

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2022年2月21日提出
【計算期間】	第5計算期間 (自 2020年12月1日 至 2021年11月30日)
【ファンド名】	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 エマージングブラス(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 エマージングブラス(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)
【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
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部【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	特殊型
		その他資産 ( )	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

< 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 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	ファミリー ファンド	あり ( )
不動産投信	年4回	北米		
その他資産 (投資信託証券) (債券 一般)	年6回 (隔月)	欧州		
資産複合 ( )	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	なし
	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 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	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 (東証REIT指数 (配当込み))
社債		アフリカ		
その他債券		中近東 (中東)		
クレジット属性 ( )		エマーシング		
不動産投信				
その他資産 (投資信託証券) (不動産投信)				
資産複合 ( )				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>



## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

(注) 2022年2月22日より、「商品分類」の「補足分類」を「インデックス型」とし、「属性区分」に対象インデックスを追加しました。

<FWO 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・ 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) <sup>(注)</sup>	S&P先進国REIT指数 (除く日本) (円ヘッジ・円ベース)	先進国リート・インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド
	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) 2022年3月14日までは、上記のほか、マザーファンドとして「ダイワ・グローバルREITインデックス・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為替ヘッジを行なうことがあります。



## ●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をめざして運用を行ないます。

◆東京証券取引所第一部上場株式<sup>※</sup>（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ないます。

- (a)上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、分散投資を行ないます。
- (b)ポートフォリオは、東証株価指数における業種別、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<sup>(注1)</sup>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ないます。

※2022年3月12日以降、「東京証券取引所上場株式」とします。

## 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をめざして運用を行ないます。

◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル<sup>(注1)</sup>を用います。  
MSCIコクサイ指数（円ベース）への連動性を随時チェックし、必要があればポートフォリオのリバランスを行ないます。なお、保有外貨建資産については、MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして為替ヘッジを行ないます。

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

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

(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<sup>(注2)</sup>を用いるとともに、残存年限別構成比率等をチェックします。

(注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<sup>(注3)</sup>を用い債券価格変動への連動をめぐ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 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）

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

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

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

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

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

※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。

\* 2022年3月14日までは、「先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」への投資のほか、海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざした運用を行なう「ダイワ・グローバルREITインデックス・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為替ヘッジを行なうことがあります。

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

## ◆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ーした新興国の上場株式の中から、4つのファンダメンタル指標 (株主資本、キャッシュフロー、売上、配当) に着目し、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うる制度等がある国は除外されています。国別構成比率に、1か国当たりの上限を設けており、分散が図られています。

## ◆東証REIT指数 (配当込み)

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

## ◆S&amp;P先進国REIT指数

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

# 3 毎年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をめぐっ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）」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。

### 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（為替ヘッジあり） 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「ライセンサ各社」）によって出資、保証、販売、または販売促進されることはございません。また、ライセンサ各社はいずれも、明示的にも黙示的にもFTSE RAFI<sup>®</sup>エマージング インデックスの使用から得られる結果や特定の日時における指数値について何ら保証や表明を行なうことはございません。当該指数はまたRAと共同しFTSEによってルールに基づき計算されます。いずれのライセンサ各社も、指数における瑕疵については（過失の有無に関わらず）何人に対しても責任を負わず、またそれについて通知する義務も負いません。FTSE<sup>®</sup>はLSEGの商標です。Fundamental Index<sup>®</sup>およびRAFI<sup>®</sup>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<sup>®</sup> 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<sup>®</sup> is a trade mark of LSEG. The trade names Fundamental Index<sup>®</sup> and RAFI<sup>®</sup> 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指数の商標は、(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、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、東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商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、言及をするものではありません。
- (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）（円ヘッジ・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<sup>®</sup>およびS&P<sup>®</sup>はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones<sup>®</sup>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）」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。

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<sup>®</sup>およびS&P<sup>®</sup>はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones<sup>®</sup>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	<p>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。</p> <p>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</p>
1	収益分配金、償還金など お申込金( 3)	
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約(以下「信託契約」といいます。)( 2)の委託者であり、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
運用指図	2 損益 信託金( 3)	
受託会社	<p>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 など</p>
	損益 投資	

投資対象	<p>ファミリーファンド方式で運用を行ないます。</p> <p>&lt; FWO T O P I X インデックス &gt; 東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。） など</p> <p>&lt; FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり） &gt; 外国の株式（ D R（預託証券）を含みます。） など</p> <p>&lt; FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし） &gt; 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>&lt; FWO 日本債券インデックス &gt; わが国の公社債 など</p> <p>&lt; FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） &gt; 外国の公社債 など</p> <p>&lt; FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし） &gt; 外国の公社債、新興国通貨建ての債券 など</p> <p>&lt; FWO J - R E I T インデックス &gt; わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券 など</p> <p>&lt; 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） &gt; 海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券 など</p>
------	---

（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11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) (注)	先進国リート・インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンドの受益証券
FWO 外国REITインデックス (為替ヘッジなし)	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券

(注) 2022年3月14日までは、上記のほかマザーファンドとして「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」に投資します。

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

<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。

<FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)>

<2022年3月14日まで>

- イ．主として、マザーファンドの受益証券に投資し、投資成果をS&P先進国REIT指数(除く日本)(円ヘッジ・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
- ロ．ダイワ・グローバルREITインデックス・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。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(以下総称して「リート」と

いいます。)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．先進国リート・インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンドの運用にあたっては、先進国(日本を除きます。)の金融商品取引所上場または店頭登録のリートに投資し、投資成果をベンチマーク(S&P先進国REIT指数(除く日本)(円ヘッジ・円ベース))の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。

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

ニ．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ダイワ・グローバルREITインデックス・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。

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

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

ト．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。

#### <2022年3月15日から>

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

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

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

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

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

#### <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。

## &lt;FWO J - R E I T インデックス&gt;

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

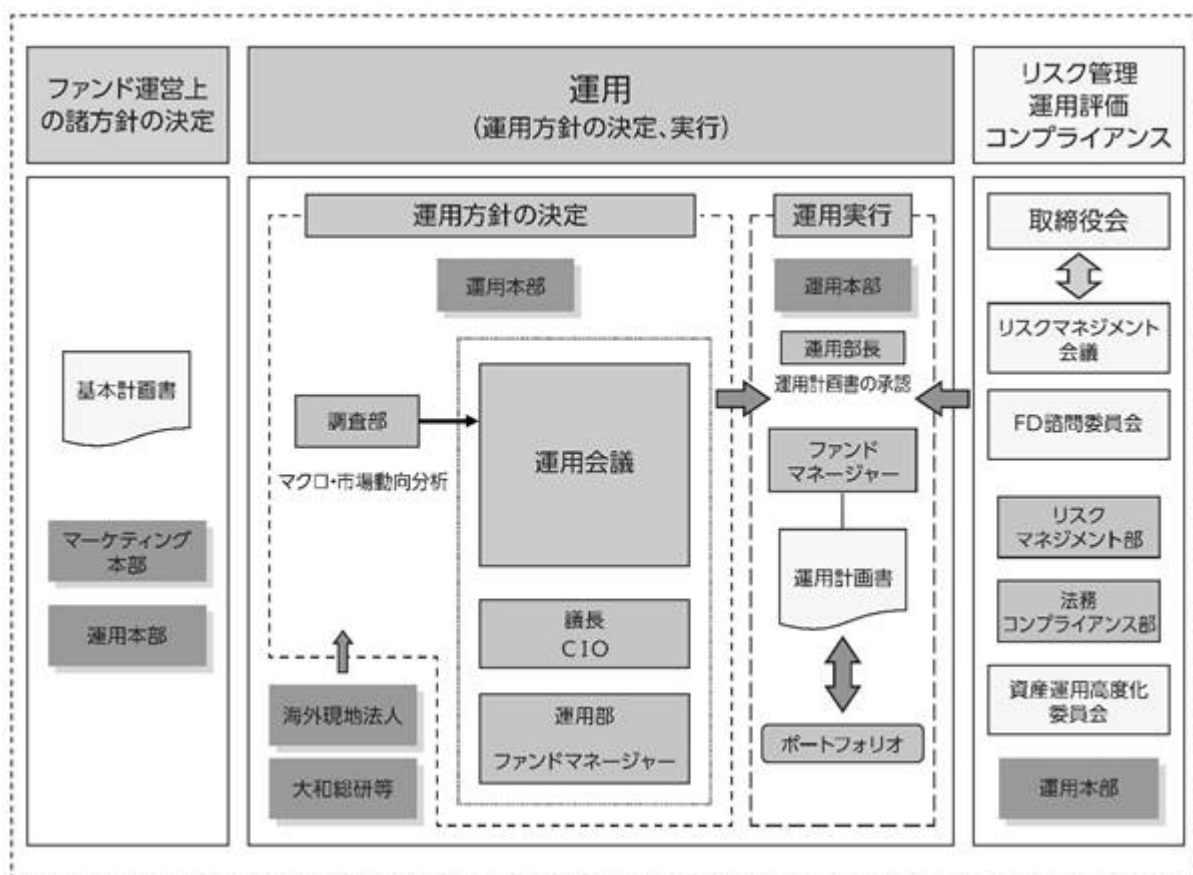
指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、＜ファンドの特色＞をご参照下さい。

### (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45~55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11月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

#### (4)【分配方針】

## &lt;各ファンド共通&gt;

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）

## &lt;各ファンド共通&gt;

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）

## &lt;FWO TOPIXインデックス&gt;

## &lt;FWO 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）&gt;

## &lt;FWO 外国株式インデックス EM+（為替ヘッジなし）&gt;

## &lt;FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）&gt;

## &lt;FWO 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）&gt;

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

## &lt;FWO 日本債券インデックス&gt;

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。

## &lt;FWO 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）&gt;

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。

## &lt;FWO 外国債券インデックス EM+（為替ヘッジなし）&gt;

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、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、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。

□ . 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。

□ . 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。 )。

□ . 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。  2022年3月12日に信託約款を変更し、下記とします。 東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）を投資対象とします。
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。 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。 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 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。

## 先進国リート・インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド

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

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

#### ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への直接投資は、行ないません。  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。  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  委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。）および外国の金融商品取引所におけるこの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。</p>
---------------	--

### 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

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)

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)

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 TOPIXインデックスの と同内容)

## &lt;FWO J-REITインデックス&gt;

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

- ・リートには資産規模が小さく、流動性が低いものもあります。このようなリートへの投資は、流動性の高い株式等に比べ、より制約を受けることが考えられます。
- ・金利の上昇局面においては、他の、より利回りの高い債券等との比較でリートに対する投資価値が相対的に低下し、価格が下落することも想定されます。

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

- ・リートの収益は、所有する不動産から得られる賃料収入がその大半を占めます。したがって、賃料水準や入居率の低下等により賃料収入が減少した場合には、リートの収益が悪化し、価格や配当が下落することが考えられます。
- ・リートの資産価値は、所有する不動産の評価等により変動します。市況の悪化、不動産の老朽化等によってリートの資産価値が低下した場合には、価格が下落することがあります。なお、実物資産である不動産には、人的災害、自然災害等に伴って大きな損害が発生する可能性もあり、このような場合、リートの価格が大幅に下落することも想定されます。
- ・リートでは、投資資金を調達するために金融機関等から借入れを行なうことがあります。したがって、金利上昇局面において金利負担等が増加し、収益の悪化要因となることが考えられます。
- ・法人形態のリートでは、経営陣の運営如何によっては収益や財務内容が著しく悪化する可能性があります。リートが倒産等に陥り、投資資金が回収できなくなることもありえます。

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

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

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

その他

（FWO TOPIXインデックスの と同内容）

## &lt;FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)&gt;

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

- ・リートには資産規模が小さく、流動性が低いものもあります。このようなリートへの投資は、流動性の高い株式等に比べ、より制約を受けることが考えられます。
- ・金利の上昇局面においては、他の、より利回りの高い債券等との比較でリートに対する投資価値が相対的に低下し、価格が下落することも想定されます。

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

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

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 TOPIX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 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が発生した場合には、お買付けの申込みの受け付けを中止すること、すでに受け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 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、ご換金の申込みの受け付けを中止することがあります。ご換金の申込み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け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。

