1,400	751.00	1,051,400		
ブックオフGHD	3,900	839.00	3,272,100	貸付株式数	1,500株
三菱倉庫	20,200	2,990.00	60,398,000		
三井倉庫HOLD	7,400	2,247.00	16,627,800		
住友倉庫	22,600	1,350.00	30,510,000		
渋沢倉庫	3,500	2,246.00	7,861,000		
ヤマタネ	3,300	1,371.00	4,524,300		
東陽倉庫	11,300	304.00	3,435,200		
乾汽船	3,700	938.00	3,470,600	貸付株式数	100株
日本トランスシティ	13,800	566.00	7,810,800	貸付株式数	2,800株
ケイヒン	1,200	1,379.00	1,654,800	貸付株式数	300株
中央倉庫	3,900	1,200.00	4,680,000		
川西倉庫	1,100	1,141.00	1,255,100	貸付株式数	100株
安田倉庫	5,100	988.00	5,038,800		
ファイズホールディングス	1,400	1,111.00	1,555,400	貸付株式数	500株
東洋埠頭	2,000	1,444.00	2,888,000		
宇徳	5,500	463.00	2,546,500	貸付株式数	1,200株
上組	35,600	1,805.00	64,258,000		
サンリツ	1,500	683.00	1,024,500		
キムラユニティー	1,600	1,032.00	1,651,200		
キューソー流通システム	1,600	1,650.00	2,640,000	貸付株式数	600株
近鉄エクスプレス	13,600	2,170.00	29,512,000	貸付株式数	5,400株
東海運	3,600	306.00	1,101,600	貸付株式数	1,300株
エーアイティー	4,500	994.00	4,473,000		
内外トランスライン	2,100	1,270.00	2,667,000	貸付株式数	800株
ショーエイコーポ	900	1,027.00	924,300	貸付株式数	300株
日本コンセプト	2,000	1,743.00	3,486,000	貸付株式数	500株
TBSホールディングス	40,000	1,869.00	74,760,000		
日本テレビHLD S	54,900	1,137.00	62,421,300	貸付株式数	22,000株
朝日放送グループHD	6,400	693.00	4,435,200	貸付株式数	2,500株
テレビ朝日HD	18,100	1,684.00	30,480,400	貸付株式数	7,300株
スカパーJ S A T H D	43,600	473.00	20,622,800		
テレビ東京HD	5,400	2,349.00	12,684,600	貸付株式数	600株

日本BS放送	2,100	1,062.00	2,230,200	貸付株式数	800株
ビジョン	6,700	1,156.00	7,745,200	貸付株式数	2,400株
スマートバリュー	1,800	965.00	1,737,000	貸付株式数	600株
USEN-NEXT HLDGS	2,600	1,354.00	3,520,400	貸付株式数	1,000株
ワイヤレスゲート	3,200	650.00	2,080,000	貸付株式数	700株
コネクシオ	3,800	1,227.00	4,662,600		
日本通信	51,700	203.00	10,495,100	貸付株式数	19,600株
クロップス	1,300	804.00	1,045,200		
日本電信電話	882,200	2,465.00	2,174,623,000		
KDDI	481,200	2,982.50	1,435,179,000		
ソフトバンク	600,700	1,284.50	771,599,150		
光通信	6,800	25,070.00	170,476,000		
エムティーアイ	6,400	842.00	5,388,800		
GMOインターネット	24,000	2,936.00	70,464,000		
ファイバーゲート	2,100	2,128.00	4,468,800	貸付株式数	800株
アイドママーケティングコム	2,100	381.00	800,100		
KADOKAWA	17,900	3,310.00	59,249,000		
学研ホールディングス	8,900	1,634.00	14,542,600		
ゼンリン	13,300	1,296.00	17,236,800		
昭文社ホールディングス	3,100	491.00	1,522,100	貸付株式数	1,200株
インプレスホールディングス	5,300	174.00	922,200		
東京電力HD	537,100	272.00	146,091,200	貸付株式数	66,000株
中部電力	205,500	1,257.50	258,416,250		
関西電力	254,500	955.30	243,123,850		
中国電力	97,100	1,327.00	128,851,700		
北陸電力	61,400	735.00	45,129,000	貸付株式数	1,300株
東北電力	167,700	875.00	146,737,500		
四国電力	60,400	710.00	42,884,000		
九州電力	138,500	881.00	122,018,500		
北海道電力	63,600	392.00	24,931,200		
沖縄電力	13,200	1,451.00	19,153,200		
電源開発	53,500	1,404.00	75,114,000		
エフオン	3,700	1,180.00	4,366,000	貸付株式数	1,200株
イーレックス	9,700	1,964.00	19,050,800	貸付株式数	3,800株
レノバ	11,300	2,590.00	29,267,000	貸付株式数	4,500株
東京瓦斯	129,400	2,344.50	303,378,300		
大阪瓦斯	130,500	2,004.00	261,522,000		

東邦瓦斯	33,100	6,830.00	226,073,000	貸付株式数	13,300株
北海道瓦斯	3,600	1,520.00	5,472,000		
広島ガス	14,200	371.00	5,268,200	貸付株式数	4,500株
西部瓦斯	7,500	3,550.00	26,625,000		
静岡ガス	19,300	989.00	19,087,700	貸付株式数	2,200株
メタウォーター	6,600	2,363.00	15,595,800		
アイネット	3,400	1,488.00	5,059,200	貸付株式数	1,300株
松竹	4,400	13,010.00	57,244,000	貸付株式数	600株
東宝	39,000	4,420.00	172,380,000		
エイチ・アイ・エス	10,100	1,610.00	16,261,000	貸付株式数	4,000株
東映	2,500	16,740.00	41,850,000	貸付株式数	500株
ラックランド	1,500	2,336.00	3,504,000	貸付株式数	600株
NTTデータ	175,500	1,388.00	243,594,000		
共立メンテナンス	10,700	3,635.00	38,894,500		
イチネンホールディングス	7,200	1,312.00	9,446,400	貸付株式数	2,800株
建設技術研究所	4,200	2,115.00	8,883,000		
スペース	4,100	807.00	3,308,700		
長大	2,500	1,303.00	3,257,500		
アインホールディングス	8,200	7,110.00	58,302,000	貸付株式数	3,100株
燦ホールディングス	2,800	1,220.00	3,416,000	貸付株式数	300株
ピー・シー・エー	1,100	4,535.00	4,988,500	貸付株式数	400株 (400株)
スバル興業	400	8,130.00	3,252,000		
東京テアトル	3,100	1,288.00	3,992,800	貸付株式数	900株
タナベ経営	1,100	1,318.00	1,449,800		
ビジネスB太田昭和	2,200	1,727.00	3,799,400	貸付株式数	200株
ナガワ	2,000	9,140.00	18,280,000	貸付株式数	200株
よみうりランド	1,400	6,040.00	8,456,000	貸付株式数	500株
東京都競馬	4,200	5,170.00	21,714,000	貸付株式数	1,600株
常磐興産	2,600	1,453.00	3,777,800	貸付株式数	1,000株
カナモト	10,700	2,173.00	23,251,100	貸付株式数	4,200株
東京ドーム	26,400	1,347.00	35,560,800	貸付株式数	7,000株
DTS	14,800	2,200.00	32,560,000		
スクウェア・エニックス・HD	28,200	6,410.00	180,762,000	貸付株式数	11,300株
シーイーシー	7,100	1,517.00	10,770,700		
カプコン	31,200	5,880.00	183,456,000		
西尾レントオール	6,000	2,033.00	12,198,000		
アイ・エス・ビー	1,400	2,993.00	4,190,200		

アゴラ・ホスピタリティーG	47,500	24.00	1,140,000		
日本空港ビルデング	21,200	6,080.00	128,896,000	貸付株式数	8,500株
トランス・コスモス	6,200	2,700.00	16,740,000		
乃村工藝社	27,700	780.00	21,606,000		
ジャステック	4,200	1,365.00	5,733,000	貸付株式数	1,600株
S C S K	15,200	6,230.00	94,696,000	貸付株式数	200株
藤田観光	2,900	1,475.00	4,277,500	貸付株式数	1,100株 (100株)
KNT-CTホールディングス	3,900	889.00	3,467,100	貸付株式数	1,500株
日本管財	6,900	2,074.00	14,310,600		
トーカイ	6,200	2,033.00	12,604,600		
白洋舎	800	2,447.00	1,957,600	貸付株式数	300株
セコム	68,200	10,395.00	708,939,000		
日本システムウエア	2,200	2,103.00	4,626,600		
セントラル警備保障	3,100	3,475.00	10,772,500		
アイネス	6,500	1,424.00	9,256,000		
丹青社	12,200	762.00	9,296,400		
メイテック	8,000	4,805.00	38,440,000		
T K C	5,600	6,940.00	38,864,000	貸付株式数	900株
富士ソフト	7,100	5,060.00	35,926,000	貸付株式数	2,800株
応用地質	6,900	1,215.00	8,383,500		
船井総研ホールディング	13,300	2,516.00	33,462,800		
N S D	21,200	1,995.00	42,294,000		
進学会ホールディングス	2,500	445.00	1,112,500	貸付株式数	100株
丸紅建材リース	700	1,724.00	1,206,800		
オオバ	4,800	753.00	3,614,400	貸付株式数	1,100株
コナミホールディングス	24,000	5,470.00	131,280,000		
いであ	1,500	1,736.00	2,604,000	貸付株式数	600株
学究社	1,800	1,212.00	2,181,600	貸付株式数	100株
ベネッセホールディングス	21,500	2,192.00	47,128,000		
イオンディライト	7,900	2,634.00	20,808,600		
ナック	3,600	915.00	3,294,000	貸付株式数	600株
福井コンピュータH L D S	2,600	3,355.00	8,723,000	貸付株式数	1,000株
ダイセキ	10,800	2,961.00	31,978,800		
ステップ	2,400	1,561.00	3,746,400	貸付株式数	900株
日鉄物産	4,700	3,550.00	16,685,000		
泉州電業	2,000	2,875.00	5,750,000	貸付株式数	700株
元気寿司	1,700	2,325.00	3,952,500	貸付株式数	100株

トラスコ中山	14,900	2,606.00	38,829,400	貸付株式数	4,200株
ヤマダホールディングス	201,900	496.00	100,142,400	貸付株式数	61,200株
オートバックスセブン	24,600	1,296.00	31,881,600		
モリト	4,900	612.00	2,998,800		
アークランドサカモト	10,500	1,789.00	18,784,500		
ニトリホールディングス	28,700	22,230.00	638,001,000		
グルメ杵屋	4,700	981.00	4,610,700	貸付株式数	1,800株 (200株)
愛眼	5,400	226.00	1,220,400	貸付株式数	2,100株
ケーユーホールディングス	2,900	801.00	2,322,900	貸付株式数	200株
吉野家ホールディングス	22,000	1,906.00	41,932,000	貸付株式数	8,500株
加藤産業	9,600	3,455.00	33,168,000	貸付株式数	2,300株
北恵	1,600	953.00	1,524,800	貸付株式数	600株
イノテック	3,800	906.00	3,442,800		
イエローハット	12,600	1,610.00	20,286,000	貸付株式数	5,000株
松屋フーズHLDGS	3,200	3,430.00	10,976,000		
JBCホールディングス	4,500	1,481.00	6,664,500		
JKホールディングス	6,000	810.00	4,860,000	貸付株式数	2,100株
サガミホールディングス	8,900	1,243.00	11,062,700	貸付株式数	3,100株
日伝	6,000	2,358.00	14,148,000	貸付株式数	2,200株
関西スーパーマーケット	5,500	1,252.00	6,886,000	貸付株式数	800株
ミロク情報サービス	5,900	2,039.00	12,030,100	貸付株式数	1,300株 (400株)
北沢産業	5,200	280.00	1,456,000		
杉本商事	3,500	2,385.00	8,347,500	貸付株式数	1,100株
因幡電機産業	18,800	2,397.00	45,063,600	貸付株式数	3,600株
王将フードサービス	4,900	6,000.00	29,400,000		
プレナス	7,200	1,737.00	12,506,400	貸付株式数	1,100株
ミニストップ	5,000	1,350.00	6,750,000	貸付株式数	1,700株
アークス	13,600	2,182.00	29,675,200		
パローホールディングス	14,700	2,592.00	38,102,400		
東テク	2,200	2,520.00	5,544,000		
ミスミグループ本社	83,000	3,275.00	271,825,000	貸付株式数	3,800株
藤久	1,200	891.00	1,069,200	貸付株式数	400株
アルテック	5,600	292.00	1,635,200		
ベルク	3,300	6,110.00	20,163,000		
大庄	3,500	960.00	3,360,000	貸付株式数	1,400株
タキヒヨー	2,000	1,874.00	3,748,000	貸付株式数	700株
ファーストリテイリング	8,900	85,940.00	764,866,000		
ソフトバンクグループ	523,900	7,272.00	3,809,800,800		

蔵王産業	1,100	1,308.00	1,438,800	
スズケン	28,000	3,990.00	111,720,000	貸付株式数 1,300株
サンドラッグ	25,000	4,380.00	109,500,000	
サックスパーホールディング	5,500	531.00	2,920,500	貸付株式数 2,200株
ジェコス	4,500	957.00	4,306,500	
ヤマザワ	1,400	1,726.00	2,416,400	貸付株式数 500株
やまや	1,300	2,110.00	2,743,000	
グローセル	6,500	420.00	2,730,000	
ベルーナ	14,400	956.00	13,766,400	貸付株式数 5,700株
合計			163,479,342,460	

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

ソニー	20,000株	トヨタ自動車	40,000株
本田技研	30,000株	三菱UFJフィナンシャルG	200,000株
三井住友フィナンシャルG	30,000株		

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【ダイワ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) 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4期計算期間（2019年12月3日から2020年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 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3期 2019年12月2日現在	第4期 2020年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,188,312	6,646,461
親投資信託受益証券	2,352,940,005	3,369,117,428
未収入金	-	2,260,000
流動資産合計	2,358,128,317	3,378,023,889
資産合計	2,358,128,317	3,378,023,889
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,135,269	3,407,283
未払受託者報酬	246,432	334,762
未払委託者報酬	3,512,238	4,770,876
その他未払費用	62,268	83,614
流動負債合計	4,956,207	8,596,535
負債合計	4,956,207	8,596,535
純資産の部		
元本等		
元本	1,803,208,621	2,298,185,009
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	549,963,489	1,071,242,345
（分配準備積立金）	296,310,511	725,970,183
元本等合計	2,353,172,110	3,369,427,354
純資産合計	2,353,172,110	3,369,427,354
負債純資産合計	2,358,128,317	3,378,023,889

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第3期		第4期	
	自	2018年12月1日 至 2019年12月2日	自	2019年12月3日 至 2020年11月30日
営業収益				
受取利息		5		13
有価証券売買等損益		316,715,684		543,557,423
営業収益合計		316,715,689		543,557,436
営業費用				
支払利息		3,241		1,923
受託者報酬		485,725		603,298
委託者報酬		6,922,945		8,598,025
その他費用		122,143		150,717
営業費用合計		7,534,054		9,353,963
営業利益		309,181,635		534,203,473
経常利益		309,181,635		534,203,473
当期純利益		309,181,635		534,203,473
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		40,059,991		22,224,511
期首剰余金又は期首欠損金()		273,851,379		549,963,489
剰余金増加額又は欠損金減少額		106,635,362		185,885,163
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		106,635,362		185,885,163
剰余金減少額又は欠損金増加額		99,644,896		176,585,269
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		99,644,896		176,585,269
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		549,963,489		1,071,242,345

(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4期	
	自 2019年12月3日	至 2020年11月30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 2019年11月30日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2019年12月2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3期	第4期
	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1. 1 期首元本額	1,924,332,921円	1,803,208,621円
期中追加設定元本額	570,028,310円	1,186,063,315円
期中一部解約元本額	691,152,610円	691,086,927円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,803,208,621口	2,298,185,009口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第3期	第4期
	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(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(256,062,759円)、投資信託約款に規定される収益調整金(253,655,729円)及び分配準備積立金(40,247,752円)より分配対象額は549,966,240円(1万口当たり3,049.93円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(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(511,978,636円)、投資信託約款に規定される収益調整金(345,273,823円)及び分配準備積立金(213,991,547円)より分配対象額は1,071,244,006円(1万口当たり4,661.26円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	--	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第4期 自 2019年12月3日 至 2020年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第4期
	2020年11月30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3期	第4期
	2019年12月2日現在	2020年11月30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	290,744,938	525,718,724
合計	290,744,938	525,718,724

（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3期	第4期
2019年12月2日現在	2020年11月30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4期
自 2019年12月3日
至 2020年11月30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3期	第4期
	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3050円 (13,050円)	1.4661円 (14,661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	1,431,778,262	3,369,117,428	
親投資信託受益証券 合計			3,369,117,428	
合計			3,369,117,428	

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

	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		

預金	168,607,416	190,759,416
コール・ローン	1,859,345,653	1,771,762,663
株式	47,526,836,374	58,258,068,193
新株予約権証券	-	339,438
投資証券	1,442,585,740	1,445,356,342
派生商品評価勘定	44,934,029	562,322,330
未収入金	3,756,315	1,577,292
未収配当金	81,534,869	70,550,815
差入委託証拠金	438,313,323	579,571,081
流動資産合計	51,565,913,719	62,880,307,570
資産合計	51,565,913,719	62,880,307,570
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	14,026,742	315,926,545
未払金	671,432,684	-
未払解約金	-	2,260,000
その他未払費用	1,776	-
流動負債合計	685,461,202	318,186,545
負債合計	685,461,202	318,186,545
純資産の部		
元本等		
元本	1	24,374,861,574
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		26,505,590,943
元本等合計		50,880,452,517
純資産合計		50,880,452,517
負債純資産合計		51,565,913,719

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

(2)新株予約権証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

(3)投資証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

2. 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

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1. 1 期首	2018年12月1日	2019年12月3日
期首元本額	21,183,891,958円	24,374,861,574円
期中追加設定元本額	7,928,013,825円	10,181,262,768円
期中一部解約元本額	4,737,044,209円	7,969,137,949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）	19,758,559,458円	20,735,729,595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）	1,127,210,887円	1,431,778,262円
iFree 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	450,959,556円	852,840,980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)	3,038,131,673円	3,566,637,556円
計	24,374,861,574円	26,586,986,393円
2. 期末日における受益権の総数	24,374,861,574口	26,586,986,393口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年12月3日 至 2020年11月30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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年11月30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	2019年12月2日現在	2020年11月30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	6,657,866,619	5,760,707,661
新株予約権証券	-	22,807
投資証券	197,897,479	91,977,896
合計	6,855,764,098	5,668,752,572

(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(2019年1月11日から2019年12月2日まで、及び2020年1月11日から2020年11月30日まで)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	2019年12月2日 現在				2020年11月30日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数								
先物取引								

買 建	1,897,988,165	-	1,941,062,835	43,074,670	2,687,761,304	-	2,926,736,137	238,974,833
合計	1,897,988,165	-	1,941,062,835	43,074,670	2,687,761,304	-	2,926,736,137	238,974,833

(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	2019年12月2日 現在				2020年11月30日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	49,746,495,589	-	49,758,662,972	12,167,383	54,250,863,772	-	54,243,441,600	7,422,172
アメリカ・ドル	34,459,932,754	-	34,468,961,085	9,028,331	39,552,874,994	-	39,234,451,555	318,423,439
イギリス・ ポンド	2,944,929,704	-	2,945,334,552	404,848	2,316,093,489	-	2,370,724,188	54,630,699
イスラエル・ シケル	66,588,374	-	66,526,112	62,262	59,858,151	-	61,146,761	1,288,610
オーストラリ ア・ドル	1,253,805,486	-	1,254,091,794	286,308	1,181,968,356	-	1,239,950,980	57,982,624
カナダ・ドル	1,779,659,826	-	1,780,472,617	812,791	1,788,306,856	-	1,823,271,520	34,964,664
シンガポー ル・ドル	243,343,854	-	243,420,683	76,829	209,011,366	-	212,167,384	3,156,018
スイス・フラン	1,649,858,436	-	1,649,956,392	97,956	1,774,145,508	-	1,784,840,268	10,694,760
スウェーデン・ クローナ	495,067,378	-	494,937,700	129,678	602,573,643	-	626,525,510	23,951,867
デンマーク・ クローネ	343,572,015	-	343,531,650	40,365	475,836,647	-	485,223,309	9,386,662

ニュージ ランド・ドル	55,227,406	-	55,302,444	75,038	66,767,482	-	70,687,700	3,920,218
ノルウェー クローネ	114,991,308	-	114,923,400	67,908	110,749,078	-	118,900,600	8,151,522
ユーロ	5,730,251,890	-	5,731,703,963	1,452,073	5,540,018,954	-	5,647,747,536	107,728,582
香港・ドル	609,267,158	-	609,500,580	233,422	572,659,248	-	567,804,289	4,854,959
買 建	-	-	-	-	18,676,220	-	18,675,000	1,220
カナダ・ドル	-	-	-	-	11,992,140	-	11,991,000	1,140
デンマーク クローネ	-	-	-	-	6,684,080	-	6,684,000	80
合計	49,746,495,589	-	49,758,662,972	12,167,383	54,269,539,992	-	54,262,116,600	7,420,952

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1口当たり純資産額	2.0874円	2.3531円
(1万口当たり純資産額)	(20,874円)	(23,531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		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	1,295	147.400	190,883.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	1,220	295.310	360,278.200	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	2,271	119.070	270,407.970	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,594	88.130	140,479.220	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	746	143.280	106,886.880	
	SYNCHRONY FINANCIAL	6,200	31.090	192,758.000	
	ABBOTT LABORATORIES	22,370	107.620	2,407,459.400	
	HOWMET AEROSPACE INC	3,950	24.600	97,170.000	
	VERISK ANALYTICS INC	1,943	198.230	385,160.890	
	LAS VEGAS SANDS CORP	4,729	56.590	267,614.110	
	AMPHENOL CORP-CL A	4,167	131.950	549,835.650	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	7,766	148.280	1,151,542.480	
	QORVO INC	1,283	150.110	192,591.130	
	AFLAC INC	8,471	45.280	383,566.880	
	DARDEN RESTAURANTS INC	1,248	109.950	137,217.600	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1,835	67.230	123,367.050	
	ADOBE INC	6,097	477.030	2,908,451.910	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,872	38.770	111,347.440	
	LULULEMON ATHLETICA INC	1,607	365.390	587,181.730	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	4,409	12.860	56,699.740	
	GARMIN LTD	1,527	117.050	178,735.350	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2,819	277.830	783,202.770	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	8,826	209.410	1,848,252.660	
	WR BERKLEY CORP	1,771	64.410	114,070.110	
	AUTOZONE INC	291	1,119.240	325,698.840	
	DOLLAR TREE INC	3,398	109.900	373,440.200	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	12,365	9.820	121,424.300	
	PINNACLE WEST CAPITAL	1,508	83.940	126,581.520	
	CELANESE CORP	1,297	133.680	173,382.960	
DR HORTON INC	4,397	75.980	334,084.060		
DENTSPLY SIRONA INC	2,450	51.660	126,567.000		
AUTODESK INC	2,684	272.810	732,222.040		
MOODY'S CORP	2,143	277.220	594,082.460		

ALBEMARLE CORP	1,668	137.660	229,616.880	
ATMOS ENERGY CORP	1,654	96.820	160,140.280	
ALLIANT ENERGY CORP	3,614	52.760	190,674.640	
CITIGROUP INC	26,168	56.670	1,482,940.560	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	5,355	175.250	938,463.750	
AMERICAN ELECTRIC POWER	5,918	84.920	502,556.560	
ALLEGHANY CORP	146	589.880	86,122.480	
DOMINO'S PIZZA INC	526	390.470	205,387.220	
HESS CORP	3,426	50.770	173,938.020	
DAVITA INC	1,000	109.880	109,880.000	
DANAHER CORP	8,031	216.780	1,740,960.180	
FORTIVE CORP	4,335	71.430	309,649.050	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	7,172	104.990	752,988.280	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	6,580	50.450	331,961.000	
BUNGE LTD	1,838	60.840	111,823.920	
TE CONNECTIVITY LTD	4,221	115.310	486,723.510	
APPLE INC	219,106	116.590	25,545,568.540	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	3,359	78.870	264,924.330	
BOEING CO/THE	6,741	216.500	1,459,426.500	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,063	77.810	160,522.030	
BECTON DICKINSON AND CO	3,679	228.960	842,343.840	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	2,000	18.490	36,980.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	1,400	102.280	143,192.000	
CDK GLOBAL INC	1,100	46.740	51,414.000	
NISOURCE INC	4,026	24.510	98,677.260	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,708	92.720	158,365.760	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	9,978	39.950	398,621.100	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	51,978	60.580	3,148,827.240	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	17,371	231.550	4,022,255.050	
ANSYS INC	1,038	330.410	342,965.580	
TRUIST FINANCIAL CORP	17,123	48.500	830,465.500	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	8,193	60.530	495,922.290	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	28,615	63.050	1,804,175.750	
JPMORGAN CHASE & CO	38,284	121.220	4,640,786.480	
T ROWE PRICE GROUP INC	3,013	145.630	438,783.190	
LKQ CORP	3,300	35.980	118,734.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	547	171.390	93,750.330	

BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,665	81.100	297,231.500	
CADENCE DESIGN SYS INC	3,614	116.580	421,320.120	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,611	190.750	307,298.250	
DOLLAR GENERAL CORP	3,052	218.010	665,366.520	
SERVICENOW INC	2,419	527.480	1,275,974.120	
CATERPILLAR INC	6,856	175.080	1,200,348.480	
BROWN & BROWN INC	2,886	45.620	131,659.320	
ESSENTIAL UTILITIES INC	2,478	45.790	113,467.620	
CMS ENERGY CORP	3,384	61.980	209,740.320	
MOSAIC CO/THE	5,209	22.680	118,140.120	
DELTA AIR LINES INC	1,650	41.060	67,749.000	
CORNING INC	9,983	37.090	370,269.470	
CISCO SYSTEMS INC	53,450	42.700	2,282,315.000	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	1,297	51.130	66,315.610	
MORGAN STANLEY	18,909	63.840	1,207,150.560	
MSCI INC	1,006	402.250	404,663.500	
FAIR ISAAC CORP	398	473.520	188,460.960	
LENNOX INTERNATIONAL INC	450	289.960	130,482.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,780	69.620	193,543.600	
BROADCOM INC	5,058	394.950	1,997,657.100	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,416	129.860	183,881.760	
ARAMARK	3,173	36.180	114,799.140	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	1,612	28.910	46,602.920	
DTE ENERGY COMPANY	2,739	128.530	352,043.670	
CENTENE CORP	7,779	63.170	491,399.430	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,358	91.710	124,542.180	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5,532	34.140	188,862.480	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,232	115.860	258,599.520	
GARTNER INC	1,174	152.550	179,093.700	
SPLUNK INC	2,029	204.030	413,976.870	
DOMINION ENERGY INC	10,995	79.040	869,044.800	
MONSTER BEVERAGE CORP	4,768	84.150	401,227.200	
SMITH (A.O.) CORP	1,400	57.080	79,912.000	
DEERE & CO	3,623	261.950	949,044.850	
GLOBAL PAYMENTS INC	3,866	197.030	761,717.980	
VMWARE INC-CLASS A	892	142.080	126,735.360	
CABLE ONE INC	60	1,962.060	117,723.600	
BURLINGTON STORES INC	766	221.580	169,730.280	
NASDAQ INC	1,427	127.120	181,400.240	

VAIL RESORTS INC	553	282.670	156,316.510	
EAST WEST BANCORP INC	1,461	43.740	63,904.140	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	894	120.220	107,476.680	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	874	93.130	81,395.620	
CONSOLIDATED EDISON INC	4,602	77.770	357,897.540	
COGNEX CORP	2,439	74.500	181,705.500	
TELEFLEX INC	563	371.050	208,901.150	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	979	135.290	132,448.910	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	852	277.960	236,821.920	
BIO-RAD LABORATORIES-A	300	535.070	160,521.000	
CATALENT INC	2,000	97.400	194,800.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,757	276.450	485,722.650	
MOLINA HEALTHCARE INC	800	207.020	165,616.000	
IDEX CORP	1,156	192.360	222,368.160	
COLGATE-PALMOLIVE CO	10,486	84.900	890,261.400	
ROLLINS INC	1,790	57.030	102,083.700	
AMETEK INC	2,597	119.770	311,042.690	
CHURCH & DWIGHT CO INC	3,047	86.270	262,864.690	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	1,644	41.230	67,782.120	
HEICO CORP	535	127.060	67,977.100	
XPO LOGISTICS INC	1,060	105.820	112,169.200	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	480	322.750	154,920.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3,422	87.860	300,656.920	
TYLER TECHNOLOGIES INC	509	426.110	216,889.990	
COSTCO WHOLESALE CORP	5,533	388.390	2,148,961.870	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	1,128	122.710	138,416.880	
EPAM SYSTEMS INC	749	325.950	244,136.550	
RPM INTERNATIONAL INC	1,750	87.670	153,422.500	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	353	1,297.770	458,112.810	
UGI CORP	2,085	37.160	77,478.600	
CUMMINS INC	1,763	229.030	403,779.890	
ACTIVISION BLIZZARD INC	9,982	78.140	779,993.480	
CDW CORP/DE	1,792	132.230	236,956.160	
SIGNATURE BANK	769	115.200	88,588.800	
COSTAR GROUP INC	492	884.380	435,114.960	

SVB FINANCIAL GROUP	690	353.790	244,115.100	
AMERCO	70	407.440	28,520.800	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,239	201.990	250,265.610	
MERCADOLIBRE INC	603	1,513.430	912,598.290	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	837	157.800	132,078.600	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,801	104.410	396,862.410	
IPG PHOTONICS CORP	250	203.520	50,880.000	
DEXCOM INC	1,188	318.210	378,033.480	
NORDSON CORP	750	204.370	153,277.500	
COPART INC	2,495	115.210	287,448.950	
DIAMONDBACK ENERGY INC	1,591	43.520	69,240.320	
SEAGEN INC	1,545	169.120	261,290.400	
ALIGN TECHNOLOGY INC	963	475.500	457,906.500	
TRANSDIGM GROUP INC	698	591.540	412,894.920	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	1,203	95.560	114,958.680	
NIELSEN HOLDINGS PLC	4,347	16.240	70,595.280	
KINDER MORGAN INC	27,851	14.750	410,802.250	
HCA HEALTHCARE INC	3,261	153.050	499,096.050	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	544	533.890	290,436.160	
CABOT OIL & GAS CORP	4,608	17.770	81,884.160	
T-MOBILE US INC	7,244	131.900	955,483.600	
ZILLOW GROUP INC - C	1,786	108.050	192,977.300	
COCA-COLA CO/THE	51,490	52.700	2,713,523.000	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	2,575	43.960	113,197.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,946	88.960	173,116.160	
FRANKLIN RESOURCES INC	3,851	22.270	85,761.770	
CSX CORP	9,451	91.290	862,781.790	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,166	200.000	233,200.000	
EXPEDIA GROUP INC	1,563	123.730	193,389.990	
AUTOLIV INC	800	91.350	73,080.000	
AMAZON.COM INC	5,352	3,195.340	17,101,459.680	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,109	85.260	691,373.340	
EXXON MOBIL CORP	52,946	40.190	2,127,899.740	
FLIR SYSTEMS INC	1,613	39.130	63,116.690	
AES CORP	8,341	21.040	175,494.640	
EVEREST RE GROUP LTD	571	233.450	133,299.950	
EOG RESOURCES INC	7,655	51.430	393,696.650	

AKAMAI TECHNOLOGIES INC	1,914	104.320	199,668.480
ABIOMED INC	555	271.900	150,904.500
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,989	103.200	205,264.800
AGILENT TECHNOLOGIES INC	3,683	114.090	420,193.470
FORD MOTOR CO	47,597	9.090	432,656.730
DISCOVERY INC - A	1,521	27.480	41,797.080
EXACT SCIENCES CORP	1,721	118.190	203,404.990
LIBERTY GLOBAL PLC-A	2,416	22.680	54,794.880
LIBERTY BROADBAND-A	595	157.140	93,498.300
DISCOVERY INC-C	4,554	24.550	111,800.700
AERCAP HOLDINGS NV	1,824	38.660	70,515.840
FORTINET INC	1,595	123.790	197,445.050
MARKEL CORP	177	1,004.290	177,759.330
NEXTERA ENERGY INC	24,324	75.130	1,827,462.120
MASIMO CORP	693	254.410	176,306.130
FREEMONT-MCMORAN INC	19,764	23.520	464,849.280
INSULET CORP	769	251.480	193,388.120
US BANCORP	18,005	44.210	796,001.050
UNITED RENTALS INC	1,055	232.910	245,720.050
F5 NETWORKS INC	1,111	164.550	182,815.050
FASTENAL CO	7,924	48.580	384,947.920
FISERV INC	7,339	115.530	847,874.670
GENERAL ELECTRIC CO	116,958	10.400	1,216,363.200
GENERAL MOTORS CO	16,543	45.060	745,427.580
GENERAL DYNAMICS CORP	3,211	152.060	488,264.660
GOLDMAN SACHS GROUP INC	4,176	235.400	983,030.400
ALPHABET INC-CL A	3,637	1,787.020	6,499,391.740
ALPHABET INC-CL C	3,968	1,793.190	7,115,377.920
OWENS CORNING	1,763	74.300	130,990.900
GENERAL MILLS INC	7,849	60.130	471,960.370
FIRSTENERGY CORP	7,612	26.720	203,392.640
GENUINE PARTS CO	1,770	98.360	174,097.200
IHS MARKIT LTD	4,417	92.580	408,925.860
FIFTH THIRD BANCORP	8,100	26.280	212,868.000
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,779	194.470	540,432.130
HALLIBURTON CO	10,230	17.560	179,638.800
HOME DEPOT INC	13,534	275.990	3,735,248.660
ASSURANT INC	840	133.790	112,383.600
HUNTINGTON BANCSHARES INC	16,684	12.460	207,882.640

HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	500	164.530	82,265.000	
HERSHEY CO/THE	1,725	148.050	255,386.250	
HUMANA INC	1,733	406.490	704,447.170	
NXP SEMICONDUCTORS NV	3,671	158.940	583,468.740	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	917	292.740	268,442.580	
HENRY SCHEIN INC	1,870	63.680	119,081.600	
HP INC	17,443	22.270	388,455.610	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	20,050	11.220	224,961.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	1,395	42.230	58,910.850	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	2,762	42.590	117,633.580	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,028	42.060	85,297.680	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	5,011	33.030	165,513.330	
KRAFT HEINZ CO/THE	8,390	32.840	275,527.600	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	11,082	124.350	1,378,046.700	
INTERNATIONAL PAPER CO	4,047	50.690	205,142.430	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,500	85.010	127,515.000	
ZOETIS INC	6,003	161.470	969,304.410	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	3,274	143.500	469,819.000	
CHENIERE ENERGY INC	2,484	58.780	146,009.520	
ALLEGION PLC	1,110	114.280	126,850.800	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	5,108	21.820	111,456.560	
WASTE CONNECTIONS INC	3,431	104.380	358,127.780	
JUNIPER NETWORKS INC	4,912	22.210	109,095.520	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	864	139.150	120,225.600	
JM SMUCKER CO/THE	1,393	116.500	162,284.500	
JOHNSON & JOHNSON	33,256	144.000	4,788,864.000	
ABBVIE INC	22,387	104.890	2,348,172.430	
HOLOGIC INC	3,042	69.510	211,449.420	
KIMBERLY-CLARK CORP	4,429	141.370	626,127.730	
KROGER CO	10,013	32.430	324,721.590	
KLA CORP	1,919	254.130	487,675.470	
LOCKHEED MARTIN CORP	3,147	374.340	1,178,047.980	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	976	267.600	261,177.600	
LOWE'S COS INC	9,468	154.670	1,464,415.560	

ELI LILLY & CO	10,921	147.440	1,610,192.240	
LAM RESEARCH CORP	1,756	456.540	801,684.240	
JONES LANG LASALLE INC	587	133.960	78,634.520	
LOEWS CORP	3,591	43.410	155,885.310	
LINCOLN NATIONAL CORP	2,643	49.160	129,929.880	
MCDONALD'S CORP	9,458	218.330	2,064,965.140	
3M CO	7,216	176.890	1,276,438.240	
FACEBOOK INC-CLASS A	30,364	277.810	8,435,422.840	
S&P GLOBAL INC	2,923	341.570	998,409.110	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	767	271.010	207,864.670	
CONCHO RESOURCES INC	2,552	62.020	158,275.040	
PHILLIPS 66	5,107	65.230	333,129.610	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	5,659	28.620	161,960.580	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	1,496	186.480	278,974.080	
METLIFE INC	9,065	47.450	430,134.250	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	8,617	45.110	388,712.870	
ARISTA NETWORKS INC	593	272.560	161,628.080	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	2,419	45.920	111,080.480	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,232	173.460	387,162.720	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	284	1,126.680	319,977.120	
BAKER HUGHES CO	8,446	19.780	167,061.880	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,460	255.930	373,657.800	
MERCK & CO. INC.	31,887	79.860	2,546,495.820	
DUPONT DE NEMOURS INC	9,181	64.540	592,541.740	
MASCO CORP	3,543	54.240	192,172.320	
M & T BANK CORP	1,984	120.980	240,024.320	
MARSH & MCLENNAN COS	6,453	114.360	737,965.080	
BLACK KNIGHT INC	1,644	90.530	148,831.320	
HEICO CORP-CLASS A	1,018	113.720	115,766.960	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	3,361	128.350	431,384.350	
WORKDAY INC-CLASS A	2,123	223.860	475,254.780	
WAYFAIR INC- CLASS A	880	260.680	229,398.400	
SQUARE INC - A	4,460	212.520	947,839.200	
TRANSUNION	2,293	92.850	212,905.050	
VISTRA CORP	4,285	19.590	83,943.150	
BEIGENE LTD-ADR	350	285.890	100,061.500	

NETAPP INC	2,703	53.260	143,961.780	
NIKE INC -CL B	15,547	134.250	2,087,184.750	
NORFOLK SOUTHERN CORP	3,343	242.720	811,412.960	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	3,492	133.010	464,470.920	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,749	92.710	162,149.790	
ALLY FINANCIAL INC	5,094	30.670	156,232.980	
NORTHROP GRUMMAN CORP	2,025	306.030	619,710.750	
APTIV PLC	3,232	121.860	393,851.520	
NEWMONT CORP	10,413	58.480	608,952.240	
MCKESSON CORP	2,161	180.000	388,980.000	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	3,257	82.410	268,409.370	
XYLEM INC	1,972	97.140	191,560.080	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	19,639	75.900	1,490,600.100	
NUCOR CORP	3,692	55.070	203,318.440	
SUNRUN INC	1,500	66.750	100,125.000	
WESTERN UNION CO	6,811	22.520	153,383.720	
GODADDY INC - CLASS A	1,930	79.500	153,435.000	
NEWELL BRANDS INC	4,058	21.070	85,502.060	
EVERGY INC	3,243	55.770	180,862.110	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	10,238	16.560	169,541.280	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	269	226.580	60,950.020	
OKTA INC	1,376	236.040	324,791.040	
COUPA SOFTWARE INC	880	326.940	287,707.200	
LIBERTY BROADBAND-C	884	157.970	139,645.480	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	4,877	31.320	152,747.640	
LINDE PLC	6,558	257.430	1,688,225.940	
WIX.COM LTD	785	258.620	203,016.700	
EQUITABLE HOLDINGS INC	6,184	26.000	160,784.000	
KKR & CO INC	6,489	38.710	251,189.190	
PAYCHEX INC	4,600	93.370	429,502.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	916	443.150	405,925.400	
ALTRIA GROUP INC	23,279	40.370	939,773.230	
P G & E CORP	15,515	12.730	197,505.950	
PFIZER INC	70,237	37.230	2,614,923.510	
CIGNA CORP	4,630	212.500	983,875.000	
DELL TECHNOLOGIES -C	3,276	69.820	228,730.320	
ALTICE USA INC- A	4,147	34.330	142,366.510	
XCEL ENERGY INC	6,528	67.620	441,423.360	
STERIS PLC	897	191.690	171,945.930	

FOX CORP - CLASS B	1,530	28.730	43,956.900	
FOX CORP - CLASS A	5,267	29.160	153,585.720	
STRYKER CORP	4,482	232.810	1,043,454.420	
DOW INC	9,664	55.400	535,385.600	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	1,508	59.810	90,193.480	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	1,979	471.610	933,316.190	
PARKER HANNIFIN CORP	1,839	272.850	501,771.150	
UBER TECHNOLOGIES INC	11,686	50.720	592,713.920	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	2,203	110.070	242,484.210	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	31,059	138.610	4,305,087.990	
EXELON CORP	11,882	41.740	495,954.680	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2,652	123.830	328,397.160	
TELADOC HEALTH INC	905	196.450	177,787.250	
INGERSOLL-RAND INC	5,397	44.800	241,785.600	
NVR INC	45	4,120.220	185,409.900	
CONOCOPHILLIPS	14,185	42.780	606,834.300	
TWILIO INC - A	1,526	319.050	486,870.300	
DOCUSIGN INC	2,252	226.870	510,911.240	
PAYCOM SOFTWARE INC	601	416.770	250,478.770	
PEPSICO INC	17,434	144.600	2,520,956.400	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	409	113.200	46,298.800	
DROPBOX INC-CLASS A	2,392	19.540	46,739.680	
MONGODB INC	610	270.020	164,712.200	
SNAP INC - A	11,675	46.030	537,400.250	
CORTEVA INC	8,530	38.410	327,637.300	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	5,388	78.090	420,748.920	
AMCOR PLC	17,457	11.480	200,406.360	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	1,910	150.830	288,085.300	
ROKU INC	1,488	275.340	409,705.920	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,092	153.730	321,603.160	
ACCENTURE PLC-CL A	7,988	250.120	1,997,958.560	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	5,876	40.670	238,976.920	
PENTAIR PLC	1,575	53.100	83,632.500	
QUALCOMM INC	14,214	143.830	2,044,399.620	

INVESCO LTD	3,700	17.010	62,937.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	819	149.930	122,792.670	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,193	51.400	164,120.200	
DATADOG INC - CLASS A	1,825	96.420	175,966.500	
PINTEREST INC- CLASS A	5,200	69.720	362,544.000	
AVALARA INC	1,257	169.030	212,470.710	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,327	514.050	682,144.350	
REPUBLIC SERVICES INC	2,667	97.040	258,805.680	
BOOKING HOLDINGS INC	501	2,052.670	1,028,387.670	
ROSS STORES INC	4,888	109.540	535,431.520	
PACKAGING CORP OF AMERICA	998	132.770	132,504.460	
RESMED INC	1,983	209.640	415,716.120	
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,812	124.800	226,137.600	
ROBERT HALF INTL INC	1,499	65.510	98,199.490	
MODERNA INC	3,362	127.030	427,074.860	
RALPH LAUREN CORP	400	87.980	35,192.000	
PERKINELMER INC	1,163	129.260	150,329.380	
CARRIER GLOBAL CORP	9,733	37.810	368,004.730	
OTIS WORLDWIDE CORP	4,866	67.340	327,676.440	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	2,300	43.870	100,901.000	
AVANTOR INC	5,600	26.350	147,560.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	3,123	28.630	89,411.490	
DYNATRACE INC	2,339	38.420	89,864.380	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	540	873.100	471,474.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	15,350	15.620	239,767.000	
IAC/INTERACTIVECORP	1,021	142.480	145,472.080	
MATCH GROUP INC	3,162	139.630	441,510.060	
CHEVRON CORP	23,468	91.310	2,142,863.080	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	2,590	108.980	282,258.200	
ZSCALER INC	882	149.740	132,070.680	
EDISON INTERNATIONAL	4,985	62.790	313,008.150	
TESLA INC	9,558	585.760	5,598,694.080	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	363	328.790	119,350.770	
NORTONLIFELOCK INC	7,944	18.110	143,865.840	
STANLEY BLACK & DECKER INC	2,200	187.710	412,962.000	
SYNOPSYS INC	2,031	225.420	457,828.020	
CHARTER COMMUNICATIONS INC- A	1,826	642.800	1,173,752.800	

VIATRIS INC	13,745	17.050	234,352.250
CBRE GROUP INC - A	3,849	61.130	235,289.370
TWITTER INC	10,516	46.590	489,940.440
SOUTHERN CO/THE	13,916	60.650	844,005.400
SYSCO CORP	6,160	71.240	438,838.400
TRAVELERS COS INC/THE	2,958	134.440	397,673.520
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,925	55.610	107,049.250
STEEL DYNAMICS INC	2,300	37.650	86,595.000
SCHLUMBERGER LTD	17,899	21.880	391,630.120
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	2,026	50.550	102,414.300
AT&T INC	89,721	29.030	2,604,600.630
SOUTHWEST AIRLINES CO	1,758	47.730	83,909.340
ON SEMICONDUCTOR CORP	4,452	28.650	127,549.800
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,019	735.810	749,790.390
SEMPRA ENERGY	3,915	130.460	510,750.900
TIFFANY & CO	1,086	131.720	143,047.920
SEAGATE TECHNOLOGY	2,606	58.480	152,398.880
TEXAS INSTRUMENTS INC	11,444	158.990	1,819,481.560
SALESFORCE.COM INC	11,415	247.630	2,826,696.450
WESTROCK CO	2,618	44.060	115,349.080
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	9,906	45.970	455,378.820
TERADYNE INC	2,096	109.400	229,302.400
UNION PACIFIC CORP	8,502	205.640	1,748,351.280
MARATHON PETROLEUM CORP	8,128	41.420	336,661.760
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	19,009	73.910	1,404,955.190
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	8,773	168.890	1,481,671.970
IQVIA HOLDINGS INC	2,435	168.810	411,052.350
VOYA FINANCIAL INC	1,800	59.330	106,794.000
AMEREN CORPORATION	2,861	78.990	225,990.390
UNITEDHEALTH GROUP INC	11,930	337.940	4,031,624.200
VERISIGN INC	1,365	200.520	273,709.800
VALERO ENERGY CORP	5,884	56.620	333,152.080
ULTA BEAUTY INC	635	281.290	178,619.150
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	3,008	36.560	109,972.480
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	992	132.110	131,053.120
ANTHEM INC	3,254	312.800	1,017,851.200
WALT DISNEY CO/THE	22,895	147.130	3,368,541.350

WELLS FARGO & CO	48,384	28.460	1,377,008.640	
WASTE MANAGEMENT INC	5,507	119.190	656,379.330	
WILLIAMS COS INC	17,123	21.460	367,459.580	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,591	139.370	221,737.670	
WHIRLPOOL CORP	870	200.960	174,835.200	
WALMART INC	17,852	151.600	2,706,363.200	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,492	150.020	373,849.840	
WYNN RESORTS LTD	1,145	101.220	115,896.900	
WABTEC CORP	1,898	73.820	140,110.360	
TJX COMPANIES INC	14,998	63.220	948,173.560	
WATERS CORP	760	228.270	173,485.200	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	555	377.000	209,235.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	8,695	39.000	339,105.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,868	209.550	391,439.400	
WESTERN DIGITAL CORP	3,531	45.850	161,896.350	
WEC ENERGY GROUP INC	4,189	95.740	401,054.860	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	6,877	59.350	408,149.950	
VISA INC-CLASS A SHARES	21,264	211.000	4,486,704.000	
PPL CORP	10,194	29.110	296,747.340	
PULTEGROUP INC	3,556	44.360	157,744.160	
PPG INDUSTRIES INC	3,234	147.780	477,920.520	
NORTHERN TRUST CORP	2,260	96.140	217,276.400	
NVIDIA CORP	7,762	530.450	4,117,352.900	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	5,160	139.790	721,316.400	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	2,482	55.810	138,520.420	
TYSON FOODS INC-CL A	3,322	65.000	215,930.000	
NETFLIX INC	5,558	491.360	2,730,978.880	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	4,985	453.400	2,260,199.000	
NRG ENERGY INC	3,000	32.510	97,530.000	
GLOBE LIFE INC	1,215	96.020	116,664.300	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	1,953	130.340	254,554.020	
TEXTRON INC	2,831	46.870	132,688.970	
NEWS CORP - CLASS A	3,749	17.710	66,394.790	
OGE ENERGY CORP	2,452	33.650	82,509.800	

OMNICOM GROUP	2,546	63.000	160,398.000	
ORACLE CORP	25,794	57.760	1,489,861.440	
MASTERCARD INC - A	11,266	339.070	3,819,962.620	
ONEOK INC	4,566	37.230	169,992.180	
CENTURYLINK INC	11,062	10.460	115,708.520	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,269	418.800	531,457.200	
YUM! BRANDS INC	4,158	107.180	445,654.440	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	1,413	176.410	249,267.330	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	3,374	46.800	157,903.200	
BANK OF AMERICA CORP	98,093	28.990	2,843,716.070	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	418	386.240	161,448.320	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,908	80.400	233,803.200	
AMERICAN EXPRESS CO	8,835	120.590	1,065,412.650	
ANALOG DEVICES INC	4,830	137.750	665,332.500	
ADVANCED MICRO DEVICES	14,631	87.190	1,275,676.890	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	10,084	39.710	400,435.640	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,283	136.160	310,853.280	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	2,147	81.480	174,937.560	
AVERY DENNISON CORP	1,131	150.300	169,989.300	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	6,560	78.410	514,369.600	
EMERSON ELECTRIC CO	7,846	78.160	613,243.360	
AON PLC-CLASS A	3,057	206.580	631,515.060	
AMGEN INC	7,375	224.810	1,657,973.750	
EATON CORP PLC	5,056	121.900	616,326.400	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2,181	204.810	446,690.610	
APPLIED MATERIALS INC	11,964	82.660	988,944.240	
CME GROUP INC	4,588	174.770	801,844.760	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	3,389	13.150	44,565.350	
ECOLAB INC	3,315	224.810	745,245.150	
EQUIFAX INC	1,775	164.740	292,413.500	
GILEAD SCIENCES INC	15,831	60.030	950,334.930	
KEURIG DR PEPPER INC	4,594	30.760	141,311.440	
HORMEL FOODS CORP	3,315	47.200	156,468.000	
STATE STREET CORP	4,152	71.590	297,241.680	
SCHWAB (CHARLES) CORP	18,778	49.700	933,266.600	
BAXTER INTERNATIONAL INC	6,568	75.970	498,970.960	

CAMPBELL SOUP CO	2,166	48.980	106,090.680	
CROWN HOLDINGS INC	1,597	95.560	152,609.320	
CARDINAL HEALTH INC	3,319	53.780	178,495.820	
FEDEX CORP	3,193	287.410	917,700.130	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	5,487	87.760	481,539.120	
FMC CORP	1,360	115.670	157,311.200	
CERNER CORP	4,133	74.100	306,255.300	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,163	112.870	131,267.810	
CITRIX SYSTEMS INC	1,412	122.440	172,885.280	
INTEL CORP	53,449	47.450	2,536,155.050	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	5,231	22.800	119,266.800	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	4,866	45.830	223,008.780	
ILLINOIS TOOL WORKS	4,040	212.230	857,409.200	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	15,300	6.550	100,215.000	
ILLUMINA INC	1,787	317.030	566,532.610	
SEALED AIR CORP	1,450	44.530	64,568.500	
INTUITIVE SURGICAL INC	1,522	729.820	1,110,786.040	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,330	119.720	159,227.600	
SNAP-ON INC	500	177.000	88,500.000	
CARMAX INC	1,990	95.370	189,786.300	
COMERICA INC	1,271	51.490	65,443.790	
INGREDION INC	530	79.950	42,373.500	
DUKE ENERGY CORP	8,987	94.600	850,170.200	
TARGET CORP	6,474	179.770	1,163,830.980	
DOVER CORP	1,713	123.880	212,206.440	
WW GRAINGER INC	588	414.580	243,773.040	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,750	105.860	185,255.000	
CINTAS CORP	1,162	361.090	419,586.580	
CONAGRA BRANDS INC	5,567	35.940	200,077.980	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	1,500	73.190	109,785.000	
CLOROX COMPANY	1,628	203.090	330,630.520	
ENTERGY CORP	2,243	111.510	250,116.930	
MICROSOFT CORP	90,849	215.230	19,553,430.270	
INCYTE CORP	2,689	83.250	223,859.250	
CVS HEALTH CORP	16,017	67.870	1,087,073.790	
MEDTRONIC PLC	16,939	114.590	1,941,040.010	
MICRON TECHNOLOGY INC	14,666	64.230	941,997.180	

BLACKROCK INC	1,959	715.110	1,400,900.490
CENTERPOINT ENERGY INC	5,636	24.070	135,658.520
HASBRO INC	1,449	92.320	133,771.680
KELLOGG CO	3,690	63.480	234,241.200
KEYCORP	11,782	16.330	192,400.060
KANSAS CITY SOUTHERN	1,176	189.500	222,852.000
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	18,359	57.460	1,054,908.140
COOPER COS INC/THE	647	340.710	220,439.370
CHUBB LTD	5,831	151.420	882,930.020
ARROW ELECTRONICS INC	1,000	93.010	93,010.000
ALLSTATE CORP	3,999	104.140	416,455.860
EBAY INC	9,321	51.340	478,540.140
PAYPAL HOLDINGS INC	14,110	211.390	2,982,712.900
EASTMAN CHEMICAL CO	1,492	99.900	149,050.800
XILINX INC	2,892	137.490	397,621.080
DISH NETWORK CORP-A	2,984	35.910	107,155.440
ZIONS BANCORP NA	1,900	39.460	74,974.000
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,783	245.940	684,451.020
TRIMBLE INC	2,938	60.450	177,602.100
LENNAR CORP-A	3,394	77.710	263,747.740
LEAR CORP	600	146.600	87,960.000
PROGRESSIVE CORP	7,391	88.430	653,586.130
PACCAR INC	4,825	87.740	423,345.500
BIOGEN INC	1,948	243.780	474,883.440
IDEXX LABORATORIES INC	1,024	454.230	465,131.520
STARBUCKS CORP	14,828	98.660	1,462,930.480
PTC INC	1,200	108.610	130,332.000
PERRIGO CO PLC	1,929	48.030	92,649.870
EVERSOURCE ENERGY	4,290	87.930	377,219.700
INTUIT INC	3,401	354.240	1,204,770.240
BORGWARNER INC	3,081	39.500	121,699.500
BEST BUY CO INC	2,987	112.630	336,425.810
BALL CORP	3,860	96.360	371,949.600
BOSTON SCIENTIFIC CORP	18,424	33.600	619,046.400
ELECTRONIC ARTS INC	3,677	124.170	456,573.090
VULCAN MATERIALS CO	1,606	142.330	228,581.980
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3,207	226.710	727,058.970
VF CORP	4,216	85.720	361,395.520

	VIACOMCBS INC - CLASS B	7,202	35.065	252,538.130	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	942	130.550	122,978.100	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,003	173.900	174,421.700	
	CARNIVAL CORP	4,992	21.580	107,727.360	
	COMCAST CORP-CLASS A	57,477	51.750	2,974,434.750	
	JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	2,100	23.900	50,190.000	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	3,600	52.900	190,440.000	
	DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	5,600	4.090	22,904.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	23,100	4.220	97,482.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 401,982,129.280 (41,761,923,411)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	BP PLC	251,081	2.629	660,091.940	
	UNILEVER PLC	15,143	45.860	694,457.980	
	BARCLAYS PLC	241,360	1.395	336,697.200	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	76,895	1.076	82,777.460	
	PRUDENTIAL PLC	31,421	12.120	380,822.520	
	NATWEST GROUP PLC	50,836	1.606	81,668.030	
	EVRAZ PLC	7,441	3.922	29,183.600	
	JOHNSON MATTHEY PLC	1,758	22.490	39,537.420	
	BAE SYSTEMS PLC	37,796	5.042	190,567.430	
	AVIVA PLC	51,081	3.241	165,553.520	
	AVEVA GROUP PLC	1,140	33.750	38,475.000	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	62,903	13.836	870,325.900	
	INFORMA PLC	16,200	5.402	87,512.400	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	64,335	1.593	102,485.650	
	AUTO TRADER GROUP PLC	14,499	5.482	79,483.510	
	DCC PLC	938	56.860	53,334.680	
	OCADO GROUP PLC	6,234	22.180	138,270.120	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	740	108.500	80,290.000	
	HALMA PLC	3,978	22.200	88,311.600	
	GVC HOLDINGS PLC	8,805	10.425	91,792.120	
	JD SPORTS FASHION PLC	6,411	7.332	47,005.450	
	M&G PLC	25,964	1.934	50,227.350	
	RELX PLC	24,203	17.420	421,616.260	
	DIAGEO PLC	29,351	29.330	860,864.830	

RIO TINTO PLC	14,520	49.225	714,747.000	
STANDARD CHARTERED PLC	31,951	4.637	148,156.780	
TESCO PLC	134,491	2.278	306,370.490	
SMITH & NEPHEW PLC	11,297	14.525	164,088.920	
GLENCORE PLC	129,226	2.135	275,962.120	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,200	14.335	45,872.000	
SMITHS GROUP PLC	4,080	14.675	59,874.000	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	16,879	2.971	50,147.500	
PEARSON PLC	8,271	6.500	53,761.500	
SAINSBURY (J) PLC	17,631	2.165	38,171.110	
NEXT PLC	1,685	65.180	109,828.300	
TAYLOR WIMPEY PLC	32,236	1.572	50,674.990	
WHITBREAD PLC	1,785	31.620	56,441.700	
BUNZL PLC	3,159	23.160	73,162.440	
VODAFONE GROUP PLC	359,129	1.249	448,552.120	
CRODA INTERNATIONAL PLC	1,749	59.500	104,065.500	
KINGFISHER PLC	17,229	2.709	46,673.360	
WPP PLC	13,021	7.494	97,579.370	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	8,244	8.992	74,130.040	
SEVERN TRENT PLC	4,300	23.880	102,684.000	
RENTOKIL INITIAL PLC	22,242	4.908	109,163.730	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	9,111	65.160	593,672.760	
ST JAMES'S PLACE PLC	4,883	10.195	49,782.180	
SCHRODERS PLC	1,227	32.340	39,681.180	
SSE PLC	12,460	13.800	171,948.000	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	12,368	6.290	77,794.720	
ASTRAZENECA PLC	16,608	77.700	1,290,441.600	
FERGUSON PLC	2,724	83.240	226,745.760	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	68,232	2.563	174,878.610	
3I GROUP PLC	13,293	10.760	143,032.680	
ASHTED GROUP PLC	5,921	31.500	186,511.500	
SAGE GROUP PLC/THE	11,548	6.098	70,419.700	
NATIONAL GRID PLC	45,105	8.738	394,127.490	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	865,213	0.372	322,681.180	
RSA INSURANCE GROUP PLC	12,586	6.744	84,879.980	
IMPERIAL BRANDS PLC	13,785	14.130	194,782.050	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	1,963	46.850	91,966.550	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	28,695	26.770	768,165.150	

BHP GROUP PLC	26,934	17.378	468,059.050	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,964	21.260	105,534.640	
HSBC HOLDINGS PLC	256,005	4.048	1,036,436.240	
ANGLO AMERICAN PLC	14,645	22.655	331,782.470	
MONDI PLC	5,921	16.895	100,035.290	
WM MORRISON SUPERMARKETS	39,167	1.836	71,910.610	
COMPASS GROUP PLC	21,992	14.180	311,846.560	
PERSIMMON PLC	4,969	26.960	133,964.240	
BT GROUP PLC	131,754	1.213	159,817.600	
COCA-COLA HBC AG-DI	2,574	21.830	56,190.420	
BURBERRY GROUP PLC	5,136	17.215	88,416.240	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	2,182	47.730	104,146.860	
INTERTEK GROUP PLC	1,897	55.020	104,372.940	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	3,750	79.200	297,000.000	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	49,526	13.394	663,351.240	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	48,246	13.040	629,127.840	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2,039	26.320	53,666.480	
ADMIRAL GROUP PLC	1,570	28.470	44,697.900	
ANTOFAGASTA PLC	3,460	12.370	42,800.200	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	33,046	2.710	89,554.660	
EXPERIAN PLC	12,119	25.850	313,276.150	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 18,888,957.660 (2,617,065,083)	
イスラエル・ シュケル	株	イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	12,000	11.440	137,280.000	
AZRIELI GROUP LTD	530	201.300	106,689.000	
ICL GROUP LTD	11,096	15.550	172,542.800	
ELBIT SYSTEMS LTD	300	427.400	128,220.000	
BANK HAPOALIM BM	15,160	22.200	336,552.000	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	19,043	19.150	364,673.450	
NICE LTD	800	796.200	636,960.000	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	3,883	72.800	282,682.400	
イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 2,165,599.650 (67,869,893)	

オーストラリア・ドル	株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
MEDIBANK PRIVATE LTD	22,824	2.890	65,961.360	
BHP GROUP LTD	36,548	38.720	1,415,138.560	
SOUTH32 LTD	56,387	2.460	138,712.020	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	15,653	22.730	355,792.690	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	20,554	18.570	381,687.780	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	42,103	23.320	981,841.960	
WESTPAC BANKING CORP	44,270	20.430	904,436.100	
SANTOS LTD	18,270	6.250	114,187.500	
AUSNET SERVICES	28,500	1.860	53,010.000	
AUST AND NZ BANKING GROUP	35,190	23.090	812,537.100	
RIO TINTO LTD	4,169	102.000	425,238.000	
ORIGIN ENERGY LTD	20,968	5.190	108,823.920	
AURIZON HOLDINGS LTD	29,047	4.300	124,902.100	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	953	29.310	27,932.430	
COLES GROUP LTD	16,696	17.940	299,526.240	
WISETECH GLOBAL LTD	2,509	29.950	75,144.550	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	8,183	12.850	105,151.550	
EVOLUTION MINING LTD	17,017	5.100	86,786.700	
AFTERPAY LTD	3,000	94.700	284,100.000	
TPG TELECOM LTD	5,000	7.770	38,850.000	
OIL SEARCH LTD	17,345	3.650	63,309.250	
SEEK LTD	2,600	26.060	67,756.000	
TREASURY WINE ESTATES LTD	10,173	9.230	93,896.790	
NEWCREST MINING LTD	11,981	27.090	324,565.290	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	21,856	80.710	1,763,997.760	
AMPOL LTD	2,000	30.630	61,260.000	
ORICA LTD	5,845	16.880	98,663.600	
QBE INSURANCE GROUP LTD	15,348	10.270	157,623.960	
CIMIC GROUP LTD	1,000	25.560	25,560.000	
WOOLWORTHS GROUP LTD	16,980	37.560	637,768.800	
COCA-COLA AMATIL LTD	2,600	12.650	32,890.000	
TABCORP HOLDINGS LTD	17,352	3.930	68,193.360	
CROWN RESORTS LTD	3,000	9.950	29,850.000	
QANTAS AIRWAYS LTD	6,373	5.520	35,178.960	
TELSTRA CORP LTD	35,114	3.110	109,204.540	

	AMP LTD	24,935	1.740	43,386.900	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	6,733	39.020	262,721.660	
	MACQUARIE GROUP LTD	4,277	137.490	588,044.730	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	6,163	33.180	204,488.340	
	CSL LTD	5,550	303.000	1,681,650.000	
	WESFARMERS LTD	13,798	49.890	688,382.220	
	COCHLEAR LTD	805	222.210	178,879.050	
	BLUESCOPE STEEL LTD	7,092	17.300	122,691.600	
	SUNCORP GROUP LTD	14,504	10.180	147,650.720	
	ASX LTD	2,260	77.240	174,562.400	
	COMPUTERSHARE LTD	6,054	14.210	86,027.340	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	27,097	5.320	144,156.040	
	SONIC HEALTHCARE LTD	5,223	33.260	173,716.980	
	AGL ENERGY LTD	8,466	13.720	116,153.520	
	BRAMBLES LTD	18,337	11.100	203,540.700	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,064	63.680	131,435.520	
	REA GROUP LTD	608	141.370	85,952.960	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	1,551	60.980	94,579.980	
	オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 15,497,499.530 (1,191,912,689)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	2,300	24.230	55,729.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	250	1,620.320	405,080.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	3,721	75.930	282,535.530	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	6,300	51.010	321,363.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	1,700	143.700	244,290.000	
	BCE INC	900	57.030	51,327.000	
	FRANCO-NEVADA CORP	2,200	169.450	372,790.000	
	SUNCOR ENERGY INC	21,812	22.410	488,806.920	
	METRO INC/CN	3,000	60.060	180,180.000	
	NATIONAL BANK OF CANADA	3,941	73.480	289,584.680	
	BANK OF NOVA SCOTIA	15,075	64.890	978,216.750	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	5,700	111.140	633,498.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	23,030	70.900	1,632,827.000	
	GREAT-WEST LIFECO INC	3,900	30.510	118,989.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	18,232	108.160	1,971,973.120	

TC ENERGY CORP	11,304	59.310	670,440.240	
PEMBINA PIPELINE CORP	6,375	34.070	217,196.250	
BARRICK GOLD CORP	21,848	29.450	643,423.600	
CAE INC	2,300	33.470	76,981.000	
THOMSON REUTERS CORP	2,284	103.700	236,850.800	
EMPIRE CO LTD 'A'	1,800	35.660	64,188.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,560	59.990	93,584.400	
HYDRO ONE LTD	4,800	29.670	142,416.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	2,489	64.300	160,042.700	
WSP GLOBAL INC	1,200	95.640	114,768.000	
PARKLAND CORP	2,800	39.590	110,852.000	
QUEBECOR INC -CL B	2,300	32.950	75,785.000	
EMERA INC	2,731	54.430	148,648.330	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	1,000	32.810	32,810.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	5,600	60.900	341,040.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	2,900	84.190	244,151.000	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	7,000	20.440	143,080.000	
B2GOLD CORP	16,400	7.030	115,292.000	
AIR CANADA	1,700	24.860	42,262.000	
KINROSS GOLD CORP	14,757	9.330	137,682.810	
BANK OF MONTREAL	8,200	96.770	793,514.000	
POWER CORP OF CANADA	6,300	29.690	187,047.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	1,355	1,343.000	1,819,765.000	
NUTRIEN LTD	8,027	64.300	516,136.100	
CANOPY GROWTH CORP	2,000	37.500	75,000.000	
CRONOS GROUP INC	3,400	10.840	36,856.000	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	3,193	52.020	166,099.860	
CAMECO CORP	2,800	13.230	37,044.000	
TELUS CORP	600	25.240	15,144.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	4,400	20.870	91,828.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	743	166.260	123,531.180	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	15,200	31.370	476,824.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	300	445.200	133,560.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,100	80.030	248,093.000	
WESTON (GEORGE) LTD	901	97.500	87,847.500	
PAN AMERICAN SILVER CORP	2,400	38.160	91,584.000	
BLACKBERRY LTD	6,400	7.990	51,136.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	7,266	59.180	430,001.880	
ENBRIDGE INC	26,700	41.690	1,113,123.000	

BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	18,000	53.290	959,220.000	
MANULIFE FINANCIAL CORP	26,600	22.420	596,372.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	4,300	25.320	108,876.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,800	421.800	759,240.000	
IA FINANCIAL CORP INC	1,100	58.470	64,317.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	2,800	34.930	97,804.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	8,793	141.580	1,244,912.940	
CGI INC - CLASS A	2,800	97.680	273,504.000	
ONEX CORPORATION	1,600	71.300	114,080.000	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	6,800	22.680	154,224.000	
IGM FINANCIAL INC	300	34.910	10,473.000	
TMX GROUP LTD	794	126.330	100,306.020	
OPEN TEXT CORP	4,500	58.190	261,855.000	
CI FINANCIAL CORP	2,000	17.450	34,900.000	
SAPUTO INC	2,900	36.010	104,429.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	6,300	18.040	113,652.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	10,013	43.000	430,559.000	
YAMANA GOLD INC	11,900	6.660	79,254.000	
FORTIS INC	6,200	52.940	328,228.000	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	1,355	88.690	120,174.950	
LUNDIN MINING CORP	6,600	10.320	68,112.000	
CENOVUS ENERGY INC	14,100	6.960	98,136.000	
DOLLARAMA INC	3,529	52.730	186,084.170	
ATCO LTD -CLASS I	800	39.670	31,736.000	
ALTAGAS LTD	4,700	19.070	89,629.000	
KEYERA CORP	2,200	23.460	51,612.000	
INTER PIPELINE LTD	4,800	13.510	64,848.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 24,879,356.730 (1,989,104,570)	
シンガポール・ ドル	株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	17,900	23.060	412,774.000	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	23,300	25.680	598,344.000	
SINGAPORE AIRLINES LTD	17,750	4.510	80,052.500	
KEPPEL CORP LTD	17,300	5.240	90,652.000	
UOL GROUP LTD	3,000	7.550	22,650.000	
CITY DEVELOPMENTS LTD	5,200	7.870	40,924.000	

	CAPITALAND LTD	33,400	3.140	104,876.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	27,000	0.920	24,840.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	900	21.000	18,900.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	44,700	10.150	453,705.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	45,000	0.845	38,025.000	
	VENTURE CORP LTD	3,200	19.170	61,344.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	128,400	2.420	310,728.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	14,100	4.020	56,682.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	16,800	9.220	154,896.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	15,800	4.290	67,782.000	
	シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 2,537,174.500 (197,113,088)	
スイス・フラン	株		スイス・フラン	スイス・フラン	
	UBS GROUP AG-REG	46,478	13.160	611,650.480	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	130	819.000	106,470.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	1,754	53.900	94,540.600	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	8,876	302.500	2,684,990.000	
	SIKA AG-REG	1,690	230.600	389,714.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	82,000.000	82,000.000	
	ABB LTD-REG	22,139	24.150	534,656.850	
	SWISS RE AG	3,666	83.740	306,990.840	
	NESTLE SA-REG	37,555	102.300	3,841,876.500	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	234	966.400	226,137.600	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	531	249.800	132,643.800	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	30,122	11.715	352,879.230	
	JULIUS BAER GROUP LTD	2,684	52.440	140,748.960	
	SGS SA-REG	65	2,588.000	168,220.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	467	242.000	113,014.000	
	VIFOR PHARMA AG	665	132.350	88,012.750	
	TEMENOS AG - REG	793	115.100	91,274.300	
	ALCON INC	5,853	57.820	338,420.460	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	500	229.400	114,700.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,792	372.300	667,161.600	
	BALOISE HOLDING AG - REG	611	158.900	97,087.900	
	CLARIANT AG-REG	1,568	18.375	28,812.000	

	NOVARTIS AG-REG	27,851	81.060	2,257,602.060	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	56	1,972.000	110,432.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	6,710	76.780	515,193.800	
	SWISSCOM AG-REG	276	481.100	132,783.600	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS- REG	784	95.900	75,185.600	
	GEBERIT AG-REG	456	543.200	247,699.200	
	GIVAUDAN-REG	113	3,643.000	411,659.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	111	1,035.500	114,940.500	
	SONOVA HOLDING AG-REG	672	223.700	150,326.400	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	2,165	78.360	169,649.400	
	LONZA GROUP AG-REG	913	551.800	503,793.400	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	450	44.420	19,989.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	6,587	48.070	316,637.090	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	381	409.100	155,867.100	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	640	202.600	129,664.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	946	81.800	77,382.800	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	17	7,725.000	131,325.000	
	スイス・フラン 小計			スイス・フラン 16,732,131.820 (1,923,693,195)	
スウェーデン・ クローナ		株	スウェーデン・クロー ナ	スウェーデン・クロー ナ	
	ICA GRUPPEN AB	700	411.600	288,120.000	
	ERICSSON LM-B SHS	44,595	106.150	4,733,759.250	
	VOLVO AB-B SHS	18,873	199.900	3,772,712.700	
	SKF AB-B SHARES	4,000	215.000	860,000.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	2,600	205.200	533,520.000	
	SWEDISH MATCH AB	2,188	692.000	1,514,096.000	
	TELE2 AB-B SHS	7,026	110.800	778,480.800	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN- A	21,779	93.400	2,034,158.600	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	24,145	88.220	2,130,071.900	
	SWEDBANK AB - A SHARES	10,821	156.320	1,691,538.720	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	10,352	182.650	1,890,792.800	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	8,201	139.050	1,140,349.050	
	SKANSKA AB-B SHS	3,709	207.500	769,617.500	
	SANDVIK AB	14,657	196.200	2,875,703.400	
	INVESTOR AB-B SHS	6,290	595.000	3,742,550.000	

	ATLAS COPCO AB-A SHS	8,575	439.700	3,770,427.500	
	SECURITAS AB-B SHS	2,500	142.900	357,250.000	
	TELIA CO AB	36,421	36.820	1,341,021.220	
	ALFA LAVAL AB	4,840	222.300	1,075,932.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	4,813	382.000	1,838,566.000	
	ASSA ABLOY AB-B	14,449	206.800	2,988,053.200	
	LUNDBERGS AB-B SHS	948	448.200	424,893.600	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	924	220.000	203,280.000	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	4,179	239.100	999,198.900	
	LUNDIN ENERGY AB	1,900	215.000	408,500.000	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	7,260	273.700	1,987,062.000	
	BOLIDEN AB	3,171	299.000	948,129.000	
	EPIROC AB-A	6,982	144.550	1,009,248.100	
	EPIROC AB-B	4,015	137.450	551,861.750	
	HUSQVARNA AB-B SHS	11,400	91.340	1,041,276.000	
	NORDEA BANK ABP	43,548	74.530	3,245,632.440	
	EQT AB	3,845	191.050	734,587.250	
	EVOLUTION GAMING GROUP	2,064	690.200	1,424,572.800	
	KINNEVIK AB - B	3,641	409.700	1,491,717.700	
	HEXAGON AB-B SHS	3,868	712.600	2,756,336.800	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	1,300	264.200	343,460.000	
	スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ ナ 57,696,476.980 (705,050,949)	
デンマーク・クローネ		株	デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	NOVO NORDISK A/S-B	23,671	419.250	9,924,066.750	
	DANSKE BANK A/S	7,236	104.000	752,544.000	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	39	11,520.000	449,280.000	
	H LUNDBECK A/S	500	193.950	96,975.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2,557	1,234.000	3,155,338.000	
	GN STORE NORD A/S	1,159	501.400	581,122.600	
	CARLSBERG AS-B	1,232	939.800	1,157,833.600	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	2,981	359.300	1,071,073.300	
	COLOPLAST-B	1,519	929.800	1,412,366.200	
	DSV PANALPINA A/S	2,798	1,020.500	2,855,359.000	
	DEMANT A/S	1,314	218.700	287,371.800	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	66	12,415.000	819,390.000	
	TRYG A/S	1,700	181.100	307,870.000	

	PANDORA A/S	1,637	649.200	1,062,740.400	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,262	609.800	769,567.600	
	GENMAB A/S	919	2,319.000	2,131,161.000	
	ORSTED A/S	2,837	1,126.500	3,195,880.500	
	AMBU A/S-B	2,091	201.500	421,336.500	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 30,451,276.250 (508,840,826)	
ニュージーランド・ドル		株	ニュージーランド・ドル	ニュージーランド・ドル	
	MERIDIAN ENERGY LTD	15,000	6.180	92,700.000	
	MERCURY NZ LTD	3,294	6.000	19,764.000	
	A2 MILK CO LTD	7,000	14.670	102,690.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	16,860	4.650	78,399.000	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	13,289	7.655	101,727.290	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	9,200	33.950	312,340.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	4,419	15.000	66,285.000	
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 773,905.290 (56,580,215)	
ノルウェー・クローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	NORSK HYDRO ASA	13,050	36.480	476,064.000	
	DNB ASA	12,838	163.550	2,099,654.900	
	ORKLA ASA	7,483	86.040	643,837.320	
	TELENOR ASA	8,746	153.400	1,341,636.400	
	EQUINOR ASA	14,248	146.850	2,092,318.800	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,756	364.000	1,003,184.000	
	MOWI ASA	4,677	183.150	856,592.550	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,000	192.000	384,000.000	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	1,700	342.000	581,400.000	
	ADEVINTA ASA	4,582	144.900	663,931.800	
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 10,142,619.770 (119,277,209)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	12,553	49.510	621,499.030	
	EVONIK INDUSTRIES AG	1,800	25.140	45,252.000	

DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	25,558	9.484	242,392.070	
COMMERZBANK AG	9,689	5.392	52,243.080	
VOLKSWAGEN AG	420	160.900	67,578.000	
VOLKSWAGEN AG-PREF	2,272	145.920	331,530.240	
SIEMENS AG-REG	9,465	112.680	1,066,516.200	
E.ON SE	30,006	9.140	274,254.840	
UNIPER SE	2,066	28.260	58,385.160	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	3,729	73.090	272,552.610	
GEA GROUP AG	1,300	28.800	37,440.000	
CONTINENTAL AG	1,474	116.950	172,384.300	
BASF SE	11,283	60.920	687,360.360	
ALLIANZ SE-REG	5,392	198.140	1,068,370.880	
THYSSENKRUPP AG	4,030	5.564	22,422.920	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	2,683	89.860	241,094.380	
RWE AG	7,526	34.870	262,431.620	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,700	10.070	17,119.000	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	560	46.940	26,286.400	
BRENNTAG AG	2,121	63.860	135,447.060	
FRESENIUS SE & CO KGAA	4,835	38.070	184,068.450	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	959	33.520	32,145.680	
HOCHTIEF AG	166	80.850	13,421.100	
SAP SE	13,066	100.140	1,308,429.240	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,704	235.800	401,803.200	
ZALANDO SE	2,025	80.460	162,931.500	
HEIDELBERGCEMENT AG	2,128	60.500	128,744.000	
KION GROUP AG	600	70.100	42,060.000	
COVESTRO AG	1,945	47.450	92,290.250	
SARTORIUS AG-VORZUG	513	364.000	186,732.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	2,102	55.000	115,610.000	
DELIVERY HERO SE	1,979	99.000	195,921.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	560	111.500	62,440.000	
METRO AG	1,500	7.860	11,790.000	
NEMETSCHKE SE	1,139	65.050	74,091.950	
SCOUT24 AG	1,460	63.050	92,053.000	
AROUNDTOWN SA	16,064	6.000	96,384.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	1,500	38.340	57,510.000	
KNORR-BREMSE AG	549	107.680	59,116.320	

TEAMVIEWER AG	1,461	39.560	57,797.160	
SIEMENS ENERGY AG	4,732	24.920	117,921.440	
KION GROUP AG-RTS	600	0.000	0.000	
BEIERSDORF AG	1,275	94.900	120,997.500	
FUCHS PETROLUB SE-PREF	700	48.260	33,782.000	
MERCK KGAA	1,692	133.400	225,712.800	
ADIDAS AG	2,385	271.200	646,812.000	
PUMA SE	1,295	82.120	106,345.400	
HENKEL AG & CO KGAA	1,311	80.150	105,076.650	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	41,860	15.155	634,388.300	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	2,561	70.820	181,370.020	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	11,027	56.590	624,017.930	
QIAGEN N.V.	2,521	40.670	102,529.070	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	16,497	29.605	488,393.680	
HANNOVER RUECK SE	644	139.100	89,580.400	
DEUTSCHE POST AG-REG	13,116	40.580	532,247.280	
DEUTSCHE BOERSE AG	2,404	137.050	329,468.200	
LANXESS AG	1,529	59.480	90,944.920	
MTU AERO ENGINES AG	666	204.400	136,130.400	
DEUTSCHE WOHNEN SE	4,796	41.000	196,636.000	
SYMRISE AG	1,656	105.350	174,459.600	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	6,240	2.394	14,938.560	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	900	55.500	49,950.000	
VONOVIA SE	7,186	56.560	406,440.160	
LEG IMMOBILIEN AG	1,073	118.000	126,614.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	11,420	43.230	493,686.600	
NN GROUP NV	3,100	34.420	106,702.000	
ARCELORMITTAL	8,031	15.294	122,826.110	
HEINEKEN NV	3,711	89.240	331,169.640	
AEGON NV	38,061	3.058	116,390.530	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	13,893	23.810	330,792.330	
AKZO NOBEL N.V.	2,504	89.640	224,458.560	
KONINKLIJKE DSM NV	2,230	137.000	305,510.000	
WOLTERS KLUWER	3,300	69.760	230,208.000	
ING GROEP NV	45,601	8.416	383,778.010	

KONINKLIJKE KPN NV	37,607	2.538	95,446.560	
ASML HOLDING NV	5,327	366.350	1,951,546.450	
ABN AMRO BANK NV-CVA	9,053	9.498	85,985.390	
GALAPAGOS NV	557	105.100	58,540.700	
ADYEN NV	215	1,616.000	347,440.000	
UNILEVER NV	18,650	50.260	937,349.000	
JUST EAT TAKEAWAY	1,400	88.180	123,452.000	
PROSUS NV	5,999	93.240	559,346.760	
VOPAK	630	45.740	28,816.200	
RANDSTAD NV	2,020	51.420	103,868.400	
HEINEKEN HOLDING NV	1,285	78.300	100,615.500	
ALTICE EUROPE NV	11,295	4.500	50,827.500	
JCDECAUX SA	845	17.890	15,117.050	
TOTAL SE	30,762	37.700	1,159,727.400	
MICHELIN (CGDE)	2,146	108.250	232,304.500	
AIR LIQUIDE SA	6,119	138.100	845,033.900	
KERING	977	606.200	592,257.400	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	6,745	117.450	792,200.250	
BOUYGUES SA	2,721	33.780	91,915.380	
BNP PARIBAS	13,400	43.825	587,255.000	
PEUGEOT SA	6,497	19.990	129,875.030	
NATIXIS	7,674	2.657	20,389.810	
THALES SA	1,404	79.860	112,123.440	
DANONE	7,551	52.780	398,541.780	
CARREFOUR SA	8,022	13.750	110,302.500	
SUEZ	2,950	16.175	47,716.250	
VIVENDI	10,430	25.390	264,817.700	
L'OREAL	3,205	309.300	991,306.500	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	6,975	40.300	281,092.500	
LEGRAND SA	4,119	71.420	294,178.980	
PERNOD RICARD SA	2,744	159.700	438,216.800	
EURAZEO SE	560	52.000	29,120.000	
SOCIETE GENERALE SA	11,065	17.328	191,734.320	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	3,442	496.000	1,707,232.000	
ACCOR SA	1,850	30.240	55,944.000	
CAPGEMINI SE	1,981	119.750	237,224.750	
VALEO SA	3,703	33.520	124,124.560	
PUBLICIS GROUPE	2,918	38.460	112,226.280	

BUREAU VERITAS SA	3,227	21.540	69,509.580	
EIFFAGE	945	84.180	79,550.100	
SODEXO SA	1,248	73.200	91,353.600	
IPSEN	276	80.000	22,080.000	
ORPEA	524	104.850	54,941.400	
AMUNDI SA	437	67.850	29,650.450	
TELEPERFORMANCE	870	275.000	239,250.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	977	78.900	77,085.300	
FAURECIA	560	42.720	23,923.200	
EUROFINS SCIENTIFIC	1,480	67.510	99,914.800	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	399	293.600	117,146.400	
SEB SA	197	149.500	29,451.500	
ESSILORLUXOTTICA	3,809	120.950	460,698.550	
DASSAULT AVIATION SA	22	895.000	19,690.000	
WORLDLINE SA	3,135	78.260	245,345.100	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	2,216	35.160	77,914.560	
AXA SA	24,318	19.732	479,842.770	
EDENRED	3,007	48.670	146,350.690	
RENAULT SA	2,554	34.115	87,129.710	
HERMES INTERNATIONAL	451	823.400	371,353.400	
STMICROELECTRONICS NV	8,575	33.210	284,775.750	
REMY COINTREAU	253	149.400	37,798.200	
ATOS SE	946	76.360	72,236.560	
DASSAULT SYSTEMES SE	1,633	155.300	253,604.900	
WENDEL	201	93.800	18,853.800	
ORANGE	25,792	10.690	275,716.480	
ALSTOM	2,961	45.190	133,807.590	
CNP ASSURANCES	1,349	13.480	18,184.520	
SANOFI	14,291	85.210	1,217,736.110	
VINCI SA	6,925	87.980	609,261.500	
AIRBUS SE	7,402	90.000	666,180.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	7,351	19.795	145,513.040	
CREDIT AGRICOLE SA	14,609	9.864	144,103.170	
BIOMERIEUX	457	119.300	54,520.100	
ENGIE	21,099	12.520	264,159.480	
EDF	6,760	12.990	87,812.400	
SES	4,402	7.900	34,775.800	
SAFRAN SA	4,381	123.000	538,863.000	
ILIAD SA	219	173.600	38,018.400	

ARKEMA	838	97.480	81,688.240	
ADP	350	108.500	37,975.000	
SCOR SE	3,289	29.020	95,446.780	
GETLINK SE	4,973	14.230	70,765.790	
BOLLORE	7,300	3.256	23,768.800	
UCB SA	1,921	90.540	173,927.340	
KBC GROUP NV	3,011	59.680	179,696.480	
COLRUYT SA	350	49.180	17,213.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,139	82.920	94,445.880	
SOLVAY SA	873	96.500	84,244.500	
UMICORE	2,270	38.310	86,963.700	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	9,876	57.250	565,401.000	
AGEAS	1,654	41.850	69,219.900	
PROXIMUS	2,269	17.995	40,830.650	
TELENET GROUP HOLDING NV	462	35.060	16,197.720	
ELIA GROUP SA/NV	700	95.500	66,850.000	
SOFINA	239	263.000	62,857.000	
ARGENX SE	516	235.000	121,260.000	
PRYSMIAN SPA	4,145	26.900	111,500.500	
ASSICURAZIONI GENERALI	15,985	14.470	231,302.950	
MEDIOBANCA SPA	9,971	7.730	77,075.830	
TENARIS SA	4,700	6.704	31,508.800	
UNICREDIT SPA	29,471	9.094	268,009.270	
TELECOM ITALIA SPA	108,503	0.401	43,531.400	
TELECOM ITALIA-RSP	48,381	0.428	20,740.930	
INTESA SANPAOLO	213,525	1.944	415,220.710	
ATLANTIA SPA	6,027	15.270	92,032.290	
POSTE ITALIANE SPA	7,727	8.800	67,997.600	
MONCLER SPA	2,435	41.010	99,859.350	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	1,285	45.310	58,223.350	
ENI SPA	36,061	8.582	309,475.500	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	8,500	9.554	81,209.000	
PIRELLI & C SPA	5,651	4.345	24,553.590	
DIASORIN SPA	277	172.800	47,865.600	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	2,414	10.740	25,926.360	
NEXI SPA	3,553	15.890	56,457.170	
LEONARDO SPA	6,676	5.986	39,962.530	
ENEL SPA	98,337	8.502	836,061.170	

SNAM SPA	24,300	4.701	114,234.300	
TERNA SPA	19,900	6.332	126,006.800	
EXOR NV	1,088	58.720	63,887.360	
CNH INDUSTRIAL NV	11,691	9.194	107,487.050	
FINECOBANK SPA	5,972	13.115	78,322.780	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	16,937	13.226	224,008.760	
FERRARI NV	1,722	178.550	307,463.100	
TELEFONICA SA	57,039	3.736	213,097.700	
ENDESA SA	3,760	24.290	91,330.400	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	95,166	3.958	376,667.020	
IBERDROLA SA	72,039	11.470	826,287.330	
BANKINTER SA	6,700	4.174	27,965.800	
REPSOL SA	17,685	8.486	150,074.910	
GRIFOLS SA	5,114	24.430	124,935.020	
BANCO SANTANDER SA	207,370	2.465	511,167.050	
AMADEUS IT GROUP SA	5,400	60.340	325,836.000	
NATURGY ENERGY GROUP SA	3,978	19.910	79,201.980	
MAPFRE SA	8,005	1.579	12,639.890	
CAIXABANK SA	46,859	2.203	103,230.370	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	3,583	26.820	96,096.060	
AENA SME SA	866	143.800	124,530.800	
CELLNEX TELECOM SA	4,546	51.440	233,846.240	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	14,255	28.280	403,131.400	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	1,793	28.860	51,745.980	
ENAGAS SA	3,675	20.780	76,366.500	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	5,147	17.130	88,168.110	
FERROVIAL SA	6,055	23.610	142,958.550	
UPM-KYMMENE OYJ	6,525	28.300	184,657.500	
NOKIA OYJ	65,261	3.418	223,062.090	
WARTSILA OYJ ABP	4,116	8.052	33,142.030	
STORA ENSO OYJ-R SHS	8,853	14.505	128,412.760	
ELISA OYJ	1,734	45.420	78,758.280	
SAMPO OYJ-A SHS	6,809	36.030	245,328.270	
FORTUM OYJ	4,400	19.285	84,854.000	
KONE OYJ-B	4,543	69.620	316,283.660	

	NESTE OYJ	5,778	57.500	332,235.000	
	ORION OYJ-CLASS B	1,763	39.990	70,502.370	
	VERBUND AG	1,216	59.000	71,744.000	
	OMV AG	1,209	29.520	35,689.680	
	ERSTE GROUP BANK AG	3,489	24.980	87,155.220	
	VOESTALPINE AG	1,800	26.930	48,474.000	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	1,100	16.760	18,436.000	
	ANDRITZ AG	550	34.940	19,217.000	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	3,055	35.580	108,696.900	
	KINGSPAN GROUP PLC	1,600	72.000	115,200.000	
	JERONIMO MARTINS	2,900	14.170	41,093.000	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	27,576	4.600	126,849.600	
	GALP ENERGIA SGPS SA	7,183	9.558	68,655.110	
	KERRY GROUP PLC-A	1,822	116.400	212,080.800	
	CRH PLC	10,517	34.150	359,155.550	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,204	154.000	339,416.000	
	ユーロ 小計			ユーロ 52,538,543.300 (6,534,744,015)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	23,500	41.200	968,200.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	23,000	61.750	1,420,250.000	
	MTR CORP	16,500	42.850	707,025.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	19,000	105.300	2,000,700.000	
	SINO LAND CO	34,000	10.500	357,000.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	37,552	57.500	2,159,240.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	8,000	46.500	372,000.000	
	CLP HOLDINGS LTD	17,000	73.000	1,241,000.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	20,565	32.300	664,249.500	
	HONG KONG & CHINA GAS	163,836	12.100	1,982,415.600	
	HANG SENG BANK LTD	8,000	137.600	1,100,800.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	17,500	41.400	724,500.000	
	WH GROUP LTD	169,500	6.560	1,111,920.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	14,900	386.200	5,754,380.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	37,000	20.050	741,850.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	3,000	92.900	278,700.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	7,500	20.000	150,000.000	

BANK OF EAST ASIA LTD	8,600	16.440	141,384.000	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	3,000	34.700	104,100.000	
SJM HOLDINGS LTD	10,000	9.110	91,100.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	8,000	23.550	188,400.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	28,552	43.750	1,249,150.000	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	5,500	40.050	220,275.000	
PCCW LTD	60,000	4.670	280,200.000	
AIA GROUP LTD	159,400	88.500	14,106,900.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	20,000	37.650	753,000.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	19,200	27.750	532,800.000	
SANDS CHINA LTD	29,000	33.100	959,900.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	19,000	101.200	1,922,800.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	45,000	25.200	1,134,000.000	
WYNN MACAU LTD	16,800	13.720	230,496.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 43,648,735.100 (584,893,050)	
合計			58,258,068,193 [58,258,068,193]	

(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	スイス・フラン	CIF -CW	13,420.000	2,952.400	
		小計		2,952.400 (339,438)	
新株予約権証券 合計				339,438 [339,438]	
投資証券	アメリカ・ドル	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,679	281,853.730	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	4,233	362,133.150	
		BOSTON PROPERTIES INC	2,356	241,325.080	
		VORNADO REALTY TRUST	2,128	85,822.240	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	1,501	428,880.730	

EQUITY RESIDENTIAL	5,245	310,504.000	
EQUINIX INC	1,081	757,262.120	
AMERICAN TOWER CORP	5,555	1,300,369.950	
HOST HOTELS & RESORTS INC	12,228	178,773.360	
INVITATION HOMES INC	6,976	200,629.760	
VICI PROPERTIES INC	5,464	140,315.520	
VENTAS INC	4,401	210,807.900	
WEYERHAEUSER CO	8,683	249,288.930	
AGNC INVESTMENT CORP	7,559	117,693.630	
CROWN CASTLE INTL CORP	5,102	852,901.340	
IRON MOUNTAIN INC	3,474	92,477.880	
VEREIT INC	13,632	100,058.880	
SUN COMMUNITIES INC	1,214	168,272.540	
PROLOGIS INC	9,436	949,261.600	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,648	267,206.720	
CAMDEN PROPERTY TRUST	1,177	115,039.980	
DUKE REALTY CORP	4,971	190,836.690	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	771	192,757.710	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	974	86,072.380	
WELLTOWER INC	4,901	316,310.540	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	6,434	192,247.920	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,714	212,536.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,950	114,484.500	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	15,632	127,557.120	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1,552	59,581.280	
REALTY INCOME CORP	4,587	282,742.680	
PUBLIC STORAGE	2,105	463,163.150	
REGENCY CENTERS CORP	1,939	90,919.710	
UDR INC	4,752	186,373.440	
WP CAREY INC	2,702	188,842.780	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,164	77,579.400	
DIGITAL REALTY TRUST INC	3,415	466,932.950	
EXTRA SPACE STORAGE INC	1,797	197,670.000	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	8,597	168,243.290	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 11,025,730.580 (1,145,463,150)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	

	LAND SECURITIES GROUP PLC	10,295	68,472.040	
	SEGRO PLC	13,286	119,760.000	
	BRITISH LAND CO PLC	14,580	68,540.580	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 256,772.620 (35,575,847)	
オーストラリア・ドル	LENDLEASE GROUP	4,303	61,102.600	
	TRANSURBAN GROUP	33,406	473,028.960	
	SYDNEY AIRPORT	9,129	61,346.880	
	APA GROUP	14,243	150,548.510	
	SCENTRE GROUP	64,017	184,368.960	
	DEXUS	13,949	136,979.180	
	GPT GROUP	30,647	145,266.780	
	MIRVAC GROUP	61,117	159,515.370	
	STOCKLAND	18,729	86,527.980	
	GOODMAN GROUP	20,198	375,884.780	
	VICINITY CENTRES	50,371	84,119.570	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 1,918,689.570 (147,566,415)	
カナダ・ドル	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	2,000	31,200.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1,600	82,144.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,400	25,438.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 138,782.000 (11,095,621)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE IN-RTS	1,128	0.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	30,500	92,110.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	51,660	102,803.400	
	SUNTEC REIT	26,000	39,780.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	46,000	90,160.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	37,600	77,832.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 402,685.400 (31,284,628)	

ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,751	ユーロ	110,593.160
	ICADE	406		24,319.400
	GECINA SA	578		73,463.800
	KLEPIERRE	2,394		46,395.720
	COVIVIO	353		25,416.000
ユーロ 小計			ユーロ	280,188.080 (34,849,793)
香港・ドル	LINK REIT	32,000	香港・ドル	2,192,000.000
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	52,000		405,080.000
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	34,000		352,240.000
香港・ドル 小計			香港・ドル	2,949,320.000 (39,520,888)
投資証券 合計				1,445,356,342 [1,445,356,342]
合計				1,445,695,780 [1,445,695,780]

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 591銘柄	97.3%	-	2.7%	71.9%
	投資証券 39銘柄				
イギリス・ポンド	株式 83銘柄	98.7%	-	1.3%	4.4%
	投資証券 3銘柄				
イスラエル・シェケル	株式 8銘柄	100%	-	-	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 53銘柄	89.0%	-	11.0%	2.2%
	投資証券 11銘柄				
カナダ・ドル	株式 81銘柄	99.4%	-	0.6%	3.4%
	投資証券 3銘柄				
シンガポール・ドル	株式 16銘柄	86.3%	-	13.7%	0.4%
	投資証券 6銘柄				

スイス・フラン	株式	39銘柄				
	新株予約 権証券	1銘柄	100%	0.0%	-%	3.2%
スウェーデン・クローナ	株式	36銘柄	100%	-%	-%	1.2%
デンマーク・クローネ	株式	18銘柄	100%	-%	-%	0.9%
ニュージーランド・ドル	株式	7銘柄	100%	-%	-%	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式	10銘柄	100%	-%	-%	0.2%
ユーロ	株式	240銘柄				
	投資証券	5銘柄	99.5%	-%	0.5%	11.0%
香港・ドル	株式	31銘柄				
	投資証券	3銘柄	93.7%	-%	6.3%	1.0%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワファンドラップオンライン 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）】

(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4期計算期間（2019年12月3日から2020年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 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）

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 2019年12月2日現在	第4期 2020年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	20,237,588	26,395,175
親投資信託受益証券	1,830,894,299	2,493,659,423
未収入金	150,000	1,770,000
流動資産合計	1,851,281,887	2,521,824,598
資産合計	1,851,281,887	2,521,824,598
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,788,039	4,321,652
未払受託者報酬	189,845	240,611
未払委託者報酬	2,800,778	3,549,526
その他未払費用	47,956	60,077
流動負債合計	5,826,618	8,171,866
負債合計	5,826,618	8,171,866
純資産の部		
元本等		
元本	1,462,100,428	1,873,069,139
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	383,354,841	640,583,593
（分配準備積立金）	196,075,466	398,853,797
元本等合計	1,845,455,269	2,513,652,732
純資産合計	1,845,455,269	2,513,652,732
負債純資産合計	1,851,281,887	2,521,824,598

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自	2018年12月1日 至 2019年12月2日	自	2019年12月3日 至 2020年11月30日
営業収益				
受取利息		21		85
有価証券売買等損益		168,546,217		251,645,124
営業収益合計		168,546,238		251,645,209
営業費用				
支払利息		11,859		8,792
受託者報酬		369,173		443,721
委託者報酬		5,446,478		6,546,008
その他費用		93,305		110,990
営業費用合計		5,920,815		7,109,511
営業利益		162,625,423		244,535,698
経常利益		162,625,423		244,535,698
当期純利益		162,625,423		244,535,698
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()		10,659,263		12,747,709
期首剰余金又は期首欠損金()		219,747,125		383,354,841
剰余金増加額又は欠損金減少額		78,690,190		119,705,037
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		78,690,190		119,705,037
剰余金減少額又は欠損金増加額		67,048,634		119,759,692
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		67,048,634		119,759,692
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		383,354,841		640,583,593

(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4期	
	自 2019年12月3日	至 2020年11月30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 2019年11月30日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2019年12月2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3期	第4期
	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1. 1 期首元本額	1,417,526,848円	1,462,100,428円
期中追加設定元本額	481,206,327円	950,256,999円
期中一部解約元本額	436,632,747円	539,288,288円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,462,100,428口	1,873,069,139口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第3期	第4期
	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(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(151,969,731円)、投資信託約款に規定される収益調整金(187,289,622円)及び分配準備積立金(44,105,735円)より分配対象額は383,365,088円(1万口当たり2,622.02円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(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(257,283,549円)、投資信託約款に規定される収益調整金(241,737,340円)及び分配準備積立金(141,570,248円)より分配対象額は640,591,137円(1万口当たり3,420.01円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	--	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第4期 自 2019年12月3日 至 2020年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第4期
	2020年11月30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3期	第4期
	2019年12月2日現在	2020年11月30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	160,883,353	258,646,609
合計	160,883,353	258,646,609

（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3期	第4期
2019年12月2日現在	2020年11月30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4期
自 2019年12月3日
至 2020年11月30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3期	第4期
	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2622円 (12,622円)	1.3420円 (13,420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	331,827,564	505,041,552	
	外国株式インデックスマザーファンド	662,541,353	1,988,617,871	
親投資信託受益証券 合計			2,493,659,423	
合計			2,493,659,423	

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」受益証券及び「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」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

	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		

流動資産		
預金	612,451,738	365,587,927
コール・ローン	6,367,531,949	3,752,997,009
株式	121,306,145,522	151,364,986,629
新株予約権証券	-	868,069
投資証券	3,645,255,546	3,711,750,912
派生商品評価勘定	373,437,617	619,719,431
未収入金	96,592,173	12,393,192
未収配当金	214,896,369	182,217,065
差入委託証拠金	1,487,858,524	2,380,060,115
流動資産合計	134,104,169,438	162,390,580,349
資産合計	134,104,169,438	162,390,580,349
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	930,366	23,156,487
未払金	76,338,905	1,712,592
未払解約金	58,281,600	82,467,100
その他未払費用	3,792	-
流動負債合計	135,554,663	107,336,179
負債合計	135,554,663	107,336,179
純資産の部		
元本等		
元本	1 48,893,612,273	54,067,455,177
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	85,075,002,502	108,215,788,993
元本等合計	133,968,614,775	162,283,244,170
純資産合計	133,968,614,775	162,283,244,170
負債純資産合計	134,104,169,438	162,390,580,349

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

(2)新株予約権証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

(3)投資証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

2. 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

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1. 1 期首	2018年12月1日	2019年12月3日
期首元本額	43,964,024,902円	48,893,612,273円
期中追加設定元本額	10,527,862,672円	16,107,558,260円
期中一部解約元本額	5,598,275,301円	10,933,715,356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	466,203,951円	429,418,774円
V A		
ダイワ国内重視バランスファ	12,135,579円	6,511,702円
ンド30 V A(一般投資家私		
募)		
ダイワ国内重視バランスファ	136,414,008円	109,450,582円
ンド50 V A(一般投資家私		
募)		

ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	19,175,184円	14,001,565円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	467,869,193円	353,394,455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)	8,549,100円	22,667,766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)	538,132,530円	535,920,559円
ダイワファンドラップ 外国 株式インデックス(為替ヘッ ジなし)	1,863,069,978円	2,255,476,207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)	538,513,489円	662,541,353円
D-I's 外国株式インデッ クス	2,768,783円	11,396,584円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	2,115,496円	6,026,400円
iFree 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	1,146,595,215円	2,011,620,301円
iFree 8資産バランス	816,785,041円	1,021,183,359円
iFree 年金バランス	26,201,082円	49,879,929円
DCダイワ外国株式インデッ クス	29,501,748,908円	33,018,813,032円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	576,429,097円	579,030,840円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	874,085,645円	976,488,397円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	675,316,597円	722,361,053円
大和DC海外株式インデッ ク スファンド	1,500,453,033円	1,541,641,973円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	3,017,912円	2,282,168円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	14,368,992円	11,422,149円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	5,760,550円	7,627,380円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	136,727,006円	452,466,523円
ダイワつみたてインデックス バランス30	88,638円	2,121,988円
ダイワつみたてインデックス バランス50	86,527円	2,068,375円
ダイワつみたてインデックス バランス70	530,015円	2,463,419円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	184,271,979円	161,683,743円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	323,611,524円	284,495,474円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	2,650,169,104円	2,255,482,425円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	127,631,309円	110,264,809円
ダイワバランスファンド 2020-07(適格機関投資家専 用)	-円	271,255,135円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国株式	677,239,222円	798,778,255円
ダイワ・ノーロード 外国株 式ファンド	111,772,535円	183,907,812円
ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワ SMA専用)	2,632,754,719円	2,325,979,029円
ダイワ投信倶楽部外国株式イ ンデックス	2,712,848,524円	2,735,745,325円
ダイワライフスタイル25	18,663,687円	17,629,498円
ダイワライフスタイル50	67,445,810円	63,519,419円
ダイワライフスタイル75	54,062,311円	50,437,420円
計	48,893,612,273円	54,067,455,177円
2. 期末日における受益権の総数	48,893,612,273口	54,067,455,177口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 2019年12月3日 至 2020年11月30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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年11月30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	2019年12月2日現在	2020年11月30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	14,202,028,663	17,672,692,878
新株予約権証券	-	30,829
投資証券	442,369,912	288,804,566
合計	14,644,398,575	17,383,919,141

（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（2018年12月1日から2019年12月2日まで、及び2019年12月3日から2020年11月30日まで）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	2019年12月2日 現在				2020年11月30日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株値指数								
先物取引								
買 建	8,546,091,477	-	8,919,524,138	373,432,661	6,984,505,406	-	7,583,915,003	599,409,597
合計	8,546,091,477	-	8,919,524,138	373,432,661	6,984,505,406	-	7,583,915,003	599,409,597

（注） 1. 時価の算定方法

株値指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

2. 通貨関連

種 類	2019年12月2日 現在				2020年11月30日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	6,314,295,910	-	6,313,370,500	925,410	4,081,862,053	-	4,079,015,400	2,846,653
アメリカ・ドル	4,843,983,500	-	4,843,319,000	664,500	3,024,714,845	-	3,001,843,000	22,871,845
イギリス・ポンド	240,357,900	-	240,312,000	45,900	165,466,538	-	169,006,600	3,540,062
オーストラリア・ドル	96,328,960	-	96,317,000	11,960	112,156,038	-	117,657,000	5,500,962
カナダ・ドル	226,600,550	-	226,572,500	28,050	129,630,400	-	131,901,000	2,270,600
スイス・フラン	230,248,200	-	230,202,000	46,200	173,808,703	-	174,769,600	960,897
ユーロ	676,776,800	-	676,648,000	128,800	476,085,529	-	483,838,200	7,752,671
合計	6,314,295,910	-	6,313,370,500	925,410	4,081,862,053	-	4,079,015,400	2,846,653

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,7400円 (27,400円)	3,0015円 (30,015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		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	3,750	147.400	552,750.000	
	PALO ALTO NETWORKS INC	3,230	295.310	953,851.300	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	6,100	119.070	726,327.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	4,400	88.130	387,772.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1,780	143.280	255,038.400	
	SYNCHRONY FINANCIAL	17,300	31.090	537,857.000	
	ABBOTT LABORATORIES	57,916	107.620	6,232,919.920	
	HOWMET AEROSPACE INC	13,233	24.600	325,531.800	
	VERISK ANALYTICS INC	5,150	198.230	1,020,884.500	
	LAS VEGAS SANDS CORP	11,100	56.590	628,149.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	9,650	131.950	1,273,317.500	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	20,262	148.280	3,004,449.360	
	QORVO INC	3,850	150.110	577,923.500	
	AFLAC INC	22,550	45.280	1,021,064.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	4,350	109.950	478,282.500	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	5,050	67.230	339,511.500	
	ADOBE INC	15,770	477.030	7,522,763.100	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,050	38.770	273,328.500	
	LULULEMON ATHLETICA INC	4,100	365.390	1,498,099.000	
	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	14,400	12.860	185,184.000	
	GARMIN LTD	4,650	117.050	544,282.500	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	7,310	277.830	2,030,937.300	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	22,750	209.410	4,764,077.500		
WR BERKLEY CORP	4,575	64.410	294,675.750		
AUTOZONE INC	770	1,119.240	861,814.800		