### 流動性リスクに関する事項

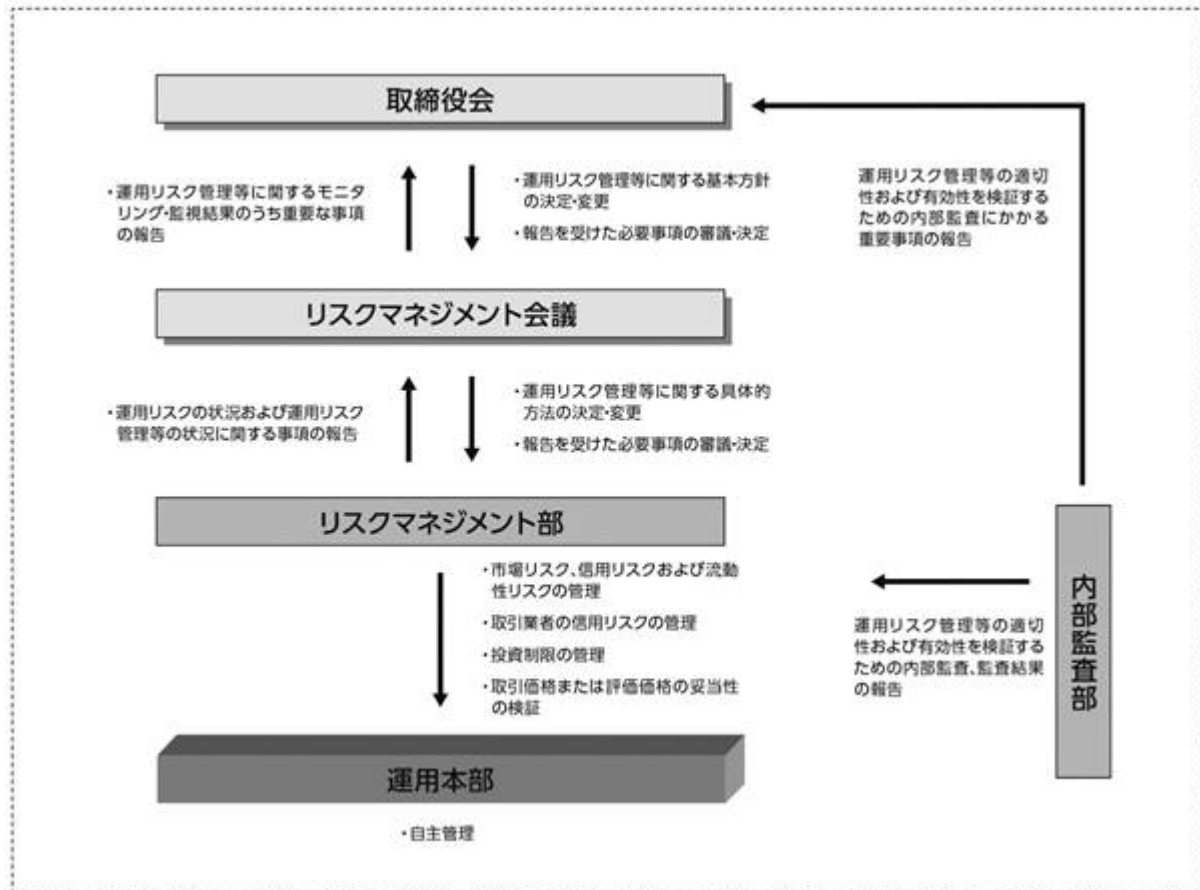
- 当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

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

## (4)リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。





#### 流動性リスクに対する管理体制

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

## 参考情報

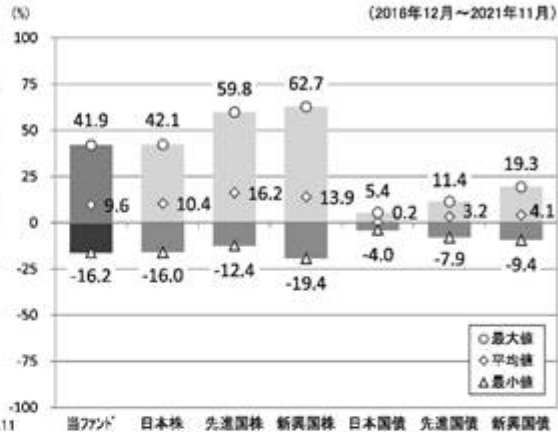
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間に於ける年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間に於ける年間騰落率の推移を表示しています。

### ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

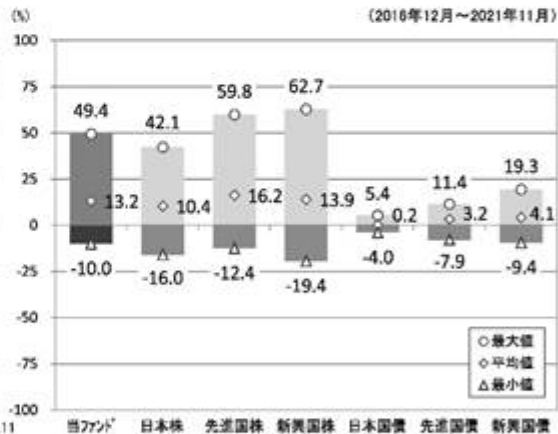
#### [FWO TOPIXインデックス]



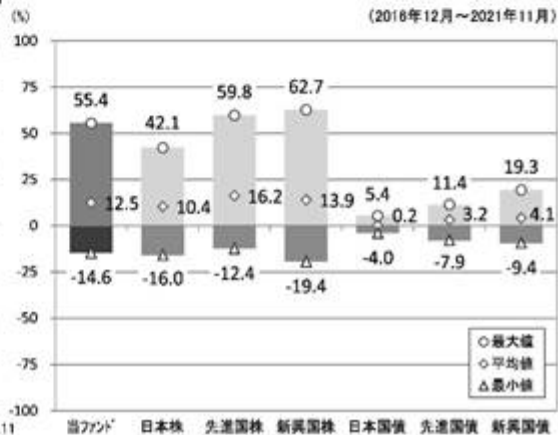
### 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



#### [FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)]

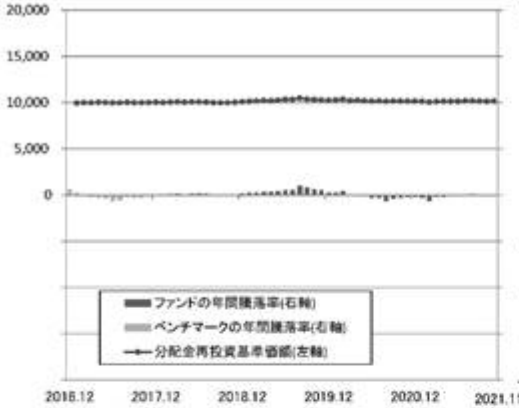


#### [FWO 外国株式インデックスEM+(為替ヘッジなし)]



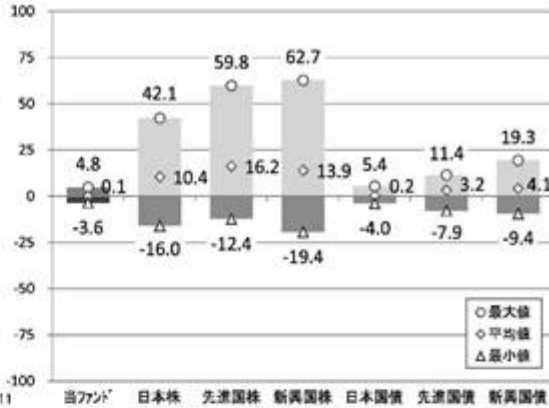
## [FWO 日本債券インデックス]

(円) (2016年12月～2021年11月) (%)



2016.12 2017.12 2018.12 2019.12 2020.12 2021.11

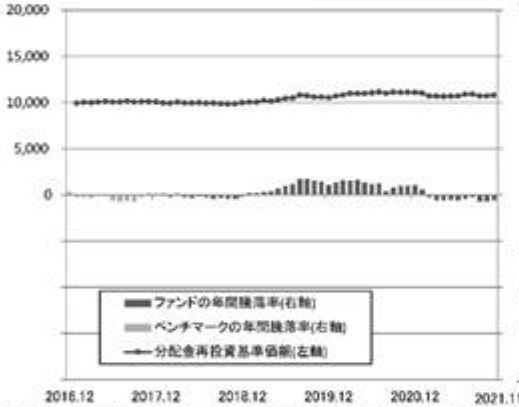
(2016年12月～2021年11月)



当ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債

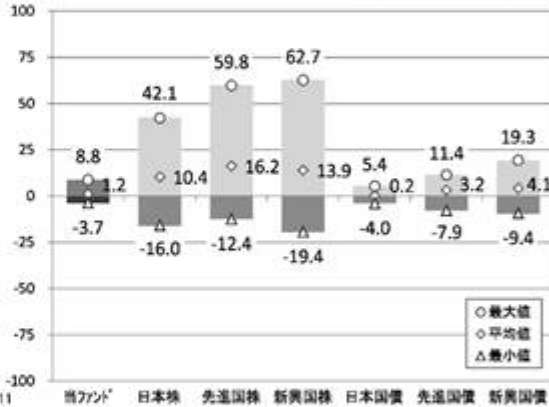
## [FWO 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)]

(円) (2016年12月～2021年11月) (%)



2016.12 2017.12 2018.12 2019.12 2020.12 2021.11

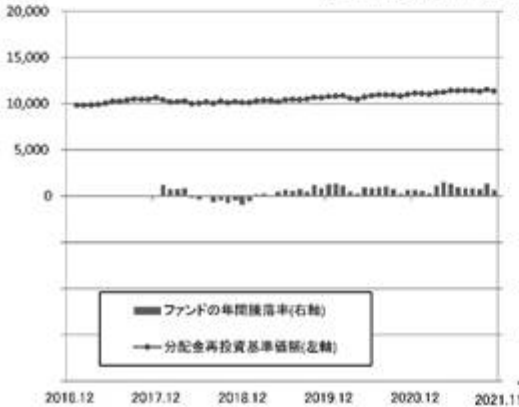
(2016年12月～2021年11月)



当ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債

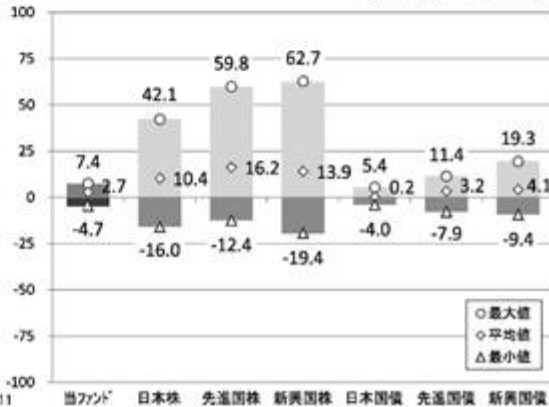
## [FWO 外国債券インデックスEM+(為替ヘッジなし)]

(円) (2016年12月～2021年11月) (%)



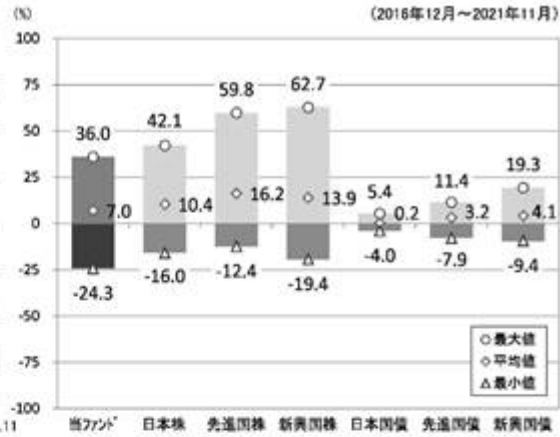
2016.12 2017.12 2018.12 2019.12 2020.12 2021.11

(2016年12月～2021年11月)

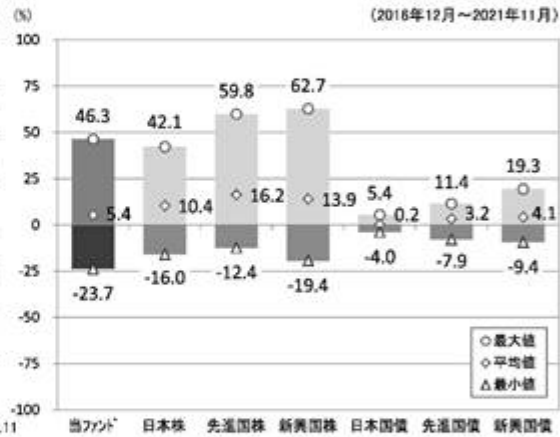


当ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債

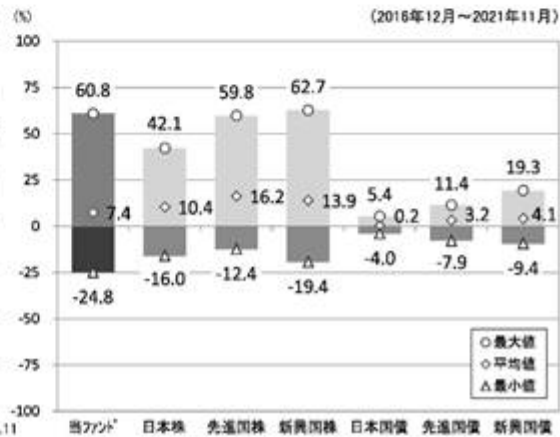
## [FWO J-REITインデックス]



## [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、指数種、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、知的所有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諾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-REITインデックス	年率0.231% (税抜0.21%)
FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)	年率0.3245% (税抜0.295%)
FWO 外国REIT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 TOPIX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)
-----------------	-----------------	-----------------

## &lt;FWO J-REITインデックス&gt;

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)
-------------------------	-------------------------	-------------------------