DOLLAR TREE INC	7,721	109.900	848,537.900	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	36,650	9.820	359,903.000	
PINNACLE WEST CAPITAL	3,800	83.940	318,972.000	
CELANESE CORP	3,950	133.680	528,036.000	
DR HORTON INC	11,316	75.980	859,789.680	
DENTSPLY SIRONA INC	7,000	51.660	361,620.000	
AUTODESK INC	7,230	272.810	1,972,416.300	
MOODY'S CORP	5,570	277.220	1,544,115.400	
ALBEMARLE CORP	3,550	137.660	488,693.000	
ATMOS ENERGY CORP	4,000	96.820	387,280.000	
ALLIANT ENERGY CORP	8,050	52.760	424,718.000	
CITIGROUP INC	68,173	56.670	3,863,363.910	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	14,150	175.250	2,479,787.500	
AMERICAN ELECTRIC POWER	16,400	84.920	1,392,688.000	
ALLEGHANY CORP	480	589.880	283,142.400	
DOMINO'S PIZZA INC	1,270	390.470	495,896.900	
HESS CORP	9,000	50.770	456,930.000	
DAVITA INC	2,750	109.880	302,170.000	
DANAHER CORP	20,850	216.780	4,519,863.000	
FORTIVE CORP	9,850	71.430	703,585.500	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	18,050	104.990	1,895,069.500	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	18,400	50.450	928,280.000	
BUNGE LTD	4,450	60.840	270,738.000	
TE CONNECTIVITY LTD	10,675	115.310	1,230,934.250	
APPLE INC	567,800	116.590	66,199,802.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,200	78.870	804,474.000	
BOEING CO/THE	17,560	216.500	3,801,740.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,165	77.810	401,888.650	
BECTON DICKINSON AND CO	9,419	228.960	2,156,574.240	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	6,700	18.490	123,883.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	4,350	102.280	444,918.000	
CDK GLOBAL INC	4,000	46.740	186,960.000	
NISOURCE INC	12,600	24.510	308,826.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,450	92.720	412,604.000	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	26,021	39.950	1,039,538.950	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	135,504	60.580	8,208,832.320	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	45,550	231.550	10,547,102.500	

ANSYS INC	2,780	330.410	918,539.800	
TRUIST FINANCIAL CORP	44,417	48.500	2,154,224.500	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	22,200	60.530	1,343,766.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	74,000	63.050	4,665,700.000	
JPMORGAN CHASE & CO	99,770	121.220	12,094,119.400	
T ROWE PRICE GROUP INC	7,700	145.630	1,121,351.000	
LKQ CORP	9,150	35.980	329,217.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,660	171.390	284,507.400	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	10,062	81.100	816,028.200	
CADENCE DESIGN SYS INC	9,300	116.580	1,084,194.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,010	190.750	764,907.500	
DOLLAR GENERAL CORP	8,350	218.010	1,820,383.500	
SERVICENOW INC	6,260	527.480	3,302,024.800	
CATERPILLAR INC	17,650	175.080	3,090,162.000	
BROWN & BROWN INC	7,950	45.620	362,679.000	
ESSENTIAL UTILITIES INC	7,300	45.790	334,267.000	
CMS ENERGY CORP	9,300	61.980	576,414.000	
MOSAIC CO/THE	12,050	22.680	273,294.000	
DELTA AIR LINES INC	5,150	41.060	211,459.000	
CORNING INC	24,600	37.090	912,414.000	
CISCO SYSTEMS INC	138,250	42.700	5,903,275.000	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	4,200	51.130	214,746.000	
MORGAN STANLEY	45,902	63.840	2,930,383.680	
MSCI INC	2,820	402.250	1,134,345.000	
FAIR ISAAC CORP	1,000	473.520	473,520.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,100	289.960	318,956.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	7,500	69.620	522,150.000	
BROADCOM INC	13,052	394.950	5,154,887.400	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,780	129.860	490,870.800	
ARAMARK	7,200	36.180	260,496.000	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	7,250	28.910	209,597.500	
DTE ENERGY COMPANY	6,250	128.530	803,312.500	
CENTENE CORP	18,987	63.170	1,199,408.790	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,500	91.710	320,985.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	14,300	34.140	488,202.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	6,150	115.860	712,539.000	
GARTNER INC	2,920	152.550	445,446.000	
SPLUNK INC	5,180	204.030	1,056,875.400	
DOMINION ENERGY INC	27,641	79.040	2,184,744.640	

MONSTER BEVERAGE CORP	12,850	84.150	1,081,327.500	
SMITH (A.O.) CORP	4,250	57.080	242,590.000	
DEERE & CO	9,650	261.950	2,527,817.500	
GLOBAL PAYMENTS INC	9,884	197.030	1,947,444.520	
VMWARE INC-CLASS A	2,830	142.080	402,086.400	
CABLE ONE INC	170	1,962.060	333,550.200	
BURLINGTON STORES INC	2,190	221.580	485,260.200	
NASDAQ INC	3,700	127.120	470,344.000	
VAIL RESORTS INC	1,360	282.670	384,431.200	
EAST WEST BANCORP INC	4,600	43.740	201,204.000	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,250	120.220	270,495.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,430	93.130	226,305.900	
CONSOLIDATED EDISON INC	10,900	77.770	847,693.000	
COGNEX CORP	5,500	74.500	409,750.000	
TELEFLEX INC	1,500	371.050	556,575.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2,800	135.290	378,812.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,400	277.960	667,104.000	
BIO-RAD LABORATORIES-A	710	535.070	379,899.700	
CATALENT INC	5,150	97.400	501,610.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	4,480	276.450	1,238,496.000	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,000	207.020	414,040.000	
IDEX CORP	2,520	192.360	484,747.200	
COLGATE-PALMOLIVE CO	26,800	84.900	2,275,320.000	
ROLLINS INC	4,925	57.030	280,872.750	
AMETEK INC	7,425	119.770	889,292.250	
CHURCH & DWIGHT CO INC	8,200	86.270	707,414.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	4,350	41.230	179,350.500	
HEICO CORP	1,400	127.060	177,884.000	
XPO LOGISTICS INC	3,100	105.820	328,042.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,240	322.750	400,210.000	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8,850	87.860	777,561.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,300	426.110	553,943.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	14,440	388.390	5,608,351.600	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,600	122.710	319,046.000	
EPAM SYSTEMS INC	1,800	325.950	586,710.000	

RPM INTERNATIONAL INC	4,350	87.670	381,364.500	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	880	1,297.770	1,142,037.600	
UGI CORP	7,050	37.160	261,978.000	
CUMMINS INC	4,850	229.030	1,110,795.500	
ACTIVISION BLIZZARD INC	25,300	78.140	1,976,942.000	
CDW CORP/DE	4,650	132.230	614,869.500	
SIGNATURE BANK	1,650	115.200	190,080.000	
COSTAR GROUP INC	1,310	884.380	1,158,537.800	
SVB FINANCIAL GROUP	1,710	353.790	604,980.900	
AMERCO	290	407.440	118,157.600	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,150	201.990	636,268.500	
MERCADOLIBRE INC	1,480	1,513.430	2,239,876.400	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,500	157.800	394,500.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	9,016	104.410	941,360.560	
IPG PHOTONICS CORP	1,170	203.520	238,118.400	
DEXCOM INC	3,000	318.210	954,630.000	
NORDSON CORP	1,730	204.370	353,560.100	
COPART INC	6,850	115.210	789,188.500	
DIAMONDBACK ENERGY INC	5,150	43.520	224,128.000	
SEAGEN INC	3,950	169.120	668,024.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,510	475.500	1,193,505.000	
TRANSDIGM GROUP INC	1,710	591.540	1,011,533.400	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	2,800	95.560	267,568.000	
NIELSEN HOLDINGS PLC	11,100	16.240	180,264.000	
KINDER MORGAN INC	67,381	14.750	993,869.750	
HCA HEALTHCARE INC	9,000	153.050	1,377,450.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,220	533.890	651,345.800	
CABOT OIL & GAS CORP	12,400	17.770	220,348.000	
T-MOBILE US INC	18,327	131.900	2,417,331.300	
ZILLOW GROUP INC - C	4,550	108.050	491,627.500	
COCA-COLA CO/THE	133,600	52.700	7,040,720.000	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	6,500	43.960	285,740.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	5,550	88.960	493,728.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	9,500	22.270	211,565.000	
CSX CORP	25,250	91.290	2,305,072.500	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,130	200.000	626,000.000	
EXPEDIA GROUP INC	4,375	123.730	541,318.750	

AUTOLIV INC	2,750	91.350	251,212.500	
AMAZON.COM INC	13,880	3,195.340	44,351,319.200	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	20,240	85.260	1,725,662.400	
EXXON MOBIL CORP	138,405	40.190	5,562,496.950	
FLIR SYSTEMS INC	4,200	39.130	164,346.000	
AES CORP	21,900	21.040	460,776.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,350	233.450	315,157.500	
EOG RESOURCES INC	19,300	51.430	992,599.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	5,200	104.320	542,464.000	
ABIOMED INC	1,520	271.900	413,288.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	4,950	103.200	510,840.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	10,140	114.090	1,156,872.600	
FORD MOTOR CO	126,323	9.090	1,148,276.070	
DISCOVERY INC - A	4,690	27.480	128,881.200	
EXACT SCIENCES CORP	4,850	118.190	573,221.500	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	4,887	22.680	110,837.160	
LIBERTY BROADBAND-A	850	157.140	133,569.000	
DISCOVERY INC-C	10,389	24.550	255,049.950	
AERCAP HOLDINGS NV	4,000	38.660	154,640.000	
FORTINET INC	4,800	123.790	594,192.000	
MARKEL CORP	460	1,004.290	461,973.400	
NEXTERA ENERGY INC	64,080	75.130	4,814,330.400	
MASIMO CORP	1,700	254.410	432,497.000	
FREEMONT-MCMORAN INC	47,208	23.520	1,110,332.160	
INSULET CORP	2,220	251.480	558,285.600	
US BANCORP	44,150	44.210	1,951,871.500	
UNITED RENTALS INC	2,350	232.910	547,338.500	
F5 NETWORKS INC	1,900	164.550	312,645.000	
FASTENAL CO	18,600	48.580	903,588.000	
FISERV INC	18,583	115.530	2,146,893.990	
GENERAL ELECTRIC CO	288,050	10.400	2,995,720.000	
GENERAL MOTORS CO	42,600	45.060	1,919,556.000	
GENERAL DYNAMICS CORP	7,950	152.060	1,208,877.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	10,760	235.400	2,532,904.000	
ALPHABET INC-CL A	9,820	1,787.020	17,548,536.400	
ALPHABET INC-CL C	9,887	1,793.190	17,729,269.530	
OWENS CORNING	3,350	74.300	248,905.000	
GENERAL MILLS INC	20,050	60.130	1,205,606.500	
FIRSTENERGY CORP	18,068	26.720	482,776.960	

GENUINE PARTS CO	4,850	98.360	477,046.000	
IHS MARKIT LTD	12,584	92.580	1,165,026.720	
FIFTH THIRD BANCORP	23,000	26.280	604,440.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,160	194.470	1,392,405.200	
HALLIBURTON CO	27,600	17.560	484,656.000	
HOME DEPOT INC	35,200	275.990	9,714,848.000	
ASSURANT INC	1,900	133.790	254,201.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	31,800	12.460	396,228.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,290	164.530	212,243.700	
HERSHEY CO/THE	4,740	148.050	701,757.000	
HUMANA INC	4,350	406.490	1,768,231.500	
NXP SEMICONDUCTORS NV	9,300	158.940	1,478,142.000	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	2,360	292.740	690,866.400	
HENRY SCHEIN INC	4,500	63.680	286,560.000	
HP INC	47,300	22.270	1,053,371.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	41,900	11.220	470,118.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	5,978	42.230	252,450.940	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	6,500	42.590	276,835.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,950	42.060	124,077.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	13,200	33.030	435,996.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	21,753	32.840	714,368.520	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	29,150	124.350	3,624,802.500	
INTERNATIONAL PAPER CO	12,200	50.690	618,418.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	4,350	85.010	369,793.500	
ZOETIS INC	15,600	161.470	2,518,932.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	7,979	143.500	1,144,986.500	
CHENIERE ENERGY INC	7,650	58.780	449,667.000	
ALLEGION PLC	2,900	114.280	331,412.000	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	12,973	21.820	283,070.860	
WASTE CONNECTIONS INC	8,507	104.380	887,960.660	
JUNIPER NETWORKS INC	10,500	22.210	233,205.000	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	2,400	139.150	333,960.000	
JM SMUCKER CO/THE	3,670	116.500	427,555.000	
JOHNSON & JOHNSON	86,200	144.000	12,412,800.000	

ABBVIE INC	57,772	104.890	6,059,705.080	
HOLOGIC INC	8,350	69.510	580,408.500	
KIMBERLY-CLARK CORP	11,250	141.370	1,590,412.500	
KROGER CO	25,500	32.430	826,965.000	
KLA CORP	5,030	254.130	1,278,273.900	
LOCKHEED MARTIN CORP	8,260	374.340	3,092,048.400	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,780	267.600	743,928.000	
LOWE'S COS INC	24,450	154.670	3,781,681.500	
ELI LILLY & CO	28,185	147.440	4,155,596.400	
LAM RESEARCH CORP	4,820	456.540	2,200,522.800	
JONES LANG LASALLE INC	1,650	133.960	221,034.000	
LOEWS CORP	8,300	43.410	360,303.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	6,249	49.160	307,200.840	
MCDONALD'S CORP	24,300	218.330	5,305,419.000	
3M CO	18,850	176.890	3,334,376.500	
FACEBOOK INC-CLASS A	78,750	277.810	21,877,537.500	
S&P GLOBAL INC	7,900	341.570	2,698,403.000	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,110	271.010	571,831.100	
CONCHO RESOURCES INC	6,200	62.020	384,524.000	
PHILLIPS 66	14,150	65.230	923,004.500	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	15,250	28.620	436,455.000	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,050	186.480	755,244.000	
METLIFE INC	25,550	47.450	1,212,347.500	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	21,700	45.110	978,887.000	
ARISTA NETWORKS INC	1,870	272.560	509,687.200	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4,800	45.920	220,416.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	5,658	173.460	981,436.680	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	800	1,126.680	901,344.000	
BAKER HUGHES CO	21,373	19.780	422,757.940	
ROCKWELL AUTOMATION INC	3,760	255.930	962,296.800	
MERCK & CO. INC.	82,621	79.860	6,598,113.060	
DUPONT DE NEMOURS INC	24,218	64.540	1,563,029.720	
MASCO CORP	8,700	54.240	471,888.000	
M & T BANK CORP	4,289	120.980	518,883.220	
MARSH & MCLENNAN COS	16,850	114.360	1,926,966.000	
BLACK KNIGHT INC	5,000	90.530	452,650.000	
HEICO CORP-CLASS A	2,500	113.720	284,300.000	

MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	9,122	128.350	1,170,808.700	
WORKDAY INC-CLASS A	5,680	223.860	1,271,524.800	
WAYFAIR INC- CLASS A	2,100	260.680	547,428.000	
SQUARE INC - A	11,800	212.520	2,507,736.000	
TRANSUNION	6,150	92.850	571,027.500	
VISTRA CORP	14,250	19.590	279,157.500	
BEIGENE LTD-ADR	1,450	285.890	414,540.500	
NETAPP INC	7,450	53.260	396,787.000	
NIKE INC -CL B	40,600	134.250	5,450,550.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	8,450	242.720	2,050,984.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	8,000	133.010	1,064,080.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	4,150	92.710	384,746.500	
ALLY FINANCIAL INC	12,550	30.670	384,908.500	
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,220	306.030	1,597,476.600	
APTIV PLC	8,700	121.860	1,060,182.000	
NEWMONT CORP	26,461	58.480	1,547,439.280	
MCKESSON CORP	5,250	180.000	945,000.000	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	8,700	82.410	716,967.000	
XYLEM INC	5,870	97.140	570,211.800	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	51,000	75.900	3,870,900.000	
NUCOR CORP	9,900	55.070	545,193.000	
SUNRUN INC	3,900	66.750	260,325.000	
WESTERN UNION CO	12,946	22.520	291,543.920	
GODADDY INC - CLASS A	5,700	79.500	453,150.000	
NEWELL BRANDS INC	12,542	21.070	264,259.940	
EVERGY INC	7,400	55.770	412,698.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	30,224	16.560	500,509.440	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	820	226.580	185,795.600	
OKTA INC	3,860	236.040	911,114.400	
COUPA SOFTWARE INC	2,180	326.940	712,729.200	
LIBERTY BROADBAND-C	3,600	157.970	568,692.000	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	13,355	31.320	418,278.600	
LINDE PLC	17,196	257.430	4,426,766.280	
WIX.COM LTD	1,780	258.620	460,343.600	
EQUITABLE HOLDINGS INC	13,300	26.000	345,800.000	
KKR & CO INC	16,300	38.710	630,973.000	
PAYCHEX INC	10,700	93.370	999,059.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,410	443.150	1,067,991.500	

ALTRIA GROUP INC	61,150	40.370	2,468,625.500	
P G & E CORP	35,500	12.730	451,915.000	
PFIZER INC	181,913	37.230	6,772,620.990	
CIGNA CORP	12,160	212.500	2,584,000.000	
DELL TECHNOLOGIES -C	7,851	69.820	548,156.820	
ALTICE USA INC- A	10,900	34.330	374,197.000	
XCEL ENERGY INC	17,450	67.620	1,179,969.000	
STERIS PLC	2,850	191.690	546,316.500	
FOX CORP - CLASS B	5,433	28.730	156,090.090	
FOX CORP - CLASS A	10,849	29.160	316,356.840	
STRYKER CORP	11,120	232.810	2,588,847.200	
DOW INC	24,068	55.400	1,333,367.200	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	2,800	59.810	167,468.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	5,180	471.610	2,442,939.800	
PARKER HANNIFIN CORP	4,170	272.850	1,137,784.500	
UBER TECHNOLOGIES INC	31,500	50.720	1,597,680.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	5,350	110.070	588,874.500	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	80,917	138.610	11,215,905.370	
EXELON CORP	32,272	41.740	1,347,033.280	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	7,350	123.830	910,150.500	
TELADOC HEALTH INC	2,300	196.450	451,835.000	
INGERSOLL-RAND INC	11,358	44.800	508,838.400	
NVR INC	110	4,120.220	453,224.200	
CONOCOPHILLIPS	35,500	42.780	1,518,690.000	
TWILIO INC - A	4,050	319.050	1,292,152.500	
DOCUSIGN INC	5,750	226.870	1,304,502.500	
PAYCOM SOFTWARE INC	1,610	416.770	670,999.700	
PEPSICO INC	45,400	144.600	6,564,840.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,300	113.200	147,160.000	
DROPBOX INC-CLASS A	8,000	19.540	156,320.000	
MONGODB INC	1,620	270.020	437,432.400	
SNAP INC - A	29,500	46.030	1,357,885.000	
CORTEVA INC	24,818	38.410	953,259.380	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	12,800	78.090	999,552.000	
AMCOR PLC	52,200	11.480	599,256.000	

CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	4,650	150.830	701,359.500	
ROKU INC	3,350	275.340	922,389.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,000	153.730	922,380.000	
ACCENTURE PLC-CL A	20,850	250.120	5,215,002.000	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	12,600	40.670	512,442.000	
PENTAIR PLC	5,505	53.100	292,315.500	
QUALCOMM INC	36,450	143.830	5,242,603.500	
INVESCO LTD	12,000	17.010	204,120.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,350	149.930	352,335.500	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,200	51.400	472,880.000	
DATADOG INC - CLASS A	4,350	96.420	419,427.000	
PINTEREST INC- CLASS A	13,100	69.720	913,332.000	
AVALARA INC	2,500	169.030	422,575.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,320	514.050	1,706,646.000	
REPUBLIC SERVICES INC	7,400	97.040	718,096.000	
BOOKING HOLDINGS INC	1,350	2,052.670	2,771,104.500	
ROSS STORES INC	11,800	109.540	1,292,572.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,100	132.770	411,587.000	
RESMED INC	4,850	209.640	1,016,754.000	
QUEST DIAGNOSTICS INC	4,350	124.800	542,880.000	
ROBERT HALF INTL INC	3,600	65.510	235,836.000	
MODERNA INC	8,800	127.030	1,117,864.000	
RALPH LAUREN CORP	1,450	87.980	127,571.000	
PERKINELMER INC	3,730	129.260	482,139.800	
CARRIER GLOBAL CORP	26,637	37.810	1,007,144.970	
OTIS WORLDWIDE CORP	13,718	67.340	923,770.120	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	5,800	43.870	254,446.000	
AVANTOR INC	15,500	26.350	408,425.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	4,700	28.630	134,561.000	
DYNATRACE INC	6,100	38.420	234,362.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	1,330	873.100	1,161,223.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	32,135	15.620	501,948.700	
IAC/INTERACTIVECORP	2,530	142.480	360,474.400	
MATCH GROUP INC	8,170	139.630	1,140,777.100	
CHEVRON CORP	61,018	91.310	5,571,553.580	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	6,500	108.980	708,370.000	

ZSCALER INC	2,400	149.740	359,376.000	
EDISON INTERNATIONAL	12,350	62.790	775,456.500	
TESLA INC	24,270	585.760	14,216,395.200	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	1,000	328.790	328,790.000	
NORTONLIFELOCK INC	17,850	18.110	323,263.500	
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,022	187.710	942,679.620	
SYNOPSYS INC	5,040	225.420	1,136,116.800	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	4,685	642.800	3,011,518.000	
VIATRIS INC	38,621	17.050	658,488.050	
CBRE GROUP INC - A	10,850	61.130	663,260.500	
TWITTER INC	25,950	46.590	1,209,010.500	
SOUTHERN CO/THE	34,750	60.650	2,107,587.500	
SYSCO CORP	16,000	71.240	1,139,840.000	
TRAVELERS COS INC/THE	8,403	134.440	1,129,699.320	
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,300	55.610	239,123.000	
STEEL DYNAMICS INC	6,600	37.650	248,490.000	
SCHLUMBERGER LTD	46,002	21.880	1,006,523.760	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	5,050	50.550	255,277.500	
AT&T INC	233,291	29.030	6,772,437.730	
SOUTHWEST AIRLINES CO	4,700	47.730	224,331.000	
ON SEMICONDUCTOR CORP	12,900	28.650	369,585.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2,690	735.810	1,979,328.900	
SEMPRA ENERGY	9,670	130.460	1,261,548.200	
TIFFANY & CO	3,650	131.720	480,778.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	7,650	58.480	447,372.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	29,750	158.990	4,729,952.500	
SALESFORCE.COM INC	29,421	247.630	7,285,522.230	
WESTROCK CO	8,530	44.060	375,831.800	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	24,484	45.970	1,125,529.480	
TERADYNE INC	5,500	109.400	601,700.000	
UNION PACIFIC CORP	21,980	205.640	4,519,967.200	
MARATHON PETROLEUM CORP	21,588	41.420	894,174.960	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	49,479	73.910	3,656,992.890	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	23,050	168.890	3,892,914.500	
IQVIA HOLDINGS INC	6,244	168.810	1,054,049.640	
VOYA FINANCIAL INC	4,350	59.330	258,085.500	

AMEREN CORPORATION	8,050	78.990	635,869.500	
UNITEDHEALTH GROUP INC	31,016	337.940	10,481,547.040	
VERISIGN INC	3,370	200.520	675,752.400	
VALERO ENERGY CORP	13,142	56.620	744,100.040	
ULTA BEAUTY INC	1,760	281.290	495,070.400	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	8,688	36.560	317,633.280	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,500	132.110	330,275.000	
ANTHEM INC	8,300	312.800	2,596,240.000	
WALT DISNEY CO/THE	59,162	147.130	8,704,505.060	
WELLS FARGO & CO	127,422	28.460	3,626,430.120	
WASTE MANAGEMENT INC	14,000	119.190	1,668,660.000	
WILLIAMS COS INC	40,200	21.460	862,692.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3,700	139.370	515,669.000	
WHIRLPOOL CORP	1,950	200.960	391,872.000	
WALMART INC	46,400	151.600	7,034,240.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	6,750	150.020	1,012,635.000	
WYNN RESORTS LTD	3,050	101.220	308,721.000	
WABTEC CORP	5,861	73.820	432,659.020	
TJX COMPANIES INC	39,400	63.220	2,490,868.000	
WATERS CORP	2,050	228.270	467,953.500	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,760	377.000	663,520.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	24,700	39.000	963,300.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,173	209.550	874,452.150	
WESTERN DIGITAL CORP	9,750	45.850	447,037.500	
WEC ENERGY GROUP INC	10,480	95.740	1,003,355.200	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	16,800	59.350	997,080.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	55,200	211.000	11,647,200.000	
PPL CORP	24,800	29.110	721,928.000	
PULTEGROUP INC	8,900	44.360	394,804.000	
PPG INDUSTRIES INC	7,850	147.780	1,160,073.000	
NORTHERN TRUST CORP	6,400	96.140	615,296.000	
NVIDIA CORP	20,100	530.450	10,662,045.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	13,843	139.790	1,935,112.970	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	5,300	55.810	295,793.000	
TYSON FOODS INC-CL A	9,800	65.000	637,000.000	

NETFLIX INC	14,400	491.360	7,075,584.000	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	12,920	453.400	5,857,928.000	
NRG ENERGY INC	7,950	32.510	258,454.500	
GLOBE LIFE INC	3,225	96.020	309,664.500	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	5,700	130.340	742,938.000	
TEXTRON INC	7,150	46.870	335,120.500	
NEWS CORP - CLASS A	13,137	17.710	232,656.270	
OGE ENERGY CORP	6,750	33.650	227,137.500	
OMNICOM GROUP	7,150	63.000	450,450.000	
ORACLE CORP	72,033	57.760	4,160,626.080	
MASTERCARD INC - A	29,200	339.070	9,900,844.000	
ONEOK INC	14,400	37.230	536,112.000	
CENTURYLINK INC	31,152	10.460	325,849.920	
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,420	418.800	1,432,296.000	
YUM! BRANDS INC	9,800	107.180	1,050,364.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	3,700	176.410	652,717.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	6,050	46.800	283,140.000	
BANK OF AMERICA CORP	255,601	28.990	7,409,872.990	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,210	386.240	467,350.400	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	5,850	80.400	470,340.000	
AMERICAN EXPRESS CO	22,600	120.590	2,725,334.000	
ANALOG DEVICES INC	12,199	137.750	1,680,412.250	
ADVANCED MICRO DEVICES	38,300	87.190	3,339,377.000	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	28,322	39.710	1,124,666.620	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	5,500	136.160	748,880.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	5,900	81.480	480,732.000	
AVERY DENNISON CORP	2,750	150.300	413,325.000	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	17,900	78.410	1,403,539.000	
EMERSON ELECTRIC CO	19,700	78.160	1,539,752.000	
AON PLC-CLASS A	7,620	206.580	1,574,139.600	
AMGEN INC	19,250	224.810	4,327,592.500	
EATON CORP PLC	13,086	121.900	1,595,183.400	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	5,580	204.810	1,142,839.800	
APPLIED MATERIALS INC	30,200	82.660	2,496,332.000	
CME GROUP INC	11,800	174.770	2,062,286.000	

NATIONAL OILWELL VARCO INC	11,694	13.150	153,776.100	
ECOLAB INC	8,450	224.810	1,899,644.500	
EQUIFAX INC	4,050	164.740	667,197.000	
GILEAD SCIENCES INC	41,150	60.030	2,470,234.500	
KEURIG DR PEPPER INC	11,500	30.760	353,740.000	
HORMEL FOODS CORP	9,600	47.200	453,120.000	
STATE STREET CORP	11,743	71.590	840,681.370	
SCHWAB (CHARLES) CORP	50,290	49.700	2,499,413.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	16,900	75.970	1,283,893.000	
CAMPBELL SOUP CO	6,000	48.980	293,880.000	
CROWN HOLDINGS INC	4,550	95.560	434,798.000	
CARDINAL HEALTH INC	9,450	53.780	508,221.000	
FEDEX CORP	8,200	287.410	2,356,762.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	15,104	87.760	1,325,527.040	
FMC CORP	4,200	115.670	485,814.000	
CERNER CORP	10,050	74.100	744,705.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2,824	112.870	318,744.880	
CITRIX SYSTEMS INC	3,800	122.440	465,272.000	
INTEL CORP	138,600	47.450	6,576,570.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	12,400	22.800	282,720.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	11,650	45.830	533,919.500	
ILLINOIS TOOL WORKS	10,300	212.230	2,185,969.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	34,600	6.550	226,630.000	
ILLUMINA INC	4,850	317.030	1,537,595.500	
SEALED AIR CORP	5,000	44.530	222,650.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	3,820	729.820	2,787,912.400	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,050	119.720	484,866.000	
SNAP-ON INC	1,630	177.000	288,510.000	
CARMAX INC	5,350	95.370	510,229.500	
COMERICA INC	4,500	51.490	231,705.000	
INGREDION INC	2,150	79.950	171,892.500	
DUKE ENERGY CORP	24,178	94.600	2,287,238.800	
TARGET CORP	16,280	179.770	2,926,655.600	
DOVER CORP	4,800	123.880	594,624.000	
WW GRAINGER INC	1,490	414.580	617,724.200	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,250	105.860	449,905.000	
CINTAS CORP	2,940	361.090	1,061,604.600	

CONAGRA BRANDS INC	15,800	35.940	567,852.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	4,750	73.190	347,652.500	
CLOROX COMPANY	4,050	203.090	822,514.500	
ENTERGY CORP	6,650	111.510	741,541.500	
MICROSOFT CORP	235,900	215.230	50,772,757.000	
INCYTE CORP	6,000	83.250	499,500.000	
CVS HEALTH CORP	42,969	67.870	2,916,306.030	
MEDTRONIC PLC	43,898	114.590	5,030,271.820	
MICRON TECHNOLOGY INC	36,650	64.230	2,354,029.500	
BLACKROCK INC	5,000	715.110	3,575,550.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	15,800	24.070	380,306.000	
HASBRO INC	4,400	92.320	406,208.000	
KELLOGG CO	8,400	63.480	533,232.000	
KEYCORP	32,600	16.330	532,358.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	3,150	189.500	596,925.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	46,811	57.460	2,689,760.060	
COOPER COS INC/THE	1,770	340.710	603,056.700	
CHUBB LTD	14,869	151.420	2,251,463.980	
ARROW ELECTRONICS INC	2,700	93.010	251,127.000	
ALLSTATE CORP	10,250	104.140	1,067,435.000	
EBAY INC	25,650	51.340	1,316,871.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	36,500	211.390	7,715,735.000	
EASTMAN CHEMICAL CO	4,550	99.900	454,545.000	
XILINX INC	8,000	137.490	1,099,920.000	
DISH NETWORK CORP-A	8,200	35.910	294,462.000	
ZIONS BANCORP NA	5,200	39.460	205,192.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	7,450	245.940	1,832,253.000	
TRIMBLE INC	8,250	60.450	498,712.500	
LENNAR CORP-A	9,000	77.710	699,390.000	
LEAR CORP	1,800	146.600	263,880.000	
PROGRESSIVE CORP	19,300	88.430	1,706,699.000	
PACCAR INC	11,487	87.740	1,007,869.380	
BIOGEN INC	5,620	243.780	1,370,043.600	
IDEXX LABORATORIES INC	2,770	454.230	1,258,217.100	
STARBUCKS CORP	38,350	98.660	3,783,611.000	
PTC INC	3,700	108.610	401,857.000	
PERRIGO CO PLC	4,200	48.030	201,726.000	
EVERSOURCE ENERGY	10,980	87.930	965,471.400	

	INTUIT INC	8,570	354.240	3,035,836.800	
	BORGWARNER INC	8,200	39.500	323,900.000	
	BEST BUY CO INC	7,600	112.630	855,988.000	
	BALL CORP	10,584	96.360	1,019,874.240	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	47,097	33.600	1,582,459.200	
	ELECTRONIC ARTS INC	9,570	124.170	1,188,306.900	
	VULCAN MATERIALS CO	4,350	142.330	619,135.500	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	8,550	226.710	1,938,370.500	
	VF CORP	10,900	85.720	934,348.000	
	VIACOMCBS INC - CLASS B	18,375	35.065	644,319.370	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	1,900	130.550	248,045.000	
	VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	3,070	173.900	533,873.000	
	CARNIVAL CORP	15,300	21.580	330,174.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	149,090	51.750	7,715,407.500	
	JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	7,200	23.900	172,080.000	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	7,500	52.900	396,750.000	
	DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	9,000	4.090	36,810.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	40,300	4.220	170,066.000	
	アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 1,043,158,544.690 (108,373,741,208)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	BP PLC	666,500	2.629	1,752,228.500	
	UNILEVER PLC	38,410	45.860	1,761,482.600	
	BARCLAYS PLC	568,800	1.395	793,476.000	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	279,500	1.076	300,881.750	
	PRUDENTIAL PLC	84,900	12.120	1,028,988.000	
	NATWEST GROUP PLC	159,791	1.606	256,704.240	
	EVRAZ PLC	15,000	3.922	58,830.000	
	JOHNSON MATTHEY PLC	6,064	22.490	136,379.360	
	BAE SYSTEMS PLC	106,500	5.042	536,973.000	
	AVIVA PLC	128,966	3.241	417,978.800	
	AVEVA GROUP PLC	2,000	33.750	67,500.000	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	165,100	13.836	2,284,323.600	
	INFORMA PLC	49,900	5.402	269,559.800	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	156,500	1.593	249,304.500	
	AUTO TRADER GROUP PLC	31,900	5.482	174,875.800	
	DCC PLC	3,150	56.860	179,109.000	

OCADO GROUP PLC	15,200	22.180	337,136.000	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,450	108.500	265,825.000	
HALMA PLC	12,250	22.200	271,950.000	
GVC HOLDINGS PLC	19,100	10.425	199,117.500	
JD SPORTS FASHION PLC	14,600	7.332	107,047.200	
M&G PLC	83,700	1.934	161,917.650	
RELX PLC	63,146	17.420	1,100,003.320	
DIAGEO PLC	76,900	29.330	2,255,477.000	
RIO TINTO PLC	37,000	49.225	1,821,325.000	
STANDARD CHARTERED PLC	86,800	4.637	402,491.600	
TESCO PLC	320,700	2.278	730,554.600	
SMITH & NEPHEW PLC	29,050	14.525	421,951.250	
GLENCORE PLC	330,725	2.135	706,263.230	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	10,250	14.335	146,933.750	
SMITHS GROUP PLC	12,383	14.675	181,720.520	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	41,983	2.971	124,731.490	
PEARSON PLC	23,563	6.500	153,159.500	
SAINSBURY (J) PLC	54,225	2.165	117,397.120	
NEXT PLC	4,450	65.180	290,051.000	
TAYLOR WIMPEY PLC	117,700	1.572	185,024.400	
WHITBREAD PLC	6,861	31.620	216,944.820	
BUNZL PLC	11,205	23.160	259,507.800	
VODAFONE GROUP PLC	870,183	1.249	1,086,858.560	
CRODA INTERNATIONAL PLC	4,261	59.500	253,529.500	
KINGFISHER PLC	68,211	2.709	184,783.590	
WPP PLC	40,900	7.494	306,504.600	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	22,827	8.992	205,260.380	
SEVERN TRENT PLC	7,833	23.880	187,052.040	
RENTOKIL INITIAL PLC	61,200	4.908	300,369.600	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	23,450	65.160	1,528,002.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	16,550	10.195	168,727.250	
SCHROEDERS PLC	4,150	32.340	134,211.000	
SSE PLC	33,900	13.800	467,820.000	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	34,000	6.290	213,860.000	
ASTRAZENECA PLC	43,150	77.700	3,352,755.000	
FERGUSON PLC	7,487	83.240	623,217.880	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	195,500	2.563	501,066.500	
3I GROUP PLC	31,391	10.760	337,767.160	

ASSTEAD GROUP PLC	14,650	31.500	461,475.000	
SAGE GROUP PLC/THE	35,114	6.098	214,125.170	
NATIONAL GRID PLC	114,434	8.738	999,924.290	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,296,465	0.372	856,466.620	
RSA INSURANCE GROUP PLC	31,760	6.744	214,189.440	
IMPERIAL BRANDS PLC	30,400	14.130	429,552.000	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,150	46.850	194,427.500	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	75,360	26.770	2,017,387.200	
BHP GROUP PLC	68,727	17.378	1,194,337.800	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	11,500	21.260	244,490.000	
HSBC HOLDINGS PLC	669,650	4.048	2,711,078.020	
ANGLO AMERICAN PLC	40,383	22.655	914,876.860	
MONDI PLC	15,650	16.895	264,406.750	
WM MORRISON SUPERMARKETS	73,400	1.836	134,762.400	
COMPASS GROUP PLC	58,939	14.180	835,755.020	
PERSIMMON PLC	10,600	26.960	285,776.000	
BT GROUP PLC	290,100	1.213	351,891.300	
COCA-COLA HBC AG-DI	6,550	21.830	142,986.500	
BURBERRY GROUP PLC	13,289	17.215	228,770.130	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	5,636	47.730	269,006.280	
INTERTEK GROUP PLC	5,200	55.020	286,104.000	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	10,499	79.200	831,520.800	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	135,000	13.394	1,808,190.000	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	122,318	13.040	1,595,026.720	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,700	26.320	150,024.000	
ADMIRAL GROUP PLC	6,150	28.470	175,090.500	
ANTOFAGASTA PLC	12,800	12.370	158,336.000	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	70,862	2.710	192,036.020	
EXPERIAN PLC	29,654	25.850	766,555.900	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 49,505,477.980 (6,858,983,974)	
イスラエル・ シュケル		株	イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	34,500	11.440	394,680.000	
AZRIELI GROUP LTD	1,400	201.300	281,820.000	
ICL GROUP LTD	23,600	15.550	366,980.000	

	ELBIT SYSTEMS LTD	950	427.400	406,030.000	
	BANK HAPOALIM BM	35,700	22.200	792,540.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	51,200	19.150	980,480.000	
	NICE LTD	2,200	796.200	1,751,640.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,100	72.800	298,480.000	
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル	
				5,272,650.000	
				(165,244,851)	
オーストラリア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	88,800	2.890	256,632.000	
	BHP GROUP LTD	95,750	38.720	3,707,440.000	
	SOUTH32 LTD	151,600	2.460	372,936.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	30,550	22.730	694,401.500	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	56,500	18.570	1,049,205.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	102,450	23.320	2,389,134.000	
	WESTPAC BANKING CORP	117,348	20.430	2,397,419.640	
	SANTOS LTD	53,100	6.250	331,875.000	
	AUSNET SERVICES	65,000	1.860	120,900.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	92,450	23.090	2,134,670.500	
	RIO TINTO LTD	12,250	102.000	1,249,500.000	
	ORIGIN ENERGY LTD	53,500	5.190	277,665.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	60,000	4.300	258,000.000	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,400	29.310	99,654.000	
	COLES GROUP LTD	43,045	17.940	772,227.300	
	WISETECH GLOBAL LTD	4,500	29.950	134,775.000	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	25,000	12.850	321,250.000	
	EVOLUTION MINING LTD	53,000	5.100	270,300.000	
	AFTERPAY LTD	7,000	94.700	662,900.000	
	TPG TELECOM LTD	12,000	7.770	93,240.000	
	OIL SEARCH LTD	64,200	3.650	234,330.000	
	SEEK LTD	10,700	26.060	278,842.000	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	23,500	9.230	216,905.000	
	NEWCREST MINING LTD	26,000	27.090	704,340.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	57,450	80.710	4,636,789.500	
	AMPOL LTD	7,950	30.630	243,508.500	
	ORICA LTD	13,100	16.880	221,128.000	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	46,450	10.270	477,041.500	

	CIMIC GROUP LTD	2,800	25.560	71,568.000	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	41,300	37.560	1,551,228.000	
	COCA-COLA AMATIL LTD	15,700	12.650	198,605.000	
	TABCORP HOLDINGS LTD	72,763	3.930	285,958.590	
	CROWN RESORTS LTD	11,600	9.950	115,420.000	
	QANTAS AIRWAYS LTD	30,500	5.520	168,360.000	
	TELSTRA CORP LTD	134,500	3.110	418,295.000	
	AMP LTD	102,000	1.740	177,480.000	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	14,250	39.020	556,035.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	11,084	137.490	1,523,939.160	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	18,450	33.180	612,171.000	
	CSL LTD	14,750	303.000	4,469,250.000	
	WESFARMERS LTD	37,000	49.890	1,845,930.000	
	COCHLEAR LTD	2,050	222.210	455,530.500	
	BLUESCOPE STEEL LTD	16,300	17.300	281,990.000	
	SUNCORP GROUP LTD	41,257	10.180	419,996.260	
	ASX LTD	6,250	77.240	482,750.000	
	COMPUTERSHARE LTD	15,900	14.210	225,939.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	70,936	5.320	377,379.520	
	SONIC HEALTHCARE LTD	14,350	33.260	477,281.000	
	AGL ENERGY LTD	19,000	13.720	260,680.000	
	BRAMBLES LTD	50,400	11.100	559,440.000	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	5,750	63.680	366,160.000	
	REA GROUP LTD	1,600	141.370	226,192.000	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	3,800	60.980	231,724.000	
	オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 40,966,311.470 (3,150,719,015)	
カナダ・ドル	株		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	8,300	24.230	201,109.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	700	1,620.320	1,134,224.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	9,287	75.930	705,161.910	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	14,900	51.010	760,049.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	4,650	143.700	668,205.000	
	BCE INC	4,930	57.030	281,157.900	
	FRANCO-NEVADA CORP	6,200	169.450	1,050,590.000	
	SUNCOR ENERGY INC	50,130	22.410	1,123,413.300	

METRO INC/CN	8,200	60.060	492,492.000	
NATIONAL BANK OF CANADA	11,000	73.480	808,280.000	
BANK OF NOVA SCOTIA	39,900	64.890	2,589,111.000	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	14,650	111.140	1,628,201.000	
TORONTO-DOMINION BANK	59,400	70.900	4,211,460.000	
GREAT-WEST LIFECO INC	9,100	30.510	277,641.000	
ROYAL BANK OF CANADA	46,750	108.160	5,056,480.000	
TC ENERGY CORP	31,050	59.310	1,841,575.500	
PEMBINA PIPELINE CORP	17,829	34.070	607,434.030	
BARRICK GOLD CORP	58,600	29.450	1,725,770.000	
CAE INC	7,900	33.470	264,413.000	
THOMSON REUTERS CORP	5,712	103.700	592,334.400	
EMPIRE CO LTD 'A'	5,300	35.660	188,998.000	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	4,650	59.990	278,953.500	
HYDRO ONE LTD	10,500	29.670	311,535.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	5,960	64.300	383,228.000	
WSP GLOBAL INC	3,700	95.640	353,868.000	
PARKLAND CORP	4,400	39.590	174,196.000	
QUEBECOR INC -CL B	5,300	32.950	174,635.000	
EMERA INC	7,700	54.430	419,111.000	
SSR MINING INC	7,200	22.990	165,528.000	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,000	32.810	131,240.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	11,600	60.900	706,440.000	
AGNICO EAGLE MINES LTD	7,800	84.190	656,682.000	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	18,900	20.440	386,316.000	
B2GOLD CORP	34,700	7.030	243,941.000	
AIR CANADA	4,100	24.860	101,926.000	
KINROSS GOLD CORP	40,300	9.330	375,999.000	
BANK OF MONTREAL	21,100	96.770	2,041,847.000	
POWER CORP OF CANADA	18,100	29.690	537,389.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	3,500	1,343.000	4,700,500.000	
NUTRIEN LTD	18,819	64.300	1,210,061.700	
CANOPY GROWTH CORP	7,400	37.500	277,500.000	
CRONOS GROUP INC	5,500	10.840	59,620.000	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	8,800	52.020	457,776.000	
CAMECO CORP	12,800	13.230	169,344.000	
TELUS CORP	10,800	25.240	272,592.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	15,100	20.870	315,137.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1,800	166.260	299,268.000	

CANADIAN NATURAL RESOURCES	38,900	31.370	1,220,293.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	445.200	400,680.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	9,200	80.030	736,276.000	
WESTON (GEORGE) LTD	2,537	97.500	247,357.500	
PAN AMERICAN SILVER CORP	7,000	38.160	267,120.000	
BLACKBERRY LTD	16,000	7.990	127,840.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	19,250	59.180	1,139,215.000	
ENBRIDGE INC	66,500	41.690	2,772,385.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	43,425	53.290	2,314,118.250	
MANULIFE FINANCIAL CORP	63,800	22.420	1,430,396.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	10,500	25.320	265,860.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	4,500	421.800	1,898,100.000	
IA FINANCIAL CORP INC	3,300	58.470	192,951.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	6,300	34.930	220,059.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	23,350	141.580	3,305,893.000	
CGI INC - CLASS A	7,900	97.680	771,672.000	
ONEX CORPORATION	2,600	71.300	185,380.000	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	15,100	22.680	342,468.000	
IGM FINANCIAL INC	2,400	34.910	83,784.000	
TMX GROUP LTD	1,900	126.330	240,027.000	
OPEN TEXT CORP	8,700	58.190	506,253.000	
CI FINANCIAL CORP	7,000	17.450	122,150.000	
SAPUTO INC	8,000	36.010	288,080.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	19,300	18.040	348,172.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	28,300	43.000	1,216,900.000	
YAMANA GOLD INC	32,300	6.660	215,118.000	
FORTIS INC	15,000	52.940	794,100.000	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3,800	88.690	337,022.000	
LUNDIN MINING CORP	19,400	10.320	200,208.000	
CENOVUS ENERGY INC	31,400	6.960	218,544.000	
DOLLARAMA INC	9,700	52.730	511,481.000	
ATCO LTD -CLASS I	2,200	39.670	87,274.000	
ALTAGAS LTD	9,100	19.070	173,537.000	
KEYERA CORP	7,400	23.460	173,604.000	
INTER PIPELINE LTD	12,800	13.510	172,928.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 64,939,978.990	

(5,191,951,320)

シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	42,000	23.060	968,520.000
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	62,900	25.680	1,615,272.000
	SINGAPORE AIRLINES LTD	43,675	4.510	196,974.250
	KEPPEL CORP LTD	51,300	5.240	268,812.000
	UOL GROUP LTD	14,000	7.550	105,700.000
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	7.870	126,707.000
	CAPITALAND LTD	82,900	3.140	260,306.000
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	91,300	0.920	83,996.000
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	2,700	21.000	56,700.000
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	116,400	10.150	1,181,460.000
	GENTING SINGAPORE LTD	209,000	0.845	176,605.000
	VENTURE CORP LTD	8,600	19.170	164,862.000
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	290,950	2.420	704,099.000
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	50,000	4.020	201,000.000
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	27,300	9.220	251,706.000
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	65,900	4.290	282,711.000
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 6,645,430.250 (516,283,476)
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン
	UBS GROUP AG-REG	120,000	13.160	1,579,200.000
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	280	819.000	229,320.000
	ADECCO GROUP AG-REG	5,150	53.900	277,585.000
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	22,980	302.500	6,951,450.000
	SIKA AG-REG	4,710	230.600	1,086,126.000
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	3	82,000.000	246,000.000
	ABB LTD-REG	60,100	24.150	1,451,415.000
	SWISS RE AG	9,750	83.740	816,465.000
	NESTLE SA-REG	97,200	102.300	9,943,560.000
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	590	966.400	570,176.000
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,260	249.800	314,748.000
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	79,970	11.715	936,848.550
	JULIUS BAER GROUP LTD	7,400	52.440	388,056.000

	SGS SA-REG	200	2,588.000	517,600.000	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	690	242.000	166,980.000	
	VIFOR PHARMA AG	1,450	132.350	191,907.500	
	TEMENOS AG - REG	2,120	115.100	244,012.000	
	ALCON INC	16,130	57.820	932,636.600	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	970	229.400	222,518.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	4,862	372.300	1,810,122.600	
	BALOISE HOLDING AG - REG	1,570	158.900	249,473.000	
	CLARIANT AG-REG	5,700	18.375	104,737.500	
	NOVARTIS AG-REG	72,600	81.060	5,884,956.000	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	100	1,972.000	197,200.000	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	17,160	76.780	1,317,544.800	
	SWISSCOM AG-REG	830	481.100	399,313.000	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS- REG	1,010	95.900	96,859.000	
	GEBERIT AG-REG	1,190	543.200	646,408.000	
	GIVAUDAN-REG	300	3,643.000	1,092,900.000	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	340	1,035.500	352,070.000	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,822	223.700	407,581.400	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	5,500	78.360	430,980.000	
	LONZA GROUP AG-REG	2,400	551.800	1,324,320.000	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,520	44.420	67,518.400	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	17,290	48.070	831,130.300	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,040	409.100	425,464.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,800	202.600	364,680.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,510	81.800	205,318.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	34	7,725.000	262,650.000	
	スイス・フラン 小計			スイス・フラン 43,537,829.650 (5,005,544,275)	
スウェーデン・ クローナ		株	スウェーデン・クロー ナ	スウェーデン・クローナ	
	ICA GRUPPEN AB	3,520	411.600	1,448,832.000	
	ERICSSON LM-B SHS	99,630	106.150	10,575,724.500	
	VOLVO AB-B SHS	50,850	199.900	10,164,915.000	
	SKF AB-B SHARES	13,300	215.000	2,859,500.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	7,600	205.200	1,559,520.000	
	SWEDISH MATCH AB	5,650	692.000	3,909,800.000	
	TELE2 AB-B SHS	16,800	110.800	1,861,440.000	

SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	57,400	93.400	5,361,160.000	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	52,850	88.220	4,662,427.000	
SWEDBANK AB - A SHARES	31,800	156.320	4,970,976.000	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	28,200	182.650	5,150,730.000	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	20,700	139.050	2,878,335.000	
SKANSKA AB-B SHS	11,550	207.500	2,396,625.000	
SANDVIK AB	38,450	196.200	7,543,890.000	
INVESTOR AB-B SHS	15,600	595.000	9,282,000.000	
ATLAS COPCO AB-A SHS	22,950	439.700	10,091,115.000	
SECURITAS AB-B SHS	10,950	142.900	1,564,755.000	
TELIA CO AB	86,200	36.820	3,173,884.000	
ALFA LAVAL AB	11,000	222.300	2,445,300.000	
ATLAS COPCO AB-B SHS	13,250	382.000	5,061,500.000	
ASSA ABLOY AB-B	34,150	206.800	7,062,220.000	
LUNDBERGS AB-B SHS	2,600	448.200	1,165,320.000	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	5,200	220.000	1,144,000.000	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	10,400	239.100	2,486,640.000	
LUNDIN ENERGY AB	6,350	215.000	1,365,250.000	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	21,200	273.700	5,802,440.000	
BOLIDEN AB	9,300	299.000	2,780,700.000	
EPIROC AB-A	22,250	144.550	3,216,237.500	
EPIROC AB-B	13,500	137.450	1,855,575.000	
HUSQVARNA AB-B SHS	14,150	91.340	1,292,461.000	
NORDEA BANK ABP	111,100	74.530	8,280,283.000	
EQT AB	8,100	191.050	1,547,505.000	
EVOLUTION GAMING GROUP	4,400	690.200	3,036,880.000	
KINNEVIK AB - B	8,300	409.700	3,400,510.000	
HEXAGON AB-B SHS	9,900	712.600	7,054,740.000	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,700	264.200	1,505,940.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 149,959,130.000 (1,832,500,569)	
デンマーク・クローネ	株	デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
NOVO NORDISK A/S-B	59,500	419.250	24,945,375.000	
DANSKE BANK A/S	22,700	104.000	2,360,800.000	
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	105	11,520.000	1,209,600.000	
H LUNDBECK A/S	2,300	193.950	446,085.000	

	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	6,800	1,234.000	8,391,200.000	
	GN STORE NORD A/S	4,300	501.400	2,156,020.000	
	CARLSBERG AS-B	3,650	939.800	3,430,270.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	7,250	359.300	2,604,925.000	
	COLOPLAST-B	4,050	929.800	3,765,690.000	
	DSV PANALPINA A/S	7,160	1,020.500	7,306,780.000	
	DEMANT A/S	3,425	218.700	749,047.500	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	220	12,415.000	2,731,300.000	
	TRYG A/S	4,000	181.100	724,400.000	
	PANDORA A/S	3,500	649.200	2,272,200.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	3,450	609.800	2,103,810.000	
	GENMAB A/S	2,290	2,319.000	5,310,510.000	
	ORSTED A/S	6,600	1,126.500	7,434,900.000	
	AMBU A/S-B	5,600	201.500	1,128,400.000	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 79,071,312.500 (1,321,281,632)	
ニュージーランド・ドル		株	ニュージーランド・ドル	ニュージーランド・ドル	
	MERIDIAN ENERGY LTD	41,500	6.180	256,470.000	
	MERCURY NZ LTD	23,000	6.000	138,000.000	
	A2 MILK CO LTD	26,200	14.670	384,354.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	62,089	4.650	288,713.850	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	38,900	7.655	297,779.500	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	20,400	33.950	692,580.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	14,000	15.000	210,000.000	
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 2,267,897.350 (165,805,975)	
ノルウェー・クローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	NORSK HYDRO ASA	41,700	36.480	1,521,216.000	
	DNB ASA	33,100	163.550	5,413,505.000	
	ORKLA ASA	24,450	86.040	2,103,678.000	
	TELENOR ASA	25,400	153.400	3,896,360.000	
	EQUINOR ASA	33,823	146.850	4,966,907.550	
	YARA INTERNATIONAL ASA	5,710	364.000	2,078,440.000	
	MOWI ASA	14,100	183.150	2,582,415.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,350	192.000	1,411,200.000	