## &lt;FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)&gt;

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)
--------------------------	-------------------------	-------------------------

## &lt;FWO 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)&gt;

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 TOP 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11月末日現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- ( ) 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

## 【ダイワ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11月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	3,521,316,023	99.99
内 日本	3,521,316,023	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	245,231	0.01
純資産総額	3,521,561,254	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11月30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	2,681,477,325	1.2051 3,231,493,518	1.3132 3,521,316,023	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
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
2020年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	-
6月末日	3,339,501,131	-	1.3828	-
7月末日	3,317,785,597	-	1.3526	-
8月末日	3,500,281,200	-	1.3950	-
9月末日	3,670,512,381	-	1.4559	-
10月末日	3,622,383,769	-	1.4350	-
第5計算期間末 (2021年11月30日)	3,521,561,254	3,521,561,254	1.3823	1.3823

## 【分配の推移】

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

## 【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
第5計算期間	12.0

## (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	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
第5計算期間	891,127,877	487,424,798

(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11月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	177,548,758,040	97.20
内 日本	177,548,758,040	97.20
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,114,533,662	2.80
純資産総額	182,663,291,702	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)	5,536,320,000	3.03
内 日本	5,536,320,000	3.03

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

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

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

## (2) 投資資産（2021年11月30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	3,409,900	1,985.83 6,771,512,900	2,001.00 6,823,209,900	3.74
2	ソニーグループ	日本	株式	電気機 器	421,700	12,341.45 5,204,389,600	13,825.00 5,830,002,500	3.19
3	キーエンス	日本	株式	電気機 器	61,000	71,630.00 4,369,430,000	70,330.00 4,290,130,000	2.35
4	リクルートホールディ ングス	日本	株式	サービ ス業	496,200	7,015.67 3,481,178,400	6,901.00 3,424,276,200	1.87
5	三菱UFJフィナンシャル G	日本	株式	銀行業	4,258,400	632.50 2,693,438,000	601.40 2,561,001,760	1.40
6	東京エレクトロン	日本	株式	電気機 器	42,700	53,941.40 2,303,298,000	59,840.00 2,555,168,000	1.40
7	日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	772,600	3,225.94 2,492,365,600	3,125.00 2,414,375,000	1.32
8	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	396,100	6,329.00 2,506,916,900	6,030.00 2,388,483,000	1.31
9	HOYA	日本	株式	精密機 器	131,400	18,410.21 2,419,101,800	18,020.00 2,367,828,000	1.30
10	日本電産	日本	株式	電気機 器	174,500	13,274.47 2,316,395,900	13,000.00 2,268,500,000	1.24
11	日立	日本	株式	電気機 器	323,800	6,443.57 2,086,430,600	6,688.00 2,165,574,400	1.19
12	信越化学	日本	株式	化学	113,200	21,150.00 2,394,180,000	19,000.00 2,150,800,000	1.18
13	ダイキン工業	日本	株式	機械	85,800	26,672.59 2,288,508,600	23,150.00 1,986,270,000	1.09
14	任天堂	日本	株式	その他 製品	38,000	52,660.00 2,001,080,000	50,100.00 1,903,800,000	1.04
15	三井住友フィナンシャ ルG	日本	株式	銀行業	459,700	3,928.20 1,805,795,900	3,703.00 1,702,269,100	0.93
16	三菱商事	日本	株式	卸売業	497,900	3,538.11 1,761,629,200	3,391.00 1,688,378,900	0.92

17	村田製作所	日本	株式	電気機器	197,700	10,011.36 1,979,247,500	8,380.00 1,656,726,000	0.91
18	本田技研	日本	株式	輸送用機器	529,900	3,338.09 1,768,855,500	3,101.00 1,643,219,900	0.90
19	武田薬品	日本	株式	医薬品	529,200	3,759.00 1,989,262,800	3,031.00 1,604,005,200	0.88
20	KDDI	日本	株式	情報・通信業	481,600	3,786.00 1,823,337,600	3,300.00 1,589,280,000	0.87
21	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	1,000,600	1,552.78 1,553,721,600	1,562.50 1,563,437,500	0.86
22	伊藤忠	日本	株式	卸売業	465,300	3,453.51 1,606,922,700	3,260.00 1,516,878,000	0.83
23	第一三共	日本	株式	医薬品	529,200	3,019.43 1,597,885,500	2,824.50 1,494,725,400	0.82
24	SMC	日本	株式	機械	19,800	77,236.12 1,529,275,200	72,650.00 1,438,470,000	0.79
25	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	76,100	17,327.22 1,318,601,500	17,840.00 1,357,624,000	0.74
26	三井物産	日本	株式	卸売業	516,000	2,445.70 1,261,986,000	2,557.00 1,319,412,000	0.72
27	ファナック	日本	株式	電気機器	59,100	25,563.75 1,510,817,900	22,245.00 1,314,679,500	0.72
28	東京海上HD	日本	株式	保険業	218,700	6,000.00 1,312,200,600	5,708.00 1,248,339,600	0.68
29	デンソー	日本	株式	輸送用機器	148,200	7,740.93 1,147,206,000	8,331.00 1,234,654,200	0.68
30	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	849,700	1,602.00 1,361,219,400	1,402.00 1,191,279,400	0.65

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	97.20%
合計	97.20%

(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

業種	投資比率
水産・農林業	0.08%

鉱業	0.22%
建設業	2.12%
食料品	3.16%
繊維製品	0.45%
パルプ・紙	0.20%
化学	6.62%
医薬品	4.70%
石油・石炭製品	0.39%
ゴム製品	0.64%
ガラス・土石製品	0.77%
鉄鋼	0.69%
非鉄金属	0.67%
金属製品	0.62%
機械	5.23%
電気機器	19.27%
輸送用機器	7.85%
精密機器	2.94%
その他製品	2.12%
電気・ガス業	1.05%
陸運業	2.90%
海運業	0.42%
空運業	0.36%
倉庫・運輸関連業	0.16%
情報・通信業	8.38%
卸売業	4.98%
小売業	4.10%
銀行業	4.54%
証券、商品先物取引業	0.71%
保険業	1.86%
その他金融業	1.10%
不動産業	1.79%
サービス業	6.07%
合計	97.20%

(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 031 2月	買建	292	5,890,975,350	5,536,320,000	3.03%

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

(注2) 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11月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	13,823円
純資産総額	35億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-3.7%
3カ月間	-0.9%
6カ月間	1.1%
1年間	12.0%
3年間	23.3%
5年間	-
設定来	38.2%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期					
	17年11月	18年11月	19年12月	20年11月	21年11月					
分配金	0円	0円	0円	0円	0円					

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

## 主要な資産の状況

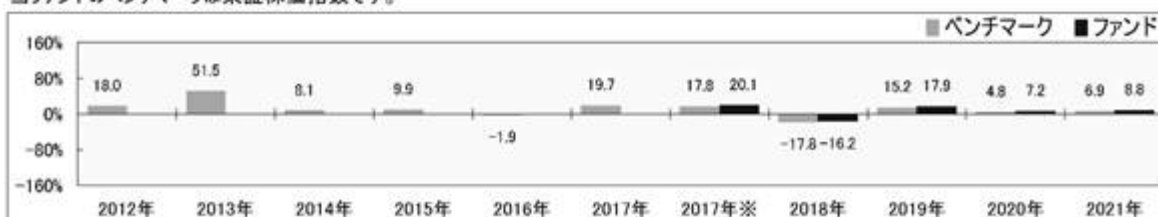
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	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	2,123	97.2%	電気機器	19.3%	トヨタ自動車	輸送用機器	3.7%
国内株式先物	1	3.0%	情報・通信業	8.4%	ソニーグループ	電気機器	3.2%
不動産投資信託等	-	-	輸送用機器	7.9%	TOPIX先物 0312月	-	3.0%
コール・ローン、その他	-	2.8%	化学	6.6%	キーエンス	電気機器	2.3%
合計	2,124	-	サービス業	6.1%	リクルートホールディングス	サービス業	1.9%
株式市場・上場別構成			機械	5.2%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	1.4%
一部(東証・名証)		97.2%	卸売業	5.0%	東京エレクトロン	電気機器	1.4%
二部(東証・名証)		-	医薬品	4.7%	日本電信電話	情報・通信業	1.3%
新興市場他		-	銀行業	4.5%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.3%
その他		-	その他	29.5%	HOYA	精密機器	1.3%
合計		97.2%	合計	97.2%	合計		20.9%

※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11月30日までの騰落率を表しています。

・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)】

## (1) 【投資状況】（2021年11月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	3,374,132,488	99.98
内 日本	3,374,132,488	99.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	535,916	0.02
純資産総額	3,374,668,404	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11月30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	1,138,524,932	2.4008 2,733,471,733	2.9636 3,374,132,488	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
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
2020年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	-
6月末日	3,124,492,255	-	1.7288	-
7月末日	3,171,573,463	-	1.7696	-
8月末日	3,271,644,571	-	1.8107	-
9月末日	3,178,752,205	-	1.7428	-
10月末日	3,364,235,358	-	1.8331	-
第5計算期間末 (2021年11月30日)	3,374,668,404	3,374,668,404	1.8402	1.8402

## 【分配の推移】

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

## 【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
第5計算期間	25.5

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	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
第5計算期間	503,558,139	967,841,476

(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11月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	76,523,797,165	93.01
内 香港	657,293,549	0.80
内 シンガポール	237,233,740	0.29
内 イスラエル	153,430,975	0.19
内 ノルウェー	163,854,633	0.20
内 スウェーデン	893,156,931	1.09
内 デンマーク	645,269,396	0.78
内 イギリス	3,248,193,242	3.95
内 アイルランド	149,397,849	0.18
内 オランダ	1,125,692,224	1.37
内 ベルギー	203,390,770	0.25
内 フランス	2,592,724,418	3.15
内 ドイツ	2,029,753,614	2.47
内 スイス	2,320,365,780	2.82
内 ポルトガル	50,113,077	0.06
内 スペイン	527,955,477	0.64
内 イタリア	575,654,367	0.70
内 フィンランド	241,817,953	0.29

	内 オーストリア	49,136,458	0.06
	内 カナダ	2,715,192,984	3.30
	内 アメリカ	56,498,332,866	68.67
	内 オーストラリア	1,394,359,271	1.69
	内 ニュージーランド	51,477,591	0.06
投資証券		1,902,993,078	2.31
	内 香港	31,864,560	0.04
	内 シンガポール	31,557,114	0.04
	内 イギリス	51,782,690	0.06
	内 フランス	31,532,110	0.04
	内 カナダ	11,113,227	0.01
	内 アメリカ	1,556,883,562	1.89
	内 オーストラリア	182,991,658	0.22
	内 その他	5,268,157	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		3,849,033,787	4.68
純資産総額		82,275,824,030	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	3,055,897,774	3.71
内 イギリス	129,401,928	0.16
内 ドイツ	395,580,276	0.48
内 カナダ	91,123,749	0.11
内 アメリカ	2,381,149,215	2.89
内 オーストラリア	58,642,606	0.07
為替予約取引(売建)	79,437,746,970	96.55
内 日本	79,437,746,970	96.55

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

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

(注3) 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11月30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	201,515	14,742.31 2,970,802,244	18,230.50 3,673,720,175	4.47
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	86,366	25,015.40 2,160,488,584	38,298.39 3,307,679,191	4.02
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	5,465	357,793.33 1,955,341,061	405,199.81 2,214,417,010	2.69
4	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	9,886	91,195.87 901,563,027	129,355.35 1,278,807,013	1.55
5	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	3,631	205,537.45 746,306,692	331,140.09 1,202,369,702	1.46
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	3,509	202,846.79 711,789,571	332,467.79 1,166,629,495	1.42
7	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	30,067	15,826.08 475,844,433	37,971.87 1,141,700,372	1.39
8	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	28,943	29,519.78 854,394,431	38,457.67 1,113,080,433	1.35
9	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	36,551	15,760.55 576,067,975	18,343.13 670,460,004	0.81
10	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	12,845	30,994.24 398,121,412	46,283.91 594,516,842	0.72
11	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	11,428	41,191.33 470,735,278	51,424.04 587,673,929	0.71
12	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	31,789	18,169.29 577,584,829	18,174.75 577,757,366	0.70

13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	15,959	26,557.33 423,828,447	32,096.79 512,232,710	0.62
14	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	34,292	12,460.82 427,310,655	14,802.32 507,601,329	0.62
15	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	29,125	15,694.34 457,098,429	16,954.00 493,785,407	0.60
16	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	92,634	3,785.12 350,640,123	5,186.77 480,471,651	0.58
17	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	20,264	24,272.48 491,858,870	22,331.91 452,533,891	0.55
18	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	5,719	54,806.53 313,439,062	78,215.73 447,315,802	0.54
19	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	4,916	54,644.36 268,631,920	90,503.36 444,914,557	0.54
20	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	5,301	57,028.69 302,309,559	75,525.07 400,358,432	0.49
21	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	66,999	4,323.71 289,689,983	5,961.54 399,417,754	0.49
22	SALESFORCE.COM INC	アメリカ	株式	情報技術	11,624	25,146.35 292,301,919	33,760.10 392,427,516	0.48
23	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	10,604	39,609.36 420,018,062	36,748.84 389,684,781	0.47
24	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	8,388	38,558.76 323,430,900	44,061.87 369,591,008	0.45
25	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	21,761	20,380.87 443,510,441	16,816.34 365,940,455	0.44
26	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	51,519	5,328.98 274,544,071	7,007.09 360,998,491	0.44
27	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	4,690	58,567.88 274,683,768	73,810.56 346,171,540	0.42
28	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	5,260	41,807.28 219,906,489	63,128.69 332,056,949	0.40
29	COMCAST CORP-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	54,820	5,890.44 322,920,123	5,862.56 321,385,983	0.39

30	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	50,501	5,213.28 263,278,966	6,343.81 320,369,011	0.39
----	-------------------	------	----	------	--------	-------------------------	-------------------------	------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	93.01%
投資証券	2.31%
合計	95.32%

(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。

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	3.14%
素材	3.86%
資本財・サービス	8.77%
一般消費財・サービス	11.58%
生活必需品	6.41%
ヘルスケア	11.85%
金融	12.86%
情報技術	23.31%
コミュニケーション・サービス	8.19%
公益事業	2.66%
不動産	0.36%
合計	93.01%

(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 202112	買建	90	2,311,000,624	2,381,149,215	2.89%
	イギリス	FTSE 100 IDX FUT 202112	買建	12	130,332,203	129,401,928	0.16%



	オーストラリア	SPI 200 FUTURES 202112	買建	4	59,643,936	58,642,606	0.07%
	カナダ	S&P/TSX 60 IX FUT 202112	買建	4	90,325,586	91,123,749	0.11%
	ドイツ	SWISS MKT IX FUTR 202112	買建	7	103,744,054	105,591,973	0.13%
		EURO STOXX 50 202112	買建	55	293,976,397	289,988,303	0.35%
為替予約取引	日本	イスラエル・シケル 売/円買 2021年12月	売建	3,046,500	109,632,262	109,730,969	0.13%
		ノルウェー・クローネ 売/円買 2021年12月	売建	13,449,800	181,739,077	169,571,043	0.21%
		ユーロ売/円買 2021年12 月	売建	61,467,400	8,105,568,523	7,894,030,752	9.59%
		香港ドル売/円買 2021年 12月	売建	47,788,400	700,444,136	697,122,842	0.85%
		ニュージーランド・ドル 売/円買 2021年12月	売建	680,000	55,546,276	52,709,316	0.06%
		豪ドル売/円買 2021年12 月	売建	20,314,500	1,739,465,672	1,651,270,226	2.01%
		デンマーク・クローネ 売/円買 2021年12月	売建	38,454,600	681,739,696	664,199,386	0.81%
		シンガポール・ドル売/ 円買 2021年12月	売建	3,065,600	259,144,977	255,038,606	0.31%
		カナダ・ドル売/円買 2021年12月	売建	31,071,000	2,859,792,381	2,773,108,499	3.37%
		米ドル売/円買 2021年12 月	売建	514,174,800	58,645,426,218	58,488,051,926	71.09%
		スウェーデン・クローネ 売/円買 2021年12月	売建	72,136,700	957,236,295	904,038,764	1.10%
		英ポンド売/円買 2021年 12月	売建	22,576,600	3,518,705,343	3,421,709,496	4.16%
		スイス・フラン売/円買 2021年12月	売建	19,122,900	2,382,488,912	2,357,165,145	2.86%

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

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

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

(注4) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## (参考情報) 運用実績

## ●FWO 外国株式インデックス(為替ヘッジあり)

2021年11月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	18,402円
純資産総額	33億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.4%
3カ月間	1.6%
6カ月間	9.0%
1年間	25.5%
3年間	61.1%
5年間	-
設定来	84.0%



※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	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	第5期 21年11月					
分配金	0円	0円	0円	0円	0円					

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	株式業種別構成	比率	租入上位10銘柄	国・地域名	比率
外国株式・先物	1,226	96.7%	日本円	99.9%	情報技術	23.3%	APPLE INC	アメリカ	4.5%
外国リート	57	2.2%	米ドル	0.6%	金融	12.9%	MICROSOFT CORP	アメリカ	4.0%
外国投資証券	6	0.1%	イスラエル・シケル	0.0%	ヘルスケア	11.9%	S&P500 EMINI FUT 202112	アメリカ	2.9%
			ニュージーランド・ドル	-0.0%	一般消費財・サービス	11.6%	AMAZON.COM INC	アメリカ	2.7%
コール・ローン、その他		4.7%	ノルウェー・クローネ	-0.0%	資本財・サービス	8.8%	TESLA INC	アメリカ	1.6%
合計	1,289	-	スウェーデン・クローネ	-0.0%	コミュニケーション・サービス	8.2%	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.5%
国・地域別構成			スイス・フラン	-0.0%	生活必需品	6.4%	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.4%
アメリカ		73.4%	シンガポール・ドル	-0.0%	素材	3.9%	NVIDIA CORP	アメリカ	1.4%
イギリス		4.2%	カナダ・ドル	-0.0%	エネルギー	3.1%	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	1.4%
その他		21.4%	その他	-0.4%	公益事業、他	3.0%	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	0.8%
合計		99.0%	合計	100.0%	合計	93.0%	合計		22.1%

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

※外国株式の国・地域名については、原則としてMSCI Incが提供するリスク所在国・地域に基づいて表示しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計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11月30日までの騰落率を表しています。

・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 【ダイワファンドラップオンライン 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11月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	2,608,113,005	99.21
内 日本	2,608,113,005	99.21
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	20,836,366	0.79
純資産総額	2,628,949,371	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11月30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	513,644,174	3.0736 1,578,764,608	4.1095 2,110,820,733	80.29
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	270,194,117	1.5912 429,949,195	1.8405 497,292,272	18.92

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.21%
合計	99.21%

(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
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
2020年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	-
6月末日	2,403,963,551	-	1.6849	-
7月末日	2,431,840,867	-	1.6892	-
8月末日	2,521,206,099	-	1.7276	-
9月末日	2,501,869,548	-	1.6979	-
10月末日	2,668,284,791	-	1.8056	-
第5計算期間末 (2021年11月30日)	2,628,949,371	2,628,949,371	1.7840	1.7840

## 【分配の推移】

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

## 【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
第5計算期間	32.9

## (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
第5計算期間	415,335,713	814,761,474

(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11月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	229,141,995,703	91.37
内 香港	2,019,819,006	0.81
内 シンガポール	746,104,406	0.30
内 イスラエル	469,391,562	0.19
内 ノルウェー	470,097,377	0.19
内 スウェーデン	2,677,537,778	1.07
内 デンマーク	1,959,025,386	0.78
内 イギリス	9,729,339,111	3.88
内 アイルランド	449,002,965	0.18
内 オランダ	3,364,990,639	1.34
内 ベルギー	593,517,776	0.24
内 フランス	7,642,465,645	3.05
内 ドイツ	5,954,384,514	2.37
内 スイス	6,862,594,012	2.74

	内 ポルトガル	133,039,143	0.05
	内 スペイン	1,527,490,004	0.61
	内 イタリア	1,654,205,960	0.66
	内 フィンランド	682,716,253	0.27
	内 オーストリア	143,240,392	0.06
	内 カナダ	8,006,114,675	3.19
	内 アメリカ	169,868,567,833	67.74
	内 オーストラリア	4,018,864,747	1.60
	内 ニューゼaland	169,486,519	0.07
投資証券		5,638,901,536	2.25
	内 香港	91,958,582	0.04
	内 シンガポール	96,607,210	0.04
	内 イギリス	142,764,491	0.06
	内 フランス	93,942,606	0.04
	内 カナダ	26,584,306	0.01
	内 アメリカ	4,673,546,263	1.86
	内 オーストラリア	492,115,558	0.20
	内 その他	21,382,520	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		15,996,314,124	6.38
純資産総額		250,777,211,363	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)	16,312,448,690	6.50
内 イギリス	722,494,098	0.29
内 ドイツ	2,658,197,441	1.06
内 カナダ	683,428,116	0.27
内 アメリカ	11,720,545,581	4.67
内 オーストラリア	527,783,454	0.21
為替予約取引(買建)	9,748,917,290	3.89
内 日本	9,748,917,290	3.89

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

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

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

(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11月30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	605,600	13,434.07 8,135,698,275	18,230.50 11,040,393,707	4.40
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	259,600	25,009.14 6,492,383,120	38,298.39 9,942,263,368	3.96
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	16,470	367,119.97 6,046,467,316	405,199.81 6,673,641,017	2.66
4	TESLA INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	29,620	68,843.59 2,039,149,848	129,355.35 3,831,505,535	1.53
5	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	10,900	210,512.84 2,294,590,837	331,140.09 3,609,427,087	1.44
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	10,557	209,309.83 2,209,684,222	332,467.79 3,509,862,518	1.40
7	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	90,380	15,633.70 1,412,976,618	37,971.87 3,431,898,081	1.37
8	META PLATFORMS INC CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	86,900	32,153.10 2,794,112,699	38,457.67 3,341,971,792	1.33
9	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	109,770	14,160.38 1,554,390,748	18,343.13 2,013,526,159	0.80
10	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	38,550	31,706.56 1,222,291,408	46,283.91 1,784,244,784	0.71
11	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	34,216	39,028.00 1,335,385,221	51,424.04 1,759,524,953	0.70

12	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	95,500	16,641.02 1,589,225,256	18,174.75 1,735,689,341	0.69
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	48,850	26,702.72 1,304,429,651	32,096.79 1,567,928,309	0.63
14	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	102,700	12,680.45 1,302,293,066	14,802.32 1,520,198,778	0.61
15	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	88,667	15,730.29 1,394,761,366	16,954.00 1,503,260,797	0.60
16	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	279,401	3,404.22 951,163,389	5,186.77 1,449,189,926	0.58
17	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	61,250	24,192.16 1,481,776,773	22,331.91 1,367,829,690	0.55
18	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技術	15,010	49,159.84 737,890,041	90,503.36 1,358,455,554	0.54
19	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	17,320	55,040.78 953,307,341	78,215.73 1,354,696,570	0.54
20	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	16,070	56,462.57 907,354,136	75,525.07 1,213,687,984	0.48
21	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	203,113	4,261.02 865,470,574	5,961.54 1,210,867,899	0.48
22	SALESFORCE.COM INC	アメリカ	株式	情報技術	35,216	27,926.09 983,447,265	33,760.10 1,188,896,027	0.47
23	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	32,050	38,878.39 1,246,053,979	36,748.84 1,177,800,569	0.47
24	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	65,862	17,161.86 1,130,314,741	16,816.34 1,107,558,029	0.44
25	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	25,000	37,553.78 938,846,945	44,061.87 1,101,546,875	0.44
26	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	153,605	4,766.39 732,158,638	7,007.09 1,076,324,720	0.43
27	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	14,240	52,009.50 740,616,783	73,810.56 1,051,062,416	0.42
28	COSTCO WHOLESALE CORP	アメリカ	株式	生活必需品	16,060	44,226.03 710,271,434	63,128.69 1,013,846,883	0.40



29	COMCAST CORP-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	166,090	5,946.53 987,662,456	5,862.56 973,713,936	0.39
30	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技 術	152,950	4,966.28 759,596,554	6,343.81 970,286,535	0.39

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	91.37%
投資証券	2.25%
合計	93.62%

(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

業種	投資比率
エネルギー	3.06%
素材	3.77%
資本財・サービス	8.62%
一般消費財・サービス	11.35%
生活必需品	6.33%
ヘルスケア	11.64%
金融	12.62%
情報技術	22.96%
コミュニケーション・サービス	8.06%
公益事業	2.61%
不動産	0.35%
合計	91.37%

(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 202112	買建	443	11,321,468,692	11,720,545,581	4.67%
	イギリス	FTSE 100 IDX FUT 202112	買建	67	719,861,387	722,494,098	0.29%
	オーストラリア	SPI 200 FUTURES 202112	買建	36	538,055,421	527,783,454	0.21%
	カナダ	S&P/TSX 60 IX FUT 202112	買建	30	664,563,818	683,428,116	0.27%
	ドイツ	SWISS MKT IX FUTR 202112	買建	42	622,790,939	633,551,835	0.25%
		EURO STOXX 50 202112	買建	384	2,048,077,093	2,024,645,606	0.81%
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2021年12月	買建	1,990,000	308,287,051	301,604,400	0.12%
		米ドル買/円売 2021年12月	買建	61,780,000	7,046,626,660	7,027,555,314	2.80%
		スイス・フラン買/円売 2021年12月	買建	3,570,000	443,805,440	440,052,480	0.18%
		ユーロ買/円売 2021年12月	買建	9,940,000	1,304,068,477	1,276,557,422	0.51%
		豪ドル買/円売 2021年12月	買建	3,380,000	286,703,319	274,744,314	0.11%
		カナダ・ドル買/円売 2021年12月	買建	4,800,000	439,283,847	428,403,360	0.17%