	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,100	342.000	1,060,200.000	
	ADEVINTA ASA	8,100	144.900	1,173,690.000	
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 26,207,611.550 (308,201,512)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	BAYER AG-REG	32,270	49.510	1,597,687.700	
	EVONIK INDUSTRIES AG	6,500	25.140	163,410.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	63,950	9.484	606,501.800	
	COMMERZBANK AG	32,935	5.392	177,585.520	
	VOLKSWAGEN AG	1,010	160.900	162,509.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	6,120	145.920	893,030.400	
	SIEMENS AG-REG	25,050	112.680	2,822,634.000	
	E.ON SE	74,200	9.140	678,188.000	
	UNIPER SE	6,650	28.260	187,929.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	11,000	73.090	803,990.000	
	GEA GROUP AG	5,050	28.800	145,440.000	
	CONTINENTAL AG	3,590	116.950	419,850.500	
	BASF SE	30,120	60.920	1,834,910.400	
	ALLIANZ SE-REG	13,470	198.140	2,668,945.800	
	THYSSENKRUPP AG	11,450	5.564	63,707.800	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	5,800	89.860	521,188.000	
	RWE AG	21,200	34.870	739,244.000	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,650	10.070	97,175.500	
	FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	1,180	46.940	55,389.200	
	BRENNTAG AG	5,000	63.860	319,300.000	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	13,550	38.070	515,848.500	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,320	33.520	111,286.400	
	HOCHTIEF AG	710	80.850	57,403.500	
	SAP SE	34,192	100.140	3,423,986.880	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	4,610	235.800	1,087,038.000	
	ZALANDO SE	4,950	80.460	398,277.000	
	HEIDELBERGCEMENT AG	4,900	60.500	296,450.000	
	KION GROUP AG	2,100	70.100	147,210.000	
	COVESTRO AG	5,600	47.450	265,720.000	
	SARTORIUS AG-VORZUG	1,210	364.000	440,440.000	
	PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	5,000	55.000	275,000.000	

DELIVERY HERO SE	4,150	99.000	410,850.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,250	111.500	139,375.000	
METRO AG	5,000	7.860	39,300.000	
NEMETSCHKE SE	2,000	65.050	130,100.000	
SCOUT24 AG	3,600	63.050	226,980.000	
AROUNDTOWN SA	37,000	6.000	222,000.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	8,600	38.340	329,724.000	
KNORR-BREMSE AG	2,300	107.680	247,664.000	
TEAMVIEWER AG	4,450	39.560	176,042.000	
SIEMENS ENERGY AG	13,125	24.920	327,075.000	
KION GROUP AG-RTS	2,100	0.000	0.000	
BEIERSDORF AG	3,290	94.900	312,221.000	
FUCHS PETROLUB SE-PREF	2,350	48.260	113,411.000	
MERCK KGAA	4,250	133.400	566,950.000	
ADIDAS AG	6,170	271.200	1,673,304.000	
PUMA SE	2,710	82.120	222,545.200	
HENKEL AG & CO KGAA	3,400	80.150	272,510.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	109,250	15.155	1,655,683.750	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	6,920	70.820	490,074.400	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	28,100	56.590	1,590,179.000	
QIAGEN N.V.	7,298	40.670	296,809.660	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	41,300	29.605	1,222,686.500	
HANNOVER RUECK SE	2,000	139.100	278,200.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	32,400	40.580	1,314,792.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	6,260	137.050	857,933.000	
LANXESS AG	2,500	59.480	148,700.000	
MTU AERO ENGINES AG	1,710	204.400	349,524.000	
DEUTSCHE WOHNEN SE	11,000	41.000	451,000.000	
SYMRISE AG	4,220	105.350	444,577.000	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	33,800	2.394	80,917.200	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	1,950	55.500	108,225.000	
VONOVIA SE	17,050	56.560	964,348.000	
LEG IMMOBILIEN AG	2,300	118.000	271,400.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	30,210	43.230	1,305,978.300	
NN GROUP NV	9,050	34.420	311,501.000	
ARCELORMITTAL	23,300	15.294	356,350.200	

HEINEKEN NV	8,550	89.240	763,002.000	
AEGON NV	58,244	3.058	178,110.150	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZEN	36,233	23.810	862,707.730	
AKZO NOBEL N.V.	6,538	89.640	586,066.320	
KONINKLIJKE DSM NV	5,700	137.000	780,900.000	
WOLTERS KLUWER	8,900	69.760	620,864.000	
ING GROEP NV	126,250	8.416	1,062,520.000	
KONINKLIJKE KPN NV	114,650	2.538	290,981.700	
ASML HOLDING NV	13,930	366.350	5,103,255.500	
ABN AMRO BANK NV-CVA	13,050	9.498	123,948.900	
GALAPAGOS NV	1,390	105.100	146,089.000	
ADYEN NV	600	1,616.000	969,600.000	
UNILEVER NV	47,950	50.260	2,409,967.000	
JUST EAT TAKEAWAY	4,000	88.180	352,720.000	
PROSUS NV	16,100	93.240	1,501,164.000	
VOPAK	2,300	45.740	105,202.000	
RANDSTAD NV	3,700	51.420	190,254.000	
HEINEKEN HOLDING NV	3,750	78.300	293,625.000	
ALTICE EUROPE NV	20,500	4.500	92,250.000	
JCDECAUX SA	2,700	17.890	48,303.000	
TOTAL SE	81,050	37.700	3,055,585.000	
MICHELIN (CGDE)	5,700	108.250	617,025.000	
AIR LIQUIDE SA	15,577	138.100	2,151,183.700	
KERING	2,500	606.200	1,515,500.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	18,200	117.450	2,137,590.000	
BOUYGUES SA	7,400	33.780	249,972.000	
BNP PARIBAS	36,450	43.825	1,597,421.250	
PEUGEOT SA	19,150	19.990	382,808.500	
NATIXIS	29,550	2.657	78,514.350	
THALES SA	3,500	79.860	279,510.000	
DANONE	20,000	52.780	1,055,600.000	
CARREFOUR SA	19,800	13.750	272,250.000	
SUEZ	11,225	16.175	181,564.370	
VIVENDI	26,891	25.390	682,762.490	
L'OREAL	8,230	309.300	2,545,539.000	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	16,850	40.300	679,055.000	
LEGRAND SA	8,817	71.420	629,710.140	
PERNOD RICARD SA	6,937	159.700	1,107,838.900	

EURAZEO SE	1,254	52.000	65,208.000	
SOCIETE GENERALE SA	26,950	17.328	466,989.600	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	9,100	496.000	4,513,600.000	
ACCOR SA	6,150	30.240	185,976.000	
CAPGEMINI SE	5,320	119.750	637,070.000	
VALEO SA	7,700	33.520	258,104.000	
PUBLICIS GROUPE	7,050	38.460	271,143.000	
BUREAU VERITAS SA	9,700	21.540	208,938.000	
EIFFAGE	2,740	84.180	230,653.200	
SODEXO SA	2,700	73.200	197,640.000	
IPSEN	1,150	80.000	92,000.000	
ORPEA	1,800	104.850	188,730.000	
AMUNDI SA	1,950	67.850	132,307.500	
TELEPERFORMANCE	1,920	275.000	528,000.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,000	78.900	236,700.000	
FAURECIA	2,250	42.720	96,120.000	
EUROFINS SCIENTIFIC	4,400	67.510	297,044.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	900	293.600	264,240.000	
SEB SA	650	149.500	97,175.000	
ESSILORLUXOTTICA	9,250	120.950	1,118,787.500	
DASSAULT AVIATION SA	100	895.000	89,500.000	
WORLDLINE SA	7,814	78.260	611,523.640	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,000	35.160	105,480.000	
AXA SA	63,850	19.732	1,259,888.200	
EDENRED	7,950	48.670	386,926.500	
RENAULT SA	5,800	34.115	197,867.000	
HERMES INTERNATIONAL	1,020	823.400	839,868.000	
STMICROELECTRONICS NV	21,050	33.210	699,070.500	
REMY COINTREAU	750	149.400	112,050.000	
ATOS SE	3,200	76.360	244,352.000	
DASSAULT SYSTEMES SE	4,360	155.300	677,108.000	
WENDEL	780	93.800	73,164.000	
ORANGE	65,900	10.690	704,471.000	
ALSTOM	6,300	45.190	284,697.000	
CNP ASSURANCES	4,850	13.480	65,378.000	
SANOFI	37,075	85.210	3,159,160.750	
VINCI SA	17,000	87.980	1,495,660.000	
AIRBUS SE	19,400	90.000	1,746,000.000	

VEOLIA ENVIRONNEMENT	17,500	19.795	346,412.500	
CREDIT AGRICOLE SA	37,600	9.864	370,886.400	
BIOMERIEUX	1,340	119.300	159,862.000	
ENGIE	60,223	12.520	753,991.960	
EDF	20,250	12.990	263,047.500	
SES	11,000	7.900	86,900.000	
SAFRAN SA	10,420	123.000	1,281,660.000	
ILIAD SA	490	173.600	85,064.000	
ARKEMA	2,220	97.480	216,405.600	
ADP	910	108.500	98,735.000	
SCOR SE	4,950	29.020	143,649.000	
GETLINK SE	14,200	14.230	202,066.000	
BOLLORE	28,600	3.256	93,121.600	
UCB SA	4,130	90.540	373,930.200	
KBC GROUP NV	8,250	59.680	492,360.000	
COLRUYT SA	1,600	49.180	78,688.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,600	82.920	298,512.000	
SOLVAY SA	2,450	96.500	236,425.000	
UMICORE	6,350	38.310	243,268.500	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	24,900	57.250	1,425,525.000	
AGEAS	5,790	41.850	242,311.500	
PROXIMUS	4,950	17.995	89,075.250	
TELENET GROUP HOLDING NV	1,450	35.060	50,837.000	
ELIA GROUP SA/NV	1,050	95.500	100,275.000	
SOFINA	550	263.000	144,650.000	
ARGENX SE	1,450	235.000	340,750.000	
PRYSMIAN SPA	7,850	26.900	211,165.000	
ASSICURAZIONI GENERALI	37,243	14.470	538,906.210	
MEDIOBANCA SPA	18,865	7.730	145,826.450	
TENARIS SA	13,300	6.704	89,163.200	
UNICREDIT SPA	69,656	9.094	633,451.660	
TELECOM ITALIA SPA	262,982	0.401	105,508.370	
TELECOM ITALIA-RSP	171,950	0.428	73,714.960	
INTESA SANPAOLO	550,737	1.944	1,070,963.170	
ATLANTIA SPA	17,257	15.270	263,514.390	
POSTE ITALIANE SPA	16,000	8.800	140,800.000	
MONCLER SPA	6,300	41.010	258,363.000	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	3,450	45.310	156,319.500	
ENI SPA	84,100	8.582	721,746.200	

DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	19,500	9.554	186,303.000	
PIRELLI & C SPA	11,000	4.345	47,795.000	
DIASORIN SPA	850	172.800	146,880.000	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	8,300	10.740	89,142.000	
NEXI SPA	12,050	15.890	191,474.500	
LEONARDO SPA	13,175	5.986	78,865.550	
ENEL SPA	267,134	8.502	2,271,173.260	
SNAM SPA	66,600	4.701	313,086.600	
TERNA SPA	46,300	6.332	293,171.600	
EXOR NV	3,530	58.720	207,281.600	
CNH INDUSTRIAL NV	32,800	9.194	301,563.200	
FINECOBANK SPA	19,700	13.115	258,365.500	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	36,000	13.226	476,136.000	
FERRARI NV	4,145	178.550	740,089.750	
TELEFONICA SA	157,227	3.736	587,400.070	
ENDESA SA	10,350	24.290	251,401.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	220,512	3.958	872,786.490	
IBERDROLA SA	194,434	11.470	2,230,157.980	
BANKINTER SA	21,500	4.174	89,741.000	
REPSOL SA	49,400	8.486	419,208.400	
GRIFOLS SA	9,800	24.430	239,414.000	
BANCO SANTANDER SA	547,750	2.465	1,350,203.750	
AMADEUS IT GROUP SA	14,600	60.340	880,964.000	
NATURGY ENERGY GROUP SA	9,400	19.910	187,154.000	
MAPFRE SA	30,650	1.579	48,396.350	
CAIXABANK SA	117,500	2.203	258,852.500	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,876	26.820	238,054.320	
AENA SME SA	2,250	143.800	323,550.000	
CELLNEX TELECOM SA	10,455	51.440	537,805.200	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	36,000	28.280	1,018,080.000	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	7,700	28.860	222,222.000	
ENAGAS SA	7,950	20.780	165,201.000	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	13,900	17.130	238,107.000	
FERROVIAL SA	16,270	23.610	384,134.700	

	UPM-KYMMENE OYJ	17,550	28.300	496,665.000	
	NOKIA OYJ	186,400	3.418	637,115.200	
	WARTSILA OYJ ABP	14,700	8.052	118,364.400	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	18,850	14.505	273,419.250	
	ELISA OYJ	4,600	45.420	208,932.000	
	SAMPO OYJ-A SHS	15,300	36.030	551,259.000	
	FORTUM OYJ	13,850	19.285	267,097.250	
	KONE OYJ-B	11,250	69.620	783,225.000	
	NESTE OYJ	13,900	57.500	799,250.000	
	ORION OYJ-CLASS B	3,200	39.990	127,968.000	
	VERBUND AG	2,000	59.000	118,000.000	
	OMV AG	4,450	29.520	131,364.000	
	ERSTE GROUP BANK AG	9,450	24.980	236,061.000	
	VOESTALPINE AG	4,250	26.930	114,452.500	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	4,400	16.760	73,744.000	
	ANDRITZ AG	2,100	34.940	73,374.000	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	7,550	35.580	268,629.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	5,000	72.000	360,000.000	
	JERONIMO MARTINS	7,700	14.170	109,109.000	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	88,300	4.600	406,180.000	
	GALP ENERGIA SGPS SA	15,050	9.558	143,847.900	
	KERRY GROUP PLC-A	5,150	116.400	599,460.000	
	CRH PLC	25,350	34.150	865,702.500	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	4,960	154.000	763,840.000	
	ユーロ 小計			ユーロ 135,724,829.440 (16,881,454,286)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	47,500	41.200	1,957,000.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	77,000	61.750	4,754,750.000	
	MTR CORP	52,500	42.850	2,249,625.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	44,500	105.300	4,685,850.000	
	SINO LAND CO	104,000	10.500	1,092,000.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	95,669	57.500	5,500,967.500	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	15,500	46.500	720,750.000	
	CLP HOLDINGS LTD	56,000	73.000	4,088,000.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	48,507	32.300	1,566,776.100	

HONG KONG & CHINA GAS	377,358	12.100	4,566,031.800	
HANG SENG BANK LTD	26,100	137.600	3,591,360.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	52,500	41.400	2,173,500.000	
WH GROUP LTD	321,000	6.560	2,105,760.000	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	41,900	386.200	16,181,780.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	66,000	20.050	1,323,300.000	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	10,800	92.900	1,003,320.000	
KERRY PROPERTIES LTD	22,500	20.000	450,000.000	
BANK OF EAST ASIA LTD	45,240	16.440	743,745.600	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	26,000	34.700	902,200.000	
SJM HOLDINGS LTD	58,000	9.110	528,380.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	38,200	23.550	899,610.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	91,169	43.750	3,988,643.750	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	20,000	40.050	801,000.000	
PCCW LTD	147,000	4.670	686,490.000	
AIA GROUP LTD	419,400	88.500	37,116,900.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	57,000	37.650	2,146,050.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	60,900	27.750	1,689,975.000	
SANDS CHINA LTD	82,400	33.100	2,727,440.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	47,000	101.200	4,756,400.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	125,500	25.200	3,162,600.000	
WYNN MACAU LTD	54,000	13.720	740,880.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 118,901,084.750 (1,593,274,536)	
合計			151,364,986,629 [151,364,986,629]	

(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	スイス・フラン			スイス・フラン	
		CIF -CW	34,320.000	7,550.400	
	スイス・フラン 小計			スイス・フラン 7,550.400 (868,069)	

新株予約権証券 合計			868,069	
			[868,069]	
投資証券	アメリカ・ドル		アメリカ・ドル	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,587	770,019.690	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	10,137	867,220.350	
	BOSTON PROPERTIES INC	4,950	507,028.500	
	VORNADO REALTY TRUST	5,397	217,661.010	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	3,650	1,042,914.500	
	EQUITY RESIDENTIAL	12,350	731,120.000	
	EQUINIX INC	2,918	2,044,117.360	
	AMERICAN TOWER CORP	14,500	3,394,305.000	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	22,243	325,192.660	
	INVITATION HOMES INC	17,700	509,052.000	
	VICI PROPERTIES INC	15,400	395,472.000	
	VENTAS INC	12,200	584,380.000	
	WEYERHAEUSER CO	24,114	692,312.940	
	AGNC INVESTMENT CORP	18,100	281,817.000	
	CROWN CASTLE INTL CORP	13,750	2,298,587.500	
	IRON MOUNTAIN INC	9,710	258,480.200	
	VEREIT INC	33,500	245,890.000	
	SUN COMMUNITIES INC	3,250	450,482.500	
	PROLOGIS INC	24,402	2,454,841.200	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4,120	668,016.800	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	3,200	312,768.000	
	DUKE REALTY CORP	12,150	466,438.500	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,170	542,521.700	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,360	208,553.200	
	WELLTOWER INC	13,850	893,879.000	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	17,650	527,382.000	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,750	465,000.000	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	5,800	340,518.000	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	45,100	368,016.000	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	5,350	205,386.500	
	REALTY INCOME CORP	11,200	690,368.000	
	PUBLIC STORAGE	5,220	1,148,556.600	
	REGENCY CENTERS CORP	5,300	248,517.000	
	UDR INC	9,750	382,395.000	
	WP CAREY INC	5,800	405,362.000	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	7,600	272,460.000	

	DIGITAL REALTY TRUST INC	8,900	1,216,897.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	4,250	467,500.000	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	17,250	337,582.500	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 28,239,012.210 (2,933,750,978)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	21,662	144,073.960	
	SEGREO PLC	38,450	346,588.300	
	BRITISH LAND CO PLC	29,550	138,914.550	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 629,576.810 (87,227,867)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	LENLEASE GROUP	21,500	305,300.000	
	TRANSURBAN GROUP	89,500	1,267,320.000	
	SYDNEY AIRPORT	42,500	285,600.000	
	APA GROUP	38,100	402,717.000	
	SCENTRE GROUP	159,922	460,575.360	
	DEXUS	33,150	325,533.000	
	GPT GROUP	63,160	299,378.400	
	MIRVAC GROUP	126,100	329,121.000	
	STOCKLAND	78,000	360,360.000	
	GOODMAN GROUP	52,900	984,469.000	
	VICINITY CENTRES	123,273	205,865.910	
オーストラリア・ドル	小計		オーストラリア・ドル 5,226,239.670 (401,950,093)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	4,800	74,880.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2,100	50,925.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,400	123,216.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4,700	85,399.000	
カナダ・ドル	小計		カナダ・ドル 334,420.000 (26,736,879)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	

	ASCENDAS REAL ESTATE IN-RTS	3,737	0.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	101,000	305,020.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	158,032	314,483.680	
	SUNTEC REIT	63,000	96,390.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	91,800	179,928.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	65,500	135,585.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 1,031,406.680 (80,129,985)	
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,200	265,272.000	ユーロ
	ICADE	950	56,905.000	
	GECINA SA	1,400	177,940.000	
	KLEPIERRE	6,250	121,125.000	
	COVIVIO	1,500	108,000.000	
ユーロ 小計			ユーロ 729,242.000 (90,703,120)	
香港・ドル	LINK REIT	70,500	4,829,250.000	香港・ドル
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	92,000	716,680.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	122,000	1,263,920.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 6,809,850.000 (91,251,990)	
投資証券 合計			3,711,750,912 [3,711,750,912]	
合計			3,712,618,981 [3,712,618,981]	

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 591銘柄 投資証券 39銘柄	97.4%	-%	2.6%	71.7%

イギリス・ポンド	株式	83銘柄	98.7%	-	1.3%	4.5%
	投資証券	3銘柄				
イスラエル・シケル	株式	8銘柄	100%	-	-	0.1%
オーストラリア・ドル	株式	53銘柄	88.7%	-	11.3%	2.3%
	投資証券	11銘柄				
カナダ・ドル	株式	82銘柄	99.5%	-	0.5%	3.4%
	投資証券	4銘柄				
シンガポール・ドル	株式	16銘柄	86.6%	-	13.4%	0.4%
	投資証券	6銘柄				
スイス・フラン	株式	39銘柄	100%	0.0%	-	3.2%
	新株予約	1銘柄				
	権証券					
スウェーデン・クローナ	株式	36銘柄	100%	-	-	1.2%
デンマーク・クローネ	株式	18銘柄	100%	-	-	0.9%
ニュージーランド・ドル	株式	7銘柄	100%	-	-	0.1%
ノルウェー・クローネ	株式	10銘柄	100%	-	-	0.2%
ユーロ	株式	240銘柄	99.5%	-	0.5%	10.9%
	投資証券	5銘柄				
香港・ドル	株式	31銘柄	94.6%	-	5.4%	1.1%
	投資証券	3銘柄				

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

「ダイワ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

	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	46,071,542	94,440,539
コール・ローン	35,988,024	84,736,581
株式	7,638,071,305	10,885,466,209
投資証券	516,963,253	370,527,886

派生商品評価勘定	1,395,130	30,470,879
未収入金	-	158,585
未収配当金	5,282,299	4,962,173
差入委託証拠金	24,985,862	120,253,166
流動資産合計	8,268,757,415	11,591,016,018
資産合計	8,268,757,415	11,591,016,018
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	410,784	136,357
未払解約金	4,530,000	22,960,464
その他未払費用	22	-
流動負債合計	4,940,806	23,096,821
負債合計	4,940,806	23,096,821
純資産の部		
元本等		
元本	1	5,229,878,945
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,033,937,664
元本等合計		8,263,816,609
純資産合計		8,263,816,609
負債純資産合計		8,268,757,415
		11,591,016,018

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

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

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1. 1 期首	2018年12月1日	2019年12月3日
期首元本額	3,983,740,010円	5,229,878,945円
期中追加設定元本額	1,604,258,721円	2,845,361,975円
期中一部解約元本額	358,119,786円	474,678,589円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
新興国株式インデックスファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	12,116,644円	24,807,196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）	224,767,012円	268,661,195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）	224,901,804円	331,827,564円
D - I ' s 新興国株式インデックス	105,608,121円	124,780,786円
i F r e e 新興国株式インデックス	1,877,009,457円	2,774,751,964円
i F r e e 8 資産バランス	1,391,517,281円	2,062,394,720円
新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド（為替ヘッジなし / 適格機関投資家専用）	- 円	433,627,020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	950,189,602円	1,094,619,655円
ダイワ・インデックスセレク ト 新興国株式	375,541,562円	393,670,881円
ダイワ・ノーロード 新興国 株式ファンド	68,227,462円	91,421,350円
計	5,229,878,945円	7,600,562,331円
2. 期末日における受益権の総数	5,229,878,945口	7,600,562,331口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年12月3日 至 2020年11月30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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年11月30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	2019年12月2日現在	2020年11月30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	43,383,764	1,024,011,630
投資証券	12,369,553	39,343,894
合計	31,014,211	1,063,355,524

(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(2019年7月6日から2019年12月2日まで、及び2020年7月7日から2020年11月30日まで)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	2019年12月2日 現在				2020年11月30日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								

株価指数 先物取引								
買 建	95,786,286	-	96,770,664	984,378	303,239,326	-	333,590,789	30,351,463
合計	95,786,286	-	96,770,664	984,378	303,239,326	-	333,590,789	30,351,463

(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	2019年12月2日 現在				2020年11月30日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売 建	7,923	-	7,923	0	413,383	-	412,587	796
チリ・ペソ	7,923	-	7,923	0	-	-	-	-
メキシコ・ペ ソ	-	-	-	-	413,383	-	412,587	796
買 建	7,923	-	7,891	32	84,564,346	-	84,546,609	17,737
アメリカ・ドル	7,923	-	7,891	32	84,564,346	-	84,546,609	17,737
合計	15,846	-	15,814	32	84,977,729	-	84,959,196	16,941

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5801円 (15,801円)	1.5220円 (15,220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		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF	33,700	5.200	175,240.000	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	8,500	276.480	2,350,080.000	
	BAIDU INC - SPON ADR	5,700	139.420	794,694.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	10,100	26.000	262,600.000	
	CANADIAN SOLAR INC	3,600	44.170	159,012.000	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	3,000	29.510	88,530.000	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	19,950	8.580	171,171.000	
	JD.COM INC-ADR	10,700	89.410	956,687.000	
	NETEASE INC-ADR	3,000	93.340	280,020.000	
	TRIP.COM GROUP LTD-ADR	7,000	34.210	239,470.000	
	VTB BANK JSC -GDR-REG S	238,298	0.964	229,838.420	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	6,760	26.080	176,300.800	
TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	6,550	40.500	265,275.000		

	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	47,900	4.794	229,632.600	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	12,310	28.530	351,204.300	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	26,670	15.030	400,850.100	
	RUSHYDRO PJSC-ADR	83,995	0.986	82,819.070	
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	103,800	13.570	1,408,566.000	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,620	163.000	264,060.000	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	20,630	69.120	1,425,945.600	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	68,600	6.036	414,069.600	
	GAZPROM PJSC-SPON ADR	428,390	4.835	2,071,265.650	
	SEVERSTAL - GDR REG S	14,270	15.090	215,334.300	
	TATNEFT PJSC - PREF	16,010	6.345	101,592.990	
	SISTEMA PJSFC	426,500	0.407	173,733.490	
	ROSSETI PJSC	4,933,000	0.022	112,275.080	
	INTER RAO UES PJSC	1,577,000	0.068	108,699.450	
	ALROSA PJSC	133,260	1.193	159,088.580	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	57,629	2.018	116,349.080	
	AEROFLOT PJSC	78,050	0.949	74,105.740	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 13,858,509.850 (1,439,760,589)	
インド・ルピー	株		インド・ルピー	インド・ルピー	
	TATA STEEL LTD	22,340	577.350	12,897,999.000	
	AXIS BANK LTD	29,890	601.600	17,981,824.000	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,950	7,035.800	13,719,810.000	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	4,230	2,138.200	9,044,586.000	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	62,040	209.350	12,988,074.000	
	STATE BANK OF INDIA	70,070	244.250	17,114,597.500	
	NTPC LTD	124,500	94.700	11,790,150.000	
	POWER FINANCE CORPORATION	55,240	108.200	5,976,968.000	
	JSW STEEL LTD	45,520	350.200	15,941,104.000	
	INDIAN OIL CORP LTD	138,070	84.600	11,680,722.000	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	55,505	373.000	20,703,365.000	
	VODAFONE IDEA LTD	1,421,490	9.800	13,930,602.000	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	34,990	244.000	8,537,560.000	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	3,050	1,070.200	3,264,110.000	
	TECH MAHINDRA LTD	8,020	876.850	7,032,337.000	

	YES BANK LTD	17,640	14.700	259,308.000	
	TATA MOTORS LTD-A-DVR	61,120	78.150	4,776,528.000	
	REC LTD	53,060	121.450	6,444,137.000	
	COAL INDIA LTD	93,510	125.550	11,740,180.500	
	BHARTI INFRATEL LTD	28,880	218.600	6,313,168.000	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE L	29,840	187.050	5,581,572.000	
	GAIL INDIA LTD	57,166	102.650	5,868,089.900	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	70,200	226.350	15,889,770.000	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	15,280	875.750	13,381,460.000	
	WIPRO LTD	26,423	350.500	9,261,261.500	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	11,116	2,679.650	29,786,989.400	
	INFOSYS LTD	62,040	1,100.000	68,244,000.000	
	LARSEN & TOUBRO LTD	6,972	1,122.400	7,825,372.800	
	TATA MOTORS LTD	133,180	180.350	24,019,013.000	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	19,590	2,256.250	44,199,937.500	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	52,540	1,929.800	101,391,692.000	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	156,725	78.500	12,302,912.500	
	ITC LTD	58,990	193.650	11,423,413.500	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	22,250	722.000	16,064,500.000	
	HERO MOTOCORP LTD	3,110	3,108.850	9,668,523.500	
	BHARTI AIRTEL LTD	26,342	463.250	12,202,931.500	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	18,340	511.650	9,383,661.000	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	19,540	822.100	16,063,834.000	
	VEDANTA LTD	173,860	120.750	20,993,595.000	
	インド・ルピー 小計			インド・ルピー 645,689,659.100 (910,422,419)	
インドネシア・ ルピア		株	インドネシア・ルピア	インドネシア・ルピア	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	317,100	5,550.000	1,759,905,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	1,242,000	3,460.000	4,297,320,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	221,400	6,350.000	1,405,890,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	85,600	31,925.000	2,732,780,000.000	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	434,200	6,650.000	2,887,430,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,048,400	4,270.000	4,476,668,000.000	
	インドネシア・ルピア 小計			インドネシア・ルピア	

				17,559,993,000.000	
				(129,943,948)	
オフショア・人民元		株	オフショア・人民元	オフショア・人民元	
	INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	81,500	20.610	1,679,715.000	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	86,807	8.590	745,672.130	
	PING AN INSURANCE GROUP CO-A	16,700	90.100	1,504,670.000	
	IND & COMM BK OF CHINA-A	294,000	5.390	1,584,660.000	
	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	5,500	20.330	111,815.000	
	CHINA LIFE INSURANCE CO-A	9,400	42.800	402,320.000	
	GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	8,400	27.310	229,404.000	
	KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	700	1,737.900	1,216,530.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	7,100	55.500	394,050.000	
	SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	124,400	10.200	1,268,880.000	
	HUADIAN POWER INTL CORP-A	82,800	3.690	305,532.000	
	CITIC SECURITIES CO-A	14,600	29.980	437,708.000	
	CHINA MERCHANTS BANK-A	48,400	45.850	2,219,140.000	
	PING AN BANK CO LTD-A	45,500	19.700	896,350.000	
	GF SECURITIES CO LTD-A	9,800	16.930	165,914.000	
	CHINA STATE CONSTRUCTION -A	298,100	5.500	1,639,550.000	
	SAIC MOTOR CORP LTD-A	51,700	27.080	1,400,036.000	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	23,800	3.580	85,204.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	29,100	6.320	183,912.000	
	METALLURGICAL CORP OF CHINA-A	140,700	2.770	389,739.000	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	62,100	4.070	252,747.000	
	JIANGXI COPPER CO LTD-A	9,600	20.850	200,160.000	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	4,900	11.360	55,664.000	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-A	30,300	7.030	213,009.000	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	615,800	3.320	2,044,456.000	
	BANK OF CHINA LTD-A	332,100	3.330	1,105,893.000	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	241,300	4.280	1,032,764.000	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	227,300	4.750	1,079,675.000	

	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	33,200	19.300	640,760.000	
	CHINA VANKE CO LTD -A	24,800	31.610	783,928.000	
	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	18,600	38.480	715,728.000	
	CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	74,900	5.460	408,954.000	
	CHINA MINSHENG BANKING-A	199,100	5.350	1,065,185.000	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	182,900	4.500	823,050.000	
	CRRC CORP LTD-A	82,900	5.640	467,556.000	
	CHINA UNITED NETWORK-A	120,000	4.920	590,400.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD-A	9,000	19.300	173,700.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD-A	22,900	13.560	310,524.000	
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	26,800	7.840	210,112.000	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	111,800	6.320	706,576.000	
	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	3,500	62.020	217,070.000	
	HUAXIA BANK CO LTD-A	84,000	6.530	548,520.000	
	AIR CHINA LTD-A	14,800	7.860	116,328.000	
	BYD CO LTD -A	1,800	174.100	313,380.000	
	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	4,400	13.870	61,028.000	
	WEICHAI POWER CO LTD-A	9,800	17.350	170,030.000	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	25,900	8.950	231,805.000	
	HUANENG POWER INTL INC-A	66,500	5.160	343,140.000	
	オフショア・人民元 小計			オフショア・人民元 31,742,943.130 (501,855,931)	
サウジアラビア・リアル		株	サウジアラビア・リアル	サウジアラビア・リアル	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	28,123	96.500	2,713,869.500	
	SAUDI TELECOM CO	9,931	107.400	1,066,589.400	
	AL RAJHI BANK	22,918	74.000	1,695,932.000	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	17,908	30.600	547,984.800	
	RIYAD BANK	20,666	20.620	426,132.920	
	ETIHAD ETISALAT CO	14,210	29.950	425,589.500	
	SAVOLA	10,062	45.150	454,299.300	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	7,707	60.500	466,273.500	
	ALINMA BANK	22,704	16.240	368,712.960	
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	17,348	42.650	739,892.200	

	SAUDI ARABIAN OIL CO	13,920	35.750	497,640.000	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	40,017	12.100	484,205.700	
サウジアラビア・リアル 小計				サウジアラビア・リアル 9,887,121.780 (274,268,757)	
シンガポール・ ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	121,700	0.920	111,964.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 111,964.000 (8,698,483)	
タイ・パーツ		株	タイ・パーツ	タイ・パーツ	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	27,600	123.000	3,394,800.000	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	40,400	377.000	15,230,800.000	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	28,100	114.000	3,203,400.000	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	20,900	113.500	2,372,150.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	142,400	89.250	12,709,200.000	
	THANACHART CAPITAL PCL-NVDR	37,200	35.250	1,311,300.000	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	101,800	30.250	3,079,450.000	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	29,300	179.500	5,259,350.000	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	347,000	11.200	3,886,400.000	
	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	445,500	8.750	3,898,125.000	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	52,700	100.500	5,296,350.000	
	IRPC PCL - NVDR	1,166,100	2.820	3,288,402.000	
	PTT PCL-NVDR	775,900	41.750	32,393,825.000	
	THAI OIL PCL-NVDR	82,200	49.750	4,089,450.000	
	CP ALL PCL-NVDR	87,800	61.750	5,421,650.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	171,500	29.250	5,016,375.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL- NVDR	165,800	59.000	9,782,200.000	
タイ・パーツ 小計				タイ・パーツ 119,633,227.000 (410,341,968)	
チリ・ペソ		株	チリ・ペソ	チリ・ペソ	
	ENEL CHILE SA	987,867	55.500	54,826,618.500	
	BANCO SANTANDER CHILE	3,130,380	33.490	104,836,426.200	
	ENEL AMERICAS SA	1,107,863	115.300	127,736,603.900	
	FALABELLA SA	34,300	2,740.000	93,982,000.000	

	BANCO DE CHILE	1,637,092	67.880	111,125,804.960	
チリ・ペソ 小計				チリ・ペソ 492,507,453.560 (66,685,509)	
トルコ・リラ		株	トルコ・リラ	トルコ・リラ	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	143,820	9.180	1,320,267.600	
	AKBANK T.A.S.	181,672	6.380	1,159,067.360	
	TURKIYE IS BANKASI-C	160,500	6.800	1,091,400.000	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	87,760	15.720	1,379,587.200	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	12,590	94.150	1,185,348.500	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	117,881	11.810	1,392,174.610	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	115,490	9.990	1,153,745.100	
	TURKIYE HALK BANKASI	162,330	5.420	879,828.600	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T- D	134,820	4.760	641,743.200	
	KOC HOLDING AS	50,915	18.680	951,092.200	
	TURK HAVA YOLLARI AO	66,080	11.930	788,334.400	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	11,840	69.850	827,024.000	
トルコ・リラ 小計				トルコ・リラ 12,769,612.770 (169,197,369)	
ブラジル・リアル		株	ブラジル・リアル	ブラジル・リアル	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	600	64.730	38,838.000	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	14,600	6.820	99,572.000	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	5,300	81.010	429,353.000	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	36,500	21.140	771,610.000	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	9,500	69.450	659,775.000	
	TIM SA	28,626	14.100	403,626.600	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS- PR	170,300	25.500	4,342,650.000	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	185,826	24.640	4,578,752.640	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S- PREF	242,636	28.960	7,026,738.560	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	33,100	24.010	794,731.000	
	VALE SA	135,590	78.440	10,635,679.600	
	GERDAU SA-PREF	47,900	22.760	1,090,204.000	

PETROBRAS - PETROLEO BRAS	110,700	25.900	2,867,130.000	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	50,804	12.450	632,509.800	
BRASKEM SA-PREF A	18,500	23.440	433,640.000	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	8,200	33.180	272,076.000	
BANCO DO BRASIL S.A.	60,700	34.610	2,100,827.000	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	14,700	32.170	472,899.000	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	3,300	67.880	224,004.000	
EMBRAER SA	37,700	8.250	311,025.000	
METALURGICA GERDAU SA-PREF	99,900	10.340	1,032,966.000	
CCR SA	34,400	12.920	444,448.000	
BRF SA	25,800	21.890	564,762.000	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	9,200	45.400	417,680.000	
LOJAS RENNEN S.A.	7,205	46.350	333,951.750	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	12,884	23.640	304,577.760	
JBS SA	57,800	23.070	1,333,446.000	
SUZANO SA	11,345	55.530	629,987.850	
MARFRIG GLOBAL FOODS SA	26,700	14.980	399,966.000	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	17,600	56.900	1,001,440.000	
CIELO SA	99,728	3.760	374,977.280	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	12,600	22.140	278,964.000	
CIA ENERGETICA DE MINAS GER	3,331	14.100	46,967.100	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	17,500	40.420	707,350.000	
TELEFONICA BRASIL S.A.	20,600	44.090	908,254.000	
KLABIN SA - UNIT	19,100	24.830	474,253.000	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	74,300	20.400	1,515,720.000	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	24,100	26.120	629,492.000	
LOJAS AMERICANAS SA	2,293	19.250	44,140.250	
COGNA EDUCACAO	69,800	4.890	341,322.000	
BANCO BRADESCO S.A.	53,941	22.020	1,187,780.820	
AMBEV SA	115,800	14.320	1,658,256.000	
ブラジル・リアル 小計			ブラジル・リアル 52,816,343.010 (1,027,806,034)	
マレーシア・リングット		株	マレーシア・リングット マレーシア・リングット	

	MISC BHD	54,900	7.100	389,790.000	
	MALAYAN BANKING BHD	92,500	8.290	766,825.000	
	PUBLIC BANK BERHAD	44,900	18.600	835,140.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	100,100	3.830	383,383.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	41,700	10.720	447,024.000	
マレーシア・リングgit 小計				マレーシア・リングgit 2,822,162.000 (72,049,795)	
メキシコ・ペソ		株	メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	19,000	88.240	1,676,560.000	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	1,023,800	14.740	15,090,812.000	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	89,500	32.130	2,875,635.000	
	CEMEX SAB-CPO	1,318,719	9.310	12,277,273.890	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA- UBD	56,600	145.350	8,226,810.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	29,623	40.980	1,213,950.540	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	88,500	71.320	6,311,820.000	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	125,400	52.880	6,631,152.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	85,500	105.050	8,981,775.000	
メキシコ・ペソ 小計				メキシコ・ペソ 63,285,788.430 (328,453,242)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION- H	191,500	5.320	1,018,780.000	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	346,000	3.900	1,349,400.000	
	CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	40,000	9.740	389,600.000	
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	94,000	22.700	2,133,800.000	
	CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	145,000	4.370	633,650.000	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	88,000	12.160	1,070,080.000	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	198,000	3.040	601,920.000	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	27,000	27.900	753,300.000	

CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,275,800	3.770	8,579,766.000	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	15,500	25.800	399,900.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	138,000	8.230	1,135,740.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	132,000	4.200	554,400.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	18,500	35.850	663,225.000	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	125,500	11.060	1,388,030.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	23,900	583.000	13,933,700.000	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	906,000	2.430	2,201,580.000	
AIR CHINA LTD-H	86,000	6.350	546,100.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	434,000	4.800	2,083,200.000	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	62,500	28.800	1,800,000.000	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	212,000	3.960	839,520.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	70,000	8.280	579,600.000	
PETROCHINA CO LTD-H	1,654,000	2.630	4,350,020.000	
CNOOC LTD	773,000	9.450	7,304,850.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	114,000	6.760	770,640.000	
HUANENG POWER INTL INC-H	422,000	3.070	1,295,540.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	25,500	51.000	1,300,500.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	149,000	6.640	989,360.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	5,010,000	6.100	30,561,000.000	
CHINA MOBILE LTD	282,000	47.550	13,409,100.000	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	89,000	14.300	1,272,700.000	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	667,000	3.450	2,301,150.000	
GF SECURITIES CO LTD-H	43,800	11.320	495,816.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	40,400	12.500	505,000.000	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	19,000	55.500	1,054,500.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	334,000	4.400	1,469,600.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	114,000	4.840	551,760.000	
HUADIAN POWER INTL CORP-H	142,000	2.110	299,620.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	224,000	15.360	3,440,640.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	69,120	7.650	528,768.000	

SINOPHARM GROUP CO-H	68,000	19.640	1,335,520.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	90,000	34.150	3,073,500.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	31,000	37.900	1,174,900.000	
YANZHOU COAL MINING CO-H	128,000	6.690	856,320.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	82,500	7.590	626,175.000	
BYD CO LTD-H	12,000	186.900	2,242,800.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,944,000	2.990	5,812,560.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	25,900	33.800	875,420.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	277,000	2.530	700,810.000	
CITIC LTD	104,000	6.160	640,640.000	
IND & COMM BK OF CHINA-H	4,060,000	4.870	19,772,200.000	
CHINA TOWER CORP LTD-H	796,000	1.230	979,080.000	
XIAOMI CORP-CLASS B	120,200	26.050	3,131,210.000	
MEITUAN-CLASS B	14,000	312.000	4,368,000.000	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	56,000	12.940	724,640.000	
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	1,254	12.720	15,950.880	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	215,000	1.420	305,300.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	161,500	19.400	3,133,100.000	
CRRC CORP LTD - H	171,000	3.210	548,910.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	428,000	4.130	1,767,640.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	121,000	91.700	11,095,700.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	39,000	29.900	1,166,100.000	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	507,080	4.470	2,266,647.600	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	288,000	10.560	3,041,280.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	9,000	108.100	972,900.000	
CHINA RES LAND RTS	692	0.000	0.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	53,500	29.700	1,588,950.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	324,000	1.630	528,120.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	84,000	8.770	736,680.000	

SHENZHO INTERNATIONAL GROUP	6,800	135.400	920,720.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	250,000	6.580	1,645,000.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	145,000	16.080	2,331,600.000	
WEICHAH POWER CO LTD-H	63,000	17.240	1,086,120.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	350,000	2.840	994,000.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	80,800	30.300	2,448,240.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	46,900	13.220	620,018.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	159,000	18.500	2,941,500.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	12,000	103.600	1,243,200.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	82,000	10.560	865,920.000	
KUNLUN ENERGY CO LTD	196,000	6.160	1,207,360.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES -H	112,400	10.120	1,137,488.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	146,000	7.550	1,102,300.000	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	300,000	10.840	3,252,000.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	583,100	4.350	2,536,485.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	111,000	16.780	1,862,580.000	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	68,000	11.240	764,320.000	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,833,000	0.590	1,081,470.000	
CHINA MERCHANTS BANK-H	118,500	51.300	6,079,050.000	
BANK OF CHINA LTD-H	4,434,000	2.780	12,326,520.000	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	44,000	17.540	771,760.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	217,000	3.170	687,890.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	83,600	6.800	568,480.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	38,000	50.400	1,915,200.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 238,426,129.480 (3,194,910,135)	
台湾・ドル	株	台湾・ドル	台湾・ドル	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	24,000	127.000	3,048,000.000	
TAIWAN CEMENT	178,145	43.300	7,713,678.500	
ASIA CEMENT CORP	73,000	44.100	3,219,300.000	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	126,000	74.400	9,374,400.000	

THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	52,000	39.900	2,074,800.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	111,112	66.300	7,366,725.600	
FORMOSA PLASTICS CORP	64,600	87.200	5,633,120.000	
NAN YA PLASTICS CORP	64,140	65.600	4,207,584.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	61,390	79.000	4,849,810.000	
CHINA STEEL CORP	130,686	23.150	3,025,380.900	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	5,000	680.000	3,400,000.000	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	72,616	49.050	3,561,814.800	
DELTA ELECTRONICS INC	62,000	220.000	13,640,000.000	
YAGEO CORPORATION	8,000	436.000	3,488,000.000	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	43,000	52.100	2,240,300.000	
QUANTA COMPUTER INC	112,000	77.700	8,702,400.000	
AU OPTRONICS CORP	976,000	12.000	11,712,000.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	116,400	109.500	12,745,800.000	
MEDIATEK INC	36,003	725.000	26,102,175.000	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	31,000	194.500	6,029,500.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	152,411	45.650	6,957,562.150	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	210,838	41.350	8,718,151.300	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	300,000	8.740	2,622,000.000	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	205,505	25.450	5,230,102.250	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	182,381	19.300	3,519,953.300	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	219,993	29.100	6,401,796.300	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	184,747	13.350	2,466,372.450	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	511,334	8.690	4,443,492.460	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	227,000	11.350	2,576,450.000	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	337,028	19.750	6,656,303.000	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	155,747	21.400	3,332,985.800	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,000	3,330.000	3,330,000.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	14,000	304.000	4,256,000.000	
TAIWAN MOBILE CO LTD	42,000	99.200	4,166,400.000	
WISTRON CORP	168,110	30.950	5,203,004.500	
INNOLUX CORP	1,265,000	9.940	12,574,100.000	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	42,000	61.200	2,570,400.000	
PEGATRON CORP	84,000	66.500	5,586,000.000	

ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	19,000	122.000	2,318,000.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	31,471	160.500	5,051,095.500	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	27,400	91.000	2,493,400.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	39,000	94.500	3,685,500.000	
COMPAL ELECTRONICS	142,000	19.250	2,733,500.000	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	350,000	489.000	171,150,000.000	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	482,902	82.600	39,887,705.200	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	13,000	273.000	3,549,000.000	
ASUSTEK COMPUTER INC	16,760	251.500	4,215,140.000	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	95,000	27.700	2,631,500.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	601,000	39.150	23,529,150.000	
台湾・ドル 小計			台湾・ドル 493,989,853.010 (1,798,123,065)	
南アフリカ・ランド	株	南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
GOLD FIELDS LTD	20,720	130.050	2,694,636.000	
NEPI ROCKCASTLE PLC	7,821	80.540	629,903.340	
MULTICHOICE GROUP LTD	15,130	135.110	2,044,214.300	
OLD MUTUAL LTD	230,840	12.500	2,885,500.000	
VODACOM GROUP LTD	23,120	124.700	2,883,064.000	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	31,120	128.090	3,986,160.800	
NEDBANK GROUP LTD	18,400	129.690	2,386,296.000	
BIDVEST GROUP LTD	10,770	170.000	1,830,900.000	
BID CORP LTD	9,910	284.310	2,817,512.100	
NETCARE LTD	87,690	12.580	1,103,140.200	
STANDARD BANK GROUP LTD	48,220	127.290	6,137,923.800	
SASOL LTD	31,540	132.560	4,180,942.400	
REMGRO LTD	16,410	96.070	1,576,508.700	
DISCOVERY LTD	11,940	126.400	1,509,216.000	
EXXARO RESOURCES LTD	10,630	123.360	1,311,316.800	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	21,020	38.570	810,741.400	
SANLAM LTD	53,120	57.870	3,074,054.400	
TIGER BRANDS LTD	8,780	199.670	1,753,102.600	
FIRSTRAND LTD	118,530	47.370	5,614,766.100	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	47,860	36.320	1,738,275.200	

THE FOSCHINI GROUP LTD	12,640	101.000	1,276,640.000	
ABSA GROUP LTD	32,960	115.000	3,790,400.000	
NASPERS LTD-N SHS	2,329	3,164.110	7,369,212.190	
MTN GROUP LTD	48,590	69.130	3,359,026.700	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	8,730	165.210	1,442,283.300	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	18,580	126.670	2,353,528.600	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	6,950	319.500	2,220,525.000	
SAPPI LIMITED	56,180	29.000	1,629,220.000	
TELKOM SA SOC LTD	47,800	30.830	1,473,674.000	
SPAR GROUP LIMITED/THE	9,970	192.500	1,919,225.000	
MR PRICE GROUP LTD	9,000	168.000	1,512,000.000	
SIBANYE STILLWATER LTD	34,100	51.720	1,763,652.000	
南アフリカ・ランド 小計			南アフリカ・ランド 81,077,560.930 (552,948,965)	
合計			10,885,466,209 [10,885,466,209]	

(2) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	167,600	アメリカ・ドル 3,403,956.000	
	アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 3,403,956.000 (353,636,989)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	100,400	メキシコ・ペソ 1,999,968.000	
	メキシコ・ペソ 小計			メキシコ・ペソ 1,999,968.000 (10,379,834)	
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	76,930	南アフリカ・ランド 954,701.300	
	南アフリカ・ランド 小計			南アフリカ・ランド 954,701.300 (6,511,063)	
投資証券 合計				370,527,886 [370,527,886]	
合計				370,527,886	

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 30銘柄 投資証券 1銘柄	80.3%	19.7%	15.9%
インド・ルピー	株式 39銘柄	100%	-%	8.1%
インドネシア・ルピア	株式 6銘柄	100%	-%	1.2%
オフショア・人民元	株式 48銘柄	100%	-%	4.5%
サウジアラビア・リアル	株式 12銘柄	100%	-%	2.4%
シンガポール・ドル	株式 1銘柄	100%	-%	0.1%
タイ・バーツ	株式 17銘柄	100%	-%	3.6%
チリ・ペソ	株式 5銘柄	100%	-%	0.6%
トルコ・リラ	株式 12銘柄	100%	-%	1.5%
ブラジル・リアル	株式 42銘柄	100%	-%	9.1%
マレーシア・リングgit	株式 5銘柄	100%	-%	0.6%
メキシコ・ペソ	株式 9銘柄 投資証券 1銘柄	96.9%	3.1%	3.0%
香港・ドル	株式 92銘柄	100%	-%	28.4%
台湾・ドル	株式 49銘柄	100%	-%	16.0%
南アフリカ・ランド	株式 32銘柄 投資証券 1銘柄	98.8%	1.2%	5.0%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワファンドラップオンライン 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4期計算期間（2019年12月3日から2020年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 2019年12月2日現在	第4期 2020年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,343,283	5,048,214
親投資信託受益証券	2,133,023,236	2,400,061,917
未収入金	1,440,677	4,102,533
流動資産合計	2,137,807,196	2,409,212,664
資産合計	2,137,807,196	2,409,212,664
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,433,319	5,442,381
未払受託者報酬	117,079	126,560
未払委託者報酬	1,054,044	1,139,425
その他未払費用	59,176	63,209
流動負債合計	2,663,618	6,771,575
負債合計	2,663,618	6,771,575
純資産の部		
元本等		
元本	1 2,083,243,207	1 2,366,238,389
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	51,900,371	36,202,700
（分配準備積立金）	34,375,102	26,383,258
元本等合計	2,135,143,578	2,402,441,089
純資産合計	2,135,143,578	2,402,441,089
負債純資産合計	2,137,807,196	2,409,212,664

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第3期		第4期	
	自	2018年12月1日 至 2019年12月2日	自	2019年12月3日 至 2020年11月30日
営業収益				
受取利息		7		18
有価証券売買等損益		50,963,605		17,964,515
営業収益合計		50,963,612		17,964,497
営業費用				
支払利息		3,620		1,780
受託者報酬		234,066		247,070
委託者報酬		2,107,318		2,224,406
その他費用		117,798		123,430
営業費用合計		2,462,802		2,596,686
営業利益又は営業損失（ ）		48,500,810		20,561,183
経常利益又は経常損失（ ）		48,500,810		20,561,183
当期純利益又は当期純損失（ ）		48,500,810		20,561,183
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（ ）		16,164,749		1,971,258
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		5,410,368		51,900,371
剰余金増加額又は欠損金減少額		18,862,014		17,121,458
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		18,862,014		17,121,458
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,708,072		14,229,204
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,708,072		14,229,204
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		51,900,371		36,202,700

(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4期	
	自 2019年12月3日	至 2020年11月30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 2019年11月30日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2019年12月2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3期	第4期
	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1. 1 期首元本額	2,156,165,819円	2,083,243,207円
期中追加設定元本額	844,707,447円	862,550,219円
期中一部解約元本額	917,630,059円	579,555,037円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,083,243,207口	2,366,238,389口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第3期	第4期
	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（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（32,337,045円）、投資信託約款に規定される収益調整金（17,528,238円）及び分配準備積立金（2,038,057円）より分配対象額は51,903,340円（1万口当たり249.15円）であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（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（16,278,613円）及び分配準備積立金（26,383,258円）より分配対象額は42,661,871円（1万口当たり180.29円）であり、分配を行っておりません。</p>
------------	--	--

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	<p style="text-align: center;">第4期 自 2019年12月3日 至 2020年11月30日</p>
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第4期
	2020年11月30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3期	第4期
	2019年12月2日現在	2020年11月30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	40,934,580	16,932,525
合計	40,934,580	16,932,525