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

(注2) 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11月30日現在)

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	13,499,628,366	83.71
内 中国	3,957,691,851	24.54

内 台湾	2,126,719,267	13.19
内 タイ	577,703,659	3.58
内 シンガポール	15,436,287	0.10
内 マレーシア	82,245,495	0.51
内 インドネシア	252,980,204	1.57
内 インド	1,595,310,446	9.89
内 サウジアラビア	294,052,517	1.82
内 ロシア	1,441,785,321	8.94
内 トルコ	199,304,988	1.24
内 カナダ	10,220,869	0.06
内 メキシコ	368,999,156	2.29
内 チリ	70,198,578	0.44
内 ブラジル	1,980,898,585	12.28
内 南アフリカ	526,081,143	3.26
投資証券	1,239,446,104	7.69
内 アメリカ	1,239,446,104	7.69
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,386,926,021	8.60
純資産総額	16,126,000,491	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1,302,515,755	8.08
内 アメリカ	1,302,515,755	8.08
為替予約取引(買建)	519,957,192	3.22
内 日本	519,957,192	3.22

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

(注2) 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11月30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	-	504,600	2,589.06 1,306,489,208	2,456.29 1,239,446,104	7.69
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技 術	214,000	2,407.62 515,231,707	2,428.09 519,612,929	3.22
3	GAZPROM PJSC-SPON ADR	ロシア	株式	エネル ギー	392,339	881.94 346,021,434	1,028.02 403,334,583	2.50
4	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技 術	916,902	456.54 418,609,683	423.79 388,574,907	2.41
5	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	株式	金融	4,708,000	88.56 416,946,600	73.97 348,256,880	2.16
6	IND & COMM BK OF CHINA-H	中国	株式	金融	5,490,000	66.38 364,450,905	60.69 333,212,256	2.07
7	SBERBANK PJSC - SPONSORED ADR	ロシア	株式	金融	156,977	1,903.37 298,785,642	1,914.74 300,571,569	1.86
8	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	ブラジ ル	株式	エネル ギー	443,800	592.01 262,737,779	597.90 265,348,950	1.65
9	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	ブラジ ル	株式	エネル ギー	367,300	609.26 223,782,540	611.90 224,751,296	1.39
10	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	ブラジ ル	株式	金融	485,736	502.24 243,957,917	459.73 223,311,011	1.38
11	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	株式	エネル ギー	55,200	3,257.76 179,828,390	3,735.49 206,199,324	1.28
12	LUKOIL PJSC-SPON ADR	ロシア	株式	エネル ギー	20,288	10,603.36 215,121,049	10,059.54 204,088,016	1.27
13	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	中国	株式	一般消 費財・ サービ ス	95,100	3,093.08 294,151,908	1,896.70 180,376,170	1.12
14	BANCO BRADESCO SA- PREF	ブラジ ル	株式	金融	421,218	527.50 222,192,916	411.24 173,225,016	1.07
15	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	株式	金融	194,000	1,092.79 212,001,454	810.47 157,232,053	0.98
16	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	21,500	8,381.95 180,212,033	6,746.41 145,047,944	0.90
17	VALE SA	ブラジ ル	株式	素材	94,890	2,304.36 218,661,463	1,410.05 133,799,716	0.83

18	BANK OF CHINA LTD-H	中国	株式	金融	3,350,000	40.56 135,876,670	39.83 133,432,845	0.83
19	INFOSYS LTD	インド	株式	情報技術	48,724	2,398.73 116,875,915	2,595.41 126,459,025	0.78
20	PTT PCL-NVDR	タイ	株式	エネルギー	1,036,800	130.97 135,794,880	121.68 126,157,824	0.78
21	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国	株式	エネルギー	2,079,800	57.04 118,646,143	51.35 106,811,873	0.66
22	PETROCHINA CO LTD-H	中国	株式	エネルギー	2,052,000	55.29 113,467,597	49.75 102,090,899	0.63
23	AL RAJHI BANK	サウジアラビア	株式	金融	24,162	3,425.73 82,772,633	4,099.95 99,062,992	0.61
24	BANCO DO BRASIL S.A.	ブラジル	株式	金融	154,300	652.07 100,614,770	625.08 96,451,184	0.60
25	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	中国	株式	金融	2,523,000	39.39 99,388,539	37.93 95,707,482	0.59
26	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	インド	株式	金融	21,890	3,787.82 82,915,402	4,152.11 90,889,775	0.56
27	CHINA MERCHANTS BANK-H	中国	株式	金融	101,000	943.97 95,341,273	889.26 89,815,311	0.56
28	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	77.74 69,696,528	97.54 87,450,305	0.54
29	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	中国	株式	不動産	318,000	260.28 82,770,821	266.99 84,905,046	0.53
30	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	ロシア	株式	エネルギー	91,299	871.02 79,523,539	868.74 79,315,798	0.49

(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	83.71%
投資証券	7.69%
合計	91.40%

(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	14.96%
素材	8.48%
資本財・サービス	2.76%
一般消費財・サービス	5.27%
生活必需品	3.59%
ヘルスケア	0.71%
金融	26.87%
情報技術	11.34%
コミュニケーション・サービス	4.68%
公益事業	3.10%
不動産	1.97%
合計	83.71%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	アメリカ	MSCI EMGMKT 202112	買建	189	1,381,506,891	1,302,515,755	8.08%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2021年12 月	買建	4,571,000	521,810,396	519,957,192	3.22%

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

(注2) 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11月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	17,840円
純資産総額	26億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-1.2%
3カ月間	3.3%
6カ月間	8.1%
1年間	32.9%
3年間	54.5%
5年間	-
設定来	78.4%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。 ※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。  
 ※「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	第5期 21年11月					
分配金	0円	0円	0円	0円	0円					

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	株式業種別構成	比率	租入上位10銘柄	国・地域名	比率
外国株式・先物	1,632	96.0%	米ドル	64.1%	情報技術	20.6%	S&P500 EMINI FUT 202112	アメリカ	3.8%
外国リート	57	1.7%	ユーロ	7.7%	金融	15.2%	APPLE INC	アメリカ	3.5%
外国投資証券	7	1.5%	香港ドル	4.7%	一般消費財・サービス	10.1%	MICROSOFT CORP	アメリカ	3.2%
			英ポンド	3.4%	ヘルスクア	9.5%	AMAZON.COM INC	アメリカ	2.1%
コール・ローン、その他		7.5%	カナダ・ドル	2.8%	資本財・サービス	7.4%	MSCI EMGMKT 202112	アメリカ	1.5%
合計	1,696	-	台湾ドル	2.6%	コミュニケーション・サービス	7.4%	INVESCO FTSE RAFT EMERGING M	アメリカ	1.5%
国・地域別構成			ブラジル・リアル	2.5%	生活必需品	5.8%	TESLA INC	アメリカ	1.2%
アメリカ		62.6%	スイス・フラン	2.4%	エネルギー	5.3%	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.2%
中国		4.6%	インド・ルピー	1.9%	素材	4.6%	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.1%
その他		31.9%	その他	8.0%	公益事業、他	3.3%	NVIDIA CORP	アメリカ	1.1%
合計		99.2%	合計	100.0%	合計	89.2%	合計		20.2%

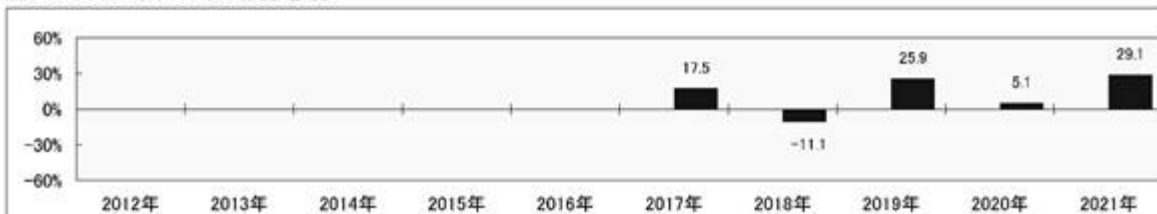
※株式業種別構成は、原則としてS&PとMSCI Incが共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

※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11月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス】

## (1) 【投資状況】（2021年11月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	3,038,297,670	99.90
内 日本	3,038,297,670	99.90
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,026,801	0.10
純資産総額	3,041,324,471	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11月30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	2,139,796,937	1.4179 3,034,227,302	1.4199 3,038,297,670	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
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
2020年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	-
6月末日	2,886,408,952	-	1.0137	-
7月末日	2,917,535,418	-	1.0187	-
8月末日	2,953,855,608	-	1.0177	-
9月末日	2,977,238,499	-	1.0140	-
10月末日	3,005,934,732	-	1.0128	-
第5計算期間末 (2021年11月30日)	3,041,324,471	3,041,324,471	1.0151	1.0151

## 【分配の推移】

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

## 【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
第5計算期間	0.0

## (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	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
第5計算期間	1,226,825,775	597,072,806

(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11月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	85,097,080,600	89.50
内 日本	85,097,080,600	89.50
地方債証券	3,514,853,500	3.70
内 日本	3,514,853,500	3.70
特殊債証券	2,703,089,900	2.84
内 日本	2,703,089,900	2.84
社債券	2,976,109,700	3.13
内 日本	2,976,109,700	3.13
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	788,477,271	0.83
純資産総額	95,079,610,971	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11月30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	100.29 1,554,526,000	0.100000 2023/03/20	1.63
2	138 5年国債	日本	国債証券	1,200,000,000	100.75 1,209,010,000	100.47 1,205,676,000	0.100000 2023/12/20	1.27
3	141 5年国債	日本	国債証券	1,120,000,000	100.87 1,129,786,400	100.63 1,127,078,400	0.100000 2024/09/20	1.19
4	145 5年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	100.97 1,110,680,900	100.82 1,109,031,000	0.100000 2025/09/20	1.17
5	349 10年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	101.38 1,064,532,000	101.18 1,062,453,000	0.100000 2027/12/20	1.12
6	148 5年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	100.52 1,005,249,700	100.50 1,005,020,000	0.005000 2026/06/20	1.06
7	136 5年国債	日本	国債証券	950,000,000	100.60 955,709,500	100.35 953,391,500	0.100000 2023/06/20	1.00
8	134 5年国債	日本	国債証券	950,000,000	100.49 954,681,100	100.23 952,251,500	0.100000 2022/12/20	1.00
9	359 10年国債	日本	国債証券	930,000,000	100.85 937,962,440	101.11 940,360,200	0.100000 2030/06/20	0.99
10	334 10年国債	日本	国債証券	900,000,000	102.60 923,436,000	101.85 916,695,000	0.600000 2024/06/20	0.96
11	345 10年国債	日本	国債証券	900,000,000	101.16 910,499,300	101.01 909,135,000	0.100000 2026/12/20	0.96
12	360 10年国債	日本	国債証券	900,000,000	100.62 905,654,300	101.01 909,117,000	0.100000 2030/09/20	0.96
13	139 5年国債	日本	国債証券	900,000,000	100.78 907,109,500	100.53 904,770,000	0.100000 2024/03/20	0.95
14	144 5年国債	日本	国債証券	890,000,000	100.97 898,635,100	100.78 896,977,600	0.100000 2025/06/20	0.94
15	342 10年国債	日本	国債証券	880,000,000	101.06 889,357,000	100.90 887,981,600	0.100000 2026/03/20	0.93
16	142 5年国債	日本	国債証券	850,000,000	100.88 857,493,700	100.68 855,856,500	0.100000 2024/12/20	0.90
17	147 5年国債	日本	国債証券	840,000,000	100.49 844,129,840	100.47 843,981,600	0.005000 2026/03/20	0.89
18	351 10年国債	日本	国債証券	800,000,000	101.36 810,936,000	101.21 809,744,000	0.100000 2028/06/20	0.85

19	137	5年国債	日本	国債証券	800,000,000	100.66 805,293,600	100.42 803,392,000	0.100000 2023/09/20	0.84
20	346	10年国債	日本	国債証券	780,000,000	101.24 789,739,600	101.06 788,307,000	0.100000 2027/03/20	0.83
21	344	10年国債	日本	国債証券	780,000,000	101.16 789,102,600	100.96 787,527,000	0.100000 2026/09/20	0.83
22	343	10年国債	日本	国債証券	780,000,000	101.08 788,437,800	100.96 787,488,000	0.100000 2026/06/20	0.83
23	340	10年国債	日本	国債証券	760,000,000	102.46 778,711,200	101.98 775,093,600	0.400000 2025/09/20	0.82
24	362	10年国債	日本	国債証券	710,000,000	100.22 711,604,520	100.74 715,268,200	0.100000 2031/03/20	0.75
25	333	10年国債	日本	国債証券	700,000,000	102.43 717,045,000	101.67 711,697,000	0.600000 2024/03/20	0.75
26	352	10年国債	日本	国債証券	700,000,000	101.27 708,930,200	101.26 708,855,000	0.100000 2028/09/20	0.75
27	143	5年国債	日本	国債証券	700,000,000	100.98 706,878,000	100.74 705,215,000	0.100000 2025/03/20	0.74
28	140	5年国債	日本	国債証券	700,000,000	100.85 705,968,000	100.57 704,025,000	0.100000 2024/06/20	0.74
29	363	10年国債	日本	国債証券	700,000,000	100.72 705,058,800	100.57 703,990,000	0.100000 2031/06/20	0.74
30	335	10年国債	日本	国債証券	690,000,000	102.40 706,608,300	101.75 702,123,300	0.500000 2024/09/20	0.74

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	89.50%
地方債証券	3.70%
特殊債券	2.84%
社債券	3.13%
合計	99.17%

(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

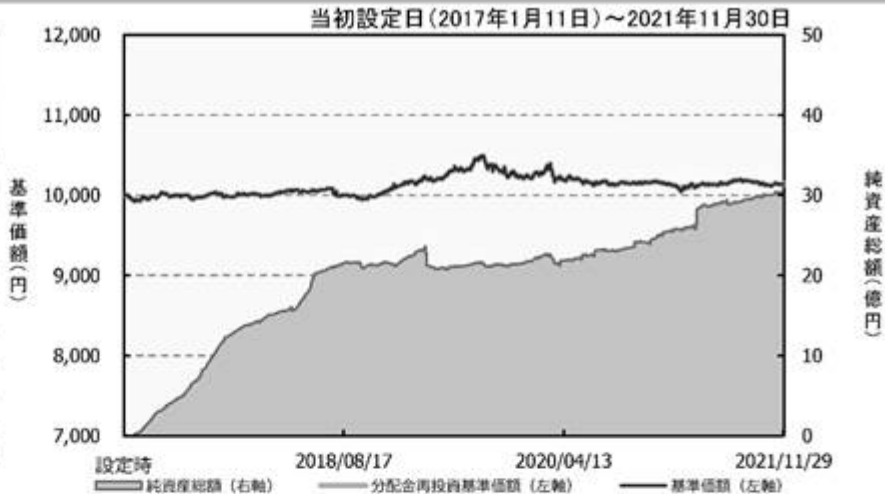
## ●FWO 日本債券インデックス

2021年11月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	10,151円
純資産総額	30億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.2%
3カ月間	-0.3%
6カ月間	0.2%
1年間	-0.0%
3年間	1.3%
5年間	-
設定来	1.5%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期					
	17年11月	18年11月	19年12月	20年11月	21年11月					
分配金	0円	0円	0円	0円	0円					

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

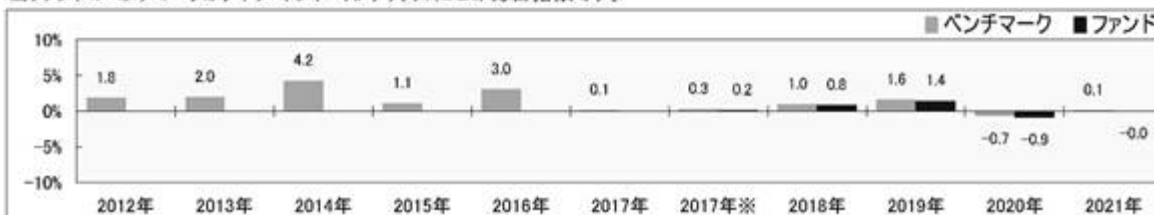
資産別構成	銘柄数	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	利率(%)	償還日	比率	
国内債券	344	99.1%	直接利回り(%)	135 5年国債	0.100	2023/03/20	1.6%	
国内債券先物	-	-	最終利回り(%)	138 5年国債	0.100	2023/12/20	1.3%	
コール・ローン、その他		0.9%	修正デュレーション	141 5年国債	0.100	2024/09/20	1.2%	
合計	344	100.0%	残存年数	145 5年国債	0.100	2025/09/20	1.2%	
債券種別構成		比率	格付別構成	比率				
国債		89.2%	AAA	92.1%	148 5年国債	0.005	2026/06/20	1.1%
地方債		4.5%	AA	4.1%	136 5年国債	0.100	2023/06/20	1.0%
事業債		3.8%	A	2.1%	134 5年国債	0.100	2022/12/20	1.0%
政府保証債		1.3%	BBB	-	359 10年国債	0.100	2030/06/20	1.0%
その他		0.3%	BB以下・無格付	1.7%	334 10年国債	0.600	2024/06/20	1.0%
合計		99.1%	合計	100.0%	合計			11.4%

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を1.7%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11月30日までの騰落率を表しています。

・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス(為替ヘッジあり)】

## (1) 【投資状況】(2021年11月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	5,174,345,100	99.81
内 日本	5,174,345,100	99.81
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,099,257	0.19
純資産総額	5,184,444,357	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11月30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	4,945,846,970	1.0662 5,273,576,948	1.0462 5,174,345,100	99.81

(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。

## 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)	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
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
2020年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	-
6月末日	4,962,721,869	-	1.0703	-
7月末日	5,049,822,579	-	1.0887	-
8月末日	5,110,507,021	-	1.0886	-
9月末日	5,083,599,405	-	1.0712	-
10月末日	5,132,249,671	-	1.0706	-
第5計算期間末 (2021年11月30日)	5,184,444,357	5,184,444,357	1.0770	1.0770

## 【分配の推移】

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

## 【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
第5計算期間	2.9

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	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
第5計算期間	1,938,477,119	724,498,228

(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11月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	129,099,884,265	97.07
内 ユーロ	50,336,486,111	37.85
内 中国	260,121,992	0.20
内 シンガポール	541,470,918	0.41
内 マレーシア	593,693,650	0.45
内 イスラエル	595,756,580	0.45
内 ノルウェー	294,273,400	0.22
内 スウェーデン	346,477,840	0.26
内 デンマーク	632,003,312	0.48
内 イギリス	7,952,022,882	5.98
内 ポーランド	624,129,129	0.47
内 カナダ	2,506,073,713	1.88
内 アメリカ	61,387,508,514	46.16
内 メキシコ	812,897,888	0.61
内 オーストラリア	2,216,968,336	1.67
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,892,409,106	2.93
純資産総額	132,992,293,371	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)	129,361,914,181	97.27
内 日本	129,361,914,181	97.27

(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11月30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	102.14 3,950,959,052	101.36 3,920,903,293	1.625000 2022/11/15	2.95
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	25,405,000	105.30 3,043,666,736	104.39 3,017,327,811	2.750000 2023/11/15	2.27
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	16,300,000	106.65 1,977,818,854	104.66 1,940,998,228	2.250000 2025/11/15	1.46
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	16,000,000	107.30 1,953,308,848	105.28 1,916,596,724	2.250000 2027/08/15	1.44
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	15,800,000	107.13 1,925,810,162	105.15 1,890,248,502	2.500000 2025/01/31	1.42
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	15,520,000	103.05 1,819,564,567	102.05 1,801,907,463	1.750000 2023/05/15	1.35
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	15,000,000	106.66 1,820,325,688	104.76 1,787,935,369	2.750000 2024/02/15	1.34
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	14,820,000	105.75 1,783,138,530	103.61 1,747,056,602	2.000000 2025/08/15	1.31
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	14,700,000	105.50 1,764,496,050	103.69 1,734,147,985	2.125000 2024/07/31	1.30
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	13,310,000	104.96 1,589,448,930	103.54 1,567,975,022	2.500000 2023/08/15	1.18
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	12,810,000	105.83 1,542,391,602	104.19 1,518,589,661	2.250000 2024/11/15	1.14
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	12,000,000	111.04 1,516,072,028	109.49 1,494,828,580	2.875000 2028/08/15	1.12

13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	12,000,000	104.14 1,421,815,545	102.15 1,394,674,574	1.625000 2026/02/15	1.05
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	12,000,000	102.47 1,399,081,598	101.69 1,388,380,818	1.375000 2023/09/30	1.04
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	11,750,000	103.46 1,383,051,407	101.57 1,357,892,164	1.500000 2026/08/15	1.02
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	8,950,000	130.92 1,333,109,304	127.85 1,301,913,399	6.125000 2027/11/15	0.98
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	11,000,000	103.08 1,290,040,305	102.09 1,277,713,325	2.000000 2023/02/15	0.96
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	10,865,000	103.84 1,283,673,333	102.16 1,262,860,493	1.625000 2026/05/15	0.95
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	10,300,000	106.10 1,243,418,155	104.00 1,218,786,268	2.125000 2025/05/15	0.92
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	11,800,000	84.58 1,135,541,783	87.41 1,173,520,712	1.125000 2040/05/15	0.88
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	9,580,000	106.42 1,159,943,741	104.47 1,138,657,670	2.500000 2024/05/15	0.86
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	8,850,000	105.56 1,062,873,485	103.92 1,046,424,206	2.000000 2026/11/15	0.79
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,300,000	111.26 924,049,048	109.25 907,344,192	2.875000 2028/05/15	0.68
24	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債 証券	7,700,000	98.39 861,928,587	97.59 854,978,023	1.250000 2031/08/15	0.64
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,000,000	105.16 837,529,459	103.29 822,639,014	1.875000 2026/06/30	0.62
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,000,000	104.78 834,465,405	103.04 820,616,183	1.875000 2024/08/31	0.62
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,300,000	113.28 811,971,370	111.39 798,446,278	3.125000 2028/11/15	0.60
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,900,000	94.74 743,768,416	94.91 745,110,789	0.875000 2030/11/15	0.56
29	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債 証券	4,750,000	121.16 739,068,891	118.85 724,971,399	4.500000 2026/03/01	0.55
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,500,000	97.00 717,319,850	95.98 709,806,479	0.625000 2027/11/30	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	97.07%
合計	97.07%

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

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	英ポンド売/円買 2021年12月	売建	51,912,000	8,107,969,951	7,867,782,720	5.92%
		スウェーデン・クローネ売/円買 2021年12月	売建	27,956,000	371,157,834	350,344,592	0.26%
		米ドル売/円買 2021年12月	売建	542,364,000	61,830,345,724	61,696,074,456	46.39%
		マレーシア・リングギット売/円買 2021年12月	売建	21,580,000	583,070,020	578,372,054	0.43%
		ポーランド・ズロチ売/円買 2021年12月	売建	24,035,000	686,610,248	659,767,960	0.50%
		シンガポール・ドル売/円買 2021年12月	売建	6,578,000	555,965,324	547,263,288	0.41%
		カナダ・ドル売/円買 2021年12月	売建	28,315,000	2,602,730,485	2,527,170,380	1.90%
		イスラエル・シェケル売/円買 2021年12月	売建	16,914,000	610,830,504	609,201,686	0.46%
		ノルウェー・クローネ売/円買 2021年12月	売建	23,986,000	323,132,196	302,415,488	0.23%
		ユーロ売/円買 2021年12月	売建	391,272,000	51,623,554,290	50,248,715,328	37.78%
豪ドル売/円買 2021年12月	売建	27,158,000	2,325,574,845	2,207,565,188	1.66%		

メキシコ・ペソ売/円買 2021年12月	売建	163,828,000	904,117,583	859,146,797	0.65%
オフショア人民元売/円 買 2021年12月	売建	15,000,000	266,020,350	267,268,500	0.20%
デンマーク・クローネ 売/円買 2021年12月	売建	37,102,000	658,382,410	640,825,744	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) 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11月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	10,770円
純資産総額	51億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.6%
3カ月間	-1.1%
6カ月間	1.0%
1年間	-2.9%
3年間	9.2%
5年間	-
設定来	7.7%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 17年11月	第2期 18年11月	第3期 19年12月	第4期 20年11月	第5期 21年11月					
分配金	0円	0円	0円	0円	0円					

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

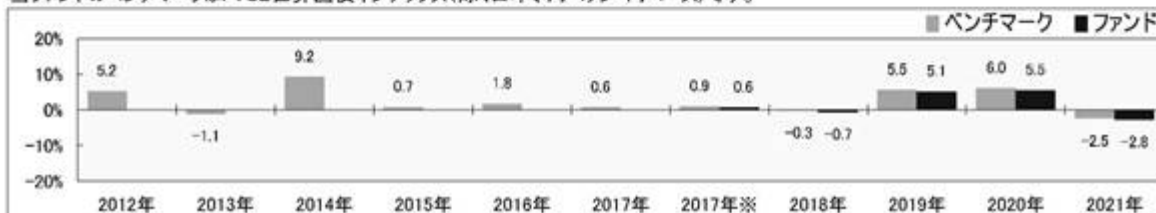
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	償還日	比率
外国債券	522	96.9%	日本円	99.3%	直接利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2022/11/15	2.9%
			ユーロ	0.5%	最終利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2023/11/15	2.3%
コール・ローン、その他		3.1%	英ポンド	0.1%	修正デュレーション	United States Treasury Note/Bond	2025/11/15	1.5%
合計	522	100.0%	米ドル	0.0%	残存年数	United States Treasury Note/Bond	2027/08/15	1.4%
			豪ドル	0.0%	格付別構成	United States Treasury Note/Bond	2025/01/31	1.4%
債券種別構成			マレーシア・リンギット	0.0%	AAA	United States Treasury Note/Bond	2023/05/15	1.4%
国債		96.9%	カナダ・ドル	0.0%	AA	United States Treasury Note/Bond	2024/02/15	1.3%
			デンマーク・クローネ	0.0%	A	United States Treasury Note/Bond	2025/08/15	1.3%
			シンガポール・ドル	0.0%	BBB	United States Treasury Note/Bond	2024/07/31	1.3%
			その他	-0.0%	BB	United States Treasury Note/Bond	2023/08/15	1.2%
合計		96.9%	合計	100.0%	合計	合計		16.0%