（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3期	第4期
2019年12月2日現在	2020年11月30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4期
自 2019年12月3日
至 2020年11月30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3期 2019年12月2日現在	第4期 2020年11月30日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0249円 (10,249円)	1.0153円 (10,153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	1,691,971,743	2,400,061,917	
親投資信託受益証券 合計			2,400,061,917	
合計			2,400,061,917	

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

	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		

流動資産		
コール・ローン	277,498,394	327,212,168
国債証券	71,946,332,660	79,869,797,660
地方債証券	4,253,511,900	4,128,711,500
特殊債券	3,020,630,000	3,097,138,700
社債券	2,898,205,400	2,777,936,600
未収入金	1,861,375,540	101,092,000
未収利息	188,754,567	196,593,327
前払費用	12,421,243	3,411,279
流動資産合計	84,458,729,704	90,501,893,234
資産合計	84,458,729,704	90,501,893,234
負債の部		
流動負債		
未払金	1,951,218,000	100,000,000
未払解約金	19,276,281	142,747,138
その他未払費用	134	-
流動負債合計	1,970,494,415	242,747,138
負債合計	1,970,494,415	242,747,138
純資産の部		
元本等		
元本	1	57,670,399,195
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		24,817,836,094
元本等合計		82,488,235,289
純資産合計		82,488,235,289
負債純資産合計		84,458,729,704

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券

	<p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(但し、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
--	--

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1. 1 期首	2018年12月1日	2019年12月3日
期首元本額	56,170,487,793円	57,670,399,195円
期中追加設定元本額	19,864,910,379円	27,218,615,082円
期中一部解約元本額	18,364,998,977円	21,256,844,603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)	109,396,910円	65,126,538円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	596,838,676円	505,967,183円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	82,263,337円	62,478,037円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	882,267,553円	718,126,297円
DCダイワ日本債券インデック ス	7,293,354,645円	8,503,141,748円
ダイワ・バランスファンド35 VA	11,302,866,367円	10,269,709,415円
ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	1,855,649,526円	1,737,338,049円
ダイワ国内バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専用)	265,692,526円	226,910,962円
ダイワ国内バランスファンド3 0VA(適格機関投資家専用)	369,416,535円	339,059,642円
ダイワ・ノーロード 日本債券 ファンド	81,822,975円	90,548,180円
ダイワファンドラップ 日本債 券インデックス	21,258,481,478円	23,601,367,986円

ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)	3,005,941,387円	6,701,446,457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	1,491,311,778円	1,691,971,743円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	1,129,962,205円	1,058,268,870円
ダイワ投信倶楽部日本債券イン デックス	6,866,925,426円	6,961,101,317円
ダイワライフスタイル25	450,390,874円	459,018,956円
ダイワライフスタイル50	491,002,347円	504,172,138円
ダイワライフスタイル75	136,814,650円	136,416,156円
計	57,670,399,195円	63,632,169,674円
2. 期末日における受益権の総数	57,670,399,195口	63,632,169,674口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年12月3日 至 2020年11月30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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。
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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年11月30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	2019年12月2日現在	2020年11月30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	772,340,790	1,166,650,040
地方債証券	2,883,500	30,019,100
特殊債券	5,121,500	22,302,900
社債券	3,077,600	16,802,200
合計	773,180,390	1,235,774,240

(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(2018年12月1日から2019年12月2日まで、及び2019年12月3日から2020年11月30日まで)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

2019年12月2日現在	2020年11月30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)

	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.4303円	1.4185円
(1万口当たり純資産額)	(14,303円)	(14,185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 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	4 0 7 2年国債	100,000,000	100,230,000	
	4 0 8 2年国債	150,000,000	150,382,500	
	4 0 9 2年国債	50,000,000	50,137,500	
	4 1 0 2年国債	2,000,000,000	2,006,360,000	
	4 1 3 2年国債	60,000,000	60,225,000	
	4 1 5 2年国債	750,000,000	753,067,500	
	4 1 7 2年国債	100,000,000	100,450,000	
	1 3 1 5年国債	1,170,000,000	1,173,346,200	
	1 3 2 5年国債	880,000,000	883,071,200	
	1 3 3 5年国債	550,000,000	552,381,500	
	1 3 4 5年国債	870,000,000	874,289,100	
	1 3 5 5年国債	1,700,000,000	1,709,401,000	
	1 3 6 5年国債	950,000,000	955,709,500	
	1 3 7 5年国債	700,000,000	704,725,000	
	1 3 8 5年国債	900,000,000	907,029,000	
	1 3 9 5年国債	850,000,000	856,757,500	
	1 4 0 5年国債	900,000,000	907,704,000	
	1 4 1 5年国債	920,000,000	928,436,400	
	1 4 2 5年国債	430,000,000	434,115,100	
	1 4 3 5年国債	650,000,000	656,461,000	
	1 4 4 5年国債	1,085,000,000	1,095,915,100	
	1 4 0 年国債	70,000,000	102,314,800	
	2 4 0 年国債	110,000,000	155,778,700	
	3 4 0 年国債	150,000,000	212,988,000	
	4 4 0 年国債	107,000,000	152,652,620	
	5 4 0 年国債	125,000,000	172,705,000	
	6 4 0 年国債	105,000,000	143,091,900	
	7 4 0 年国債	121,000,000	158,820,970	
	8 4 0 年国債	230,000,000	282,336,500	
	9 4 0 年国債	220,000,000	201,889,600	
	1 0 4 0 年国債	345,000,000	370,875,000	
	1 1 4 0 年国債	320,000,000	333,408,000	
	1 2 4 0 年国債	350,000,000	329,353,500	
	1 3 4 0 年国債	310,000,000	291,338,000	
3 1 9 1 0 年国債	100,000,000	101,279,000		
3 2 1 1 0 年国債	175,000,000	177,548,000		
3 2 2 1 0 年国債	130,000,000	131,723,800		

3 2 3	1 0 年国債	380,000,000	386,049,600	
3 2 5	1 0 年国債	310,000,000	315,208,000	
3 2 6	1 0 年国債	30,000,000	30,512,100	
3 2 7	1 0 年国債	450,000,000	458,608,500	
3 2 8	1 0 年国債	350,000,000	355,890,500	
3 2 9	1 0 年国債	500,000,000	511,900,000	
3 3 0	1 0 年国債	612,000,000	628,095,600	
3 3 1	1 0 年国債	365,000,000	372,544,550	
3 3 2	1 0 年国債	250,000,000	255,630,000	
3 3 3	1 0 年国債	700,000,000	717,045,000	
3 3 4	1 0 年国債	900,000,000	923,436,000	
3 3 5	1 0 年国債	690,000,000	706,608,300	
3 3 6	1 0 年国債	275,000,000	282,056,500	
3 3 7	1 0 年国債	400,000,000	407,004,000	
3 3 8	1 0 年国債	580,000,000	593,287,800	
3 3 9	1 0 年国債	590,000,000	604,036,100	
3 4 0	1 0 年国債	760,000,000	778,711,200	
3 4 1	1 0 年国債	500,000,000	510,280,000	
3 4 2	1 0 年国債	1,080,000,000	1,091,502,000	
3 4 3	1 0 年国債	680,000,000	687,588,800	
3 4 4	1 0 年国債	820,000,000	829,569,400	
3 4 5	1 0 年国債	650,000,000	657,910,500	
3 4 6	1 0 年国債	700,000,000	708,869,000	
3 4 7	1 0 年国債	950,000,000	962,521,000	
3 4 8	1 0 年国債	600,000,000	608,214,000	
3 4 9	1 0 年国債	1,050,000,000	1,064,532,000	
3 5 0	1 0 年国債	700,000,000	709,765,000	
3 5 1	1 0 年国債	800,000,000	810,936,000	
3 5 2	1 0 年国債	750,000,000	759,997,500	
3 5 3	1 0 年国債	580,000,000	587,505,200	
3 5 4	1 0 年国債	600,000,000	607,494,000	
3 5 5	1 0 年国債	690,000,000	698,286,900	
3 5 6	1 0 年国債	510,000,000	515,849,700	
3 5 7	1 0 年国債	720,000,000	727,502,400	
3 5 8	1 0 年国債	580,000,000	585,660,800	
3 5 9	1 0 年国債	1,128,000,000	1,137,678,240	
3 6 0	1 0 年国債	120,000,000	120,879,600	
1	3 0 年国債	16,000,000	19,978,720	
2	3 0 年国債	24,000,000	29,338,800	

3	30年国債	30,000,000	36,531,300	
4	30年国債	36,000,000	46,270,080	
5	30年国債	28,000,000	34,285,160	
6	30年国債	24,000,000	30,103,920	
7	30年国債	55,000,000	68,833,050	
8	30年国債	27,000,000	32,412,420	
9	30年国債	43,000,000	49,597,490	
10	30年国債	45,000,000	50,314,050	
11	30年国債	40,000,000	47,755,200	
12	30年国債	60,000,000	74,837,400	
13	30年国債	75,000,000	92,820,750	
14	30年国債	82,000,000	105,986,640	
15	30年国債	50,000,000	65,517,500	
16	30年国債	250,000,000	328,777,500	
17	30年国債	130,000,000	169,669,500	
18	30年国債	80,000,000	103,569,600	
19	30年国債	57,000,000	73,976,880	
21	30年国債	60,000,000	78,239,400	
22	30年国債	170,000,000	227,366,500	
24	30年国債	92,000,000	123,750,120	
25	30年国債	150,000,000	197,455,500	
26	30年国債	180,000,000	240,417,000	
27	30年国債	150,000,000	203,929,500	
28	30年国債	170,000,000	232,267,600	
29	30年国債	200,000,000	271,208,000	
30	30年国債	220,000,000	295,809,800	
31	30年国債	300,000,000	399,672,000	
32	30年国債	285,000,000	386,514,150	
33	30年国債	200,000,000	261,112,000	
34	30年国債	270,000,000	363,976,200	
35	30年国債	300,000,000	394,074,000	
36	30年国債	350,000,000	461,265,000	
37	30年国債	200,000,000	260,422,000	
38	30年国債	200,000,000	257,060,000	
39	30年国債	230,000,000	300,738,800	
40	30年国債	200,000,000	257,434,000	
41	30年国債	170,000,000	215,279,500	
42	30年国債	205,000,000	259,858,000	
43	30年国債	200,000,000	253,774,000	

4 4	3 0 年国債	200,000,000	254,022,000	
4 5	3 0 年国債	200,000,000	245,310,000	
4 6	3 0 年国債	140,000,000	171,820,600	
4 7	3 0 年国債	400,000,000	500,588,000	
4 8	3 0 年国債	130,000,000	156,855,400	
4 9	3 0 年国債	120,000,000	144,849,600	
5 0	3 0 年国債	200,000,000	212,996,000	
5 1	3 0 年国債	240,000,000	226,812,000	
5 2	3 0 年国債	300,000,000	297,282,000	
5 3	3 0 年国債	250,000,000	253,425,000	
5 4	3 0 年国債	310,000,000	328,937,900	
5 5	3 0 年国債	260,000,000	275,696,200	
5 6	3 0 年国債	100,000,000	105,963,000	
5 7	3 0 年国債	230,000,000	243,540,100	
5 8	3 0 年国債	370,000,000	391,023,400	
5 9	3 0 年国債	300,000,000	309,285,000	
6 0	3 0 年国債	210,000,000	226,902,900	
6 1	3 0 年国債	200,000,000	205,542,000	
6 2	3 0 年国債	200,000,000	194,924,000	
6 3	3 0 年国債	230,000,000	217,724,900	
6 4	3 0 年国債	330,000,000	311,493,600	
6 5	3 0 年国債	200,000,000	188,472,000	
6 6	3 0 年国債	235,000,000	220,810,700	
6 7	3 0 年国債	164,000,000	162,571,560	
6 8	3 0 年国債	70,000,000	69,212,500	
5 3	2 0 年国債	66,000,000	67,539,780	
5 4	2 0 年国債	65,000,000	66,584,700	
5 5	2 0 年国債	140,000,000	143,868,200	
5 8	2 0 年国債	200,000,000	207,336,000	
5 9	2 0 年国債	45,000,000	46,694,250	
6 0	2 0 年国債	10,000,000	10,314,800	
6 1	2 0 年国債	100,000,000	102,617,000	
6 2	2 0 年国債	95,000,000	97,273,350	
6 3	2 0 年国債	130,000,000	136,437,600	
6 4	2 0 年国債	90,000,000	95,152,500	
6 5	2 0 年国債	175,000,000	185,913,000	
6 6	2 0 年国債	185,000,000	195,970,500	
6 7	2 0 年国債	55,000,000	58,708,100	
6 8	2 0 年国債	120,000,000	129,283,200	

69	20年国債	110,000,000	118,145,500	
70	20年国債	83,000,000	90,489,920	
71	20年国債	125,000,000	135,388,750	
72	20年国債	105,000,000	113,926,050	
73	20年国債	120,000,000	130,384,800	
74	20年国債	73,000,000	79,614,530	
75	20年国債	80,000,000	87,692,800	
76	20年国債	51,000,000	55,463,010	
77	20年国債	130,000,000	141,937,900	
78	20年国債	61,000,000	66,622,370	
79	20年国債	50,000,000	54,837,500	
80	20年国債	53,000,000	58,369,960	
82	20年国債	87,000,000	96,259,410	
83	20年国債	93,000,000	103,388,100	
85	20年国債	58,000,000	64,797,020	
86	20年国債	80,000,000	90,227,200	
87	20年国債	55,000,000	61,738,050	
88	20年国債	100,000,000	113,396,000	
89	20年国債	78,000,000	88,012,860	
90	20年国債	20,000,000	22,684,800	
91	20年国債	60,000,000	68,404,200	
92	20年国債	310,000,000	351,524,500	
93	20年国債	100,000,000	113,310,000	
94	20年国債	130,000,000	148,127,200	
95	20年国債	50,000,000	57,912,500	
96	20年国債	55,000,000	62,978,300	
97	20年国債	40,000,000	46,285,200	
98	20年国債	320,000,000	368,092,800	
99	20年国債	100,000,000	115,542,000	
100	20年国債	155,000,000	181,010,550	
101	20年国債	350,000,000	413,875,000	
103	20年国債	170,000,000	200,659,500	
104	20年国債	10,000,000	11,651,600	
105	20年国債	126,000,000	147,393,540	
106	20年国債	150,000,000	176,644,500	
107	20年国債	90,000,000	105,728,400	
108	20年国債	462,000,000	535,263,960	
109	20年国債	55,000,000	63,936,950	
110	20年国債	260,000,000	306,581,600	

111	20年国債	200,000,000	238,438,000	
112	20年国債	150,000,000	177,541,500	
113	20年国債	310,000,000	368,276,900	
114	20年国債	70,000,000	83,419,700	
115	20年国債	180,000,000	216,138,600	
116	20年国債	200,000,000	241,026,000	
117	20年国債	200,000,000	239,164,000	
118	20年国債	95,000,000	113,037,650	
119	20年国債	93,000,000	108,883,470	
120	20年国債	280,000,000	322,478,800	
121	20年国債	200,000,000	236,670,000	
122	20年国債	160,000,000	187,771,200	
123	20年国債	200,000,000	241,368,000	
124	20年国債	300,000,000	359,049,000	
125	20年国債	130,000,000	158,798,900	
126	20年国債	110,000,000	132,112,200	
127	20年国債	165,000,000	196,475,400	
128	20年国債	250,000,000	298,540,000	
129	20年国債	100,000,000	118,366,000	
130	20年国債	140,000,000	166,145,000	
131	20年国債	150,000,000	176,403,000	
132	20年国債	40,000,000	47,150,400	
133	20年国債	430,000,000	511,583,900	
134	20年国債	200,000,000	238,518,000	
135	20年国債	92,000,000	108,687,880	
136	20年国債	145,000,000	169,679,000	
138	20年国債	100,000,000	116,118,000	
139	20年国債	370,000,000	433,869,400	
140	20年国債	400,000,000	474,656,000	
141	20年国債	200,000,000	237,824,000	
142	20年国債	240,000,000	288,242,400	
143	20年国債	210,000,000	247,667,700	
144	20年国債	240,000,000	280,140,000	
145	20年国債	380,000,000	453,674,400	
146	20年国債	280,000,000	334,936,000	
147	20年国債	300,000,000	355,686,000	
148	20年国債	280,000,000	328,854,400	
149	20年国債	402,000,000	473,129,880	
150	20年国債	200,000,000	233,018,000	

151	20年国債	400,000,000	455,604,000		
152	20年国債	300,000,000	341,940,000		
153	20年国債	400,000,000	461,884,000		
154	20年国債	550,000,000	627,715,000		
155	20年国債	400,000,000	444,808,000		
156	20年国債	200,000,000	204,570,000		
157	20年国債	100,000,000	99,103,000		
158	20年国債	400,000,000	414,256,000		
159	20年国債	280,000,000	293,988,800		
160	20年国債	360,000,000	383,565,600		
161	20年国債	250,000,000	262,237,500		
162	20年国債	350,000,000	366,793,000		
163	20年国債	290,000,000	303,864,900		
164	20年国債	390,000,000	401,832,600		
165	20年国債	520,000,000	535,106,000		
166	20年国債	250,000,000	265,552,500		
167	20年国債	300,000,000	307,902,000		
168	20年国債	320,000,000	322,473,600		
169	20年国債	300,000,000	296,610,000		
170	20年国債	265,000,000	261,737,850		
171	20年国債	300,000,000	295,998,000		
172	20年国債	175,000,000	175,628,250		
173	20年国債	410,000,000	410,742,100		
174	20年国債	30,000,000	30,027,300		
27	メキシコ国債	100,000,000	94,647,500		
11	フィリピン共和国	100,000,000	99,957,000		
国債証券 合計			79,869,797,660		
地方債証券	713	東京都公債	100,000,000	101,373,700	
	751	東京都公債	100,000,000	101,740,700	
	16	東京都20年	100,000,000	115,381,500	
	24-1	北海道公債	100,000,000	101,347,500	
	24-6	北海道公債	100,000,000	101,433,200	
	222	神奈川県公債	100,000,000	100,121,800	
	31	神奈川県20年	100,000,000	110,064,200	
	361	大阪府公債	100,000,000	101,422,100	
	420	大阪府公債	200,000,000	201,266,200	
	24-5	京都府公債	100,000,000	101,453,000	
	26-17	兵庫県公債	100,000,000	101,851,500	
	3	兵庫県公債12年	200,000,000	204,676,400	

19	兵庫県公債20年	100,000,000	116,738,700	
26-10	静岡県公債	100,000,000	101,959,400	
21-5	愛知県公債	100,000,000	118,478,200	
24-16	愛知県公債	100,000,000	101,593,400	
29-5	広島県公債	100,000,000	101,267,200	
4	埼玉県30年	100,000,000	116,726,500	
29-1	福岡県公債	100,000,000	100,915,000	
22-1	福岡県15年	100,000,000	108,150,000	
16	千葉県20年	100,000,000	116,983,200	
28-2	新潟県公債	100,000,000	100,761,700	
108	共同発行地方	100,000,000	101,290,700	
117	共同発行地方	100,000,000	101,425,500	
126	共同発行地方	100,000,000	102,240,500	
131	共同発行地方	100,000,000	102,063,400	
168	共同発行地方	100,000,000	100,962,700	
25-6	大阪市公債	200,000,000	204,030,200	
11	名古屋市20年	100,000,000	118,098,800	
20-1	神戸市20年	100,000,000	117,165,100	
24-10	神戸市公債	100,000,000	101,467,300	
24-3	横浜市公債	100,000,000	101,446,100	
24-5	札幌市公債	100,000,000	101,272,000	
4	川崎市公債30年	100,000,000	132,043,200	
23-4	福岡市20年	100,000,000	118,447,600	
24-4	福井県公債	100,000,000	101,053,300	
地方債証券 合計			4,128,711,500	
特殊債券	47	日本政策投資CO	100,000,000	107,903,000
	19	政保政策投資C	100,000,000	101,475,700
	247	道路機構	200,000,000	195,574,200
	86	政保道路機構	100,000,000	116,636,100
	168	政保道路機構	100,000,000	101,372,700
	173	政保道路機構	100,000,000	101,471,100
	175	政保道路機構	100,000,000	101,474,900
	186	政保道路機構	100,000,000	101,477,300
	190	政保道路機構	100,000,000	101,426,700
	223	政保道路機構	100,000,000	115,813,300
	236	政保道路機構	100,000,000	101,321,600
	261	政保道路機構	200,000,000	203,702,000
	284	政保道路機構	200,000,000	194,686,000
	298	政保道路機構	100,000,000	103,190,500

	3 3 地方公共団体	100,000,000	101,238,300	
	3 9 政保地方公共団	100,000,000	101,342,900	
	F 1 4 3 地方公共団体	100,000,000	108,469,700	
	1 地方公共団 1 5 年	100,000,000	108,858,200	
	4 8 地方公共団体	100,000,000	101,927,500	
	5 1 地方公共団体	100,000,000	102,222,300	
	3 1 地方公共団 2 0	100,000,000	118,583,400	
	6 5 地方公共団体	100,000,000	101,956,100	
	7 1 地方公共団体	100,000,000	101,900,200	
	2 5 日本政策金融	100,000,000	101,390,600	
	2 5 政保日本政策	100,000,000	101,759,000	
	1 2 7 都市再生	100,000,000	100,023,100	
	1 9 利付商工債	100,000,000	99,942,300	
特殊債券 合計			3,097,138,700	
社債券	2 0 成田国際空港	100,000,000	99,909,000	
	6 3 中日本高速道	100,000,000	102,447,200	
	2 1 西日本高速道	100,000,000	102,091,200	
	1 2 アサヒグループHD	100,000,000	100,552,600	
	1 1 日本たばこ産業	100,000,000	102,243,900	
	5 野村不動産HD	100,000,000	102,723,800	
	2 3 森ビル	100,000,000	100,631,000	
	1 1 セブンアンドアイ	100,000,000	100,715,500	
	1 4 セブンアンドアイ	100,000,000	100,009,900	
	4 J Xホールディングス	100,000,000	102,104,300	
	1 7 パナソニック	100,000,000	100,997,900	
	1 5 デンソー	100,000,000	100,232,500	
	7 凸版印刷	100,000,000	106,929,700	
	1 三菱UFJFG 劣後	100,000,000	101,696,500	
	1 1 三菱UFJ信託BK	100,000,000	101,789,700	
	7 8 トヨタファイナンス	100,000,000	100,334,000	
	1 7 5 オリックス	100,000,000	102,662,900	
	1 3 NTTファイナンス	100,000,000	106,475,800	
	1 0 7 東日本旅客鉄	100,000,000	115,983,600	
	4 1 東海旅客鉄道	100,000,000	115,988,900	
	5 0 9 関西電力	100,000,000	100,869,200	
	3 7 2 中国電力	100,000,000	101,990,700	
	4 8 2 九州電力	100,000,000	100,278,600	
	3 3 2 北海道電力	100,000,000	102,876,100	
	1 1 東京電力パワー	100,000,000	101,026,000	

	30 大阪瓦斯	100,000,000	101,426,500	
	4 ファーストリテイリング	100,000,000	102,949,600	
社債券	合計		2,777,936,600	
合計			89,873,584,460	

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オンライン 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4期計算期間（2019年12月3日から2020年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 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3期 2019年12月2日現在	第4期 2020年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	10,077,643	10,430,258
親投資信託受益証券	3,535,778,990	3,989,839,661
未収入金	154,141	2,207,315
流動資産合計	3,546,010,774	4,002,477,234
資産合計	3,546,010,774	4,002,477,234
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,047,651	3,552,887
未払受託者報酬	388,512	425,942
未払委託者報酬	4,274,084	4,685,855
その他未払費用	147,388	159,654
流動負債合計	6,857,635	8,824,338
負債合計	6,857,635	8,824,338
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,349,305,616	1 3,599,799,209
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	189,847,523	393,853,687
（分配準備積立金）	166,517,050	285,891,990
元本等合計	3,539,153,139	3,993,652,896
純資産合計	3,539,153,139	3,993,652,896
負債純資産合計	3,546,010,774	4,002,477,234

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自	2018年12月1日 至 2019年12月2日	自	2019年12月3日 至 2020年11月30日
営業収益				
受取利息		11		27
有価証券売買等損益		257,734,758		194,264,334
営業収益合計		257,734,769		194,264,361
営業費用				
支払利息		6,975		3,634
受託者報酬		777,062		826,537
委託者報酬		8,548,636		9,092,633
その他費用		293,299		309,882
営業費用合計		9,625,972		10,232,686
営業利益		248,108,797		184,031,675
経常利益		248,108,797		184,031,675
当期純利益		248,108,797		184,031,675
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		50,322,335		26,981,937
期首剰余金又は期首欠損金()		51,000,019		189,847,523
剰余金増加額又は欠損金減少額		43,061,080		99,530,900
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		15,020,048		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		28,041,032		99,530,900
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		52,574,474
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		52,574,474
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		189,847,523		393,853,687

(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4期	
	自 2019年12月3日	至 2020年11月30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 2019年11月30日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2019年12月2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3期	第4期
	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1. 1 期首元本額	3,649,169,243円	3,349,305,616円
期中追加設定元本額	1,134,630,067円	1,133,997,978円
期中一部解約元本額	1,434,493,694円	883,504,385円
2. 計算期間末日における受益権の総数	3,349,305,616口	3,599,799,209口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第3期	第4期
	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(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(162,816,007円)、投資信託約款に規定される収益調整金(23,336,298円)及び分配準備積立金(3,701,043円)より分配対象額は189,853,348円(1万口当たり566.84円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(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(157,048,480円)、投資信託約款に規定される収益調整金(107,964,944円)及び分配準備積立金(128,843,510円)より分配対象額は393,856,934円(1万口当たり1,094.11円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	--	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第4期 自 2019年12月3日 至 2020年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第4期
	2020年11月30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3期	第4期
	2019年12月2日現在	2020年11月30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	227,225,519	177,145,338
合計	227,225,519	177,145,338

（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3期	第4期
2019年12月2日現在	2020年11月30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4期
自 2019年12月3日
至 2020年11月30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3期	第4期
	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0567円 (10,567円)	1.1094円 (11,094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	3,712,169,391	3,989,839,661	
親投資信託受益証券 合計			3,989,839,661	
合計			3,989,839,661	

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

	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		

預金		762,734,708	479,164,548
コール・ローン		2,753,096,044	1,436,753,003
国債証券		90,390,273,186	110,150,652,712
派生商品評価勘定		6,002,225	292,953,238
未収入金		2,841,787,582	-
未収利息		541,213,301	639,128,168
前払費用		33,522,385	38,293,615
差入委託証拠金		163,821,655	226,631,580
流動資産合計		97,492,451,086	113,263,576,864
資産合計		97,492,451,086	113,263,576,864
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		110,854,741	1,456,290,993
未払金		5,511,761,821	-
未払解約金		154,141	2,207,315
その他未払費用		921	-
流動負債合計		5,622,771,624	1,458,498,308
負債合計		5,622,771,624	1,458,498,308
純資産の部			
元本等			
元本	1	89,984,609,700	104,020,210,262
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,885,069,762	7,784,868,294
元本等合計		91,869,679,462	111,805,078,556
純資産合計		91,869,679,462	111,805,078,556
負債純資産合計		97,492,451,086	113,263,576,864

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	<p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1. 1 期首	2018年12月1日	2019年12月3日
期首元本額	85,791,284,610円	89,984,609,700円
期中追加設定元本額	38,604,112,946円	41,109,045,405円
期中一部解約元本額	34,410,787,856円	27,073,444,843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）	80,746,616,292円	85,205,153,074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）	3,463,394,055円	3,712,169,391円
ダイワバランスファンド2020-07（適格機関投資家専用）	- 円	3,019,092,522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）	5,774,599,353円	12,083,795,275円
計	89,984,609,700円	104,020,210,262円
2. 期末日における受益権の総数	89,984,609,700口	104,020,210,262口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年12月3日 至 2020年11月30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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	2019年12月2日現在	2020年11月30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	1,099,359,108	453,372,386
合計	1,099,359,108	453,372,386

（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（2019年6月18日から2019年12月2日まで、及び2020年6月16日から2020年11月30日まで）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	2019年12月2日 現在			2020年11月30日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （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	91,199,675,614	-	91,305,800,610	106,124,996	110,147,657,915	-	111,310,995,670	1,163,337,755
アメリカ・ ドル	44,292,767,362	-	44,361,862,160	69,094,798	48,517,480,784	-	48,225,490,690	291,990,094
イギリス・ ポンド	5,853,453,015	-	5,850,183,600	3,269,415	7,361,207,558	-	7,546,135,260	184,927,702
イスラエル・ シケル	-	-	-	-	446,480,098	-	455,914,160	9,434,062
オーストラ リア・ドル	1,797,008,342	-	1,801,201,990	4,193,648	2,889,380,524	-	3,027,168,500	137,787,976
カナダ・ ドル	1,676,430,474	-	1,679,849,710	3,419,236	2,123,973,551	-	2,166,294,060	42,320,509
シンガポー ル・ドル	445,530,013	-	446,152,630	622,617	521,469,287	-	529,311,520	7,842,233
スウェーデ ン・クローナ	382,371,395	-	382,956,700	585,305	350,202,913	-	364,412,620	14,209,707
デンマーク・ クローネ	463,853,022	-	464,111,340	258,318	597,472,751	-	610,232,490	12,759,739
ノルウェー・ クローネ	177,085,967	-	177,105,380	19,413	170,642,283	-	183,452,750	12,810,467
ポーランド・ ズロチ	502,320,600	-	502,560,000	239,400	644,216,042	-	676,877,200	32,661,158
マレーシア・ リンギット	295,468,320	-	295,084,800	383,520	525,341,544	-	524,378,400	963,144
メキシコ・ ペソ	770,369,730	-	769,387,240	982,490	807,242,353	-	854,731,080	47,488,727
ユーロ	34,057,305,298	-	34,088,197,110	30,891,812	45,192,548,227	-	46,146,596,940	954,048,713
南アフリカ・ ランド	485,712,076	-	487,147,950	1,435,874	-	-	-	-
買 建	1,375,991,520	-	1,377,264,000	1,272,480	-	-	-	-
アメリカ・ ドル	602,274,200	-	603,130,000	855,800	-	-	-	-
イギリス・ ポンド	169,978,320	-	169,884,000	94,320	-	-	-	-
ユーロ	603,739,000	-	604,250,000	511,000	-	-	-	-
合計	92,575,667,134	-	92,683,064,610	104,852,516	110,147,657,915	-	111,310,995,670	1,163,337,755

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.0209円	1.0748円
(1万口当たり純資産額)	(10,209円)	(10,748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	2% United States Treasury Note/Bond 20211115	13,946,000.000	14,197,028.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	15,000,000.000	15,429,450.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	11,000,000.000	11,445,060.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	15,520,000.000	16,117,675.200	

2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	11,310,000.000	12,020,381.100	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	13,905,000.000	14,951,073.150	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	10,500,000.000	11,353,860.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	6,080,000.000	6,555,942.400	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	3,300,000.000	3,841,761.000	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	3,250,000.000	4,482,432.500	
5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	800,000.000	1,092,560.000	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	2,700,000.000	3,661,011.000	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	1,400,000.000	2,102,506.000	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	1,130,000.000	1,638,138.400	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	700,000.000	1,040,970.000	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	2,630,000.000	3,624,666.000	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,410,000.000	2,163,687.300	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,390,000.000	2,199,119.000	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,770,000.000	2,870,302.800	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	2,170,000.000	2,886,599.100	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	4,500,000.000	5,770,890.000	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	1,100,000.000	1,575,486.000	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,532,000.000	3,694,339.920	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	1,000,000.000	1,435,700.000	

3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,200,000.000	4,438,976.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,940,000.000	5,268,174.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	7,810,000.000	8,412,775.800	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	22,750,000.000	23,208,412.500	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	8,300,000.000	8,963,336.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	2,170,000.000	2,853,376.400	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	14,820,000.000	15,971,958.600	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	32,220,000.000	33,166,301.400	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	11,800,000.000	12,887,724.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	1,700,000.000	2,241,603.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	6,000,000.000	6,381,060.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	5,165,000.000	5,498,297.450	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,070,000.000	2,508,570.900	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,750,000.000	6,086,892.500	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	5,000,000.000	5,167,950.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,850,000.000	6,366,438.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	3,430,000.000	4,445,314.300	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	4,670,000.000	5,164,693.100	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	8,000,000.000	8,161,840.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,500,000.000	4,641,595.000	

2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	7,550,000.000	8,434,105.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,250,000.000	2,988,630.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	13,500,000.000	15,001,875.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	12,200,000.000	13,035,822.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,310,000.000	4,211,975.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	7,000,000.000	7,422,730.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	11,300,000.000	12,335,532.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,500,000.000	2,749,200.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	4,500,000.000	6,130,170.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	4,400,000.000	5,116,716.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	1,500,000.000	2,003,085.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	7,800,000.000	9,270,378.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	1,850,000.000	2,638,840.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	4,000,000.000	4,612,480.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	3,200,000.000	4,286,496.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	2,000,000.000	2,621,240.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	4,000,000.000	4,316,840.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	2,100,000.000	2,443,203.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,400,000.000	5,867,424.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	2,800,000.000	3,342,052.000	

	1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	4,500,000.000	4,787,190.000	
	2% United States Treasury Note/Bond 20500215	2,500,000.000	2,761,325.000	
	1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	3,400,000.000	3,137,826.000	
	1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,400,000.000	5,199,606.000	
	0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	4,000,000.000	3,924,040.000	
	1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	3,100,000.000	2,952,254.000	
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 459,576,961.820 (47,745,450,564)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	2% United Kingdom Gilt 20250907	1,350,000.000	1,479,478.500	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	960,000.000	1,589,587.200	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,025,000.000	1,110,280.000	
	0.5% United Kingdom Gilt 20220722	250,000.000	252,267.500	
	1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,850,000.000	2,143,669.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20370907	720,000.000	841,104.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,100,000.000	1,435,038.000	
	1.25% United Kingdom Gilt 20270722	650,000.000	699,497.500	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	800,000.000	891,984.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20711022	697,000.000	980,713.850	
	1% United Kingdom Gilt 20240422	400,000.000	414,172.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20490122	800,000.000	985,176.000	

1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	1,051,832.500	
0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,000,000.000	1,055,040.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20411022	550,000.000	597,960.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20301022	1,400,000.000	1,407,924.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	900,000.000	898,767.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	513,000.000	749,646.900	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,300,000.000	1,862,380.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	2,075,000.000	2,521,166.500	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	915,000.000	1,402,704.150	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	950,000.000	1,608,046.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	850,000.000	1,744,463.500	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	770,000.000	1,387,054.900	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,100,000.000	1,419,220.000	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	911,000.000	1,595,616.500	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	907,500.000	1,306,727.400	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	843,000.000	1,588,422.750	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,130,000.000	1,833,300.700	
4% United Kingdom Gilt 20220307	1,040,000.000	1,093,435.200	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	300,000.000	458,688.000	
4% United Kingdom Gilt 20600122	337,000.000	703,864.940	

	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,000,000.000	1,651,500.000	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	700,000.000	1,273,853.000	
	1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,080,000.000	2,146,248.000	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,175,000.000	1,778,691.500	
	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	2,490,000.000	2,648,413.800	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	858,900.000	1,803,698.580	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,900,000.000	2,099,557.000	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	490,000.000	777,144.900	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 53,288,335.270 (7,383,098,852)	
イスラエル・ シュケル	4.25% Israel Government Bond - Fixed 20230331	3,500,000.000	3,833,550.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,200,000.000	2,055,360.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	4,000,000.000	4,378,680.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	1,000,000.000	1,400,070.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	1,700,000.000	1,732,266.000	
イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 13,399,926.000 (419,953,680)	
オーストラリ ア・ドル	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,080,000.000	1,179,597.600	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	2,083,000.000	2,350,957.120	

4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	889,000.000	1,128,985.550	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	2,156,000.000	2,348,660.160	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,620,000.000	1,952,407.800	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	3,500,000.000	3,962,420.000	
4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	859,000.000	1,203,252.840	
4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	3,898,000.000	4,715,059.780	
3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	725,000.000	975,255.500	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	800,000.000	959,944.000	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	684,000.000	871,121.880	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,300,000.000	1,496,521.000	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	2,158,000.000	2,416,032.060	
3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	575,000.000	719,750.500	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,250,000.000	1,450,450.000	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	1,200,000.000	1,251,072.000	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	2,200,000.000	2,572,042.000	
2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,100,000.000	2,416,974.000	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	130,000.000	154,534.900	
1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	300,000.000	307,662.000	
1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	3,300,000.000	3,331,614.000	
1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,000,000.000	969,650.000	

オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 38,733,964.690 (2,979,029,225)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	2.75% Canada Government International Bond 20641201	680,000.000	1,044,860.800	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	907,000.000	1,292,973.850	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,050,000.000	1,665,573.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	770,000.000	1,193,030.300	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	2,100,000.000	2,180,850.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	740,000.000	1,124,052.600	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,238,000.000	1,276,687.500	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	230,000.000	247,664.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,100,000.000	1,519,023.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,492,000.000	1,616,537.240	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	820,000.000	866,502.200	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	930,000.000	959,890.200	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	3,940,000.000	3,956,390.400	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	600,000.000	664,428.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,100,000.000	1,137,290.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	300,000.000	340,968.000	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,000,000.000	1,063,770.000		
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,462,034.000		

	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	1,400,000.000	1,473,234.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	900,000.000	903,987.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	1,200,000.000	1,173,948.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 27,163,694.090 (2,171,737,343)	
シンガポール・ ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	203,000.000	238,098.700	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	1,000,000.000	1,050,120.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	150,000.000	164,640.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	300,000.000	355,269.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	89,000.000	113,920.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	200,000.000	212,660.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	420,000.000	535,920.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	400,000.000	434,200.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	330,000.000	435,930.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	200,000.000	217,040.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	260,000.000	300,401.400	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	800,000.000	907,040.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	1,000,000.000	1,053,300.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	300,000.000	358,431.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	200,000.000	236,068.000	

シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 6,613,038.100 (513,766,930)	
スウェーデン・ クローナ	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	スウェーデン・クローナ 2,520,000.000	スウェーデン・クローナ 3,956,702.400	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	6,950,000.000	7,358,451.500	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	4,150,000.000	4,381,113.500	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	2,020,000.000	2,279,529.600	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	4,780,000.000	5,141,654.800	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	2,550,000.000	2,729,316.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	3,000,000.000	3,234,090.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 29,080,857.800 (355,368,082)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	デンマーク・クローネ 6,740,000.000	デンマーク・クローネ 12,951,584.000	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	2,310,000.000	2,390,295.600	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	2,670,000.000	2,844,431.100	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	4,330,000.000	4,850,033.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,200,000.000	5,588,960.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	4,700,000.000	5,121,731.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	1,000,000.000	1,098,200.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 34,845,234.700 (582,263,872)	

ノルウェー・クローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	1,610,000.000	1,679,052.900	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	1,300,000.000	1,412,125.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	150,000.000	158,287.500	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	1,430,000.000	1,502,072.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,000,000.000	3,206,760.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	4,000,000.000	4,375,760.000	
1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	2,500,000.000	2,627,625.000		
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 14,961,682.400 (175,949,385)	
ポーランド・ズロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	5.75% Poland Government Bond 20220923	1,200,000.000	1,324,008.000	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	2,640,000.000	2,916,487.200	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	1,815,000.000	2,015,448.600	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	800,000.000	825,200.000	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	3,000,000.000	3,157,020.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	4,400,000.000	4,754,288.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	2,300,000.000	2,622,000.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	500,000.000	501,100.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	600,000.000	837,270.000	
	4% Poland Government Bond 20231025	710,000.000	790,932.900	

	2.75% Poland Government Bond 20280425	1,500,000.000	1,695,450.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	2,230,000.000	2,519,253.300	
	ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 23,958,458.000 (663,888,872)	
マレーシア・リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,760,000.000	1,997,001.600	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	1,250,000.000	1,354,037.500	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	600,000.000	639,474.000	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,500,000.000	1,608,195.000	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,150,000.000	1,242,874.000	
	3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,100,000.000	1,140,513.000	
	3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,600,000.000	1,676,336.000	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	1,420,000.000	1,573,175.400	
	3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	2,600,000.000	2,651,220.000	
	4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	2,000,000.000	2,144,500.000	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,000,000.000	1,171,130.000	
	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	1,000,000.000	1,078,190.000	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,200,000.000	1,298,004.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,354,379.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	700,000.000	714,791.000	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	400,000.000	399,992.000	

マレーシア・リングgit 小計			マレーシア・リングgit 22,043,812.500 (562,778,534)
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ
	5.75% Mexican Bonos 20260305	9,200,000.000	9,482,440.000
	8% Mexican Bonos 20471107	11,450,000.000	12,843,236.000
	8% Mexican Bonos 20240905	12,900,000.000	14,342,994.000
	8% Mexican Bonos 20231207	6,740,000.000	7,391,555.800
	10% Mexican Bonos 20241205	6,340,000.000	7,541,873.800
	7.5% Mexican Bonos 20270603	11,800,000.000	13,194,052.000
	10% Mexican Bonos 20361120	2,750,000.000	3,718,275.000
	8.5% Mexican Bonos 20290531	6,500,000.000	7,784,205.000
	8.5% Mexican Bonos 20381118	5,000,000.000	5,947,600.000
	7.75% Mexican Bonos 20310529	22,700,000.000	26,068,680.000
	6.5% Mexican Bonos 20220609	15,900,000.000	16,393,059.000
	7.75% Mexican Bonos 20421113	9,750,000.000	10,703,940.000
7.75% Mexican Bonos 20341123	10,300,000.000	11,759,922.000	
メキシコ・ペソ 小計			メキシコ・ペソ 147,171,832.600 (763,821,811)
ユーロ		ユーロ	ユーロ
	0.75% Finland Government Bond 20310415	690,000.000	774,090.300
	0.875% Finland Government Bond 20250915	800,000.000	861,152.000
	0.5% Finland Government Bond 20260415	180,000.000	191,494.800
	1.375% Finland Government Bond 20470415	270,000.000	372,238.200
	0.5% Finland Government Bond 20270915	200,000.000	215,106.000
	1.125% Finland Government Bond 20340415	150,000.000	178,216.500
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	541,460.000
	0.125% Finland Government Bond 20360415	150,000.000	157,204.500
0.25% Finland Government Bond 20400915	150,000.000	160,299.000	

1.2% Austria Government Bond 20251020	140,000.000	153,216.000	
0.75% Austria Government Bond 20261020	490,000.000	530,983.600	
1.5% Austria Government Bond 20470220	120,000.000	166,933.200	
1.5% Austria Government Bond 20861102	280,000.000	477,904.000	
0.5% Austria Government Bond 20270420	400,000.000	429,392.000	
2.1% Austria Government Bond 21170920	50,000.000	113,496.000	
0.75% Austria Government Bond 20280220	600,000.000	658,620.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	700,000.000	759,836.000	
Austria Government Bond 20300220	600,000.000	624,720.000	
0.75% Austria Government Bond 20510320	600,000.000	722,286.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	670,000.000	715,915.100	
1% Belgium Government Bond 20310622	622,000.000	710,684.760	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	610,000.000	814,203.600	
1% Belgium Government Bond 20260622	595,000.000	649,835.200	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	414,000.000	555,074.640	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	370,000.000	635,119.800	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	400,000.000	410,692.000	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	730,000.000	797,393.600	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	500,000.000	523,740.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	310,000.000	509,289.700	

1.45% Belgium Government Bond 20370622	700,000.000	873,138.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	580,000.000	639,438.400	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	500,000.000	595,425.000	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	700,000.000	783,188.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	350,000.000	487,385.500	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	900,000.000	943,101.000	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	500,000.000	529,440.000	
Belgium Government Bond 20271022	800,000.000	831,112.000	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	955,000.000	1,425,413.900	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	800,000.000	1,172,136.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	800,000.000	1,143,496.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	2,596,000.000	4,284,256.680	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,660,000.000	2,718,997.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	3,270,000.000	5,693,527.800	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	690,000.000	1,199,682.300	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	420,000.000	795,841.200	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,810,000.000	3,697,703.300	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	606,000.000	1,093,411.860	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	1,542,000.000	1,604,281.380	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,648,000.000	2,774,902.400	

1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,150,000.000	1,208,650.000	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,460,000.000	1,571,952.800	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	800,000.000	866,440.000	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	1,725,000.000	2,986,785.750	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	990,000.000	1,069,655.400	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	2,000,000.000	2,135,340.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	1,190,000.000	1,255,830.800	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	4,300,000.000	4,668,338.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	883,000.000	942,946.870	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,050,000.000	2,141,409.500	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,150,000.000	1,223,450.500	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,100,000.000	3,364,399.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	1,260,000.000	1,785,495.600	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	750,000.000	817,620.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	1,900,000.000	2,042,614.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,800,000.000	3,018,736.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	900,000.000	949,770.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	1,500,000.000	1,515,105.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	1,800,000.000	1,825,704.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	150,000.000	152,830.500	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,000,000.000	1,023,150.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	500,000.000	513,390.000	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,415,000.000	4,553,014.600	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	1,000,000.000	1,514,160.000	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,000,000.000	3,466,920.000	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,210,000.000	3,802,216.600	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,232,000.000	2,691,057.600	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	1,065,000.000	1,841,267.850	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	1,200,000.000	1,375,680.000	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	2,143,000.000	4,080,464.870	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,000,000.000	2,319,780.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,540,000.000	4,345,668.600	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	1,900,000.000	1,999,294.000	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	2,910,000.000	3,590,707.200	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	2,195,000.000	2,320,510.100	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	1,190,000.000	2,066,899.100	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	4,730,000.000	5,023,307.300	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	2,200,000.000	2,430,010.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	2,686,000.000	3,440,631.700	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	3,360,000.000	3,693,580.800	

0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	2,700,000.000	2,844,720.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	1,500,000.000	1,793,475.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	1,800,000.000	1,913,202.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	1,250,000.000	1,510,387.500	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,000,000.000	1,548,650.000	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	2,370,000.000	2,492,742.300	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	1,800,000.000	2,387,448.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	1,400,000.000	1,545,740.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	1,400,000.000	2,054,248.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	1,200,000.000	1,220,148.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	1,500,000.000	1,645,725.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	1,300,000.000	1,552,746.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	2,250,000.000	2,478,937.500	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	2,700,000.000	2,764,773.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220225	3,000,000.000	3,025,800.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	800,000.000	1,073,728.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	1,500,000.000	1,624,545.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	4,361,154.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	200,000.000	224,448.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	600,000.000	649,932.000	

FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	1,600,000.000	1,656,096.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	580,000.000	839,254.200	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,200,000.000	2,063,184.000	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,170,000.000	1,282,741.200	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	830,000.000	1,554,797.500	
2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	500,000.000	524,450.000	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	290,000.000	395,742.700	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	750,000.000	799,837.500	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	840,000.000	1,505,977.200	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	480,000.000	528,264.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	690,000.000	721,574.400	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,170,000.000	1,249,665.300	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	970,000.000	1,061,538.900	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	400,000.000	409,408.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	600,000.000	663,744.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,100,000.000	1,179,409.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	250,000.000	287,007.500	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	750,000.000	787,132.500	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	400,000.000	413,912.000	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,600,000.000	2,274,432.000	

6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	1,635,000.000	2,333,619.150	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	3,100,000.000	3,431,266.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,205,000.000	1,698,194.450	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	920,000.000	986,332.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,500,000.000	1,659,360.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	500,000.000	550,950.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	800,000.000	827,288.000	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,000,000.000	1,290,650.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	1,200,000.000	1,236,756.000	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	1,850,000.000	2,192,490.500	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	2,400,000.000	2,468,112.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	400,000.000	403,132.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	1,400,000.000	1,864,044.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,300,000.000	1,558,830.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,700,000.000	1,920,269.000	
1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	1,500,000.000	1,533,555.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	350,000.000	512,774.500	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	1,550,000.000	1,738,712.500	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	700,000.000	715,953.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	700,000.000	786,023.000	

2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	1,400,000.000	1,670,242.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,300,000.000	1,463,475.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	500,000.000	663,010.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	800,000.000	1,259,008.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,000,000.000	1,220,320.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	900,000.000	1,002,447.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,600,000.000	2,706,470.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	1,540,000.000	2,188,032.000	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	1,588,000.000	2,452,237.240	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,000,000.000	1,580,300.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	1,450,000.000	2,222,632.500	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	1,270,000.000	1,827,911.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,640,000.000	2,708,410.800	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	3,870,000.000	4,402,357.200	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	1,700,000.000	2,072,130.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,414,000.000	4,025,876.080	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	3,250,000.000	4,012,937.500	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	780,000.000	833,804.400	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	500,000.000	552,145.000	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	6,270,000.000	6,985,720.500	

4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	1,080,000.000	1,443,960.000	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	725,000.000	1,231,550.250	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	830,000.000	959,065.000	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,110,000.000	2,422,491.000	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,370,000.000	1,745,448.500	
2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	700,000.000	719,446.000	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,000,000.000	1,452,630.000	
5% Belgium Government Bond 20350328	750,000.000	1,314,045.000	
4% Belgium Government Bond 20220328	550,000.000	584,556.500	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	815,000.000	1,492,664.350	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	700,000.000	895,118.000	
4.25% Belgium Government Bond 20220928	730,000.000	797,101.600	
4% Belgium Government Bond 20320328	300,000.000	449,223.000	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,000,000.000	1,077,170.000	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	540,000.000	997,083.000	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	800,000.000	895,672.000	
3% Belgium Government Bond 20340622	300,000.000	431,679.000	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	688,000.000	867,877.600	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	420,000.000	464,637.600	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	600,000.000	681,084.000	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	680,000.000	858,404.800	
2% IRISH TREASURY 20450218	710,000.000	1,015,740.200	
1% IRISH TREASURY 20260515	820,000.000	891,307.200	

1.7% IRISH TREASURY 20370515	570,000.000	729,417.600	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	500,000.000	550,645.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	150,000.000	177,631.500	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	600,000.000	701,874.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	150,000.000	199,672.500	
6.25% Austria Government Bond 20270715	380,000.000	557,034.400	
4.15% Austria Government Bond 20370315	500,000.000	860,350.000	
4.85% Austria Government Bond 20260315	700,000.000	909,622.000	
3.65% Austria Government Bond 20220420	900,000.000	954,702.000	
3.4% Austria Government Bond 20221122	860,000.000	930,666.200	
3.8% Austria Government Bond 20620126	420,000.000	1,032,981.600	
3.15% Austria Government Bond 20440620	630,000.000	1,114,488.900	
1.75% Austria Government Bond 20231020	680,000.000	729,136.800	
2.4% Austria Government Bond 20340523	730,000.000	998,231.200	
1.65% Austria Government Bond 20241021	880,000.000	962,376.800	
4% Finland Government Bond 20250704	200,000.000	244,008.000	
2.75% Finland Government Bond 20280704	120,000.000	150,901.200	
1.625% Finland Government Bond 20220915	980,000.000	1,022,277.200	
2.625% Finland Government Bond 20420704	210,000.000	336,199.500	
2% Finland Government Bond 20240415	350,000.000	382,662.000	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,420,000.000	2,133,507.400	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	1,400,000.000	1,529,990.000	

1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	1,410,000.000	1,673,684.100	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,565,000.000	2,895,679.800	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,000,000.000	1,128,130.000	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	689,000.000	1,033,444.880	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,230,000.000	2,243,938.200	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	1,349,000.000	1,482,551.000	
0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	250,000.000	253,557.500	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,100,000.000	1,229,162.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,320,000.000	1,666,209.600	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	1,670,000.000	1,865,824.200	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,150,000.000	2,404,022.500	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	550,000.000	808,428.500	
0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20211031	1,500,000.000	1,508,580.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	800,000.000	904,248.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	900,000.000	1,089,738.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	1,200,000.000	1,269,732.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,000,000.000	1,047,380.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	1,200,000.000	1,341,516.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	980,000.000	1,615,147.800	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	800,000.000	1,275,000.000	

	4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	900,000.000	1,629,063.000	
	4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	2,843,000.000	5,097,925.450	
	5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,000,000.000	1,359,460.000	
	5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	600,000.000	645,150.000	
	5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	4,310,000.000	4,873,963.500	
	4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,588,000.000	1,820,260.880	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,300,000.000	1,847,391.000	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	890,000.000	1,758,123.800	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	3,200,000.000	3,679,520.000	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,084,000.000	2,353,190.280	
	ユーロ 小計		ユーロ 368,496,105.170 (45,833,545,562)	
国債証券	合計		110,150,652,712 [110,150,652,712]	
合計			110,150,652,712 [110,150,652,712]	

- (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 70銘柄	100%	43.3%
イギリス・ポンド	国債証券 40銘柄	100%	6.7%
イスラエル・シケル	国債証券 5銘柄	100%	0.4%
オーストラリア・ドル	国債証券 22銘柄	100%	2.7%
カナダ・ドル	国債証券 21銘柄	100%	2.0%

シンガポール・ドル	国債証券	15銘柄	100%	0.5%
スウェーデン・クローナ	国債証券	7銘柄	100%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	100%	0.5%
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	12銘柄	100%	0.6%
マレーシア・リングギット	国債証券	16銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券	13銘柄	100%	0.7%
ユーロ	国債証券	244銘柄	100%	41.6%