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※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11月30日までの騰落率を表しています。

・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップオンライン 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11月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	3,291,001,472	99.80
内 日本	3,291,001,472	99.80
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	6,503,877	0.20
純資産総額	3,297,505,349	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11月30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	842,742,592	3.0272 2,551,169,251	3.1370 2,643,683,511	80.17
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	465,428,503	1.3916 647,701,427	1.3908 647,317,961	19.63

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
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)	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
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
2020年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	-
6月末日	3,173,778,671	-	1.1398	-
7月末日	3,203,850,936	-	1.1426	-
8月末日	3,249,099,194	-	1.1430	-
9月末日	3,259,557,502	-	1.1339	-
10月末日	3,345,398,629	-	1.1545	-
第5計算期間末 (2021年11月30日)	3,297,505,349	3,297,505,349	1.1365	1.1365

【分配の推移】

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

【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
第5計算期間	3.3

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	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
第5計算期間	1,085,864,243	422,369,928

(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11月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	230,341,773,379	98.59
内 ユーロ	90,406,985,121	38.70
内 中国	482,437,093	0.21
内 シンガポール	962,856,749	0.41
内 マレーシア	1,064,579,152	0.46
内 イスラエル	1,101,379,217	0.47
内 ノルウェー	535,815,360	0.23
内 スウェーデン	653,106,093	0.28
内 デンマーク	1,093,665,528	0.47
内 イギリス	14,166,718,339	6.06
内 ポーランド	1,108,694,362	0.47
内 カナダ	4,512,686,869	1.93
内 アメリカ	108,759,849,422	46.55
内 メキシコ	1,505,707,605	0.64
内 オーストラリア	3,987,292,469	1.71

コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,290,341,223	1.41
純資産総額	233,632,114,602	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)	1,706,004,527	0.73
内 日本	1,706,004,527	0.73

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

(注2) 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11月30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 1,164,779,180	96.91 1,179,723,224	1.125000 2031/02/15	0.50
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	9,800,000	99.33 1,107,549,806	94.91 1,058,273,294	0.875000 2030/11/15	0.45
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	10,000,000	98.10 1,116,095,077	93.01 1,058,186,147	0.625000 2030/08/15	0.45
4	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債 証券	9,300,000	98.28 1,039,884,450	97.59 1,032,635,794	1.250000 2031/08/15	0.44
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	8,700,000	101.99 1,009,498,826	101.16 1,001,280,668	1.625000 2031/05/15	0.43
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,729,000	105.20 925,086,040	102.16 898,356,995	1.625000 2026/05/15	0.38
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,700,000	99.74 873,815,630	99.52 871,885,382	0.250000 2023/11/15	0.37
8	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	5,699,000	122.83 898,925,986	118.93 870,339,956	2.750000 2027/10/25	0.37
9	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債 証券	7,500,000	99.56 849,541,921	98.95 844,375,341	0.375000 2024/09/15	0.36

10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,700,000	116.60 888,801,616	109.49 834,612,624	2.875000 2028/08/15	0.36
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,500,000	99.60 849,938,694	97.44 831,439,692	0.250000 2025/06/30	0.36
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,800,000	98.33 872,630,690	93.24 827,435,102	0.625000 2030/05/15	0.35
13	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,664,000	189.40 891,159,719	175.35 825,044,584	4.500000 2041/04/25	0.35
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,600,000	115.31 865,857,051	108.20 812,476,850	2.625000 2029/02/15	0.35
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,500,000	116.28 859,962,969	109.25 807,909,212	2.875000 2028/05/15	0.35
16	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	6,900,000	100.16 786,288,154	102.65 805,862,945	2.000000 2051/08/15	0.34
17	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,087,000	128.09 836,744,298	122.73 801,757,745	2.500000 2030/05/25	0.34
18	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,420,000	119.01 828,336,056	114.59 797,553,842	1.500000 2031/05/25	0.34
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	99.27 790,621,422	99.37 791,412,562	1.250000 2028/03/31	0.34
20	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	アメリカ	国債証券	7,000,000	98.66 785,770,147	98.95 788,051,796	1.250000 2028/09/30	0.34
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,350,000	114.92 830,290,059	108.34 782,712,627	2.750000 2028/02/15	0.34
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,100,000	108.16 750,666,454	111.27 772,231,281	2.375000 2051/05/15	0.33
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,400,000	111.71 813,391,788	105.91 771,189,489	2.375000 2027/05/15	0.33
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,668,000	102.86 780,337,603	101.36 768,958,328	1.625000 2022/11/15	0.33
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	96.94 772,022,776	96.50 768,516,350	0.750000 2028/01/31	0.33
26	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,571,000	173.86 797,270,797	165.72 759,935,484	4.000000 2037/01/04	0.33
27	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,730,000	101.88 749,673,644	101.14 744,206,729	- 2023/04/14	0.32
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,162,000	107.84 756,034,149	104.36 731,637,583	2.375000 2024/08/15	0.31

29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,287,000	103.67 741,586,846	101.78 728,039,595	2.000000 2022/11/30	0.31
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	6,800,000	97.71 755,948,993	93.96 726,908,385	1.625000 2050/11/15	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。

#### □ . 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	98.59%
合計	98.59%

(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	英ポンド買/円売 2022年 1月	買建	441,000	66,758,721	66,834,123	0.03%
		米ドル買/円売 2021年12 月	買建	2,771,000	315,253,899	315,249,188	0.13%
		デンマーク・クローネ 買/円売 2021年12月	買建	3,029,000	53,986,987	52,312,950	0.02%
		米ドル買/円売 2022年1 月	買建	3,878,000	440,553,720	440,847,549	0.19%
		ユーロ買/円売 2021年12 月	買建	4,757,000	614,074,844	610,863,913	0.26%
		ユーロ買/円売 2022年1 月	買建	1,000,000	128,502,900	128,493,100	0.05%
		カナダ・ドル買/円売 2021年12月	買建	672,000	61,806,931	59,980,905	0.03%
		シンガポール・ドル買/ 円売 2022年1月	買建	378,000	31,361,148	31,422,799	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) 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11月30日現在)

#### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	21,276,625,958	95.97
内 中国	2,242,519,616	10.12
内 タイ	1,972,104,129	8.90
内 マレーシア	1,801,970,055	8.13
内 フィリピン	25,809,460	0.12
内 インドネシア	2,219,085,225	10.01
内 ポーランド	1,582,033,833	7.14
内 ロシア	1,627,073,577	7.34
内 ハンガリー	758,296,452	3.42
内 ルーマニア	565,195,330	2.55
内 トルコ	252,539,343	1.14
内 チェコ	956,625,777	4.32
内 メキシコ	1,926,291,576	8.69
内 ドミニカ共和国	25,520,915	0.12
内 コロンビア	862,707,161	3.89
内 ペルー	451,638,606	2.04
内 チリ	411,371,991	1.86
内 ブラジル	1,878,728,598	8.47
内 ウルグアイ	24,667,497	0.11
内 南アフリカ	1,692,446,817	7.63
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	893,010,579	4.03
純資産総額	22,169,636,537	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)	284,585,927	1.28
内 日本	284,585,927	1.28
為替予約取引(売建)	53,472,000	0.24

内 日本	53,472,000	0.24
------	------------	------

(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11月30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	26,700,000	82.32 445,953,033	79.27 429,418,762	- 2024/01/01	1.94
2	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリ カ	国債証 券	40,550,000	112.99 323,032,565	109.87 314,093,609	10.500000 2026/12/21	1.42
3	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証 券	17,500,000	85.69 304,262,054	83.55 296,668,084	- 2023/07/01	1.34
4	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリ カ	国債証 券	35,400,000	94.41 235,642,673	90.03 224,687,871	8.000000 2030/01/31	1.01
5	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証 券	11,550,000	102.76 240,816,753	94.43 221,291,589	10.000000 2027/01/01	1.00
6	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリ カ	国債証 券	38,020,000	84.28 225,917,966	81.25 217,796,714	8.750000 2048/02/28	0.98
7	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証 券	10,910,000	103.20 228,448,013	98.17 217,305,729	10.000000 2023/01/01	0.98
8	Mexican Bonos	メキシコ	国債証 券	42,400,000	96.96 215,957,232	94.09 209,575,623	5.750000 2026/03/05	0.95
9	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	ブラジル	国債証 券	10,690,000	105.24 228,261,803	96.19 208,633,795	10.000000 2025/01/01	0.94
10	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証 券	10,300,000	93.70 195,823,821	93.99 196,424,898	- 2022/07/01	0.89
11	Mexican Bonos	メキシコ	国債証 券	34,230,000	103.67 186,419,863	100.23 180,234,707	7.500000 2027/06/03	0.81
12	Poland Government Bond	ポーラン ド	国債証 券	6,450,000	108.92 192,955,178	97.12 172,067,053	2.750000 2029/10/25	0.78

13	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	30,730,000	109.55 176,844,957	105.36 170,086,729	8.500000 2029/05/31	0.77
14	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	30,950,000	104.65 170,150,015	100.61 163,583,608	7.750000 2031/05/29	0.74
15	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	5,990,000	106.02 174,429,565	97.30 160,090,094	2.500000 2026/07/25	0.72
16	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	25,600,000	90.76 163,815,362	87.22 157,416,460	8.250000 2032/03/31	0.71
17	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	29,000,000	104.96 159,891,778	101.82 155,111,150	8.000000 2024/09/05	0.70
18	China Government Bond	中国	国債証券	8,600,000	98.98 151,784,003	100.30 153,808,076	2.850000 2027/06/04	0.69
19	China Government Bond	中国	国債証券	8,200,000	101.33 148,158,681	102.78 150,272,831	3.290000 2029/05/23	0.68
20	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	28,450,000	100.94 150,860,249	100.27 149,855,978	6.500000 2022/06/09	0.68
21	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	26,550,000	111.59 155,636,797	107.24 149,574,276	10.000000 2024/12/05	0.67
22	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	27,250,000	104.78 149,989,415	102.10 146,148,928	8.000000 2023/12/07	0.66
23	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	23,800,000	90.26 151,447,993	87.04 146,056,161	8.875000 2035/02/28	0.66
24	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	5,150,000	109.05 154,250,187	100.47 142,119,717	3.250000 2025/07/25	0.64
25	Brazil Letras do Tesouro Nacional	ブラジル	国債証券	9,300,000	78.39 147,914,954	75.17 141,844,369	- 2024/07/01	0.64
26	China Government Bond	中国	国債証券	8,000,000	96.29 137,353,105	98.17 140,031,899	2.680000 2030/05/21	0.63
27	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	南アフリカ	国債証券	23,900,000	86.01 144,928,551	82.59 139,168,445	8.500000 2037/01/31	0.63
28	Mexican Bonos	メキシコ	国債証券	24,900,000	109.73 143,525,713	103.43 135,294,018	8.500000 2038/11/18	0.61
29	Indonesia Treasury Bond	インドネシア	国債証券	16,000,000,000	104.95 134,337,280	105.68 135,272,960	6.500000 2025/06/15	0.61
30	China Government Bond	中国	国債証券	7,300,000	101.30 131,851,806	103.07 134,167,348	3.270000 2030/11/19	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
-----------	------

国債証券	95.97%
合計	95.97%

(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	ロシア・ルーブル買/円 売 2021年12月	買建	12,000,000	18,168,000	18,236,400	0.08%
		メキシコ・ペソ買/円売 2021年12月	買建	15,873,000	86,404,119	83,264,226	0.38%
		南アフリカ・ランド買/ 円売 2021年12月	買建	5,494,000	39,686,641	38,712,236	0.17%
		ハンガリー・フォリント 買/円売 2021年12月	買建	18,729,000	6,737,757	6,547,433	0.03%
		チェコ・コルナ買/円売 2021年12月	買建	9,110,000	46,486,583	45,731,287	0.21%
		ルーマニア・レイ買/円 売 2021年12月	買建	3,307,000	87,664,659	85,758,115	0.39%
		トルコ・リラ買/円売 2021年12月	買建	712,000	8,349,837	6,336,230	0.03%
		オフショア人民元売/円 買 2021年12月	売建	3,000,000	53,468,010	53,472,000	0.24%