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) 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4期計算期間（2019年12月3日から2020年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 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) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 2019年12月2日現在	第4期 2020年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,239,771	6,624,049
親投資信託受益証券	2,831,073,078	2,460,578,515
未収入金	-	1,466,774
流動資産合計	2,839,312,849	2,468,669,338
資産合計	2,839,312,849	2,468,669,338
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,663,649	2,362,093
未払受託者報酬	303,031	263,649
未払委託者報酬	3,485,171	3,032,364
その他未払費用	114,932	98,800
流動負債合計	5,566,783	5,756,906
負債合計	5,566,783	5,756,906
純資産の部		
元本等		
元本	1 2,655,013,152	1 2,237,982,504
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	178,732,914	224,929,928
（分配準備積立金）	108,793,480	134,435,722
元本等合計	2,833,746,066	2,462,912,432
純資産合計	2,833,746,066	2,462,912,432
負債純資産合計	2,839,312,849	2,468,669,338

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自	2018年12月1日 至 2019年12月2日	自	2019年12月3日 至 2020年11月30日
営業収益				
受取利息		8		17
有価証券売買等損益		124,191,521		62,010,192
営業収益合計		124,191,529		62,010,209
営業費用				
支払利息		5,004		2,431
受託者報酬		576,760		557,137
委託者報酬		6,633,576		6,408,028
その他費用		217,700		208,839
営業費用合計		7,433,040		7,176,435
営業利益		116,758,489		54,833,774
経常利益		116,758,489		54,833,774
当期純利益		116,758,489		54,833,774
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()		9,172,604		11,099,252
期首剰余金又は期首欠損金()		53,107,629		178,732,914
剰余金増加額又は欠損金減少額		35,450,978		56,202,927
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		35,450,978		56,202,927
剰余金減少額又は欠損金増加額		17,411,578		75,938,939
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		17,411,578		75,938,939
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		178,732,914		224,929,928

(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4期	
	自 2019年12月3日	至 2020年11月30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 2019年11月30日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2019年12月2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3期	第4期
	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1. 1 期首元本額	2,389,228,743円	2,655,013,152円
期中追加設定元本額	1,008,953,213円	695,143,661円
期中一部解約元本額	743,168,804円	1,112,174,309円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,655,013,152口	2,237,982,504口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第3期	第4期
	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(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(86,074,253円)、投資信託約款に規定される収益調整金(69,943,825円)及び分配準備積立金(22,719,227円)より分配対象額は178,737,305円(1万口当たり673.21円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(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(65,932,283円)、投資信託約款に規定される収益調整金(90,496,226円)及び分配準備積立金(68,503,439円)より分配対象額は224,931,948円(1万口当たり1,005.07円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	--	--

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第4期 自 2019年12月3日 至 2020年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第4期
	2020年11月30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3期	第4期
	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	119,014,646	69,390,782
合計	119,014,646	69,390,782

（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3期	第4期
2019年12月2日現在	2020年11月30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4期
自 2019年12月3日
至 2020年11月30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3期	第4期
	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0673円 (10,673円)	1.1005円 (11,005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	356,825,524	491,598,524	
	外国債券インデックスマザーファンド	654,015,808	1,968,979,991	
親投資信託受益証券 合計			2,460,578,515	
合計			2,460,578,515	

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」受益証券及び「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

	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		

流動資産		
預金	1,082,925,447	635,260,286
コール・ローン	1,729,159,455	1,397,690,109
国債証券	187,330,033,946	215,573,016,059
派生商品評価勘定	4,341,690	162,494
未収入金	2,827,376,943	21,902,130
未収利息	1,281,708,922	1,222,948,097
前払費用	46,960,770	58,449,028
流動資産合計	194,302,507,173	218,909,428,203
資産合計	194,302,507,173	218,909,428,203
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,600,751	69,348
未払金	3,832,899,493	2,087,434
未払解約金	3,405,669	71,815,810
その他未払費用	987	-
流動負債合計	3,837,906,900	73,972,592
負債合計	3,837,906,900	73,972,592
純資産の部		
元本等		
元本	1 66,118,107,712	72,688,498,430
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	124,346,492,561	146,146,957,181
元本等合計	190,464,600,273	218,835,455,611
純資産合計	190,464,600,273	218,835,455,611
負債純資産合計	194,302,507,173	218,909,428,203

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券

	<p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買取相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1. 1 期首	2018年12月1日	2019年12月3日
期首元本額	61,445,933,589円	66,118,107,712円
期中追加設定元本額	8,771,520,025円	13,500,674,811円
期中一部解約元本額	4,099,345,902円	6,930,284,093円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ外国債券インデックスV	653,486,435円	601,675,980円
A		
ダイワ国内重視バランスファン	22,093,366円	12,401,222円
ド30VA(一般投資家私募)		

ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	128,330,909円	102,686,952円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私募)	41,751,987円	29,631,947円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私募)	442,528,295円	339,511,943円
外国債券インデックスファンド (F0Fs用)(適格機関投資家専 用)	31,239,348円	90,339,707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)	413,208,724円	462,489,583円
ダイワファンドラップ 外国債 券インデックス(為替ヘッジな し)	1,427,469,459円	1,814,096,236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)	787,285,961円	654,015,808円
D-I's 外国債券インデック ス	2,452,065円	1,055,376円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	314,458円	957,155円
iFree 外国債券インデッ クス	600,033,543円	691,990,376円
iFree 8資産バランス	772,093,354円	989,492,660円
iFree 年金バランス	14,937,740円	49,115,601円
DCダイワ外国債券インデック ス	45,506,848,020円	48,408,053,236円
ダイワ・ライフ・バランス30	786,129,849円	819,754,500円
ダイワ・ライフ・バランス50	407,847,078円	459,770,424円
ダイワ・ライフ・バランス70	255,622,913円	279,428,323円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	420,775,557円	459,816,979円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	323,134,588円	336,784,366円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	107,264,235円	108,589,082円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	9,559,864円	8,547,742円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	21,464,206円	19,902,336円

DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	3,128,858円	4,844,467円
ダイワつみたてインデックス外 国債券	59,508,551円	163,786,187円
ダイワつみたてインデックスバ ランス30	125,482円	3,047,233円
ダイワつみたてインデックスバ ランス50	40,800円	977,653円
ダイワつみたてインデックスバ ランス70	199,958円	951,206円
ダイワ世界バランスファンド4 0VA	198,065,881円	174,483,363円
ダイワ世界バランスファンド6 0VA	149,085,433円	131,594,279円
ダイワ・バランスファンド35 VA	4,935,026,873円	4,234,846,474円
ダイワ・バランスファンド25 VA(適格機関投資家専用)	282,957,531円	250,419,145円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	144,999,465円	142,610,494円
ダイワ・ノーロード 外国債券 ファンド	32,445,382円	34,513,413円
ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワS MA専用)	1,312,096,170円	4,864,458,623円
ダイワ投信倶楽部外国債券イン デックス	5,710,869,559円	5,832,536,410円
ダイワライフスタイル25	34,837,008円	33,396,711円
ダイワライフスタイル50	61,720,946円	59,767,812円
ダイワライフスタイル75	17,127,861円	16,157,426円
計	66,118,107,712円	72,688,498,430円
2. 期末日における受益権の総数	66,118,107,712口	72,688,498,430口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 2019年12月3日 至 2020年11月30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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年11月30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	2019年12月2日現在	2020年11月30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	11,319,542,417	6,708,826,689
合計	11,319,542,417	6,708,826,689

(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(2018年12月1日から2019年12月2日まで、及び2019年12月3日から2020年11月30日まで)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	2019年12月2日 現在				2020年11月30日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	792,943,342	-	794,138,360	1,195,018	5,665,440	-	5,665,440	0
アメリカ・ドル	692,834,338	-	693,818,820	984,482	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	88,958,190	-	89,162,240	204,050	-	-	-	-
デンマーク・クローネ	11,150,814	-	11,157,300	6,486	-	-	-	-
マレーシア・リングgit	-	-	-	-	5,665,440	-	5,665,440	0
買 建	2,973,436,433	-	2,977,372,390	3,935,957	2,102,427,594	-	2,102,520,740	93,146
アメリカ・ドル	823,263,537	-	824,358,700	1,095,163	650,675,209	-	650,674,400	809
イギリス・ポンド	252,244,214	-	252,213,690	30,524	56,666,132	-	56,662,860	3,272
オーストラリア・ドル	6,661,404	-	6,668,100	6,696	28,675,523	-	28,678,740	3,217
カナダ・ドル	71,898,106	-	72,050,790	152,684	37,572,016	-	37,561,640	10,376
シンガポール・ドル	54,130,613	-	54,182,700	52,087	25,689,605	-	25,688,910	695

スウェーデン・ クローナ	25,859,325	-	25,859,330	5	16,083,586	-	16,069,300	14,286
デンマーク・ クローネ	-	-	-	-	29,879,064	-	29,877,480	1,584
ノルウェー・ クローネ	42,874,854	-	42,731,410	143,444	-	-	-	-
ポーランド・ ズロチ	45,895,875	-	46,015,630	119,755	-	-	-	-
マレーシア・ リングギット	15,757,800	-	15,738,000	19,800	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	72,071,067	-	71,975,920	95,147	-	-	-	-
ユーロ	1,501,277,606	-	1,503,729,120	2,451,514	1,257,186,459	-	1,257,307,410	120,951
南アフリカ・ ランド	61,502,032	-	61,849,000	346,968	-	-	-	-
合計	3,766,379,775	-	3,771,510,750	2,740,939	2,108,093,034	-	2,108,186,180	93,146

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1口当たり純資産額	2.8807円	3.0106円
(1万口当たり純資産額)	(28,807円)	(30,106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		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,153,000.000	2,191,754.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,224,000.000	3,297,410.480	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220515	2,459,000.000	2,516,147.160	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20220815	2,543,000.000	2,606,854.730	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	6,668,000.000	6,858,904.840	
		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,526,001.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,865,419.350	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,854,916.080	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,398,729.830	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,654,222.280	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	5,296,511.360	
		8% United States Treasury Note/Bond 20211115	2,106,000.000	2,265,592.680	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	761,367.180	
		6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,102,077.900	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	977,859.890			
5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	955,990.000			

5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	1,000,676.340	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20290215	473,000.000	645,791.630	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	1,072,278.060	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	3,466,184.880	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,748,829.600	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	1,346,001.580	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	826,148.360	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	795,284.460	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	1,445,731.800	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,687,979.380	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,645,395.600	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,856,781.300	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,597,921.000	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	2,586,871.920	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,586,630.390	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	2,241,135.780	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	2,033,536.560	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	2,122,670.550	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	2,185,769.450	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,924,411.000	

3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	2,158,963.290	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,765,448.520	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	2,231,000.000	2,805,125.540	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	2,048,958.900	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	3,496,046.320	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	2,947,001.160	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	4,603,283.640	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	3,036,303.860	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	4,747,859.900	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	4,615,147.860	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	6,645,285.660	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	2,579,265.900	
2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,200,679.460	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	6,377,982.780	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,846,000.000	5,047,875.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,886,000.000	2,936,707.020	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,238,432.790	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,527,000.000	2,567,457.270	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	6,152,188.750	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	3,099,615.310	

1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,809,000.000	3,885,751.350	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,953,098.680	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	6,250,576.960	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	2,835,000.000	3,727,798.200	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,671,579.720	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	1,326,000.000	1,360,184.280	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,908,479.210	
2% United States Treasury Note/Bond 20220731	4,179,000.000	4,307,922.150	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	6,189,403.390	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	3,373,000.000	4,351,675.950	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,518,350.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,544,602.640	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	6,378,331.200	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	2,159,000.000	2,846,835.810	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,642,720.960	
2% United States Treasury Note/Bond 20221130	6,287,000.000	6,518,298.730	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	4,992,000.000	5,195,923.200	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,366,000.000	4,643,284.660	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,649,431.330	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,648,000.000	4,419,479.040	

1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,962,000.000	3,050,386.080	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	3,623,000.000	3,735,928.910	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	3,729,000.000	3,969,632.370	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,142,594.900	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	3,423,000.000	4,148,231.010	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,590,425.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	3,092,790.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,716,386.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	4,028,622.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,859,480.200	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,478,168.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,589,142.950	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	5,767,884.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20211031	3,000,000.000	3,031,620.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,604,675.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	3,500,000.000	4,536,035.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,632,975.800	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20211130	3,400,000.000	3,454,978.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20211231	4,000,000.000	4,080,600.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,657,400.000	

2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	6,140,000.000	6,790,410.200	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	3,010,000.000	3,070,892.300	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,639,836.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,545,000.000	4,701,272.650	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,010,000.000	3,074,895.600	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,441,588.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	4,550,000.000	4,837,924.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,900,000.000	2,966,816.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	7,149,440.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	2,656,560.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,000,000.000	3,072,870.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	3,181,170.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531	3,000,000.000	3,072,180.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240531	5,300,000.000	5,626,692.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220630	3,000,000.000	3,075,930.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,550,936.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	6,556,375.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,900,000.000	2,984,506.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	3,205,530.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,450,000.000	4,390,125.000	

1.625% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,200,000.000	3,282,496.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	2,120,780.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,500,000.000	2,579,100.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,677,125.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,588,475.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	6,122,600.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	3,500,000.000	4,460,295.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,769,850.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,433,984.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	3,022,460.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131	3,500,000.000	3,667,335.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	5,650,000.000	6,500,551.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,481,731.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,838,264.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,979,693.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,800,000.000	5,060,498.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,900,000.000	3,057,209.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	3,189,072.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	4,200,000.000	5,721,492.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	7,558,785.000	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,655,250.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	2,112,857.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,953,812.500	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,660,350.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,657,600.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	3,329,760.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	3,850,000.000	4,114,071.500	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	7,812,267.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,220,000.000	5,635,345.800	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,794,325.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,853,656.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	4,006,404.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,817,175.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	3,227,340.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,821,075.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	4,312,160.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20211115	4,000,000.000	4,106,240.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	6,900,000.000	8,200,719.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	4,520,000.000	6,447,328.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	3,371,460.000	

2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,000,000.000	2,160,460.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20211215	2,800,000.000	2,872,716.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	3,500,000.000	3,895,920.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,686,325.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20220115	3,000,000.000	3,079,320.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	7,610,592.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,000,000.000	3,085,410.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	4,289,680.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,786,125.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	6,295,791.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,774,400.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,531,231.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20220315	3,500,000.000	3,600,485.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,743,550.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20220415	3,700,000.000	3,806,782.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20220515	3,400,000.000	3,497,614.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	6,094,383.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	4,425,876.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,741,710.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	3,093,552.000	

1.75% United States Treasury Note/Bond 20220615	3,500,000.000	3,585,155.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	3,276,540.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,688,650.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	3,021,788.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20220715	4,000,000.000	4,102,960.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	5,500,000.000	5,802,885.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,699,200.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	6,900,000.000	7,414,740.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220815	3,500,000.000	3,580,500.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	5,351,778.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,945,012.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	4,148,720.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20220915	3,000,000.000	3,071,820.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,665,625.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	3,141,300.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20221015	2,900,000.000	2,966,033.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	1,047,650.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,550,000.000	2,582,359.500	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	3,200,130.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,850,000.000	6,356,376.000	

2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	5,371,155.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20211130	1,500,000.000	1,520,910.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	2,133,900.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	3,145,770.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20221215	3,000,000.000	3,089,640.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,687,875.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,648,625.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20211231	1,500,000.000	1,524,255.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230115	4,000,000.000	4,114,200.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	4,700,000.000	4,910,372.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,500,000.000	2,536,025.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230215	2,250,000.000	2,310,007.500	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	3,600,000.000	3,829,752.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	3,200,000.000	3,392,000.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	5,964,462.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20220228	200,000.000	202,460.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	311,013.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	5,380,336.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20230315	1,200,000.000	1,209,228.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	1,500,000.000	1,512,300.000	

0.375% United States Treasury Note/Bond 20220331	200,000.000	200,616.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20230415	13,200,000.000	13,227,324.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,609,360.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	7,800,000.000	7,670,130.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230515	3,500,000.000	3,496,010.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,706,750.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,200,000.000	3,199,616.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	5,700,000.000	5,684,382.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	5,168,184.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	4,814,450.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20220531	500,000.000	499,820.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,488,765.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,990,610.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20230615	5,500,000.000	5,510,505.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	5,500,000.000	5,497,635.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	7,500,000.000	7,470,675.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,486,595.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230715	1,000,000.000	998,630.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,386,162.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20220731	3,500,000.000	3,497,935.000	

	0.125% United States Treasury Note/Bond 20230815	800,000.000	798,904.000	
	0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	10,000,000.000	9,810,100.000	
	0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,936,300.000	
	1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	7,700,000.000	7,333,018.000	
	1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	5,800,000.000	5,570,668.000	
	0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,481,380.000	
	0.125% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,000,000.000	2,997,990.000	
	0.125% United States Treasury Note/Bond 20230915	2,000,000.000	1,996,640.000	
	0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	6,500,000.000	6,468,475.000	
	0.125% United States Treasury Note/Bond 20220930	3,000,000.000	2,998,230.000	
	0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,942,160.000	
	0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,484,390.000	
	0.125% United States Treasury Note/Bond 20231015	4,200,000.000	4,191,936.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 897,323,813.560 (93,222,970,991)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	2% United Kingdom Gilt 20250907	1,621,000.000	1,776,470.110	
	2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,682,000.000	2,785,089.240	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,586,888.000	
	0.5% United Kingdom Gilt 20220722	2,320,000.000	2,341,042.400	

1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,940,000.000	2,247,955.600	
1.75% United Kingdom Gilt 20370907	2,750,000.000	3,212,550.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,510,000.000	1,969,915.800	
1.25% United Kingdom Gilt 20270722	2,010,000.000	2,163,061.500	
0.75% United Kingdom Gilt 20230722	2,000,000.000	2,042,480.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20281022	2,500,000.000	2,787,450.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20711022	1,060,000.000	1,491,473.000	
1% United Kingdom Gilt 20240422	2,600,000.000	2,692,118.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,110,000.000	1,366,931.700	
1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	1,051,832.500	
0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,800,000.000	1,899,072.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20250607	2,600,000.000	2,674,360.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20411022	940,000.000	1,021,968.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20230131	2,300,000.000	2,306,394.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20301022	2,300,000.000	2,313,018.000	
0.5% United Kingdom Gilt 20611022	650,000.000	590,284.500	
0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,505,430.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,000,000.000	997,300.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	1,038,268.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	900,000.000	898,767.000	

0.125% United Kingdom Gilt 20240131	1,300,000.000	1,304,849.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,386,773.700	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,840,000.000	2,635,984.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,788,509.440	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,662,000.000	2,547,862.620	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,257,000.000	2,127,698.760	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,908,000.000	3,915,807.480	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,666,000.000	3,001,082.420	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,589,526.400	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,416,000.000	4,231,624.000	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,830,000.000	2,635,053.600	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	2,530,547.750	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	2,345,975.940	
4% United Kingdom Gilt 20220307	1,382,000.000	1,453,007.160	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,260,000.000	1,926,489.600	
4% United Kingdom Gilt 20600122	1,574,000.000	3,287,487.880	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,604,415.500	
3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	2,824,314.080	
1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,313,407.700	
3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,166,000.000	3,278,847.480	

	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,582,000.000	1,682,646.840	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,586,000.000	3,330,615.860	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,206,692.760	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	2,124,000.000	3,368,685.230	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 104,078,024.550 (14,420,010,301)	
イスラエル・ シュケル		イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	6.25% Israel Government Bond - Fixed 20261030	2,000,000.000	2,681,980.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20220131	2,000,000.000	2,127,620.000	
	4.25% Israel Government Bond - Fixed 20230331	1,800,000.000	1,971,540.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,900,000.000	3,254,320.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20240331	2,000,000.000	2,232,360.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,450,167.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,970,406.000	
	1.25% Israel Government Bond - Fixed 20221130	1,000,000.000	1,022,390.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,100,000.000	2,940,147.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,800,000.000	2,020,572.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20231130	1,500,000.000	1,557,210.000	
	0.75% Israel Government Bond - Fixed 20220731	1,000,000.000	1,010,450.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	1,900,000.000	1,936,062.000	

	0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	600,000.000	603,978.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	700,000.000	706,643.000	
	0.15% Israel Government Bond - Fixed 20230731	1,000,000.000	998,300.000	
イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 29,484,145.000 (924,033,104)	
オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	3,162,000.000	3,453,599.640	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	3,568,000.000	4,026,987.520	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	2,789,000.000	3,541,890.550	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	3,473,000.000	3,783,347.280	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	3,404,000.000	4,102,466.760	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	3,498,000.000	3,960,155.760	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,762,156.080	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	3,248,000.000	3,928,813.280	
	3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,497,185.340	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,568,308.510	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	1,008,667.440	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	2,672,000.000	3,075,926.240	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	3,678,000.000	4,117,778.460	
	3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,567,178.480	

	2% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20211221	800,000.000	816,808.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	2,800,000.000	3,249,008.000	
	2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	1,850,000.000	1,928,736.000	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	2,600,000.000	3,039,686.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	4,870,000.000	5,605,077.800	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	990,000.000	1,176,842.700	
	1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	3,000,261.200	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	900,000.000	922,986.000	
	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,406,528.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	2,700,000.000	2,725,866.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,500,000.000	1,454,475.000	
	0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	2,500,000.000	2,494,900.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,505,950.000	
	0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	2,700,000.000	2,715,687.000	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 75,437,273.040 (5,801,880,670)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	2.75% Canada Government International Bond 20641201	405,000.000	622,306.800	
	8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	586,000.000	866,770.180	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,401,315.650	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,771,852.420	

5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,645,623.320	
4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,363,000.000	2,111,818.570	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,751,000.000	1,818,413.500	
3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,461,000.000	2,219,244.390	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,292,156.250	
2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,512,904.000	
2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,846,303.410	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,252,491.320	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	1,023,951.990	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,279,853.600	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	1,440,000.000	1,445,990.400	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	1,750,000.000	1,774,080.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	1,200,000.000	1,328,856.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	4,300,000.000	4,445,770.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	1,300,000.000	1,362,205.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	2,110,000.000	2,559,303.400	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,386,603.200	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,276,524.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,462,034.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,630,469.500	

	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20211101	800,000.000	808,280.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	1,600,000.000	1,660,496.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220201	1,100,000.000	1,117,369.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220501	5,000.000	5,093.500	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,902,802.700	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220801	2,300,000.000	2,301,633.000	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20221101	700,000.000	700,280.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	900,000.000	880,461.000	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	500,000.000	494,980.000	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240401	500,000.000	499,405.000	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230201	1,500,000.000	1,500,300.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 54,207,941.100 (4,333,924,891)	
シンガポール・ ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	905,478.800	
	3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	788,000.000	827,494.560	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	623,000.000	683,804.800	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	958,042.070	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	512,000.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	671,000.000	713,474.300	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	724,768.000	

	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	728,250.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	568,802.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	908,848.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	488,340.000	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20220401	500,000.000	510,050.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	650,000.000	751,003.500	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	450,000.000	464,400.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	623,590.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	490,000.000	516,117.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	418,169.500	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	470,000.000	554,759.800	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 11,857,392.330 (921,200,810)	
スウェーデン・ クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,655,000.000	7,308,908.600	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,465,000.000	8,962,488.050	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	8,025,000.000	8,471,912.250	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	8,570,805.600	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	7,723,238.800	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	4,550,000.000	4,869,956.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	7,400,000.000	7,977,422.000	

	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	3,000,000.000	3,041,970.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 56,926,701.300 (695,644,290)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	13,662,000.000	デンマーク・クローネ 26,252,899.200	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	7,550,000.000	7,812,438.000	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,162,589.180	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	6,735,161.300	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	7,900,000.000	8,490,920.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	9,590,000.000	10,450,510.700	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20221115	4,300,000.000	4,377,099.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	2,200,000.000	2,416,040.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 71,697,657.380 (1,198,067,855)	
ノルウェー・ク ローネ	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	8,204,000.000	ノルウェー・クローネ 8,555,869.560	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,448,193.750	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,693,073.750	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	3,340,000.000	3,508,336.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,450,000.000	3,687,774.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,828,790.000	

	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	4,166,431.500	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	5,045,040.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 38,933,508.560 (457,858,061)	
ポーランド・ズ ロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	5.75% Poland Government Bond 20220923	2,309,000.000	2,547,612.060	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,835,403.210	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	3,520,094.800	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	3,320,000.000	3,424,580.000	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	3,850,000.000	4,051,509.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,870,000.000	3,101,092.400	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	5,517,600.000	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	3,400,000.000	3,666,356.000	
	Poland Government Bond 20220725	3,200,000.000	3,198,464.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	1,000,000.000	1,013,990.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	1,300,000.000	1,302,860.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,154,037.150	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,625,000.000	2,924,223.750	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	4,125,595.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	5,186,498.610	
ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 49,569,915.980	

			(1,373,582,372)
マレーシア・リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット
	3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	2,373,000.000	2,511,156.060
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,336,629.480
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,668,019.220
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,449,357.000
	3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	900,847.500
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	791,841.130
	3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	1,036,935.900
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,520,882.330
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,186,000.000	1,271,546.180
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	600,000.000	691,284.000
	4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,135,218.000
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,877,280.120
	3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,203,759.630
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,349,564.000
	3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,302,000.000	1,364,118.420
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,030,319.100
	3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650,000.000	702,819.000
	3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	352,000.000	358,934.400
	3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220310	1,600,000.000	1,645,120.000

4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	750,000.000	804,187.500	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	1,190,000.000	1,291,745.000	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,050,000.000	1,229,686.500	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,284,096.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	2,500,000.000	2,611,250.000	
4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,372,476.000	
4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	710,010.000	
3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	700,823.500	
3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,910,000.000	2,065,989.700	
4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,351,080.000	
3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	419,660.000	
3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,354,379.000	
3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,786,977.500	
4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	700,000.000	699,986.000	
2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	500,000.000	496,485.000	
マレーシア・リングgit 小計		マレーシア・リングgit 42,024,463.170 (1,072,884,545)	
メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
5.75% Mexican Bonos 20260305	20,290,000.000	20,912,903.000	
8% Mexican Bonos 20471107	18,300,000.000	20,526,744.000	
7.25% Mexican Bonos 20211209	29,000,000.000	29,831,430.000	
8% Mexican Bonos 20240905	23,800,000.000	26,462,268.000	
6.75% Mexican Bonos 20230309	7,200,000.000	7,556,256.000	
8% Mexican Bonos 20231207	30,033,000.000	32,936,290.110	

	10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	28,453,324.830	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	31,272,139.520	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	11,998,535.400	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	35,381,008.080	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	16,894,000.000	20,095,750.880	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	15,015,000.000	17,243,226.000	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	28,599,000.000	29,485,854.990	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	19,654,000.000	21,576,947.360	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	9,069,982.560	
	メキシコ・ペソ 小計		メキシコ・ペソ 342,802,660.730 (1,779,145,809)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	614,000.000	688,828.180	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	300,326.760	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	1,111,000.000	1,181,948.460	
	Finland Government Bond 20230915	200,000.000	204,182.000	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	496,317.600	
	Finland Government Bond 20220415	770,000.000	777,931.000	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	860,424.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	370,000.000	439,600.700	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	541,460.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	544,365.000	
	Finland Government Bond 20240915	200,000.000	205,468.000	
	0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	324,889.300	
	0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	427,464.000	

Finland Government Bond 20300915	500,000.000	520,805.000	
1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,502,611.200	
0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,220,178.640	
1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	1,090,630.240	
1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	409,632.000	
Austria Government Bond 20230715	900,000.000	917,172.000	
0.5% Austria Government Bond 20270420	1,780,000.000	1,910,794.400	
2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	1,225,756.800	
Austria Government Bond 20220920	400,000.000	405,328.000	
0.75% Austria Government Bond 20280220	900,000.000	987,930.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	980,000.000	1,063,770.400	
Austria Government Bond 20240715	800,000.000	820,816.000	
Austria Government Bond 20300220	680,000.000	708,016.000	
Austria Government Bond 20230420	1,000,000.000	1,017,270.000	
0.75% Austria Government Bond 20510320	700,000.000	842,667.000	
Austria Government Bond 20401020	400,000.000	404,544.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,815,432.470	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	2,026,936.920	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	1,412,176.080	
1% Belgium Government Bond 20260622	2,283,000.000	2,493,401.280	

1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	1,667,905.440	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	640,000.000	1,098,585.600	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	1,490,000.000	1,529,827.700	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,400,000.000	1,529,248.000	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,099,854.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	780,000.000	1,281,438.600	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	400,000.000	498,936.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,340,000.000	1,477,323.200	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	850,000.000	1,012,222.500	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,678,260.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	600,000.000	835,518.000	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,278,425.800	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	660,000.000	698,860.800	
Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,246,668.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,189,896.840	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,741,840.860	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	3,167,697.540	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,357,901.500	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	3,219,793.830	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,448,000.000	5,647,651.600	

4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,405,000.000	2,446,301.700	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,571,000.000	6,208,790.570	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	2,510,689.500	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,439,000.000	2,939,776.270	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	2,874,000.000	5,185,586.940	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	1,807,000.000	1,862,023.150	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,311,746.580	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	4,728,110.400	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,710,253.200	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,481,910.000	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,920,223.770	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,721,611.320	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,690,641.050	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,979,000.000	5,158,049.130	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,722,253.240	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	4,042,000.000	4,315,522.140	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,315,372.080	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	3,134,000.000	3,402,458.440	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,368,000.000	2,528,763.520	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,527,907.800	

0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	6,200,000.000	6,595,994.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,496,167.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	2,370,000.000	3,358,432.200	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	2,071,304.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,400,000.000	4,730,264.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,200,000.000	2,371,864.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	3,174,540.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,750,000.000	1,846,775.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,852,672.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	2,200,000.000	2,328,282.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	2,101,060.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	700,000.000	741,027.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,273,272.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20211210	800,000.000	806,000.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220311	300,000.000	302,820.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220610	100,000.000	101,134.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220916	100,000.000	101,352.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	1,160,000.000	1,171,681.200	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	2,100,000.000	2,129,988.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	5,730,000.000	5,838,125.100	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,900,000.000	1,943,985.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	1,920,000.000	1,971,417.600	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,752,343.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,482,632.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,387,837.000	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,985,000.000	2,428,627.650	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	4,033,051.000	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	5,031,553.680	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,927,000.000	5,073,837.420	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	4,574,703.140	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	3,853,105.200	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	4,104,384.860	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,097,000.000	4,696,800.800	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,564,000.000	6,786,176.760	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	3,983,062.260	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,861,998.140	
3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,630,000.000	3,819,703.800	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,199,000.000	6,415,150.080	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	3,694,000.000	3,905,222.920	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,588,000.000	4,495,071.320	

1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	3,347,000.000	3,554,547.470	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	5,086,000.000	5,617,741.300	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,887,000.000	7,540,952.650	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	4,899,000.000	5,385,372.720	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,679,171.200	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	5,528,871.880	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	4,920,000.000	5,882,598.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,787,000.000	4,025,164.430	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	3,869,000.000	4,674,951.390	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,287,000.000	1,993,112.550	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	3,800,000.000	3,996,802.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20220525	4,000,000.000	4,042,760.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	3,408,745.200	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,753,940.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	3,000,000.000	4,401,960.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	2,400,000.000	2,440,296.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,400,000.000	4,827,460.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	4,717,959.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	5,453,662.500	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	3,400,000.000	3,481,566.000	

FRENCH GOVERNMENT BOND 20220225	1,400,000.000	1,412,040.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,750,000.000	3,690,940.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	5,250,000.000	5,685,907.500	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	3,130,000.000	3,221,583.800	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	2,800,000.000	2,907,436.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230225	2,400,000.000	2,438,688.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	1,870,000.000	2,098,588.800	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	3,098,220.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	1,000,000.000	1,083,220.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	2,000,000.000	2,070,120.000	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	645,176.840	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,648,121.610	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,685,000.000	2,897,054.200	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	867,220.760	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,779,000.000	3,332,511.750	
2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,508,318.200	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,593,887.840	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,477,033.250	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,579,000.000	2,830,878.570	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,666,232.700	

0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,872,956.160	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,638,000.000	1,749,531.420	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220115	1,200,000.000	1,209,816.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,407,614.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,432,928.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,150,000.000	1,272,176.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,286,628.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	1,033,227.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,900,000.000	1,994,069.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	832,456.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	600,000.000	620,868.000	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,906,000.000	2,428,110.580	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,577,887.200	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,414,077.680	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	2,007,844.040	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	2,126,618.610	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220415	1,629,000.000	1,669,545.810	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,666,312.700	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	2,284,385.600	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,891,000.000	2,083,692.900	

1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	1,504,000.000	1,555,301.440	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	2,077,946.500	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	1,359,000.000	1,400,626.170	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,786,000.000	1,938,863.740	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	2,754,242.120	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,141,040.520	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	1,550,000.000	1,593,989.000	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	1,358,000.000	1,368,633.140	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	1,288,853.280	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,798,650.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,705,650.700	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,394,445.000	
1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	2,050,000.000	2,095,858.500	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,850,000.000	2,710,379.500	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	3,028,725.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	1,700,000.000	1,738,743.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,703,520.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,686,958.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,358,069.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,900,000.000	1,957,703.000	

1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,389,700.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	3,050,000.000	3,638,741.500	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	2,200,000.000	2,374,856.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,744,912.500	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,684,045.400	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,250,000.000	1,967,200.000	
1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,550,000.000	1,587,262.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	2,318,608.000	
1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	2,200,000.000	2,354,858.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,339,043.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,660,837.500	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	2,050,195.000	
0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230115	740,000.000	747,385.200	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,327,092.000	
0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,449,828.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,800,000.000	2,235,960.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,603,995.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230615	2,000,000.000	2,049,740.000	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	2,300,000.000	2,502,561.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	2,081,900.000	

1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,400,000.000	2,654,760.000	
0.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,300,000.000	1,322,555.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	1,700,000.000	1,780,903.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	800,000.000	819,944.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,400,000.000	1,539,146.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	1,300,000.000	1,339,754.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240115	100,000.000	100,807.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	800,000.000	845,072.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,754,000.000	3,912,883.200	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	4,399,511.270	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,852,441.500	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	3,522,489.300	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	3,943,682.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	3,375,604.680	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,560,647.560	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,581,630.200	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	3,740,695.960	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,555,932.500	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	2,012,000.000	2,150,787.760	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	2,657,000.000	2,934,098.530	

5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,960,000.000	2,183,734.000	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	3,222,170.000	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,119,234.480	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	3,079,724.970	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,535,167.000	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,526,968.100	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,838,000.000	3,615,753.900	
2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	1,593,000.000	1,637,253.540	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,478,186.780	
5% Belgium Government Bond 20350328	2,104,000.000	3,686,334.240	
4% Belgium Government Bond 20220328	877,000.000	932,101.910	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	2,937,709.960	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,280,018.740	
4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,436,966.720	
4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	1,167,979.800	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,441,253.460	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	843,000.000	1,556,557.350	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,684,982.950	
3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	1,074,880.710	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,300,554.950	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	624,000.000	690,318.720	

3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	689,029.980	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	1,213,127.960	
0.8% IRISH TREASURY 20220315	516,000.000	525,881.400	
2% IRISH TREASURY 20450218	881,000.000	1,260,376.220	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,166,308.080	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	703,824.000	
IRISH TREASURY 20221018	350,000.000	354,525.500	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	881,032.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	888,157.500	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	450,000.000	526,405.500	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	1,200,000.000	1,352,676.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	600,000.000	798,690.000	
0.4% IRISH TREASURY 20350515	250,000.000	266,800.000	
0.2% IRISH TREASURY 20270515	800,000.000	836,296.000	
0.2% IRISH TREASURY 20301018	500,000.000	524,290.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,209,351.000	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,673,000.000	2,878,731.100	
4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,137,027.500	
3.65% Austria Government Bond 20220420	797,000.000	845,441.660	
3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	943,652.240	
3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	831,304.240	
3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	1,102,105.690	
1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,028,297.340	
2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	1,054,296.240	
1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,019,244.520	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	813,766.680	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	489,171.390	

1.625% Finland Government Bond 20220915	312,000.000	325,459.680	
1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	470,110.760	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	651,586.650	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	578,366.280	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,984,550.440	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	2,234,878.250	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,435,744.520	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,474,592.640	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	3,083,179.290	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	2,927,843.840	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	2,827,727.000	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	3,030,000.000	3,329,970.000	
0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	2,080,000.000	2,109,598.400	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	2,123,098.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	2,200,000.000	2,777,016.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,290,383.000	
0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	1,600,000.000	1,632,512.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	1,900,000.000	2,124,485.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,300,000.000	1,910,831.000	
0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	2,400,000.000	2,458,632.000	

1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	1,900,000.000	2,130,223.000	
0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20211031	1,700,000.000	1,709,724.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	2,600,000.000	2,938,806.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	2,050,000.000	2,482,181.000	
0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	2,300,000.000	2,367,022.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,962,708.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,360,000.000	1,424,436.800	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20230430	2,460,000.000	2,494,169.400	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	1,500,000.000	1,529,820.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,200,000.000	1,242,744.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,569,176.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,900,000.000	3,241,997.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	900,000.000	996,453.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,979,000.000	3,261,609.690	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,854,000.000	2,954,812.500	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	2,158,000.000	3,906,131.060	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	1,969,773.380	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	2,473,000.000	4,434,459.950	
4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,189,000.000	2,717,949.960	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,671,338.900	

	5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,126,844.500	
	5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	1,958,000.000	2,214,204.300	
	4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	2,179,040.260	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,515,293.900	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	2,566,070.580	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,265,204.500	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,367,869.490	
	ユーロ 小計		ユーロ 718,538,449.590 (89,371,812,360)	
国債証券 合計			215,573,016,059 [215,573,016,059]	
合計			215,573,016,059 [215,573,016,059]	

- (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 249銘柄	100%	43.3%
イギリス・ポンド	国債証券 48銘柄	100%	6.7%
イスラエル・シェケル	国債証券 16銘柄	100%	0.4%
オーストラリア・ドル	国債証券 28銘柄	100%	2.7%
カナダ・ドル	国債証券 35銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券 18銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	100%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	100%	0.6%
ノルウェー・クローネ	国債証券 8銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 15銘柄	100%	0.6%
マレーシア・リングgit	国債証券 34銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	100%	0.8%
ユーロ	国債証券 328銘柄	100%	41.5%

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

	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	115,243,680	175,163,692
コール・ローン	301,630,437	169,116,291
国債証券	14,286,895,440	16,818,517,045
派生商品評価勘定	1,960	7,792,655
未収入金	38,007,169	-
未収利息	250,564,347	261,621,976
前払費用	13,301,008	12,620,593
流動資産合計	15,005,644,041	17,444,832,252
資産合計	15,005,644,041	17,444,832,252
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	405,301	-
未払金	230,016,759	-
未払解約金	188,144	621,030
その他未払費用	79	-
流動負債合計	230,610,283	621,030
負債合計	230,610,283	621,030
純資産の部		
元本等		
元本	1 10,492,913,460	12,662,214,054
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,282,120,298	4,781,997,168
元本等合計	14,775,033,758	17,444,211,222

純資産合計	14,775,033,758	17,444,211,222
負債純資産合計	15,005,644,041	17,444,832,252

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1. 1 期首	2018年12月1日	2019年12月3日
期首元本額	8,027,339,497円	10,492,913,460円
期中追加設定元本額	3,046,531,608円	3,184,635,734円
期中一部解約元本額	580,957,645円	1,015,335,140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（F0Fs用）（適格機関投資家 専用）	24,087,952円	77,516,508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）	210,581,869円	252,359,389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）	399,927,854円	356,825,524円
D - I ' s 新興国債券インデッ クス	56,386,451円	57,073,382円
i F r e e 新興国債券イン デックス	2,414,507,089円	3,104,279,120円
i F r e e 8資産バランス	1,569,459,867円	2,180,610,867円
D Cダイワ新興国債券インデッ クスファンド	5,613,762,483円	6,422,193,145円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券	170,695,726円	169,652,999円
ダイワ・ノーロード 新興国債 券ファンド	33,504,169円	41,703,120円
計	10,492,913,460円	12,662,214,054円
2. 期末日における受益権の総数	10,492,913,460口	12,662,214,054口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	2019年12月2日現在	2020年11月30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	159,731,019	59,013,920
合計	159,731,019	59,013,920

(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(2019年7月6日から2019年12月2日まで、及び2020年7月7日から2020年11月30日まで)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	2019年12月2日 現在				2020年11月30日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	5,053,160	-	5,051,200	1,960	-	-	-	-
ハンガリー・ フォリント	5,053,160	-	5,051,200	1,960	-	-	-	-
買 建	335,714,491	-	335,309,190	405,301	214,471,135	-	222,263,790	7,792,655
タイ・バーツ	36,445,267	-	36,398,010	47,257	-	-	-	-
トルコ・リラ	34,097,701	-	34,063,470	34,231	-	-	-	-
ハンガリー・ フォリント	-	-	-	-	25,927,782	-	26,784,770	856,988
ブラジル・ レアル	54,406,800	-	54,348,000	58,800	-	-	-	-
ポーランド・ ズロチ	63,354,377	-	63,299,960	54,417	64,192,604	-	67,061,700	2,869,096
メキシコ・ペソ	76,500,109	-	76,328,000	172,109	50,002,941	-	52,711,680	2,708,739
ルーマニア・ レイ	5,037,000	-	5,032,000	5,000	73,318,423	-	74,609,230	1,290,807
南アフリカ・ ランド	65,873,237	-	65,839,750	33,487	1,029,385	-	1,096,410	67,025
合計	340,767,651	-	340,360,390	403,341	214,471,135	-	222,263,790	7,792,655

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.4081円	1.3777円
(1万口当たり純資産額)	(14,081円)	(13,777円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	インドネシア・ルピア		インドネシア・ルピア	インドネシア・ルピア	
		8.25% Indonesia Treasury Bond 20360515	8,250,000,000.000	9,188,107,500.000	
		8.75% Indonesia Treasury Bond 20310515	6,000,000,000.000	7,053,120,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20320815	5,500,000,000.000	5,873,230,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20380515	7,300,000,000.000	7,640,618,000.000	
		8.125% Indonesia Treasury Bond 20240515	10,000,000,000.000	11,039,500,000.000	

8.375% Indonesia Treasury Bond 20390415	7,200,000,000.000	8,209,440,000.000	
8.25% Indonesia Treasury Bond 20290515	12,000,000,000.000	13,650,120,000.000	
7% Indonesia Treasury Bond 20300915	14,300,000,000.000	15,158,429,000.000	
6.5% Indonesia Treasury Bond 20250615	12,500,000,000.000	13,220,250,000.000	
7.5% Indonesia Treasury Bond 20350615	6,100,000,000.000	6,570,432,000.000	
11% Indonesia Treasury Bond 20250915	3,600,000,000.000	4,445,712,000.000	
10.5% Indonesia Treasury Bond 20300815	2,180,000,000.000	2,809,780,200.000	
9.5% Indonesia Treasury Bond 20310715	2,970,000,000.000	3,625,063,200.000	
8.375% Indonesia Treasury Bond 20260915	12,824,000,000.000	14,556,137,680.000	
8.25% Indonesia Treasury Bond 20320615	4,750,000,000.000	5,355,482,500.000	
7% Indonesia Treasury Bond 20270515	10,330,000,000.000	11,000,726,900.000	
7% Indonesia Treasury Bond 20220515	11,060,000,000.000	11,568,317,600.000	
5.625% Indonesia Treasury Bond 20230515	10,910,000,000.000	11,244,064,200.000	
6.125% Indonesia Treasury Bond 20280515	11,450,000,000.000	11,521,906,000.000	
6.625% Indonesia Treasury Bond 20330515	7,075,000,000.000	7,072,028,500.000	
8.375% Indonesia Treasury Bond 20340315	12,520,000,000.000	14,256,148,400.000	
8.375% Indonesia Treasury Bond 20240315	13,150,000,000.000	14,535,089,500.000	
9% Indonesia Treasury Bond 20290315	11,120,000,000.000	13,065,332,800.000	
インドネシア・ルピア 小計		インドネシア・ルピア 222,659,035,980.000 (1,647,676,866)	
ウルグアイ・ペソ		ウルグアイ・ペソ	ウルグアイ・ペソ

	9.875% Uruguay Government International Bond 20220620	5,300,000.000	5,495,199.000	
	8.5% Uruguay Government International Bond 20280315	2,800,000.000	2,962,260.000	
ウルグアイ・ペソ	小計		ウルグアイ・ペソ 8,457,459.000 (20,636,200)	
オフショア・人 民元		オフショア・人民元	オフショア・人民元	
	3.29% China Government Bond 20231018	4,300,000.000	4,347,515.000	
	3.22% China Government Bond 20251206	5,700,000.000	5,718,069.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	4,800,000.000	4,792,992.000	
	3.19% China Government Bond 20240411	6,700,000.000	6,729,145.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	8,200,000.000	8,197,868.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	6,800,000.000	6,842,704.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	7,000,000.000	6,989,010.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	7,000,000.000	6,908,160.000	
	2.94% China Government Bond 20241017	4,500,000.000	4,482,990.000	
	2.85% China Government Bond 20270604	7,600,000.000	7,393,052.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	6,300,000.000	5,970,006.000	
	1.99% China Government Bond 20250409	8,000,000.000	7,619,280.000	
	2.36% China Government Bond 20230702	7,300,000.000	7,164,439.000	
オフショア・人民元	小計		オフショア・人民元 83,155,230.000 (1,314,684,186)	
コロンビア・ペ ソ		コロンビア・ペソ	コロンビア・ペソ	

	9.85% Colombia Government International Bond 20270628	90,000,000.000	117,247,500.000	
	4.375% Colombia Government International Bond 20230321	45,000,000.000	45,828,900.000	
	7% Colombian TES 20220504	4,335,000,000.000	4,609,448,850.000	
	10% Colombian TES 20240724	3,650,000,000.000	4,443,583,000.000	
	6% Colombian TES 20280428	5,090,000,000.000	5,424,311,200.000	
	7.5% Colombian TES 20260826	4,310,000,000.000	4,993,910,800.000	
	7.75% Colombian TES 20300918	2,700,000,000.000	3,148,092,000.000	
	7% Colombian TES 20320630	3,000,000,000.000	3,264,300,000.000	
	6.25% Colombian TES 20251126	2,700,000,000.000	2,965,788,000.000	
	7.25% Colombian TES 20341018	2,200,000,000.000	2,427,700,000.000	
	5.75% Colombian TES 20271103	1,050,000,000.000	1,107,571,500.000	
	7.25% Colombian TES 20501026	400,000,000.000	423,416,000.000	
	コロンビア・ペソ 小計		コロンビア・ペソ 32,971,197,750.000 (949,570,495)	
タイ・パーツ		タイ・パーツ	タイ・パーツ	
	4.875% Thailand Government Bond 20290622	26,050,000.000	33,635,239.000	
	3.625% Thailand Government Bond 20230616	23,300,000.000	25,082,450.000	
	3.85% Thailand Government Bond 20251212	22,610,000.000	25,950,175.300	
	3.65% Thailand Government Bond 20211217	26,100,000.000	26,956,863.000	
	3.65% Thailand Government Bond 20310620	22,700,000.000	27,573,236.000	
	1.875% Thailand Government Bond 20220617	17,200,000.000	17,558,964.000	
	3.4% Thailand Government Bond 20360617	20,100,000.000	24,734,658.000	
	2.125% Thailand Government Bond 20261217	26,600,000.000	28,417,844.000	
	2% Thailand Government Bond 20221217	24,000,000.000	24,711,600.000	
	3.775% Thailand Government Bond 20320625	29,000,000.000	35,899,390.000	
	2.875% Thailand Government Bond 20460617	24,900,000.000	29,169,603.000	

	2.4% Thailand Government Bond 20231217	22,000,000.000	23,184,700.000	
	2.875% Thailand Government Bond 20281217	20,000,000.000	22,518,000.000	
	3.3% Thailand Government Bond 20380617	28,000,000.000	34,210,120.000	
	1.45% Thailand Government Bond 20241217	30,000,000.000	30,873,900.000	
	1.6% Thailand Government Bond 20291217	9,000,000.000	9,216,990.000	
	1.6% Thailand Government Bond 20350617	12,000,000.000	11,977,200.000	
	タイ・パーツ 小計		タイ・パーツ 431,670,932.300 (1,480,631,298)	
チェコ・コルナ	チェコ・コルナ	チェコ・コルナ	チェコ・コルナ	
	2.5% Czech Republic Government Bond 20280825	12,600,000.000	14,008,050.000	
	5.7% Czech Republic Government Bond 20240525	8,600,000.000	10,241,740.000	
	4.7% Czech Republic Government Bond 20220912	10,200,000.000	11,074,140.000	
	2.4% Czech Republic Government Bond 20250917	16,100,000.000	17,352,580.000	
	1% Czech Republic Government Bond 20260626	17,900,000.000	18,036,756.000	
	0.95% Czech Republic Government Bond 20300515	12,000,000.000	11,696,760.000	
	0.45% Czech Republic Government Bond 20231025	9,900,000.000	9,935,937.000	
	0.25% Czech Republic Government Bond 20270210	10,500,000.000	10,056,270.000	
	2.75% Czech Republic Government Bond 20290723	12,000,000.000	13,664,760.000	
	2% Czech Republic Government Bond 20331013	20,000,000.000	21,831,000.000	
	1.2% Czech Republic Government Bond 20310313	10,000,000.000	9,960,500.000	
チェコ・コルナ	小計		チェコ・コルナ 147,858,493.000	

			(700,849,257)
チリ・ペソ		チリ・ペソ	チリ・ペソ
4.5% BONOS TESORERIA PESOS 20260301	500,000,000.000		573,905,000.000
5% BONOS TESORERIA PESOS 20350301	570,000,000.000		677,621,700.000
6% BONOS TESORERIA PESOS 20430101	410,000,000.000		560,187,100.000
4.7% BONOS TESORERIA PESOS 20300901	410,000,000.000		479,376,100.000
4% BONOS TESORERIA PESOS 20230301	250,000,000.000		269,452,500.000
2.5% BONOS TESORERIA PESOS 20250301	650,000,000.000		683,826,000.000
チリ・ペソ 小計			チリ・ペソ 3,244,368,400.000 (439,287,481)
トルコ・リラ		トルコ・リラ	トルコ・リラ
9.5% Turkey Government Bond 20220112	1,660,000.000		1,582,776.800
8.5% Turkey Government Bond 20220914	790,000.000		731,666.400
7.1% Turkey Government Bond 20230308	2,780,000.000		2,466,082.400
10.4% Turkey Government Bond 20240320	680,000.000		642,600.000
9% Turkey Government Bond 20240724	1,630,000.000		1,481,050.600
8% Turkey Government Bond 20250312	2,690,000.000		2,326,769.300
10.6% Turkey Government Bond 20260211	2,570,000.000		2,456,277.500
9.2% Turkey Government Bond 20210922	2,010,000.000		1,930,926.600
11% Turkey Government Bond 20220302	2,400,000.000		2,321,016.000
11% Turkey Government Bond 20270224	2,970,000.000		2,846,774.700
10.7% Turkey Government Bond 20220817	1,900,000.000		1,814,652.000

	10.5% Turkey Government Bond 20270811	1,700,000.000	1,591,438.000	
	12.2% Turkey Government Bond 20230118	1,400,000.000	1,378,496.000	
	12.4% Turkey Government Bond 20280308	2,000,000.000	2,045,900.000	
	16.2% Turkey Government Bond 20230614	1,400,000.000	1,497,356.000	
トルコ・リラ 小計			トルコ・リラ 27,113,782.300 (359,257,615)	
ドミニカ・ペソ	9.75% Dominican Republic International Bond 20260605	ドミニカ・ペソ 11,000,000.000	ドミニカ・ペソ 11,717,090.000	
ドミニカ・ペソ 小計			ドミニカ・ペソ 11,717,090.000 (20,856,420)	
ハンガリー・ フォリント		ハンガリー・フォリント	ハンガリー・フォリント	
	3% Hungary Government Bond 20240626	98,500,000.000	105,109,350.000	
	3% Hungary Government Bond 20271027	170,000,000.000	185,376,500.000	
	1.75% Hungary Government Bond 20221026	140,000,000.000	142,980,600.000	
	2.75% Hungary Government Bond 20261222	130,000,000.000	139,300,200.000	
	6.75% Hungary Government Bond 20281022	88,000,000.000	120,458,800.000	
	3% Hungary Government Bond 20300821	145,000,000.000	156,803,000.000	
	2.5% Hungary Government Bond 20241024	160,000,000.000	168,424,000.000	
	3.25% Hungary Government Bond 20311022	162,000,000.000	178,677,900.000	
	1.5% Hungary Government Bond 20230823	40,000,000.000	40,630,400.000	
	1% Hungary Government Bond 20251126	130,000,000.000	128,271,000.000	
	6% Hungary Government Bond 20231124	131,800,000.000	151,385,480.000	

	7% Hungary Government Bond 20220624	125,000,000.000	137,568,750.000	
	5.5% Hungary Government Bond 20250624	142,500,000.000	169,758,825.000	
ハンガリー・フォリント 小計			ハンガリー・フォリント 1,824,744,805.000 (627,529,739)	
フィリピン・ペソ	6.25% Philippine Government International Bond 20360114	フィリピン・ペソ 10,000,000.000	フィリピン・ペソ 12,893,800.000	
フィリピン・ペソ 小計			フィリピン・ペソ 12,893,800.000 (27,850,608)	
ブラジル・リアル	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20230101	ブラジル・リアル 13,310,000.000	ブラジル・リアル 14,548,229.300	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20250101	10,690,000.000	11,969,486.100	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20270101	7,250,000.000	8,185,975.000	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20290101	4,300,000.000	4,915,588.000	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20310101	500,000.000	568,775.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20220101	7,200,000.000	6,948,288.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20220701	6,100,000.000	5,702,341.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20230701	12,700,000.000	10,970,514.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20240101	15,400,000.000	12,750,276.000	
ブラジル・リアル 小計			ブラジル・リアル 76,559,472.400 (1,489,847,334)	
ペルー・ソル	5.7% Peru Government Bond 20240812	ペルー・ソル 730,000.000	ペルー・ソル 858,144.200	

	6.35% Peru Government Bond 20280812	1,970,000.000	2,448,808.500	
	6.15% Peru Government Bond 20320812	1,850,000.000	2,184,332.000	
	5.94% Peru Government Bond 20290212	1,900,000.000	2,308,557.000	
	5.4% Peru Government Bond 20340812	1,250,000.000	1,349,375.000	
	5.35% Peru Government Bond 20400812	1,000,000.000	1,008,420.000	
	8.2% Peru Government Bond 20260812	1,565,000.000	2,113,548.150	
	6.9% Peru Government Bond 20370812	2,065,000.000	2,488,366.300	
	6.95% Peru Government Bond 20310812	1,920,000.000	2,423,232.000	
	ペルー・ソル 小計		ペルー・ソル 17,182,783.150 (495,379,639)	
ポーランド・ズ ロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	5.75% Poland Government Bond 20220923	3,610,000.000	3,983,057.400	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	5,990,000.000	6,617,332.700	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	4,140,000.000	4,597,221.600	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	3,200,000.000	3,300,800.000	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	4,500,000.000	4,735,530.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	5,500,000.000	5,942,860.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	5,450,000.000	6,213,000.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	1,200,000.000	1,202,640.000	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,530,000.000	2,818,394.700	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	4,500,000.000	5,086,350.000	

	3.25% Poland Government Bond 20250725	3,550,000.000	4,010,470.500	
ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 48,507,656.900 (1,344,147,173)	
マレーシア・リンギット		マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	3.948% Malaysia Government Investment Issue 20220414	3,400,000.000	3,500,368.000	
	4.258% Malaysia Government Investment Issue 20270726	1,800,000.000	1,984,410.000	
	4.094% Malaysia Government Investment Issue 20231130	2,000,000.000	2,126,040.000	
	4.369% Malaysia Government Investment Issue 20281031	1,700,000.000	1,888,122.000	
	4.13% Malaysia Government Investment Issue 20290709	1,600,000.000	1,757,840.000	
	3.655% Malaysia Government Investment Issue 20241015	1,700,000.000	1,799,042.000	
	3.726% Malaysia Government Investment Issue 20260331	1,400,000.000	1,498,112.000	
	3.465% Malaysia Government Investment Issue 20301015	1,500,000.000	1,599,345.000	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	2,350,000.000	2,519,505.500	
	4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,740,000.000	1,868,760.000	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	2,950,000.000	3,188,242.000	
	3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,400,000.000	1,466,794.000	
	3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	2,000,000.000	2,162,520.000	
	3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	1,200,000.000	1,223,640.000	
	4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	3,020,000.000	3,238,195.000	
	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	2,520,000.000	2,735,460.000	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	2,600,000.000	3,044,938.000	

	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	1,400,000.000	1,462,300.000	
	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	2,000,000.000	2,156,380.000	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,150,000.000	2,325,590.500	
	3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	1,100,000.000	1,154,065.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	800,000.000	833,464.000	
マレーシア・リングgit 小計			マレーシア・リングgit 45,533,133.000 (1,162,460,886)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	18,900,000.000	19,480,230.000	
	8% Mexican Bonos 20471107	14,500,000.000	16,264,360.000	
	7.25% Mexican Bonos 20211209	10,000,000.000	10,286,700.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	22,000,000.000	24,460,920.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	22,750,000.000	24,949,242.500	
	10% Mexican Bonos 20241205	24,150,000.000	28,728,115.500	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	30,230,000.000	33,801,372.200	
	10% Mexican Bonos 20361120	7,390,000.000	9,992,019.000	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	30,730,000.000	36,801,326.100	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	17,900,000.000	21,292,408.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	17,950,000.000	20,613,780.000	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	31,450,000.000	32,425,264.500	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	17,820,000.000	19,563,508.800	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	10,430,000.000	11,908,348.200	
メキシコ・ペソ 小計			メキシコ・ペソ 310,567,594.800 (1,611,845,817)	
ルーマニア・レイ		ルーマニア・レイ	ルーマニア・レイ	
	5.85% Romania Government Bond 20230426	1,430,000.000	1,537,221.400	
	4.75% Romania Government Bond 20250224	1,150,000.000	1,243,449.000	
	5.8% Romania Government Bond 20270726	2,100,000.000	2,460,339.000	

	3.5% Romania Government Bond 20221219	1,090,000.000	1,109,968.800	
	3.25% Romania Government Bond 20240429	1,600,000.000	1,631,248.000	
	3.4% Romania Government Bond 20220308	1,700,000.000	1,719,754.000	
	4.25% Romania Government Bond 20230628	1,500,000.000	1,562,145.000	
	5% Romania Government Bond 20290212	2,600,000.000	2,952,586.000	
	4.85% Romania Government Bond 20260422	1,000,000.000	1,097,410.000	
	3.65% Romania Government Bond 20310924	1,400,000.000	1,431,122.000	
	4.15% Romania Government Bond 20280126	800,000.000	858,632.000	
	ルーマニア・レイ 小計		ルーマニア・レイ 17,603,875.200 (448,898,818)	
ロシア・ルーブル		ロシア・ルーブル	ロシア・ルーブル	
	8.15% Russian Federal Bond - OFZ 20270203	46,760,000.000	53,555,630.800	
	7.6% Russian Federal Bond - OFZ 20220720	32,910,000.000	34,571,625.900	
	7% Russian Federal Bond - OFZ 20230125	14,400,000.000	15,135,840.000	
	7.05% Russian Federal Bond - OFZ 20280119	46,160,000.000	50,295,936.000	
	7% Russian Federal Bond - OFZ 20230816	33,800,000.000	35,738,430.000	
	8.5% Russian Federal Bond - OFZ 20310917	31,000,000.000	37,370,500.000	
	7.75% Russian Federal Bond - OFZ 20260916	54,100,000.000	60,873,320.000	
	7.4% Russian Federal Bond - OFZ 20221207	59,000,000.000	62,406,660.000	
	7.7% Russian Federal Bond - OFZ 20330323	46,100,000.000	52,623,150.000	
	7.1% Russian Federal Bond - OFZ 20241016	48,600,000.000	52,199,316.000	

	7% Russian Federal Bond - OFZ 20211215	49,000,000.000	50,302,910.000	
	6.5% Russian Federal Bond - OFZ 20240228	38,000,000.000	39,884,420.000	
	7.25% Russian Federal Bond - OFZ 20340510	45,000,000.000	49,550,850.000	
	6.9% Russian Federal Bond - OFZ 20290523	51,000,000.000	55,309,500.000	
	7.95% Russian Federal Bond - OFZ 20261007	51,000,000.000	57,761,070.000	
	7.4% Russian Federal Bond - OFZ 20240717	55,000,000.000	59,521,000.000	
	7.15% Russian Federal Bond - OFZ 20251112	59,000,000.000	64,050,990.000	
	7.65% Russian Federal Bond - OFZ 20300410	65,000,000.000	73,871,200.000	
	7.7% Russian Federal Bond - OFZ 20390316	38,000,000.000	44,099,380.000	
	6% Russian Federal Bond - OFZ 20271006	58,000,000.000	59,599,060.000	
	ロシア・ルーブル 小計		ロシア・ルーブル 1,008,720,788.700 (1,381,947,481)	
南アフリカ・ラ ンド		南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	
	10.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20261221	30,050,000.000	34,997,432.000	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	11,220,000.000	7,704,213.000	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	12,580,000.000	8,129,196.000	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	15,940,000.000	13,421,480.000	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	13,880,000.000	14,889,076.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	29,520,000.000	23,716,368.000	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	17,900,000.000	14,677,463.000	

	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	22,900,000.000	21,555,541.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	16,600,000.000	13,331,460.000	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	15,300,000.000	13,567,275.000	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	16,600,000.000	14,438,514.000	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	11,300,000.000	9,478,101.000	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 189,906,119.000 (1,295,159,732)	
国債証券 合計			16,818,517,045 [16,818,517,045]	
合計			16,818,517,045 [16,818,517,045]	

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における () 内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における [] 内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
インドネシア・ルピア	国債証券 23銘柄	100%	9.9%
ウルグアイ・ペソ	国債証券 2銘柄	100%	0.1%
オフショア・人民元	国債証券 13銘柄	100%	7.8%
コロンビア・ペソ	国債証券 12銘柄	100%	5.6%
タイ・バーツ	国債証券 17銘柄	100%	8.8%
チェコ・コルナ	国債証券 11銘柄	100%	4.2%
チリ・ペソ	国債証券 6銘柄	100%	2.6%
トルコ・リラ	国債証券 15銘柄	100%	2.1%
ドミニカ・ペソ	国債証券 1銘柄	100%	0.1%
ハンガリー・フォリント	国債証券 13銘柄	100%	3.7%
フィリピン・ペソ	国債証券 1銘柄	100%	0.2%
ブラジル・リアル	国債証券 9銘柄	100%	8.9%
ペルー・ソル	国債証券 9銘柄	100%	2.9%
ポーランド・ズロチ	国債証券 11銘柄	100%	8.0%
マレーシア・リンギット	国債証券 22銘柄	100%	6.9%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	100%	9.6%
ルーマニア・レイ	国債証券 11銘柄	100%	2.7%

ロシア・ルーブル	国債証券	20銘柄	100%	8.2%
南アフリカ・ランド	国債証券	12銘柄	100%	7.7%

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オンライン J - R E I T 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4期計算期間（2019年12月3日から2020年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン J - R E I T インデックス

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 2019年12月2日現在	第4期 2020年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,438,639	2,943,024
親投資信託受益証券	1,183,301,020	1,176,557,004
未収入金	1,250,000	5,630,000
流動資産合計	1,186,989,659	1,185,130,028
資産合計	1,186,989,659	1,185,130,028
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,727,469	6,651,910
未払受託者報酬	126,614	123,200
未払委託者報酬	1,203,228	1,170,751
その他未払費用	31,967	30,722
流動負債合計	3,089,278	7,976,583
負債合計	3,089,278	7,976,583
純資産の部		
元本等		
元本	1,887,949,644	1,110,904,033
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	295,950,737	66,249,412
(分配準備積立金)	282,743,991	215,394,846
元本等合計	1,183,900,381	1,177,153,445
純資産合計	1,183,900,381	1,177,153,445
負債純資産合計	1,186,989,659	1,185,130,028

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第3期		第4期	
	自	2018年12月1日 至 2019年12月2日	自	2019年12月3日 至 2020年11月30日
営業収益				
受取利息		4		9
有価証券売買等損益		256,614,885		217,453,016
営業収益合計		256,614,889		217,453,007
営業費用				
支払利息		2,294		1,045
受託者報酬		237,680		241,700
委託者報酬		2,258,740		2,296,950
その他費用		59,771		60,281
営業費用合計		2,558,485		2,599,976
営業利益又は営業損失（ ）		254,056,404		220,052,983
経常利益又は経常損失（ ）		254,056,404		220,052,983
当期純利益又は当期純損失（ ）		254,056,404		220,052,983
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（ ）		32,039,454		45,498,911
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		56,762,280		295,950,737
剰余金増加額又は欠損金減少額		40,997,488		18,779,927
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		40,997,488		18,779,927
剰余金減少額又は欠損金増加額		23,825,981		73,927,180
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		23,825,981		73,927,180
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		295,950,737		66,249,412

(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4期	
	自 2019年12月3日	至 2020年11月30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 2019年11月30日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2019年12月2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3期	第4期
	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1. 1 期首元本額	970,641,025円	887,949,644円
期中追加設定元本額	281,360,657円	494,302,320円
期中一部解約元本額	364,052,038円	271,347,931円
2. 計算期間末日における受益権の総数	887,949,644口	1,110,904,033口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第3期	第4期
	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(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(222,017,335円)、投資信託約款に規定される収益調整金(21,398,266円)及び分配準備積立金(60,726,656円)より分配対象額は304,142,257円(1万口当たり3,425.22円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(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(165,112,341円)及び分配準備積立金(215,394,846円)より分配対象額は380,507,187円(1万口当たり3,425.20円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	---	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第4期 自 2019年12月3日 至 2020年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第4期
	2020年11月30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3期	第4期
	2019年12月2日現在	2020年11月30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	236,058,629	191,152,216
合計	236,058,629	191,152,216

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第3期	第4期
2019年12月2日現在	2020年11月30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4期
自 2019年12月3日
至 2020年11月30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3期	第4期
	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3333円 (13,333円)	1.0596円 (10,596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	436,537,921	1,176,557,004	
親投資信託受益証券 合計			1,176,557,004	
合計			1,176,557,004	

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

	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,707,010,907	7,415,307,202

投資証券	2	371,984,252,300	354,620,139,760
派生商品評価勘定		245,738,352	-
未収配当金		2,107,027,911	2,644,533,611
前払金		-	55,594,060
流動資産合計		381,044,029,470	364,735,574,633
資産合計		381,044,029,470	364,735,574,633
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		9,567,580	105,960,070
前受金		267,609,560	-
未払金		1,849,124,532	1,102,948,832
未払解約金		41,938,000	30,108,000
その他未払費用		2,847	-
流動負債合計		2,168,242,519	1,239,016,902
負債合計		2,168,242,519	1,239,016,902
純資産の部			
元本等			
元本	1	111,967,387,978	134,869,045,089
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		266,908,398,973	228,627,512,642
元本等合計		378,875,786,951	363,496,557,731
純資産合計		378,875,786,951	363,496,557,731
負債純資産合計		381,044,029,470	364,735,574,633

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引
	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金
	原則として、投資証券の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	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1. 1 期首	2018年12月1日	2019年12月3日
期首元本額	83,907,324,720円	111,967,387,978円
期中追加設定元本額	34,399,601,474円	48,494,130,185円
期中一部解約元本額	6,339,538,216円	25,592,473,074円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ-REITオープン	6,057,835,517円	5,777,163,787円
ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	95,733,686,971円	118,500,417,494円
ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	313,885,834円	350,789,457円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2050	317,672円	1,276,931円
iFree J-REITイン デックス	127,364,041円	153,736,446円
iFree 8資産バランス	668,611,052円	1,100,172,090円
DC・ダイワJ-REITオー プン	5,212,558,406円	5,363,429,514円
DCダイワ・ターゲットイヤー 2020	2,011,107円	2,433,426円

	DCダイワ・ターゲットイヤー 2030	4,918,860円	4,849,856円
	DCダイワ・ターゲットイヤー 2040	1,754,845円	2,918,990円
	ダイワ・ノーロード J - RE ITファンド	83,956,499円	100,134,703円
	ダイワファンドラップ J - R EITインデックス	1,211,883,231円	1,696,174,777円
	ダイワJ - REITインデック ス(ダイワSMA専用)	1,043,820,781円	283,031,438円
	ダイワファンドラップオンライ ン J - REITインデックス	349,695,910円	436,537,921円
	ダイワ・インデックスセレクト J - REIT	1,155,087,252円	1,095,978,259円
	計	111,967,387,978円	134,869,045,089円
2.	期末日における受益権の総数	111,967,387,978口	134,869,045,089口
3.	2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金 代用有価証券として以下のとお り差入を行っております。 投資証券 1,149,400,000円	先物取引に係る差入委託証拠金 代用有価証券として以下のとお り差入を行っております。 投資証券 4,717,300,000円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年12月3日 至 2020年11月30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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年11月30日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	15,102,448,797	5,873,762,785
合計	15,102,448,797	5,873,762,785

(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（2019年9月18日から2019年12月2日まで、及び2020年9月16日から2020年11月30日まで）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	2019年12月2日 現在				2020年11月30日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	6,635,035,440	-	6,871,545,000	236,509,560	8,952,191,560	-	8,846,808,000	105,383,560
合計	6,635,035,440	-	6,871,545,000	236,509,560	8,952,191,560	-	8,846,808,000	105,383,560

(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)

	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1口当たり純資産額	3.3838円	2.6952円
(1万口当たり純資産額)	(33,838円)	(26,952円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	6,451	728,963,000	
	サンケイリアルエステート	9,659	943,684,300	

SOSILA物流リート投	8,794	1,095,732,400	
日本アコモデーションファンド投資法人	13,117	7,568,509,000	
M C U B S M i d C i t y 投資法人	48,300	3,984,750,000	
森ヒルズリート	46,369	6,394,285,100	
産業ファンド	55,798	9,820,448,000	
アドバンス・レジデンス	37,495	11,304,742,500	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト 投資法人	25,752	4,586,431,200	
A P I 投資法人	19,780	7,714,200,000	
G L P 投資法人	113,502	17,921,965,800	
コンフォリア・レジデンシャル	17,225	4,983,192,500	
日本プロロジスリート	59,729	19,561,247,500	
星野リゾート・リート	6,006	3,003,000,000	
O N E リート投資法人	6,153	1,509,330,900	
イオンリート投資	40,038	4,888,639,800	
ヒューリックリート投資法	31,780	4,506,404,000	
日本リート投資法人	12,822	4,494,111,000	
インベスコ・オフィス・Jリート	253,601	3,489,549,760	
積水ハウス・リート投資	116,103	8,661,283,800	
トーセイ・リート投資法人	8,733	937,924,200	
ケネディクス商業リート	14,515	3,357,319,500	
ヘルスケア&メディカル投資	8,419	1,077,632,000	
サムティ・レジデンシャル	7,599	803,214,300	
野村不動産マスターF	127,650	17,360,400,000	
いちごホテルリート投資	6,903	484,590,600	
ラサールロジポート投資	43,989	6,871,081,800	
スターアジア不動産投	40,558	1,950,839,800	
マリモ地方創生リート	3,698	421,572,000	
三井不ロジパーク	13,777	6,833,392,000	
大江戸温泉リート	6,371	436,413,500	
投資法人みらい	42,632	1,639,200,400	
森トラスト・ホテルリート投	8,549	986,554,600	
三菱地所物流REIT	8,882	3,539,477,000	
CREロジスティクスファンド	10,772	1,683,663,600	
ザイマックス・リート	6,048	552,182,400	
タカラレーベン不動産投	11,862	1,062,835,200	
伊藤忠アドバンスロジ	15,311	1,965,932,400	
日本ビルファンド	44,426	25,633,802,000	
ジャパンリアルエステイト	39,474	21,394,908,000	
日本リテールファンド	74,163	12,348,139,500	

オリックス不動産投資	78,651	12,269,556,000	
日本プライムリアルティ	24,576	7,532,544,000	
プレミア投資法人	35,654	4,264,218,400	
東急リアル・エステート	26,466	4,020,185,400	
グローバル・ワン不動産投資法人	27,411	2,752,064,400	
ユナイテッド・アーバン投資法人	84,420	9,961,560,000	
森トラスト総合リート	28,212	3,549,069,600	
インヴィンシブル投資法人	165,054	5,108,421,300	
フロンティア不動産投資	13,100	4,912,500,000	
平和不動産リート	24,221	2,829,012,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人	25,792	7,608,640,000	
福岡リート投資法人	20,415	2,835,643,500	
ケネディクス・オフィス投資法人	12,211	8,083,682,000	
いちごオフィスリート投資法人	32,749	2,298,979,800	
大和証券オフィス投資法人	8,410	5,037,590,000	
阪急阪神リート投資法人	17,830	2,148,515,000	
スタートプロシード投資法人	6,147	1,200,509,100	
大和ハウスリート投資法人	56,321	14,153,467,300	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	127,163	6,536,178,200	
大和証券リビング投資法人	49,800	4,467,060,000	
ジャパンエクセレント投資法人	36,628	4,549,197,600	
投資証券 合計		354,620,139,760	
合計		354,620,139,760	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

日本プロロジスリート	3,500口	野村不動産マスターF	5,000口
日本ビルファンド	2,850口	ジャパンリアルエステイト	2,300口

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【ダイワ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) 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4期計算期間（2019年12月3日から2020年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 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3期 2019年12月2日現在	第4期 2020年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,912,793	1,744,262
親投資信託受益証券	851,368,742	822,816,971
派生商品評価勘定	23,716	4,460,770
未収入金	69,893	597,644
流動資産合計	853,375,144	829,619,647
資産合計	853,375,144	829,619,647
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	43,920	5,103,706
未払金	12,112,627	70,159
未払解約金	350,736	808,080
未払受託者報酬	90,018	81,847
未払委託者報酬	1,238,215	1,125,873
その他未払費用	28,645	20,377
流動負債合計	13,864,161	7,210,042
負債合計	13,864,161	7,210,042
純資産の部		
元本等		
元本	1,715,401,824	1,797,988,165
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	124,109,159	24,421,440
（分配準備積立金）	103,204,083	73,575,145
元本等合計	839,510,983	822,409,605
純資産合計	839,510,983	822,409,605
負債純資産合計	853,375,144	829,619,647

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第3期		第4期	
	自	2018年12月1日 至 2019年12月2日	自	2019年12月3日 至 2020年11月30日
営業収益				
受取利息		1		18
有価証券売買等損益		96,907,219		113,051,771
為替差損益		9,104,674		25,495,043
その他収益		2,659		-
営業収益合計		106,014,553		87,556,710
営業費用				
支払利息		2,347		824
受託者報酬		174,346		165,818
委託者報酬		2,398,258		2,281,302
その他費用		60,506		41,299
営業費用合計		2,635,457		2,489,243
営業利益又は営業損失()		103,379,096		90,045,953
経常利益又は経常損失()		103,379,096		90,045,953
当期純利益又は当期純損失()		103,379,096		90,045,953
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()		14,675,884		43,671,476
期首剰余金又は期首欠損金()		23,578,880		124,109,159
剰余金増加額又は欠損金減少額		20,541,677		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		20,541,677		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		8,714,610		53,313,242
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		8,714,610		34,530,997
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		18,782,245
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		124,109,159		24,421,440

(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4期	
	自 2019年12月3日	至 2020年11月30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. 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	計算期間末日 2019年11月30日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2019年12月2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3期	第4期
	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1. 1 期首元本額	743,572,984円	715,401,824円
期中追加設定元本額	207,870,721円	336,517,235円
期中一部解約元本額	236,041,881円	253,930,894円
2. 計算期間末日における受益権の総数	715,401,824口	797,988,165口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第3期	第4期
	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日
1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(345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(88,702,183円)、投資信託約款に規定される収益調整金(20,905,076円)及び分配準備積立金(14,501,555円)より分配対象額は124,109,159円(1万口当たり1,734.82円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(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(55,582,892円)及び分配準備積立金(73,575,145円)より分配対象額は129,158,037円(1万口当たり1,618.55円)であり、分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第4期
	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>外貨建資産について為替変動リスクを回避することを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第4期
	2020年11月30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	第3期	第4期
	2019年12月2日現在	2020年11月30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	89,632,068	74,835,738
合計	89,632,068	74,835,738

(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	第3期				第4期			
	2019年12月2日 現在				2020年11月30日 現在			
	契約額等	時価	評価損益		契約額等	時価	評価損益	
(円)	(円)	(円)		(円)	(円)	(円)		
	うち				うち			
	1年超				1年超			

市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	855,519,658	-	855,539,862	20,204	728,481,899	-	729,124,835	642,936
アメリカ・ドル	634,566,706	-	634,584,119	17,413	542,901,697	-	538,555,563	4,346,134
イギリス・ポンド	45,341,076	-	45,334,152	6,924	40,820,300	-	41,783,664	963,364
イスラエル・ シケル	699,176	-	719,340	20,164	462,946	-	473,083	10,137
オーストラリア・ ドル	55,821,673	-	55,819,406	2,267	53,121,875	-	55,714,050	2,592,175
カナダ・ドル	16,559,757	-	16,560,390	633	13,981,395	-	14,253,302	271,907
シンガポール・ ドル	31,183,654	-	31,180,303	3,351	28,980,523	-	29,417,416	436,893
ニュージー ランド・ドル	3,578,827	-	3,578,352	475	3,887,363	-	4,115,530	228,167
ユーロ	50,172,975	-	50,168,616	4,359	30,856,323	-	31,455,702	599,379
香港・ドル	17,595,814	-	17,595,184	630	13,469,477	-	13,356,525	112,952
合計	855,519,658	-	855,539,862	20,204	728,481,899	-	729,124,835	642,936

(注) 1. 時価の算定方法

- (1) 計算期間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。

計算期間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。

計算期間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。

- ・ 計算期間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。
- ・ 計算期間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) 計算期間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、計算期間
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。

（関連当事者との取引に関する注記）

第4期 自 2019年12月3日 至 2020年11月30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3期 2019年12月2日現在	第4期 2020年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.1735円	1.0306円
（1万口当たり純資産額）	(11,735円)	(10,306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	373,261,192	822,816,971	
親投資信託受益証券 合計			822,816,971	
合計			822,816,971	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「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。

（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

	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	68,199,620	99,810,361
コール・ローン	629,102,779	327,488,117
投資信託受益証券	556,331,509	154,336,387
投資証券	25,887,626,426	28,032,952,855
派生商品評価勘定	10,879,213	34,699,627
未収入金	12,311,686	2,614,233
未収配当金	49,262,263	67,602,662
差入委託証拠金	106,888,475	246,329,361
流動資産合計	27,320,601,971	28,965,833,603
資産合計	27,320,601,971	28,965,833,603
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	9,460,207	764,038
未払金	99,346,566	52,121,743
未払株式払込金	-	5,533,125
未払解約金	446,040	7,567,800
その他未払費用	365	-
流動負債合計	109,253,178	65,986,706
負債合計	109,253,178	65,986,706
純資産の部		
元本等		
元本	1	10,530,038,419
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		16,681,310,374
元本等合計		28,899,846,897

純資産合計	27,211,348,793	28,899,846,897
負債純資産合計	27,320,601,971	28,965,833,603

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(3) 投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1. 1 期首	2018年12月1日	2019年12月3日
期首元本額	8,618,915,071円	10,530,038,419円
期中追加設定元本額	3,230,356,134円	5,074,786,065円
期中一部解約元本額	1,319,232,786円	2,494,533,516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R	4,865,906,045円	6,132,754,799円
EIT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 R E I T インデックス (為替ヘッジなし)	735,435,579円	1,093,059,962円
ダイワファンドラップオンライン 外国 R E I T インデックス (為替ヘッジあり)	329,451,568円	373,261,192円
ダイワファンドラップオンライン 外国 R E I T インデックス (為替ヘッジなし)	230,518,876円	273,443,934円
D - I ' s グローバル R E I T インデックス	1,341,811円	1,889,346円
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2050	351,124円	1,550,762円
i F r e e 外国 R E I T インデックス	98,214,754円	123,942,403円
i F r e e 8 資産バランス	868,450,594円	1,373,085,035円
グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)	386,949円	58,109,678円
グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)	386,949円	22,959,674円
D C ダイワ・グローバル R E I T インデックスファンド	2,208,215,204円	2,665,764,298円
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2020	2,681,724円	3,110,210円
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2030	6,545,141円	6,033,482円
D C ダイワ・ターゲットイヤー 2040	2,040,991円	3,580,507円
ダイワバランスファンド2020-07(適格機関投資家専用)	- 円	249,211,041円
ダイワ・インデックスセレクト グローバル R E I T	241,290,100円	253,711,264円
ダイワ・ノーロード グローバル R E I T ファンド	34,970,209円	52,204,021円
ダイワ外国 R E I T インデックス(為替ヘッジあり)(ダイワ S M A 専用)	690,658,642円	217,637,598円
ダイワ外国 R E I T インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワ S M A 専用)	213,192,159円	204,981,762円
計	10,530,038,419円	13,110,290,968円

2. 期末日における受益権の総数	10,530,038,419口	13,110,290,968口
------------------	-----------------	-----------------

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所(外国の取引所)における不動産投信指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2020年11月30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。

	<p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
--	--

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	906,505	7,312,921
投資証券	2,470,093,181	3,274,154,878
合計	2,469,186,676	3,266,841,957

（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（2018年12月1日から2019年12月2日まで、及び2019年12月3日から2020年11月30日まで）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	2019年12月2日 現在				2020年11月30日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
不動産投信 指数先物取引								
買 建	792,469,626	-	793,982,167	1,512,541	690,773,738	-	723,083,683	32,309,945
合計	792,469,626	-	793,982,167	1,512,541	690,773,738	-	723,083,683	32,309,945

（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	2019年12月2日 現在				2020年11月30日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	657,354,235	-	657,260,700	93,535	321,323,856	-	322,949,500	1,625,644
アメリカ・ドル	488,897,170	-	488,834,300	62,870	165,914,658	-	165,153,300	761,358
オーストラリア・ドル	3,704,960	-	3,704,500	460	-	-	-	-
カナダ・ドル	4,120,010	-	4,119,500	510	-	-	-	-
シンガポール・ドル	-	-	-	-	14,760,758	-	14,759,200	1,558
ニュージーランド・ドル	3,522,635	-	3,522,000	635	-	-	-	-
ユーロ	157,109,460	-	157,080,400	29,060	140,648,440	-	143,037,000	2,388,560
合計	657,354,235	-	657,260,700	93,535	321,323,856	-	322,949,500	1,625,644

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1口当たり純資産額	2,5842円	2,2044円
(1万口当たり純資産額)	(25,842円)	(22,044円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REAL ESTATE ETF	17,500.000	1,485,575.000	
		アメリカ・ドル 小計		1,485,575.000 (154,336,387)	
投資信託受益証券 合計				154,336,387 [154,336,387]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	29,500	572,890.000	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	13,700	76,720.000	
		URBAN EDGE PROPERTIES	21,982	301,373.220	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	25,400	374,904.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	31,400	5,271,118.000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	71,847	6,146,510.850	
		BOSTON PROPERTIES INC	31,400	3,216,302.000	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	32,467	999,334.260	
		VORNADO REALTY TRUST	35,064	1,414,131.120	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	18,000	395,640.000	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13,900	468,569.000	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	4,800	208,512.000	
		QTS REALTY TRUST INC-CL A	13,600	816,000.000	
EQUITY RESIDENTIAL	76,500	4,528,800.000			

APPLE HOSPITALITY REIT INC	43,800	585,606.000	
EPR PROPERTIES	16,100	611,800.000	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,500	32,830.000	
CITY OFFICE REIT INC	9,300	84,444.000	
GLOBAL NET LEASE INC	19,833	336,764.340	
EQUINIX INC	19,600	13,730,192.000	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	15,529	438,073.090	
CHATHAM LODGING TRUST	7,400	82,880.000	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	7,100	128,013.000	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	12,300	799,500.000	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	25,700	349,006.000	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	4,900	225,008.000	
HOST HOTELS & RESORTS INC	157,600	2,304,112.000	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	59,008	1,683,498.240	
CORESITE REALTY CORP	9,500	1,188,925.000	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	34,100	916,267.000	
RLJ LODGING TRUST	35,871	451,615.890	
FARMLAND PARTNERS INC	2,900	23,722.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	46,100	809,055.000	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	14,000	152,460.000	
CYRUSONE INC	25,900	1,812,223.000	
KIMCO REALTY CORP	94,400	1,422,608.000	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9,800	133,672.000	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	48,850	1,289,151.500	
WHITESTONE REIT	8,500	67,660.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	46,349	1,926,264.440	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	27,200	443,360.000	
PARK HOTELS & RESORTS INC	51,680	864,089.600	
COLONY CAPITAL INC	105,011	457,847.960	
INVITATION HOMES INC	125,297	3,603,541.720	
JBG SMITH PROPERTIES	25,132	805,983.240	
ALEXANDER & BALDWIN INC	16,500	268,125.000	
CLIPPER REALTY INC	1,400	8,736.000	
GLADSTONE LAND CORP	4,500	67,230.000	
AMERICOLD REALTY TRUST	45,100	1,533,400.000	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	14,300	312,455.000	
VICI PROPERTIES INC	118,200	3,035,376.000	
RETAIL VALUE INC	2,815	43,266.550	
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	12,500	206,125.000	

BRT APARTMENTS CORP	1,300	17,641.000	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	10,100	165,034.000	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4,900	768,271.000	
SAFEHOLD INC	3,200	213,664.000	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	29,960	31,757.600	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	22,400	181,440.000	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	22,900	478,152.000	
CORECIVIC INC	25,224	193,720.320	
COREPOINT LODGING INC	6,700	45,292.000	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	3,400	45,084.000	
STORE CAPITAL CORP	50,500	1,683,165.000	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2,400	25,896.000	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	22,400	203,840.000	
LIFE STORAGE INC	10,400	1,128,088.000	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	10,100	304,818.000	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	20,082	258,254.520	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	9,200	73,968.000	
PARAMOUNT GROUP INC	36,400	359,268.000	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	29,200	283,240.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	27,400	1,331,914.000	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	23,700	342,702.000	
STAG INDUSTRIAL INC	32,500	977,275.000	
VENTAS INC	83,379	3,993,854.100	
CARETRUST REIT INC	21,503	424,254.190	
GEO GROUP INC/THE	27,400	266,054.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	64,300	1,037,802.000	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	10,600	252,916.000	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	44,987	769,727.570	
UMH PROPERTIES INC	8,600	122,636.000	
IRON MOUNTAIN INC	63,800	1,698,356.000	
TERRENO REALTY CORP	15,200	886,616.000	
VEREIT INC	240,908	1,768,264.720	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	22,320	842,803.200	
SUN COMMUNITIES INC	21,800	3,021,698.000	
ACADIA REALTY TRUST	17,011	251,082.360	
ALEXANDER'S INC	400	113,024.000	
PROLOGIS INC	163,619	16,460,071.400	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	26,200	4,248,068.000	
BRANDYWINE REALTY TRUST	38,300	440,067.000	

SAUL CENTERS INC	2,400	76,608.000	
MACK-CALI REALTY CORP	20,200	283,204.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	21,800	2,130,732.000	
COUSINS PROPERTIES INC	32,906	1,128,675.800	
SITE CENTERS CORP	31,878	340,775.820	
DUKE REALTY CORP	82,100	3,151,819.000	
EASTGROUP PROPERTIES INC	8,700	1,223,133.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	14,467	3,616,894.670	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	27,800	1,180,944.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	15,400	1,360,898.000	
GETTY REALTY CORP	7,703	220,922.040	
WELLTOWER INC	93,200	6,015,128.000	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	120,300	3,594,564.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	23,100	897,897.000	
SERVICE PROPERTIES TRUST	36,500	449,315.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,100	910,525.000	
EQUITY COMMONWEALTH	27,375	726,532.500	
KILROY REALTY CORP	23,200	1,463,920.000	
LTC PROPERTIES INC	8,400	318,780.000	
LEXINGTON REALTY TRUST	60,000	622,200.000	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	25,328	3,140,672.000	
MACERICH CO/THE	21,979	238,472.150	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	37,500	2,201,625.000	
NATL HEALTH INVESTORS INC	9,600	630,720.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	38,400	1,474,176.000	
REALTY INCOME CORP	77,117	4,753,491.880	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	24,000	653,760.000	
PUBLIC STORAGE	33,800	7,437,014.000	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	4,300	570,610.000	
REGENCY CENTERS CORP	34,920	1,637,398.800	
RPT REALTY	17,800	137,772.000	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	17,600	174,768.000	
SL GREEN REALTY CORP	16,400	993,020.000	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	49,000	242,550.000	
TAUBMAN CENTERS INC	13,300	568,841.000	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	6,000	85,980.000	
UDR INC	65,300	2,561,066.000	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,600	162,968.000	
WP CAREY INC	38,500	2,690,765.000	

WASHINGTON REIT	17,800	427,734.000	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	25,900	571,354.000	
AGREE REALTY CORP	11,700	770,796.000	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	50,748	1,819,315.800	
CUBESMART	43,300	1,379,971.000	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	45,526	493,957.100	
DIGITAL REALTY TRUST INC	59,778	8,173,445.940	
EXTRA SPACE STORAGE INC	28,600	3,146,000.000	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7,875	67,410.000	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,460	175,348.800	
KITE REALTY GROUP TRUST	18,950	281,976.000	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	21,000	310,800.000	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,233	39,568.760	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	30,500	1,234,945.000	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6,300	114,282.000	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	42,342	336,195.480	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	117,100	2,291,647.000	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	21,000	102,480.000	
DOUGLAS EMMETT INC	36,500	1,165,445.000	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	46,700	394,148.000	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	320,562	238,818.690	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	151,400	106,737.000	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	12,330.000	
PRIME US REIT	99,000	76,725.000	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 197,536,038.230 (20,522,019,012)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	
ASSURA PLC	594,520	433,999.600	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	129,570	94,197.390	
STANDARD LIFE INV PROP INC	100,000	55,200.000	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	177,710	124,574.710	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	121,110	86,351.430	
REGIONAL REIT LTD	81,310	60,982.500	
NEWRIVER REIT PLC	69,330	52,274.820	
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	183,290	249,274.400	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	135,490	138,199.800	
CUSTODIAN REIT PLC	89,420	76,811.780	

	GCP STUDENT LIVING PLC	96,860	136,572.600	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	67,900	73,332.000	
	LXI REIT PLC	118,038	136,924.080	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	75,200	78,960.000	
	AEW UK REIT PLC	25,610	19,566.040	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	180,000	129,240.000	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	150,000	160,125.000	
	RDI REIT PLC	41,036	38,779.020	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	166,381	1,106,600.030	
	SEGREO PLC	263,740	2,377,352.360	
	HAMMERSON PLC	811,984	181,478.420	
	UNITE GROUP PLC/THE	87,260	862,565.100	
	BRITISH LAND CO PLC	208,520	980,252.520	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	53,581	346,990.550	
	DERWENT LONDON PLC	24,390	753,163.200	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	283,370	394,451.040	
	WORKSPACE GROUP PLC	26,460	185,220.000	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	46,350	353,187.000	
	SHAFTESBURY PLC	53,850	286,751.250	
	BIG YELLOW GROUP PLC	36,960	418,387.200	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	203,150	448,555.200	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	121,600	43,168.000	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	370,260	596,118.600	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 11,479,605.640 (1,590,499,361)	
イスラエル・ シュケル	REIT 1 LTD	28,840	455,960.400	イスラエル・シュケル
	イスラエル・シュケル 小計		イスラエル・シュケル 455,960.400 (14,289,799)	
オーストラリ ア・ドル	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	78,380	235,140.000	オーストラリア・ドル
	CROMWELL PROPERTY GROUP	435,284	396,108.440	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	95,110	299,596.500	
	AVENTUS GROUP	88,000	237,600.000	
	RURAL FUNDS GROUP	78,595	204,347.000	
	WAYPOINT REIT	177,830	489,032.500	

	CHARTER HALL LONG WALE REIT	98,668	483,473.200	
	CENTURIA OFFICE REIT	84,950	192,836.500	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	97,590	247,878.600	
	INVESTEC AUSTRALIA PROPERTY	119,630	155,519.000	
	HOME CONSORTIUM	35,000	132,650.000	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	17,500	23,537.500	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	241,860	623,998.800	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	70,547	263,140.310	
	NATIONAL STORAGE REIT	206,195	391,770.500	
	APN INDUSTRIA REIT	29,760	89,875.200	
	GDI PROPERTY GROUP	123,310	149,205.100	
	SCENTRE GROUP	1,194,910	3,441,340.800	
	ARENA REIT	79,890	223,692.000	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	38,300	121,794.000	
	BWP TRUST	105,550	458,087.000	
	DEXUS	251,730	2,471,988.600	
	GPT GROUP	444,000	2,104,560.000	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	120,400	463,540.000	
	MIRVAC GROUP	908,060	2,370,036.600	
	STOCKLAND	550,010	2,541,046.200	
	ABACUS PROPERTY GROUP	81,120	257,150.400	
	GOODMAN GROUP	381,710	7,103,623.100	
	VICINITY CENTRES	878,900	1,467,763.000	
	CHARTER HALL GROUP	105,060	1,399,399.200	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	68,660	318,582.400	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 29,358,312.450 (2,257,947,811)	
カナダ・ドル	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	13,100	141,742.000	カナダ・ドル
	SLATE GROCERY REIT	8,100	100,683.000	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	10,200	179,418.000	
	SLATE OFFICE REIT	5,100	21,573.000	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4,200	80,766.000	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	19,700	240,931.000	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	17,600	233,376.000	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	11,200	74,144.000	
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	8,500	151,810.000	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	4,100	45,018.000	

	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6,200	474,610.000	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	18,300	236,070.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	16,200	229,554.000	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	24,700	385,320.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	36,800	489,440.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4,200	68,754.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	11,900	178,262.000	
	PLAZA RETAIL REIT	11,100	40,959.000	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	16,300	395,275.000	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	19,500	1,001,130.000	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	21,790	199,814.300	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	32,566	467,322.100	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	34,300	623,231.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,400	116,100.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,700	164,406.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	9,500	139,650.000	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	13,300	545,034.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 7,024,392.400 (561,600,172)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	KEPPEL DC REIT	293,783	837,281.550	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	126,200	59,945.000	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	455,000	423,150.000	
	AIMS APAC REIT	89,000	108,580.000	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	121,800	63,945.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	591,190	821,754.100	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	86,000	69,660.000	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	208,900	141,007.500	
	EC WORLD REIT	57,000	41,040.000	
	IREIT GLOBAL	105,124	67,804.980	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	10,046	448.470	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	722,377	2,181,578.540	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,029,422	2,048,549.780	
	SUNTEC REIT	473,400	724,302.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	608,200	1,192,072.000	
	KEPPEL REIT	375,400	401,678.000	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	417,456	429,979.680	

	ESR-REIT	559,902	226,760.310	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	161,600	202,000.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	211,776	497,673.600	
	STARHILL GLOBAL REIT	308,800	149,768.000	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	179,396	222,451.040	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	86,300	341,748.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	467,200	42,048.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	384,780	1,135,101.000	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	244,500	152,812.500	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	498,484	1,031,861.880	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	182,100	117,454.500	
	SPH REIT	220,600	183,098.000	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	202,100	101,050.000	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	219,400	76,790.000	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	541,063	208,309.250	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 14,301,702.680 (1,111,099,281)	
ニュージーランド・ドル			ニュージーランド・ドル	
	ARGOSY PROPERTY LTD	158,520	237,780.000	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	357,920	440,241.600	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	76,800	228,864.000	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	248,220	598,210.200	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	245,820	427,726.800	
	ニュージーランド・ドル 小計		ニュージーランド・ドル 1,932,822.600 (141,308,660)	
ユーロ			ユーロ	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	34,820	478,426.800	
	HAMBORNER REIT AG	11,980	107,256.940	
	WERELDHAVE NV	6,470	75,116.700	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	26,770	1,690,793.200	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	8,230	126,248.200	
	NSI NV	3,231	108,884.700	
	VASTNED RETAIL NV	3,750	87,187.500	
	ICADE	5,940	355,806.000	
	CARMILA	10,000	123,600.000	
	ALTAREA	740	102,120.000	
	GECINA SA	10,521	1,337,219.100	

	KLEPIERRE	39,940	774,037.200	
	COVIVIO	8,992	647,424.000	
	MERCIALYS	4,030	28,492.100	
	AEDIFICA	6,256	606,832.000	
	COFINIMMO	5,300	661,440.000	
	BEFIMMO	5,070	192,153.000	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	4,610	104,877.500	
	RETAIL ESTATES	1,940	116,400.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	25,480	718,026.400	
	CARE PROPERTY INVEST	4,900	133,770.000	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	2,700	136,350.000	
	MONTEA	2,150	208,335.000	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,240	22,370.400	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	10,530	51,597.000	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	50,033	406,017.790	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	66,100	524,503.500	
	CROMWELL EUROPEAN REIT	294,600	142,881.000	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	82,050	115,690.500	
	HIBERNIA REIT PLC	116,240	134,838.400	
ユーロ 小計			ユーロ 10,318,694.930 (1,283,439,275)	
韓国・ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6,000	44,460,000.000	韓国・ウォン
	LOTTE REIT CO LTD	17,960	96,984,000.000	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	17,960	73,456,400.000	
韓国・ウォン 小計			韓国・ウォン 214,900,400.000 (20,243,618)	
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	349,000	1,333,180.000	香港・ドル
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	193,000	717,960.000	
	FORTUNE REIT	311,000	2,183,220.000	
	PROSPERITY REIT	300,000	714,000.000	
	LINK REIT	476,900	32,667,650.000	
	CHAMPION REIT	431,000	1,973,980.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 39,589,990.000 (530,505,866)	
投資証券 合計			28,032,952,855	

		[28,032,952,855]	
合計		28,187,289,242	[28,187,289,242]

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 投資証券 1銘柄 155銘柄	0.7%	99.3%	73.3%
イギリス・ポンド	投資証券 33銘柄	-%	100%	5.6%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券 31銘柄	-%	100%	8.0%
カナダ・ドル	投資証券 27銘柄	-%	100%	2.0%
シンガポール・ドル	投資証券 32銘柄	-%	100%	3.9%
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	-%	100%	0.5%
ユーロ	投資証券 30銘柄	-%	100%	4.6%
韓国・ウォン	投資証券 3銘柄	-%	100%	0.1%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	-%	100%	1.9%

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オンライン 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4期計算期間（2019年12月3日から2020年11月30日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 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3期 2019年12月2日現在	第4期 2020年11月30日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,217,386	1,122,631
親投資信託受益証券	595,706,879	602,779,808
未収入金	-	394,000
流動資産合計	596,924,265	604,296,439
資産合計	596,924,265	604,296,439
負債の部		
流動負債		
未払解約金	238,199	575,308
未払受託者報酬	62,203	59,796
未払委託者報酬	855,960	822,816
その他未払費用	15,656	14,878
流動負債合計	1,172,018	1,472,798
負債合計	1,172,018	1,472,798
純資産の部		
元本等		
元本	1 508,116,057	1 604,694,831
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2 87,636,190	2 1,871,190
(分配準備積立金)	80,147,605	59,405,112
元本等合計	595,752,247	602,823,641
純資産合計	595,752,247	602,823,641
負債純資産合計	596,924,265	604,296,439

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第3期		第4期	
	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日		自 2019年12月3日 至 2020年11月30日	
営業収益				
受取利息		1		1
有価証券売買等損益		65,639,463		73,500,071
その他収益		1,226		-
営業収益合計		65,640,690		73,500,070
営業費用				
支払利息		695		285
受託者報酬		122,146		119,688
委託者報酬		1,680,789		1,647,064
その他費用		30,577		29,770
営業費用合計		1,834,207		1,796,807
営業利益又は営業損失()		63,806,483		75,296,877
経常利益又は経常損失()		63,806,483		75,296,877
当期純利益又は当期純損失()		63,806,483		75,296,877
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		6,352,067		26,508,473
期首剰余金又は期首欠損金()		26,802,608		87,636,190
剰余金増加額又は欠損金減少額		12,238,317		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		12,238,317		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		8,859,151		40,718,976
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		8,859,151		21,046,258
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		19,672,718
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		87,636,190		1,871,190

(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4期	
	自 2019年12月3日	至 2020年11月30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 2019年11月30日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を2019年12月2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3期	第4期
	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1. 1 期首元本額	534,454,266円	508,116,057円
期中追加設定元本額	146,810,171円	262,282,042円
期中一部解約元本額	173,148,380円	165,703,268円
2. 計算期間末日における受益権の総数	508,116,057口	604,694,831口
3. 2 元本の欠損		貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,871,190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3期	第4期
	自 2018年12月1日 至 2019年12月2日	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日

1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(520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(57,453,488円)、投資信託約款に規定される収益調整金(16,119,520円)及び分配準備積立金(22,693,597円)より分配対象額は96,267,125円(1万口当たり1,894.59円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(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(55,160,709円)及び分配準備積立金(59,405,112円)より分配対象額は114,565,821円(1万口当たり1,894.61円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	---	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第4期 自 2019年12月3日 至 2020年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第4期
	2020年11月30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3期	第4期
	2019年12月2日現在	2020年11月30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	62,136,768	55,860,494
合計	62,136,768	55,860,494

（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3期	第4期
2019年12月2日現在	2020年11月30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4期
自 2019年12月3日
至 2020年11月30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3期	第4期
	2019年12月2日現在	2020年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.1725円	0.9969円
（1万口当たり純資産額）	（11,725円）	（9,969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	273,443,934	602,779,808	
親投資信託受益証券 合計			602,779,808	
合計			602,779,808	

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

前記「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）」に記載のとおりであります。

【ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2020年12月1日から2021年5月31日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2021年5月31日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		4,689,813
親投資信託受益証券		3,231,363,979
流動資産合計		3,236,053,792
資産合計		3,236,053,792
負債の部		
流動負債		
未払解約金		1,080,174
未払受託者報酬		314,002
未払委託者報酬		2,983,389
その他未払費用		78,413
流動負債合計		4,455,978
負債合計		4,455,978
純資産の部		
元本等		
元本		1,236,344,381
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()		867,253,433
(分配準備積立金)		239,063,416
元本等合計		3,231,597,814
純資産合計		3,231,597,814
負債純資産合計		3,236,053,792

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
営業収益	
有価証券売買等損益	273,701,176
営業収益合計	273,701,176
営業費用	
支払利息	340
受託者報酬	314,002
委託者報酬	2,983,389
その他費用	78,414
営業費用合計	3,376,145
営業利益又は営業損失（ ）	270,325,031
経常利益又は経常損失（ ）	270,325,031
中間純利益又は中間純損失（ ）	270,325,031
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	22,278,653
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	502,327,441
剰余金増加額又は欠損金減少額	194,613,563
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	194,613,563
剰余金減少額又は欠損金増加額	77,733,949
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	77,733,949
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	867,253,433

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1. 1 期首元本額	2,143,825,188円
期中追加設定元本額	545,537,609円
期中一部解約元本額	325,018,416円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	2,364,344,381口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。
--

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2021年5月31日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3668円 (13,668円)

(参考)

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

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

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年5月31日現在
	金 額 (円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	10,198,497,140
株式	170,475,397,590
派生商品評価勘定	25,512,800
未収入金	122,297,049
未収配当金	1,475,183,003

未収利息		642,829
その他未収収益	4	32,499,790
流動資産合計		182,330,030,201
資産合計		182,330,030,201
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		45,132,850
前受金		30,381,300
未払解約金		142,157,590
受入担保金		6,693,143,887
流動負債合計		6,910,815,627
負債合計		6,910,815,627
純資産の部		
元本等		
元本	1	135,257,495,084
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		40,161,719,490
元本等合計		175,419,214,574
純資産合計		175,419,214,574
負債純資産合計		182,330,030,201

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年5月31日現在
1. 1 期首	2020年12月1日
期首元本額	142,709,508,970円
期中追加設定元本額	10,436,340,100円
期中一部解約元本額	17,888,353,986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	3,024,697,906円
ダイワ・トピックス・イン デックスファンドV A	6,170,205,936円
適格機関投資家専用・ダイ ワ・トピックスインデックス ファンドV A 2	927,558円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	26,358,549円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	528,395,182円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	26,962,746円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	761,667,628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)	170,450,590円

D - I ' s T O P I Xイン デックス	30,249,161円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2050	74,276,684円
i F r e e T O P I Xイン デックス	3,515,637,149円
i F r e e 8資産バランス	2,931,246,980円
i F r e e 年金バランス	357,093,022円
D Cダイワ日本株式インデッ クス	65,437,395,775円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,831,642,597円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,770,140,591円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	3,564,655,345円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	5,714,514,568円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2030	46,477,627円
D Cダイワ・ターゲットイ ヤー2040	41,677,370円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	1,064,242,104円
ダイワつみたてインデックス バランス3 0	11,123,978円
ダイワつみたてインデックス バランス5 0	8,155,526円
ダイワつみたてインデックス バランス7 0	12,980,279円
ダイワ世界バランスファンド 4 0 V A	118,274,541円
ダイワ世界バランスファンド 6 0 V A	133,264,022円
ダイワ・バランスファンド3 5 V A	6,627,189,222円
ダイワ・バランスファンド2 5 V A (適格機関投資家専 用)	580,569,028円
ダイワ国内バランスファンド 2 5 V A (適格機関投資家専 用)	84,571,925円

	ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専用)		152,457,761円
	ダイワ・ノーロードTOP IXファンド		178,057,906円
	ダイワファンドラップTOP PIXインデックス		10,053,384,078円
	ダイワTOPIXインデック ス(ダイワSMA専用)		1,389,270,967円
	ダイワファンドラップオンラ インTOPIXインデック ス		2,491,606,122円
	ダイワ・インデックスセレクト TOPIX		1,219,227,317円
	ダイワライフスタイル25		159,951,812円
	ダイワライフスタイル50		609,287,535円
	ダイワライフスタイル75		500,360,587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)		10,838,847,410円
	計		135,257,495,084円
2.	期末日における受益権の総数		135,257,495,084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	6,386,087,680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	923,420,000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31,507,625円が 含まれております。	

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年5月31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

	<p>重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
--	--

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	2021年5月31日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	4,975,723,700	-	4,956,245,000	19,478,700
合計	4,975,723,700	-	4,956,245,000	19,478,700

（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）

	2021年5月31日現在
1口当たり純資産額	1.2969円
（1万口当たり純資産額）	（12,969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) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年12月1日から2021年5月31日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

		当中間計算期間末 2021年5月31日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		7,524,631
親投資信託受益証券		2,985,086,193
未収入金		1,140,000
流動資産合計		2,993,750,824
資産合計		
2,993,750,824		
負債の部		
流動負債		
未払解約金		2,727,518
未払受託者報酬		353,994
未払委託者報酬		5,045,007
その他未払費用		88,418
流動負債合計		8,214,937
負債合計		
8,214,937		
純資産の部		
元本等		
元本		1,767,750,621
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		1,217,785,266
（分配準備積立金）		488,002,027
元本等合計		2,985,535,887
純資産合計		
2,985,535,887		
負債純資産合計		
2,993,750,824		

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
営業収益	
有価証券売買等損益	460,808,765
営業収益合計	460,808,765
営業費用	
支払利息	546
受託者報酬	353,994
委託者報酬	5,045,007
その他費用	88,420
営業費用合計	5,487,967
営業利益又は営業損失（ ）	455,320,798
経常利益又は経常損失（ ）	455,320,798
中間純利益又は中間純損失（ ）	455,320,798
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	86,233,136
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,071,242,345
剰余金増加額又は欠損金減少額	157,371,403
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	157,371,403
剰余金減少額又は欠損金増加額	379,916,144
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	379,916,144
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,217,785,266

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1. 1 期首元本額	2,298,185,009円
期中追加設定元本額	276,680,902円
期中一部解約元本額	807,115,290円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	1,767,750,621口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2021年5月31日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6889円 (16,889円)

(参考)

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

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

「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年5月31日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	247,449,442
コール・ローン	1,859,557,158
株式	68,586,376,663
投資証券	1,657,424,933

派生商品評価勘定		82,289,820
未収入金		255,261,061
未収配当金		98,487,715
差入委託証拠金		664,980,107
流動資産合計		73,451,826,899
資産合計		73,451,826,899
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		554,808,745
未払金		500,738,551
未払解約金		26,550,000
流動負債合計		1,082,097,296
負債合計		1,082,097,296
純資産の部		
元本等		
元本	1	26,652,187,001
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		45,717,542,602
元本等合計		72,369,729,603
純資産合計		72,369,729,603
負債純資産合計		73,451,826,899

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

(2)新株予約権証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

(3)投資証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

2. 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

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年5月31日現在
1. 1 期首	2020年12月1日
期首元本額	26,586,986,393円
期中追加設定元本額	3,701,320,933円
期中一部解約元本額	3,636,120,325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)	20,358,673,565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)	1,099,357,785円
iFree 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)	1,172,172,941円

ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジあり)(ダイワ SMA専用)	4,021,982,710円
計	26,652,187,001円
2. 期末日における受益権の総数	26,652,187,001口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種 類	2021年5月31日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	2,588,424,054	-	2,668,966,745	80,542,691
合計	2,588,424,054	-	2,668,966,745	80,542,691

(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	2021年5月31日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	70,375,999,653	-	70,928,895,509	552,895,856
アメリカ・ドル	50,833,209,012	-	51,042,191,517	208,982,505
イギリス・ポンド	3,269,009,714	-	3,345,115,723	76,106,009
イスラエル・シケル	83,464,348	-	84,269,878	805,530
オーストラリア・ドル	1,624,044,047	-	1,623,217,070	826,977
カナダ・ドル	2,477,112,170	-	2,525,977,902	48,865,732
シンガポール・ドル	255,056,141	-	258,504,961	3,448,820
スイス・フラン	2,062,371,404	-	2,101,010,423	38,639,019
スウェーデン・クローナ	859,273,619	-	880,821,480	21,547,861
デンマーク・クローネ	561,163,891	-	571,936,176	10,772,285
ニュージーランド・ドル	57,184,442	-	57,594,801	410,359
ノルウェー・クローネ	150,161,385	-	150,538,880	377,495
ユーロ	7,385,269,040	-	7,525,147,912	139,878,872

香港・ドル	758,680,440	-	762,568,786	3,888,346
買 建	87,973,200	-	87,807,440	165,760
アメリカ・ドル	87,973,200	-	87,807,440	165,760
合計	70,463,972,853	-	71,016,702,949	553,061,616

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2021年5月31日現在
1口当たり純資産額	2.7153円
(1万口当たり純資産額)	(27,153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）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年12月1日から2021年5月31日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 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）

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

当中間計算期間末 2021年5月31日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	24,243,728
親投資信託受益証券	2,283,997,543
未収入金	1,340,000
流動資産合計	2,309,581,271
資産合計	
2,309,581,271	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,907,035
未払受託者報酬	271,831
未払委託者報酬	4,010,135
その他未払費用	67,875
流動負債合計	7,256,876
負債合計	
7,256,876	
純資産の部	
元本等	
元本	1,395,499,622
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	906,824,773
（分配準備積立金）	259,098,918
元本等合計	2,302,324,395
純資産合計	
2,302,324,395	
負債純資産合計	
2,309,581,271	

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
営業収益	
受取利息	4
有価証券売買等損益	526,868,120
営業収益合計	526,868,124
営業費用	
支払利息	2,846
受託者報酬	271,831
委託者報酬	4,010,135
その他費用	67,890
営業費用合計	4,352,702
営業利益又は営業損失（ ）	522,515,422
経常利益又は経常損失（ ）	522,515,422
中間純利益又は中間純損失（ ）	522,515,422
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	120,247,747
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	640,583,593
剰余金増加額又は欠損金減少額	109,523,131
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	109,523,131
剰余金減少額又は欠損金増加額	245,549,626
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	245,549,626
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	906,824,773

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1. 1 期首元本額	1,873,069,139円
期中追加設定元本額	227,266,201円
期中一部解約元本額	704,835,718円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	1,395,499,622口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2021年5月31日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6498円 (16,498円)

(参考)

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

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

「外国株式インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年5月31日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,775,377,403
コール・ローン	11,005,466,819
株式	198,641,609,061
投資証券	4,785,831,583
派生商品評価勘定	219,739,323

未収入金		295,508,842
未収配当金		276,633,566
差入委託証拠金		3,521,739,524
流動資産合計		220,521,906,121
資産合計		220,521,906,121
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		9,494,438
未払金		6,240,791,205
未払解約金		161,698,700
流動負債合計		6,411,984,343
負債合計		6,411,984,343
純資産の部		
元本等		
元本	1	57,952,472,821
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		156,157,448,957
元本等合計		214,109,921,778
純資産合計		214,109,921,778
負債純資産合計		220,521,906,121

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

(2)新株予約権証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

(3)投資証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

2. 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、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年5月31日現在
1. 1 期首	2020年12月1日
期首元本額	54,067,455,177円
期中追加設定元本額	7,151,665,336円
期中一部解約元本額	3,266,647,692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)	509,743,583円
ダイワファンドラップ 外国 株式インデックス(為替ヘッ ジなし)	2,481,421,067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)	492,937,597円
D-I's 外国株式インデッ クス	11,942,651円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	17,218,409円
iFree 外国株式イン デックス(為替ヘッジなし)	3,069,962,748円
iFree 8資産バランス	1,041,275,263円
iFree 年金バランス	126,917,510円
DCダイワ外国株式インデッ クス	35,554,825,113円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	535,332,000円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	949,044,526円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	719,607,277円
大和DC海外株式インデック スファンド	1,624,914,989円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	11,297,099円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	8,287,172円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	590,994,011円
ダイワつみたてインデックス バランス30	1,976,858円
ダイワつみたてインデックス バランス50	2,044,179円
ダイワつみたてインデックス バランス70	2,557,564円

ダイワ世界バランスファンド 40VA	124,687,887円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	234,177,623円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	1,781,979,203円
ダイワ・バランスファンド2 5VA（適格機関投資家専用）	90,149,674円
ダイワバランスファンド 2020-07（適格機関投資家専用）	251,457,589円
ダイワバランスファンド 2021-02（適格機関投資家専用）	234,082,341円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	851,908,858円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	233,194,443円
ダイワ外国株式インデックス （為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）	2,764,408,983円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,743,712,586円
ダイワライフスタイル25	14,211,103円
ダイワライフスタイル50	54,882,248円
ダイワライフスタイル75	45,250,360円
計	57,952,472,821円
2. 期末日における受益権の総数	57,952,472,821口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等
 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい
 ことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種 類	2021年5月31日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	10,816,128,812	-	10,990,945,521	174,816,709
合計	10,816,128,812	-	10,990,945,521	174,816,709

（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。

- 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。
- 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。
- 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	2021年5月31日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	11,227,699,495	-	11,263,127,671	35,428,176

アメリカ・ドル	9,127,342,890	-	9,152,657,027	25,314,137
イギリス・ポンド	429,314,186	-	431,002,661	1,688,475
オーストラリア ・ドル	238,521,931	-	238,515,600	6,331
カナダ・ドル	289,759,784	-	291,485,013	1,725,229
スイス・フラン	282,796,192	-	284,093,871	1,297,679
ユーロ	859,964,512	-	865,373,499	5,408,987
合計	11,227,699,495	-	11,263,127,671	35,428,176

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2021年5月31日現在
1口当たり純資産額	3.6946円
(1万口当たり純資産額)	(36,946円)

「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

	2021年5月31日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
預金		140,766,071
コール・ローン		125,532,653
株式		14,237,235,553
新株予約権証券		124,376
投資証券		913,077,635
派生商品評価勘定		7,978,277
未収配当金		50,961,790
差入委託証拠金		88,848,365
流動資産合計		15,564,524,720
資産合計		15,564,524,720
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		2,149
未払解約金		10,606,566
流動負債合計		10,608,715
負債合計		10,608,715
純資産の部		
元本等		
元本	1	8,220,412,352
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		7,333,503,653
元本等合計		15,553,916,005
純資産合計		15,553,916,005
負債純資産合計		15,564,524,720

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)株式

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

(2)新株予約権証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

(3)投資証券

移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。

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

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

2. 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

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年5月31日現在
1. 1 期首	2020年12月1日
期首元本額	7,600,562,331円
期中追加設定元本額	1,153,600,914円
期中一部解約元本額	533,750,893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	28,717,856円
ンド（F0Fs用）（適格機関投	
資家専用）	
ダイワファンドラップ 外国	254,519,398円
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)	244,590,824円
D-I's 新興国株式イン デックス	128,032,591円
iFree 新興国株式イン デックス	3,241,313,974円
iFree 8資産バランス 新興国株式ファンダメンタ ル・インデックスファンド (為替ヘッジなし/適格機関 投資家専用)	2,067,703,033円 665,629,661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	1,125,906,500円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式	371,705,977円
ダイワ・ノーロード 新興国 株式ファンド	92,292,538円
計	8,220,412,352円
2. 期末日における受益権の総数	8,220,412,352口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 株式関連

種 類	2021年5月31日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	336,804,048	-	343,556,483	6,752,435
合計	336,804,048	-	343,556,483	6,752,435

(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	2021年5月31日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	1,144,442	-	1,144,485	43
シンガポール ・ドル	532,406	-	532,402	4
メキシコ・ペソ	612,036	-	612,083	47
買 建	215,037,870	-	216,261,606	1,223,736

アメリカ・ドル	215,037,870	-	216,261,606	1,223,736
合計	216,182,312	-	217,406,091	1,223,693

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2021年5月31日現在
1口当たり純資産額	1.8921円
(1万口当たり純資産額)	(18,921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) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年12月1日から2021年5月31日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

		当中間計算期間末 2021年5月31日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		5,489,426
親投資信託受益証券		2,890,280,955
流動資産合計		2,895,770,381
資産合計		2,895,770,381
負債の部		
流動負債		
未払解約金		1,105,848
未払受託者報酬		144,628
未払委託者報酬		1,302,006
その他未払費用		72,253
流動負債合計		2,624,735
負債合計		2,624,735
純資産の部		
元本等		
元本		2,855,199,379
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()		37,946,267
(分配準備積立金)		23,207,402
元本等合計		2,893,145,646
純資産合計		2,893,145,646
負債純資産合計		2,895,770,381

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
営業収益	
有価証券売買等損益	3,117,172
営業収益合計	3,117,172
営業費用	
支払利息	505
受託者報酬	144,628
委託者報酬	1,302,006
その他費用	72,255
営業費用合計	1,519,394
営業損失()	4,636,566
経常損失()	4,636,566
中間純損失()	4,636,566
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	973,509
期首剰余金又は期首欠損金()	36,202,700
剰余金増加額又は欠損金減少額	10,383,058
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	10,383,058
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,976,434
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,976,434
中間剰余金又は中間欠損金()	37,946,267

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1. 1 期首元本額	2,366,238,389円
期中追加設定元本額	819,269,853円
期中一部解約元本額	330,308,863円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	2,855,199,379口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等
 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい
 ことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2021年5月31日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0133円 (10,133円)

(参考)

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

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

「日本債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年5月31日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	342,175,950
国債証券	80,513,188,400
地方債証券	3,812,142,600
特殊債券	2,885,269,100
社債券	2,680,207,800

未収入金		403,886,000
未収利息		195,262,066
前払費用		3,298,168
流動資産合計		90,835,430,084
資産合計		90,835,430,084
負債の部		
流動負債		
未払解約金		148,931,960
流動負債合計		148,931,960
負債合計		148,931,960
純資産の部		
元本等		
元本	1	64,022,910,189
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		26,663,587,935
元本等合計		90,686,498,124
純資産合計		90,686,498,124
負債純資産合計		90,835,430,084

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年5月31日現在
1. 1 期首	2020年12月1日
期首元本額	63,632,169,674円
期中追加設定元本額	7,169,056,337円
期中一部解約元本額	6,778,315,822円

ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	1,029,521,748円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	6,874,697,589円
ダイワライフスタイル25	473,891,773円
ダイワライフスタイル50	551,510,513円
ダイワライフスタイル75	152,229,830円
計	64,022,910,189円
2. 期末日における受益権の総数	64,022,910,189口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2021年5月31日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	2021年5月31日現在
1口当たり純資産額	1.4165円
(1万口当たり純資産額)	(14,165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）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年12月1日から2021年5月31日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2021年5月31日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		17,489,205
親投資信託受益証券		4,849,616,647
流動資産合計		4,867,105,852
資産合計		4,867,105,852
負債の部		
流動負債		
未払解約金		2,088,825
未払受託者報酬		474,670
未払委託者報酬		5,221,831
その他未払費用		177,926
流動負債合計		7,963,252
負債合計		7,963,252
純資産の部		
元本等		
元本		4,556,000,055
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()		303,142,545
(分配準備積立金)		258,397,015
元本等合計		4,859,142,600
純資産合計		4,859,142,600
負債純資産合計		4,867,105,852

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
営業収益	
受取利息	1
有価証券売買等損益	158,907,028
営業収益合計	158,907,027
営業費用	
支払利息	1,237
受託者報酬	474,670
委託者報酬	5,221,831
その他費用	177,933
営業費用合計	5,875,671
営業利益又は営業損失（ ）	164,782,698
経常利益又は経常損失（ ）	164,782,698
中間純利益又は中間純損失（ ）	164,782,698
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	8,761,202
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	393,853,687
剰余金増加額又は欠損金減少額	107,783,889
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	107,783,889
剰余金減少額又は欠損金増加額	42,473,535
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	42,473,535
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	303,142,545

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1. 1 期首元本額	3,599,799,209円
期中追加設定元本額	1,353,107,236円
期中一部解約元本額	396,906,390円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	4,556,000,055口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等
 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい
 ことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2021年5月31日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0665円 (10,665円)

（参考）

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

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

「外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年5月31日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	312,142,105
コール・ローン	1,062,121,006
国債証券	115,482,597,630
派生商品評価勘定	570,561
未収入金	421,524,933

未収利息		689,207,119
前払費用		32,120,999
差入委託証拠金		237,180,201
流動資産合計		118,237,464,554
資産合計		118,237,464,554
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		1,329,980,849
未払金		242,408,102
流動負債合計		1,572,388,951
負債合計		1,572,388,951
純資産の部		
元本等		
元本	1	112,758,366,877
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,906,708,726
元本等合計		116,665,075,603
純資産合計		116,665,075,603
負債純資産合計		118,237,464,554

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年5月31日現在
1. 1 期首	2020年12月1日
期首元本額	104,020,210,262円
期中追加設定元本額	19,499,598,558円
期中一部解約元本額	10,761,441,943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）	94,123,043,807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）	4,687,431,517円

ダイワバランスファンド 2020-07(適格機関投資家専用)	3,105,099,209円
ダイワバランスファンド 2021-02(適格機関投資家専用)	3,199,296,043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)	7,643,496,301円
計	112,758,366,877円
2. 期末日における受益権の総数	112,758,366,877口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	2021年5月31日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	115,543,351,484	-	116,872,761,772	1,329,410,288

アメリカ・ドル	51,281,756,311	-	51,509,539,918	227,783,607
イギリス・ポンド	7,562,131,500	-	7,775,975,067	213,843,567
イスラエル・シェケル	498,854,043	-	500,169,941	1,315,898
オーストラリア・ドル	2,582,732,659	-	2,587,471,360	4,738,701
カナダ・ドル	2,429,172,437	-	2,482,762,389	53,589,952
シンガポール・ドル	540,262,980	-	545,373,428	5,110,448
スウェーデン・クローナ	425,272,677	-	434,240,400	8,967,723
デンマーク・クローネ	581,852,599	-	591,153,218	9,300,619
ノルウェー・クローネ	220,094,401	-	219,523,840	570,561
ポーランド・ズロチ	786,996,066	-	814,154,560	27,158,494
マレーシア・リンギット	520,856,000	-	525,670,936	4,814,936
メキシコ・ペソ	879,458,549	-	896,939,543	17,480,994
ユーロ	47,233,911,262	-	47,989,787,172	755,875,910
合計	115,543,351,484	-	116,872,761,772	1,329,410,288

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2021年5月31日現在
1口当たり純資産額	1.0346円
(1万口当たり純資産額)	(10,346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) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年12月1日から2021年5月31日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 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)【中間貸借対照表】

（単位：円）

当中間計算期間末 2021年5月31日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,469,013
親投資信託受益証券	3,119,463,752
流動資産合計	3,130,932,765
資産合計	3,130,932,765
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,566,102
未払受託者報酬	297,754
未払委託者報酬	3,424,768
その他未払費用	111,586
流動負債合計	5,400,210
負債合計	5,400,210
純資産の部	
元本等	
元本	1 2,737,724,949
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	387,807,606
（分配準備積立金）	121,482,754
元本等合計	3,125,532,555
純資産合計	3,125,532,555
負債純資産合計	3,130,932,765

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
営業収益	
有価証券売買等損益	106,747,865
営業収益合計	106,747,865
営業費用	
支払利息	724
受託者報酬	297,754
委託者報酬	3,424,768
その他費用	111,590
営業費用合計	3,834,836
営業利益	102,913,029
経常利益	102,913,029
中間純利益	102,913,029
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	3,272,343
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	224,929,928
剰余金増加額又は欠損金減少額	87,855,605
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	87,855,605
剰余金減少額又は欠損金増加額	24,618,613
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	24,618,613
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	387,807,606

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1. 1 期首元本額	2,237,982,504円
期中追加設定元本額	741,439,357円
期中一部解約元本額	241,696,912円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	2,737,724,949口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2021年5月31日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1417円 (11,417円)

(参考)

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

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

「外国債券インデックスマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年5月31日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	1,890,167,822
コール・ローン	952,347,638
国債証券	221,706,401,044
派生商品評価勘定	1,492
未収入金	1,707,215,410

未收利息		1,239,410,500
前払費用		27,716,145
流動資産合計		227,523,260,051
資産合計		227,523,260,051
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		1,334,874
未払金		3,115,109,740
未払解約金		51,391,197
流動負債合計		3,167,835,811
負債合計		3,167,835,811
純資産の部		
元本等		
元本	1	72,119,554,824
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		152,235,869,416
元本等合計		224,355,424,240
純資産合計		224,355,424,240
負債純資産合計		227,523,260,051

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年5月31日現在
1. 1 期首	2020年12月1日
期首元本額	72,688,498,430円
期中追加設定元本額	5,407,268,882円
期中一部解約元本額	5,976,212,488円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ外国債券インデックス V A	527,259,809円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	11,033,396円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	95,009,942円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	26,424,146円

ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	320,223,226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)	147,414,824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)	496,272,491円
ダイワファンドラップ 外国 債券インデックス(為替ヘッ ジなし)	2,108,412,636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)	801,370,561円
D-I's 外国債券インデッ クス	924,725円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	3,387,942円
iFree 外国債券イン デックス	1,226,813,859円
iFree 8資産バランス	1,225,640,814円
iFree 年金バランス	149,851,824円
DCダイワ外国債券インデッ クス	49,220,307,309円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	887,870,683円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	527,760,655円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	333,325,902円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	530,567,675円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	396,197,893円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	141,675,419円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	23,647,101円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	7,204,599円
ダイワつみたてインデックス 外国債券	300,455,358円
ダイワつみたてインデックス バランス30	3,501,105円
ダイワつみたてインデックス バランス50	1,143,692円
ダイワつみたてインデックス バランス70	1,212,559円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	172,531,874円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	138,878,570円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	4,172,319,047円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	245,616,231円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国債券	144,584,513円
ダイワ・ノーロード 外国債 券ファンド	36,419,678円
ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジなし)(ダイワ SMA専用)	1,732,070,866円
ダイワ投信倶楽部外国債券イ ンデックス	5,847,324,590円
ダイワライフスタイル25	33,545,886円
ダイワライフスタイル50	63,786,169円
ダイワライフスタイル75	17,567,255円
計	72,119,554,824円
2. 期末日における受益権の総数	72,119,554,824口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券

重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)デリバティブ取引

デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	2021年5月31日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	1,077,837,149	-	1,076,503,767	1,333,382
アメリカ・ドル	443,096,286	-	442,601,843	494,443
イギリス・ポンド	16,804,713	-	16,804,659	54
オーストラリア ・ドル	20,163,888	-	20,045,460	118,428
スウェーデン・ クローナ	22,289,608	-	22,176,000	113,608
デンマーク・ク ローネ	6,502,158	-	6,494,390	7,768
マレーシア・リ ンギット	5,295,800	-	5,296,360	560
ユーロ	563,684,696	-	563,085,055	599,641
合計	1,077,837,149	-	1,076,503,767	1,333,382

（注） 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2021年5月31日現在
1口当たり純資産額	3.1109円
(1万口当たり純資産額)	(31,109円)

「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

	2021年5月31日現在
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	101,431,331
コール・ローン	411,002,402
国債証券	19,884,916,391
派生商品評価勘定	5,314,910
未収入金	505,350
未収利息	329,696,188
前払費用	19,995,177
流動資産合計	20,752,861,749
資産合計	20,752,861,749
負債の部	

流動負債		
派生商品評価勘定		474,500
未払金		108,259,213
流動負債合計		108,733,713
負債合計		108,733,713
純資産の部		
元本等		
元本	1	14,123,710,464
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,520,417,572
元本等合計		20,644,128,036
純資産合計		20,644,128,036
負債純資産合計		20,752,861,749

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年5月31日現在
1. 1 期首	2020年12月1日
期首元本額	12,662,214,054円
期中追加設定元本額	1,849,631,827円
期中一部解約元本額	388,135,417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（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	128,327,769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）	265,292,980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）	428,596,890円
D - I ' s 新興国債券インデックス	58,100,915円
i F r e e 新興国債券インデックス	3,608,256,641円
i F r e e 8 資産バランス	2,609,204,320円
D C ダイワ新興国債券インデックスファンド	6,830,389,916円

ダイワ・インデックスセレクト ト 新興国債券	162,690,806円
ダイワ・ノーロード 新興国 債券ファンド	32,850,227円
計	14,123,710,464円
2. 期末日における受益権の総数	14,123,710,464口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額 と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい ことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	2021年5月31日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	17,589,048	-	17,588,840	208
アメリカ・ドル	17,589,048	-	17,588,840	208
買 建	395,095,409	-	399,935,611	4,840,202

アメリカ・ドル	3,295,260	-	3,292,779	2,481
インドネシア・ルピア	23,839,000	-	23,870,000	31,000
ウルグアイ・ペソ	17,589,048	-	17,570,435	18,613
オフショア・人民元	22,410,700	-	22,408,230	2,470
タイ・バーツ	24,738,450	-	24,745,500	7,050
チェコ・コルナ	20,233,914	-	20,685,920	452,006
トルコ・リラ	29,758,746	-	29,324,764	433,982
ハンガリー・フォリント	7,234,443	-	7,319,730	85,287
ポーランド・ズロチ	74,095,452	-	76,360,560	2,265,108
メキシコ・ペソ	48,670,551	-	49,180,631	510,080
ルーマニア・レイ	58,129,259	-	59,068,190	938,931
ロシア・ルーブル	25,263,700	-	25,330,000	66,300
南アフリカ・ランド	39,836,886	-	40,778,872	941,986
合計	412,684,457	-	417,524,451	4,840,410

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2021年5月31日現在
1口当たり純資産額	1.4617円
(1万口当たり純資産額)	(14,617円)

【ダイワファンドラップオンライン J - REITインデックス】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年12月1日から2021年5月31日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン J - R E I T インデックス

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

		当中間計算期間末 2021年5月31日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		3,492,087
親投資信託受益証券		1,570,939,526
未収入金		1,010,000
流動資産合計		1,575,441,613
資産合計		
1,575,441,613		
負債の部		
流動負債		
未払解約金		2,082,669
未払受託者報酬		152,102
未払委託者報酬		1,445,376
その他未払費用		37,949
流動負債合計		3,718,096
負債合計		
3,718,096		
純資産の部		
元本等		
元本		1,186,280,969
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		385,442,548
（分配準備積立金）		179,054,031
元本等合計		1,571,723,517
純資産合計		
1,571,723,517		
負債純資産合計		
1,575,441,613		

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
営業収益	
有価証券売買等損益	304,472,522
営業収益合計	304,472,522
営業費用	
支払利息	264
受託者報酬	152,102
委託者報酬	1,445,376
その他費用	37,950
営業費用合計	1,635,692
営業利益又は営業損失（ ）	302,836,830
経常利益又は経常損失（ ）	302,836,830
中間純利益又は中間純損失（ ）	302,836,830
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	28,866,085
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	66,249,412
剰余金増加額又は欠損金減少額	59,248,389
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	59,248,389
剰余金減少額又は欠損金増加額	14,025,998
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	14,025,998
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	385,442,548

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間
	自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1. 1 期首元本額	1,110,904,033円
期中追加設定元本額	284,338,051円
期中一部解約元本額	208,961,115円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	1,186,280,969口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等
 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しい
 ことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2021年5月31日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3249円 (13,249円)

（参考）

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

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

「ダイワ」-REITマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年5月31日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		10,250,883,096
投資証券	2	462,950,829,610
派生商品評価勘定		1,113,835,200
未収配当金		2,816,548,373
流動資産合計		477,132,096,279

資産合計		477,132,096,279
負債の部		
流動負債		
前受金		1,111,651,200
未払金		1,213,684,611
未払解約金		149,007,000
流動負債合計		2,474,342,811
負債合計		2,474,342,811
純資産の部		
元本等		
元本	1	140,669,750,786
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		333,988,002,682
元本等合計		474,657,753,468
純資産合計		474,657,753,468
負債純資産合計		477,132,096,279

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引

3. 収益及び費用の計上基準	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
----------------	--

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年5月31日現在
1. 1 期首	2020年12月1日
期首元本額	134,869,045,089円
期中追加設定元本額	18,636,461,426円
期中一部解約元本額	12,835,755,729円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワJ-REITオープン	5,491,603,833円
ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	124,150,250,069円
ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	336,825,693円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	4,336,773円
iFree J-REITイ ンデックス	411,084,303円
iFree 8資産バランス	1,131,941,500円
DC・ダイワJ-REIT オープン	5,408,028,235円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	4,697,922円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	3,294,871円
ダイワ・ノーロード J-R EITファンド	102,244,621円
ダイワファンドラップ J- REITインデックス	1,737,645,738円
ダイワJ-REITインデッ クス(ダイワSMA専用)	389,026,905円
ダイワファンドラップオンラ イン J-REITインデッ クス	465,560,124円

ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	1,033,210,199円
計	140,669,750,786円
2. 期末日における受益権の総数	140,669,750,786口
3. 2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 5,551,150,000円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

不動産投信関連

種 類	2021年5月31日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買 建	10,497,148,800	-	11,611,600,000	1,114,451,200
合計	10,497,148,800	-	11,611,600,000	1,114,451,200

（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）

	2021年5月31日現在
1口当たり純資産額	3,3743円
（1万口当たり純資産額）	（33,743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) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年12月1日から2021年5月31日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

		当中間計算期間末 2021年5月31日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,980,199
親投資信託受益証券		917,848,926
派生商品評価勘定		49,569
未収入金		341,881
流動資産合計		920,220,575
資産合計		920,220,575
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		5,766,086
未払金		5,539
未払解約金		817,198
未払受託者報酬		93,382
未払委託者報酬		1,284,614
その他未払費用		23,260
流動負債合計		7,990,079
負債合計		7,990,079
純資産の部		
元本等		
元本		1,755,010,296
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()		157,220,200
(分配準備積立金)		59,107,972
元本等合計		912,230,496
純資産合計		912,230,496
負債純資産合計		920,220,575

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
営業収益	
有価証券売買等損益	196,731,955
為替差損益	57,648,203
営業収益合計	139,083,752
営業費用	
支払利息	138
受託者報酬	93,382
委託者報酬	1,284,614
その他費用	29,200
営業費用合計	1,407,334
営業利益又は営業損失（ ）	137,676,418
経常利益又は経常損失（ ）	137,676,418
中間純利益又は中間純損失（ ）	137,676,418
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	11,023,630
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	24,421,440
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,681,257
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	11,681,257
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,535,285
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,535,285
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	157,220,200

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自	至
	2020年12月1日	2021年5月31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. 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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1. 1 期首元本額	797,988,165円
期中追加設定元本額	126,602,402円
期中一部解約元本額	169,580,271円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	755,010,296口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自	至
	2020年12月1日	2021年5月31日
	該当事項はありません。	

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2021年5月31日現在	
	1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	当中間計算期間末 2021年5月31日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	900,008,250	-	905,724,767	5,716,517
アメリカ・ドル	671,864,491	-	674,711,043	2,846,552
イギリス・ポンド	52,133,073	-	53,354,311	1,221,238
イスラエル・ シュケル	405,175	-	408,867	3,692
オーストラリア ・ドル	64,022,684	-	63,984,770	37,914
カナダ・ドル	17,485,503	-	17,825,471	339,968
シンガポール ・ドル	32,415,030	-	32,848,425	433,395
ニュージーラ ンド・ドル	3,830,834	-	3,858,776	27,942

ユーロ	42,692,645	-	43,494,426	801,781
香港・ドル	15,158,815	-	15,238,678	79,863
合計	900,008,250	-	905,724,767	5,716,517

(注) 1. 時価の算定方法

- (1) 中間計算期間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。

中間計算期間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。

中間計算期間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。

- ・ 中間計算期間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。
- ・ 中間計算期間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) 中間計算期間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、中間計算期間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)

	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2082円 (12,082円)

(参考)

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

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

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2021年5月31日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		32,261,391
コール・ローン		364,831,496
投資信託受益証券		290,514,964
投資証券		39,818,656,733
派生商品評価勘定		59,705,616
未収入金		3,314,196
未収配当金		50,053,210
差入委託証拠金		264,093,593
流動資産合計		40,883,431,199
資産合計		40,883,431,199
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		161,079
未払金		104,319,196
未払解約金		6,527,600
流動負債合計		111,007,875
負債合計		111,007,875
純資産の部		
元本等		
元本	1	14,766,477,805
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		26,005,945,519
元本等合計		40,772,423,324
純資産合計		40,772,423,324
負債純資産合計		40,883,431,199

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
----	------------------------------

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

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2021年5月31日現在
1. 1 期首	2020年12月1日
期首元本額	13,110,290,968円
期中追加設定元本額	3,062,775,588円
期中一部解約元本額	1,406,588,751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）	6,108,470,026円
ダイワファンドラップ 外国 REITインデックス（為替 ヘッジなし）	1,104,854,975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）	332,421,472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）	278,305,653円
D - I ' s グローバルREI Tインデックス	1,899,473円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	4,631,267円
i F r e e 外国REITイ ンデックス	409,984,118円
i F r e e 8 資産バランス	1,412,985,976円

グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成型）	171,876,982円
グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）	70,079,546円
DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド	2,847,954,069円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	5,853,009円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	4,114,148円
ダイワバランスファンド2020-07（適格機関投資家専用）	228,872,981円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	218,996,022円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	251,178,964円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	54,984,706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）	811,602,258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）	447,412,160円
計	14,766,477,805円
2. 期末日における受益権の総数	14,766,477,805口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引

デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

1. 不動産投信関連

種 類	2021年5月31日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
不動産投信 指数先物取引				
買 建	641,391,746	-	698,509,448	57,117,702
合計	641,391,746	-	698,509,448	57,117,702

（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	2021年5月31日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				

買 建	391,949,806	-	394,376,641	2,426,835
アメリカ・ドル	271,949,055	-	273,297,577	1,348,522
イギリス・ポンド	3,122,102	-	3,111,946	10,156
オーストラリア ・ドル	23,694,546	-	23,682,400	12,146
カナダ・ドル	8,129,997	-	8,172,657	42,660
ニュージーラ ンド・ドル	5,507,734	-	5,557,909	50,175
ユーロ	73,918,412	-	74,898,152	979,740
香港・ドル	5,627,960	-	5,656,000	28,040
合計	391,949,806	-	394,376,641	2,426,835

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	2021年5月31日現在
1口当たり純資産額	2.7611円
(1万口当たり純資産額)	(27,611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）】

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2020年12月1日から2021年5月31日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）

(1)【中間貸借対照表】

（単位：円）

		当中間計算期間末 2021年5月31日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,536,513
親投資信託受益証券		768,429,738
未収入金		422,000
流動資産合計		770,388,251
資産合計		
負債の部		
流動負債		
未払解約金		813,459
未払受託者報酬		72,523
未払委託者報酬		997,814
その他未払費用		18,047
流動負債合計		1,901,843
負債合計		
純資産の部		
元本等		
元本		1,616,471,775
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		152,014,633
（分配準備積立金）		49,130,801
元本等合計		768,486,408
純資産合計		
負債純資産合計		
		770,388,251

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間
	自 2020年12月1日
	至 2021年5月31日
営業収益	
有価証券売買等損益	152,221,930
営業収益合計	152,221,930
営業費用	
支払利息	23
受託者報酬	72,523
委託者報酬	997,814
その他費用	18,047
営業費用合計	1,088,407
営業利益又は営業損失()	151,133,523
経常利益又は経常損失()	151,133,523
中間純利益又は中間純損失()	151,133,523
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	11,383,746
期首剰余金又は期首欠損金()	1,871,190
剰余金増加額又は欠損金減少額	14,210,663
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	14,210,663
剰余金減少額又は欠損金増加額	74,617
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	74,617
中間剰余金又は中間欠損金()	152,014,633

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1. 1 期首元本額	604,694,831円
期中追加設定元本額	124,636,540円
期中一部解約元本額	112,859,596円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	616,471,775口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2020年12月1日 至 2021年5月31日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対 照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2021年5月31日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2021年5月31日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2466円 (12,466円)

(参考)

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

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

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の状況

前記「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)」に記載のとおりであります。

2【ファンドの現況】

ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス

【純資産額計算書】

2021年5月31日

資産総額	3,236,053,792円
負債総額	4,455,978円
純資産総額（ - ）	3,231,597,814円
発行済数量	2,364,344,381口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3668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

2021年5月31日

資産総額	182,330,030,201円
負債総額	6,910,815,627円
純資産総額（ - ）	175,419,214,574円
発行済数量	135,257,495,084口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2969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）

純資産額計算書

2021年5月31日

資産総額	2,993,750,824円
負債総額	8,214,937円
純資産総額（ - ）	2,985,535,887円
発行済数量	1,767,750,621口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.6889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

2021年5月31日

資産総額	73,451,826,899円
------	-----------------

負債総額	1,082,097,296円
純資産総額(-)	72,369,729,603円
発行済数量	26,652,187,001口
1単位当たり純資産額(/)	2.7153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)

純資産額計算書

2021年5月31日

資産総額	2,309,581,271円
負債総額	7,256,876円
純資産総額(-)	2,302,324,395円
発行済数量	1,395,499,622口
1単位当たり純資産額(/)	1.6498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

2021年5月31日

資産総額	220,521,906,121円
負債総額	6,411,984,343円
純資産総額(-)	214,109,921,778円
発行済数量	57,952,472,821口
1単位当たり純資産額(/)	3.6946円

(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

2021年5月31日

資産総額	15,564,524,720円
負債総額	10,608,715円
純資産総額(-)	15,553,916,005円
発行済数量	8,220,412,352口
1単位当たり純資産額(/)	1.8921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

純資産額計算書

2021年5月31日

資産総額	2,895,770,381円
負債総額	2,624,735円
純資産総額(-)	2,893,145,646円
発行済数量	2,855,199,379口
1単位当たり純資産額(/)	1.0133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

2021年5月31日

資産総額	90,835,430,084円
負債総額	148,931,960円
純資産総額(-)	90,686,498,124円
発行済数量	64,022,910,189口
1単位当たり純資産額(/)	1.4165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)

純資産額計算書

2021年5月31日

資産総額	4,867,105,852円
負債総額	7,963,252円
純資産総額(-)	4,859,142,600円
発行済数量	4,556,000,055口
1単位当たり純資産額(/)	1.0665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

2021年5月31日

資産総額	118,237,464,554円
負債総額	1,572,388,951円
純資産総額(-)	116,665,075,603円
発行済数量	112,758,366,877口
1単位当たり純資産額(/)	1.0346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）

純資産額計算書

2021年5月31日

資産総額	3,130,932,765円
負債総額	5,400,210円
純資産総額（ - ）	3,125,532,555円
発行済数量	2,737,724,949口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.1417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

2021年5月31日

資産総額	227,523,260,051円
負債総額	3,167,835,811円
純資産総額（ - ）	224,355,424,240円
発行済数量	72,119,554,824口
1 単位当たり純資産額（ / ）	3.1109円

(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

2021年5月31日

資産総額	20,752,861,749円
負債総額	108,733,713円
純資産総額（ - ）	20,644,128,036円
発行済数量	14,123,710,464口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.4617円

ダイワファンドラップオンライン J - R E I Tインデックス

純資産額計算書

2021年5月31日

資産総額	1,575,441,613円
負債総額	3,718,096円

純資産総額(-)	1,571,723,517円
発行済数量	1,186,280,969口
1単位当たり純資産額(/)	1.3249円

(参考) ダイワJ-REITマザーファンド

純資産額計算書

2021年5月31日

資産総額	477,132,096,279円
負債総額	2,474,342,811円
純資産総額(-)	474,657,753,468円
発行済数量	140,669,750,786口
1単位当たり純資産額(/)	3.3743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)

純資産額計算書

2021年5月31日

資産総額	920,220,575円
負債総額	7,990,079円
純資産総額(-)	912,230,496円
発行済数量	755,010,296口
1単位当たり純資産額(/)	1.2082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

2021年5月31日

資産総額	40,883,431,199円
負債総額	111,007,875円
純資産総額(-)	40,772,423,324円
発行済数量	14,766,477,805口
1単位当たり純資産額(/)	2.7611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)

純資産額計算書

2021年5月31日

資産総額	770,388,251円
負債総額	1,901,843円
純資産総額(-)	768,486,408円
発行済数量	616,471,775口
1単位当たり純資産額(/)	1.2466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

前記「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)」の記載と同じ。

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典
ありません。

(3) 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

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

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

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

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(7) 受益権の再分割

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

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

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2021年5月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. 商品会議

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

ロ. 商品担当役員

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ. リスクマネジメント会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2021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	45	95,256
追加型株式投資信託	747	20,710,140
株式投資信託 合計	792	20,805,395
単位型公社債投資信託	63	187,956
追加型公社債投資信託	14	1,510,584
公社債投資信託 合計	77	1,698,540
総合計	869	22,503,935

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（2020年4月1日から2021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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	2,741	4,860
有価証券	22,167	333
前払費用	205	237
未収委託者報酬	10,847	13,150
未収収益	63	49
関係会社短期貸付金	-	18,700
その他	62	207
流動資産計	36,088	37,539
固定資産		
有形固定資産	1	1
建物	7	6
器具備品	209	218
無形固定資産	2,362	1,937
ソフトウェア	2,028	1,882
ソフトウェア仮勘定	333	54
投資その他の資産	15,844	16,121
投資有価証券	9,153	10,159
関係会社株式	3,972	3,705
出資金	183	183
長期差入保証金	1,069	1,068

繰延税金資産	1,431	973
その他	33	30
固定資産計	18,424	18,283
資産合計	54,512	55,822

(単位:百万円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	69	68
未払金	7,573	8,405
未払収益分配金	14	13
未払償還金	39	39
未払手数料	3,988	4,734
その他未払金	2,3,530	2,3,617
未払費用	3,830	3,777
未払法人税等	656	804
未払消費税等	590	631
賞与引当金	688	950
その他	5	88
流動負債計	13,414	14,725
固定負債		
退職給付引当金	2,574	2,452
役員退職慰労引当金	88	74
その他	5	3
固定負債計	2,667	2,530
負債合計	16,082	17,256
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	11,749	10,574

利益剰余金合計	12,123	10,948
株主資本合計	38,793	37,618
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	363	947
評価・換算差額等合計	363	947
純資産合計	38,430	38,566
負債・純資産合計	54,512	55,822

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	69,550	65,487
その他営業収益	583	419
営業収益計	70,134	65,906
営業費用		
支払手数料	31,120	27,965
広告宣伝費	745	624
調査費	8,858	8,245
調査費	1,188	1,134
委託調査費	7,670	7,110
委託計算費	1,410	1,501
営業雑経費	1,770	1,870
通信費	240	240
印刷費	524	478
協会費	56	51
諸会費	13	14
その他営業雑経費	936	1,084
営業費用計	43,906	40,207
一般管理費		
給料	5,793	5,991
役員報酬	374	351
給料・手当	4,335	4,293
賞与	395	395
賞与引当金繰入額	688	950
福利厚生費	838	893
交際費	62	32
旅費交通費	154	37

租税公課	451	472
不動産賃借料	1,299	1,302
退職給付費用	368	449
役員退職慰労引当金繰入額	37	28
固定資産減価償却費	925	661
諸経費	1,770	1,763
一般管理費計	11,702	11,631
営業利益	14,525	14,067

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31 日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	214	578
有価証券償還益	24	42
その他	991	68
営業外収益計	1,230	689
営業外費用		
投資有価証券売却損	1	69
有価証券償還損	71	47
その他	54	24
営業外費用計	127	141
経常利益	15,629	14,616
特別損失		
システム刷新関連費用	537	547
関係会社整理損失	-	267
投資有価証券評価損	48	45
特別損失計	585	860
税引前当期純利益	15,043	13,756
法人税、住民税及び事業税	4,555	4,476
法人税等調整額	78	109
法人税等合計	4,477	4,366
当期純利益	10,566	9,389

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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	利益剰余金 合計	
				剰余金 繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,868	11,868	11,868
当期純利益	-	-	-	10,566	10,566	10,566
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,302	1,302	1,302
当期末残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793

	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	46	46	40,142
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,868
当期純利益	-	-	10,566
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	410	410	410
当期変動額合計	410	410	410
当期末残高	363	363	38,430

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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	利益剰余金 合計	
				剰余金 繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793

当期変動額						
残余金の配当	-	-	-	10,564	10,564	10,564
当期純利益	-	-	-	9,389	9,389	9,389
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,175	1,175	1,175
当期末残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618

	評価・換算差額等		純資産合計
	其他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	363	363	38,430
当期変動額			
残余金の配当	-	-	10,564
当期純利益	-	-	9,389
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	1,311	1,311	1,311
当期変動額合計	1,311	1,311	136
当期末残高	947	947	38,566

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）其他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

6. 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

(追加情報)

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44 - 2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしました。この結果、当事業年度の財務諸表への影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日）第7 - 4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載しておりません。

（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）

収益認識に関する会計基準等

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2018年3月30日）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 2018年3月30日）

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より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

当該会計基準の適用による影響は軽微であります。

（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」に独立掲記しておりました「受取配当金」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」としております。

この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「受取配当金」912百万円、「その他」78百万円は、「その他」991百万円として組替えております。

（注記に関する表示方法の変更）

「会計上の見積りの開示に関する会計基準」（企業会計基準第31号 2020年3月31日。以下「見積り会計基準」という）が公表日以後終了する事業年度における年度末に係る財務諸表から適用できることになったことに伴い、当事業年度末から適用し、（重要な会計上の見積り）を開示しております。

見積り会計基準の適用については、見積り会計基準第11項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、会計基準第6項及び第7項に定める注記事項について、前事業年度における財務諸表に関する注記を省略しております。

（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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
建物	34百万円	35百万円
器具備品	276百万円	259百万円

2 関係会社項目

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

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
未払金	3,397百万円	3,473百万円

3 保証債務

前事業年度（2020年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,603百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（2021年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,727百万円に対して保証を行っております。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2019年6月21日 定時株主総会	普通株式	11,868	4,550	2019年 3月31日	2019年 6月24日

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

2020年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	10,564百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,050円
基準日	2020年3月31日
効力発生日	2020年6月24日

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2020年6月23日 定時株主総会	普通株式	10,564	4,050	2020年 3月31日	2020年 6月24日

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

2021年6月22日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	9,388百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,599円
基準日	2021年3月31日
効力発生日	2021年6月23日

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、

株式であります。証券投資信託は事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式、子会社株式並びに関連会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式、子会社株式及び関連会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。関係会社短期貸付金は、親会社に対して貸付を行っているものであります。

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に係る業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

() 為替変動リスクの管理

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

() 価格変動リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

2. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、企業会計基準適用指針第31号「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(以下、「時価算定適用指針」という。)第26項に従い経過措置を適用した有価証券、市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。

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(2020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	時価	差額
投資有価証券(1)	60	60	-
資産合計	60	60	-

(1) 時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券267百万円、投資有価証券8,426百万円は上記の表に含めておりません。

(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、コマーシャル・ペーパー、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。

当事業年度(2021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
投資有価証券(1)	85	-	-	85
資産合計	85	-	-	85

(1) 時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券333百万円、投資有価証券9,406百万円は上記の表に含めておりません。

(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

投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。なお、時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用している有価証券は、公表されている基準価額によっていることからレベルを付しておりません。保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項(有価証券関係)をご参照下さい。

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

(単位：百万円)

区分	前事業年度	当事業年度
非上場株式等	666	666
子会社株式	1,944	1,677
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（2020年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 1,944百万円）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（2021年3月31日）

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

2. その他有価証券

前事業年度（2020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	60	55	5
(2) その他	3,004	2,772	232
小計	3,064	2,827	237
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	27,589	28,354	764
小計	27,589	28,354	764
合計	30,654	31,181	526

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

当事業年度（2021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	85	55	30
(2) その他	7,179	5,697	1,481
小計	7,265	5,752	1,512
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,561	2,721	160
小計	2,561	2,721	160
合計	9,826	8,474	1,352

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	-	-	-
(2) その他 証券投資信託	1,492	214	1
合計	1,492	214	1

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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	5,353	578	69
合計	5,353	578	69

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、証券投資信託について48百万円の減損処理を行っております。

当事業年度において、関係会社株式について267百万円、証券投資信託について45百万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いません。

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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,389百万円	2,574百万円
勤務費用	159	155
退職給付の支払額	183	378
その他	207	101
退職給付債務の期末残高	2,574	2,452

(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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,574百万円	2,452百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,574	2,452
退職給付引当金	2,574	2,452
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,574	2,452

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
勤務費用	159百万円	155百万円
その他	27	108
確定給付制度に係る退職給付費用	187	263

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181百万円、当事業年度186百万円であります。

(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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	788	750
賞与引当金	177	243
未払事業税	129	170
システム関連費用	198	155
投資有価証券評価損	47	128
出資金評価損	94	94
その他	399	298
繰延税金資産小計	1,835	1,841
評価性引当額	173	254
繰延税金資産合計	1,661	1,586
繰延税金負債		

連結法人間取引（譲渡益）	159	159
その他有価証券評価差額金	71	453
繰延税金負債合計	230	612
繰延税金資産の純額	1,431	973

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（2020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（2021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。

（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、記載を省略していません。

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、記載を省略していません。

（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、記載を省略していません。

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 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の兼任等	事業上 の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取 (注)	19,300 0	関係会社短期貸付金 -	18,700 -

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore)Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,603	-	-

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 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	所有直接100.0	経営管理	債務保証(注)	1,727	-	-

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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)(注1)	科目	期末残高(百万円)(注1)
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	16,953	未払手数料	2,984
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	1,031	未払費用	224
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,061	長期差入保証金	1,054

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4) 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。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

属性	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
----	--------	-----	---------------	-------	-------------------	-----------	-------	-----------	----	-----------

同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料（注2） 不動産の賃借料（注4）	14,917 527	未払手数料 長期差入保証金	3,321 1,054
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研 ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入（注3）	883	未払費用	179
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料（注4）	527	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(注3) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4) 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5) 大和プロパティ株式会社は、2020年10月1日付で大和証券株式会社を存続会社とする吸収合併により消滅しております。このため、取引金額は関連当事者であった期間の金額を記載しております。

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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
1株当たり純資産額	14,732.52円	1株当たり純資産額	14,784.79円
1株当たり当期純利益	4,050.66円	1株当たり当期純利益	3,599.54円

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

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当期純利益(百万円)	10,556	9,389
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

通常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。以下において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。

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

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

5【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

	名 称	資本金の額 (2020年03月末日現在)	事業の内容	備考
受託会社	三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円	(注6)	
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 (2020年07月27日現在)	(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。

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いません。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

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

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

第3【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

- ・ 金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。
 - ・ 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。
 - ・ 委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。
 - ・ 詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。
 - 委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
 - 請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
 - ・ 使用開始日を記載することがあります。
 - ・ 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
 - 届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
 - 届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
 - ・ 次の事項を記載することがあります。
 - 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
 - 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
 - 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載
 - ・ 委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。
 - ・ ファンドの形態等を記載することがあります。
 - ・ 図案を採用することがあります。
 - ・ ファンドの管理番号等を記載することがあります。
 - ・ 委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。
 - ・ UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。
- (2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。
- (3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。
- (4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

2021年5月21日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

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2020年4月1日から2021年3月31日までの第62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2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、そ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

2021年1月8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	深井 康治	印
--------------------	-------	-------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小林 英之	印
--------------------	-------	-------	---

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オンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2019年12月3日から2020年11月30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オンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2020年11月30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。

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 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、そ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

2021年1月8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 深井 康治 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小林 英之 印**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）の2019年12月3日から2020年11月30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）の2020年11月30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。

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 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、そ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

2021年1月8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 深井 康治 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小林 英之 印**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オンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2019年12月3日から2020年11月30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オンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2020年11月30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。

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 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、そ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

2021年1月8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	深井 康治	印
--------------------	-------	-------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小林 英之	印
--------------------	-------	-------	---

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）の2019年12月3日から2020年11月30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）の2020年11月30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。

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 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、そ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

2021年1月8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 深井 康治 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小林 英之 印**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オンライン 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）の2019年12月3日から2020年11月30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オンライン 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）の2020年11月30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。

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 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、そ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

2021年1月8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 深井 康治 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小林 英之 印**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オンライン 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）の2019年12月3日から2020年11月30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オンライン 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）の2020年11月30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。

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 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、そ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

2021年1月8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 深井 康治 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小林 英之 印

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オンライン TOPIXインデックスの2019年12月3日から2020年11月30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オンライン TOPIXインデックスの2020年11月30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。

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、継続企業的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。継続企業的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 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、そ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

2021年1月8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 深井 康治 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小林 英之 印**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オンライン 日本債券インデックスの2019年12月3日から2020年11月30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オンライン 日本債券インデックスの2020年11月30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。

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 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、そ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

2021年1月8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 深井 康治 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小林 英之 印**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オンライン J-REITインデックスの2019年12月3日から2020年11月30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オンライン J-REITインデックスの2020年11月30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。

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 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年7月1日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 深井 康治 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2020年12月1日から2021年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の2021年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年12月1日から2021年5月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年7月1日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 深井 康治 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 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）の2020年12月1日から2021年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 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）の2021年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年12月1日から2021年5月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成

基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年7月1日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 深井 康治 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2020年12月1日から2021年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）の2021年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年12月1日から2021年5月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年7月1日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 深井 康治 印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 竹内 知明 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 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）の2020年12月1日から2021年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 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）の2021年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年12月1日から2021年5月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成

基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年7月1日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 深井 康治 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)の2020年12月1日から2021年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)の2021年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間(2020年12月1日から2021年5月31日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年7月1日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 深井 康治 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)の2020年12月1日から2021年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)の2021年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間(2020年12月1日から2021年5月31日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以上

(注) 1 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年7月1日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士	深井 康治	印
-------	-------	---

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士	竹内 知明	印
-------	-------	---

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン T O P I X インデックスの2020年12月1日から2021年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン T O P I X インデックスの2021年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間(2020年12月1日から2021年5月31日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以上

(注) 1 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年7月1日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックスの2020年12月1日から2021年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックスの2021年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間(2020年12月1日から2021年5月31日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2021年7月1日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 深井 康治 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン J-REITインデックスの2020年12月1日から2021年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックスの2021年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年12月1日から2021年5月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以上

(注) 1 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。