(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11月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	11,365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	-1.6%
3カ月間	-0.6%
6カ月間	-0.5%
1年間	3.3%
3年間	11.2%
5年間	-
設定来	13.7%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 17年11月	第2期 18年11月	第3期 19年12月	第4期 20年11月	第5期 21年11月					
分配金	0円	0円	0円	0円	0円					

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

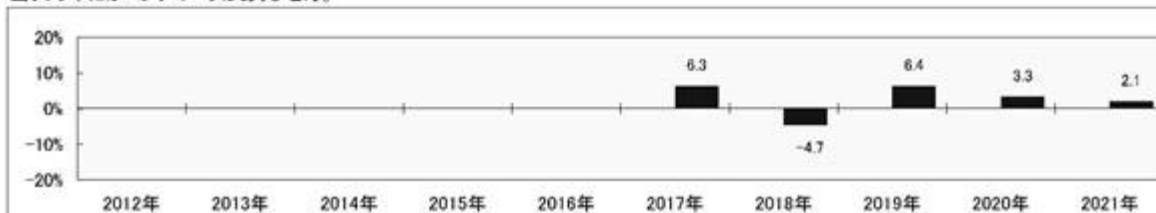
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位10銘柄	償還日	比率
外国債券	1,073	97.9%	米ドル	37.8%	直接利回り(%)	United States Treasury Note/Bond	2031/02/15	0.4%
			ユーロ	31.5%	最終利回り(%)	Brazil Letras do Tesouro Nacional	2024/01/01	0.4%
コール・ローン、その他		2.1%	英ポンド	4.9%	修正デュレーション	United States Treasury Note/Bond	2030/11/15	0.4%
合計	1,073	100.0%	メキシコ・ペソ	2.4%	残存年数	United States Treasury Note/Bond	2030/08/15	0.4%
債券種別構成			オフショア人民元	2.1%	格付別構成	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2031/08/15	0.4%
国債		97.9%	マレーシア・リンギット	2.0%	AAA	United States Treasury Note/Bond	2031/05/15	0.3%
			インドネシア・ルピア	2.0%	AA	United States Treasury Note/Bond	2026/05/15	0.3%
			ポーランド・ズロチ	1.8%	A	United States Treasury Note/Bond	2023/11/15	0.3%
			タイ・バーツ	1.8%	BBB	FRENCH GOVERNMENT BOND	2027/10/25	0.3%
			その他	13.7%	BB	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	2024/09/15	0.3%
合計		97.9%	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11月30日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップオンライン J - REITインデックス】

## (1) 【投資状況】（2021年11月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	1,678,496,673	99.95
内 日本	1,678,496,673	99.95
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	848,132	0.05
純資産総額	1,679,344,805	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11月30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	506,440,779	2.8342 1,435,399,908	3.3143 1,678,496,673	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
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
2020年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	-
6月末日	1,670,868,634	-	1.3774	-
7月末日	1,696,977,183	-	1.3873	-
8月末日	1,717,423,764	-	1.3835	-
9月末日	1,689,272,623	-	1.3398	-
10月末日	1,736,300,669	-	1.3555	-
第5計算期間末 (2021年11月30日)	1,679,344,805	1,679,344,805	1.2998	1.2998

## 【分配の推移】

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

## 【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
第5計算期間	22.7

## (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	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
第5計算期間	469,805,021	288,734,255

(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11月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	435,527,511,600	97.49
内 日本	435,527,511,600	97.49
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	11,206,840,430	2.51
純資産総額	446,734,352,030	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)	11,214,000,000	2.51
内 日本	11,214,000,000	2.51

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

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

(注3) 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11月30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	45,004	722,028.61 32,494,175,599	700,000.00 31,502,800,000	7.05
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	39,711	685,886.59 27,237,242,377	655,000.00 26,010,705,000	5.82
3	日本プロロジスリート	日本	投資証券	62,913	389,337.64 24,494,399,110	369,500.00 23,246,353,500	5.20
4	GLP投資法人	日本	投資証券	128,612	190,613.05 24,515,125,924	180,300.00 23,188,743,600	5.19
5	野村不動産マスターF	日本	投資証券	128,415	164,610.71 21,138,484,615	161,400.00 20,726,181,000	4.64
6	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	200,360	107,870.77 21,612,987,862	97,800.00 19,595,208,000	4.39
7	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	59,625	340,791.44 20,319,689,688	323,500.00 19,288,687,500	4.32
8	オリックス不動産投資	日本	投資証券	79,122	196,504.87 15,547,858,395	180,500.00 14,281,521,000	3.20
9	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	39,705	371,845.54 14,764,127,300	348,500.00 13,837,192,500	3.10
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	89,395	154,180.79 13,782,992,071	144,600.00 12,926,517,000	2.89
11	産業ファンド	日本	投資証券	56,375	214,553.15 12,095,434,164	202,800.00 11,432,850,000	2.56
12	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	26,097	405,034.78 10,570,192,713	404,500.00 10,556,236,500	2.36
13	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	120,543	93,769.19 11,303,219,665	82,500.00 9,944,797,500	2.23
14	API投資法人	日本	投資証券	21,164	462,942.24 9,797,709,642	432,000.00 9,142,848,000	2.05
15	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	48,613	195,801.19 9,518,483,613	187,200.00 9,100,353,600	2.04
16	三井不ロジパーク	日本	投資証券	14,761	624,520.36 9,218,545,164	583,000.00 8,605,663,000	1.93
17	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	13,712	648,721.03 8,895,262,855	620,000.00 8,501,440,000	1.90
18	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	12,284	770,591.26 9,465,943,055	689,000.00 8,463,676,000	1.89

19	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	25,946	342,370.90 8,883,155,502	314,000.00 8,147,044,000	1.82
20	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	121,655	64,332.29 7,826,345,801	58,600.00 7,128,983,000	1.60
21	イオンリート投資	日本	投資証券	46,700	146,667.09 6,849,353,279	152,000.00 7,098,400,000	1.59
22	森ヒルズリート	日本	投資証券	46,696	157,714.37 7,364,630,316	150,400.00 7,023,078,400	1.57
23	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	13,921	477,823.21 6,651,777,000	497,000.00 6,918,737,000	1.55
24	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	174,782	42,114.08 7,360,783,226	38,050.00 6,650,455,100	1.49
25	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	37,045	178,188.23 6,600,983,165	166,700.00 6,175,401,500	1.38
26	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	8,395	773,636.20 6,494,675,975	714,000.00 5,994,030,000	1.34
27	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	53,658	118,329.54 6,349,326,932	109,400.00 5,870,185,200	1.31
28	NTT都市開発リート投資法人	日本	投資証券	38,062	153,900.41 5,857,757,761	150,200.00 5,716,912,400	1.28
29	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	17,880	351,265.16 6,280,621,082	319,000.00 5,703,720,000	1.28
30	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	27,122	225,266.20 6,109,670,005	206,100.00 5,589,844,200	1.25

(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	97.49%
合計	97.49%

(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 031 2月	買建	5,600	11,722,529,720	11,214,000,000	2.51%

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

(注2) 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11月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	12,998円
純資産総額	16億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-4.1%
3カ月間	-6.0%
6カ月間	-1.9%
1年間	22.7%
3年間	22.8%
5年間	-
設定来	30.0%



※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)

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	第5期 21年11月					
分配金	0円	0円	0円	0円	0円					

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	リート用途別構成	比率	租入上位10銘柄	用途名	比率
国内リート	61	97.4%	オフィス不動産	27.9%	日本ビルファンド	オフィス不動産	7.0%
国内リート 先物	1	2.5%	各種不動産	24.5%	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	21.7%	日本プロロジスリート	工業用不動産	5.2%
			店舗用不動産	9.3%	GLP投資法人	工業用不動産	5.2%
			住宅用不動産	9.1%	野村不動産マスターF	各種不動産	4.6%
			ホテル・リゾート不動産	4.5%	日本都市ファンド投資法人	店舗用不動産	4.4%
			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	4.3%
					オリックス不動産投資	オフィス不動産	3.2%
					アドバンス・レジデンス	住宅用不動産	3.1%
コール・ローン、その他		2.6%			ユナイテッド・アーバン投資法人	各種不動産	2.9%
合計	62	-	合計	97.4%	合計		45.8%

※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11月30日までの騰落率を表しています。

・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

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



## (1) 【投資状況】 (2021年11月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	1,052,306,701	99.04
内 日本	1,052,306,701	99.04
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,166,023	0.96
純資産総額	1,062,472,724	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)	1,052,891,371	99.10
内 日本	1,052,891,371	99.10

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

(注2) 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11月30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	333,980,799	2.2841 762,850,965	3.1508 1,052,306,701	99.04

(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	99.04%
合計	99.04%

(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	英ポンド売/円買 2021年12月	売建	386,100	60,177,464	58,517,316	5.51%
		米ドル売/円買 2021年12月	売建	7,086,200	808,201,480	806,140,283	75.87%
		シンガポール・ドル売/円買 2021年12月	売建	402,700	34,044,123	33,505,847	3.15%
		イスラエル・シケル売/円買 2021年12月	売建	16,400	590,182	590,636	0.06%
		カナダ・ドル売/円買 2021年12月	売建	226,100	20,811,723	20,180,781	1.90%
		香港ドル売/円買 2021年12月	売建	1,029,300	15,086,375	15,016,457	1.41%
		ニュージーランド・ドル売/円買 2021年12月	売建	53,400	4,362,726	4,139,728	0.39%
		豪ドル売/円買 2021年12月	売建	875,300	74,944,909	71,151,386	6.70%
		ユーロ売/円買 2021年12月	売建	339,900	44,810,535	43,648,937	4.11%

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

(注2) 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
第4計算期間末 (2020年11月30日)	822,409,605	822,409,605	1.0306	1.0306
2020年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	-
6月末日	955,072,482	-	1.2429	-
7月末日	993,191,892	-	1.2876	-
8月末日	1,016,274,176	-	1.3118	-
9月末日	985,104,407	-	1.2623	-
10月末日	1,061,472,909	-	1.3445	-
第5計算期間末 (2021年11月30日)	1,062,472,724	1,062,472,724	1.3476	1.3476

## 【分配の推移】

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

## 【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
第5計算期間	30.8

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	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
第5計算期間	216,237,612	225,812,573

(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11月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	420,239,075	0.86
内 アメリカ	420,239,075	0.86
投資証券	47,151,826,569	96.96
内 ガーンジー	114,975,190	0.24
内 韓国	80,446,067	0.17
内 香港	644,329,416	1.32
内 シンガポール	1,641,937,295	3.38
内 イスラエル	37,813,921	0.08
内 イギリス	2,611,265,546	5.37
内 アイルランド	46,658,107	0.10
内 オランダ	68,284,027	0.14
内 ベルギー	597,318,095	1.23
内 フランス	771,140,458	1.59
内 ドイツ	130,707,199	0.27
内 スペイン	180,730,895	0.37
内 イタリア	10,811,441	0.02
内 カナダ	913,388,895	1.88
内 アメリカ	35,861,169,315	73.74
内 オーストラリア	3,260,470,571	6.70
内 ニュージーランド	180,380,131	0.37
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,056,875,291	2.17
純資産総額	48,628,940,935	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	1,103,599,867	2.27
内 ドイツ	210,767,038	0.43

	内 アメリカ	892,832,829	1.84
為替予約取引(買建)		654,669,787	1.35
	内 日本	654,669,787	1.35

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

(注2) 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11月30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	190,919	11,701.01 2,233,962,418	17,438.66 3,329,372,598	6.85
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	23,200	80,642.22 1,870,899,901	93,291.40 2,164,360,480	4.45
3	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	84,847	10,342.60 877,547,562	18,196.37 1,543,907,728	3.17
4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	39,400	26,037.74 1,025,887,811	37,759.12 1,487,709,537	3.06
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	72,978	15,713.57 1,146,751,864	19,203.23 1,401,413,925	2.88
6	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	142,239	6,621.07 941,783,687	7,941.14 1,129,540,666	2.32
7	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	109,100	7,565.13 825,357,617	9,333.69 1,018,305,666	2.09
8	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	36,000	19,659.22 707,735,933	27,393.54 986,167,462	2.03
9	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	444,441	1,537.11 683,163,392	1,995.66 886,957,348	1.82
10	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	88,000	7,013.92 617,225,618	9,809.24 863,213,947	1.78
11	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	35,800	19,079.00 683,031,825	23,352.43 836,017,001	1.72
12	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	34,500	13,266.71 457,705,129	23,100.99 796,984,448	1.64
13	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	29,928	14,815.35 443,395,878	23,891.70 715,030,798	1.47

14	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	148,797	3,402.29 506,266,661	4,695.28 698,644,754	1.44
15	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	317,050	1,424.51 451,651,818	2,148.36 681,138,489	1.40
16	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	29,900	16,633.51 497,344,724	22,384.24 669,289,000	1.38
17	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	16,767	29,113.74 488,151,969	39,421.30 660,977,021	1.36
18	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	97,700	4,504.83 440,131,896	6,763.62 660,806,309	1.36
19	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	101,629	5,550.61 564,112,811	5,588.38 567,941,715	1.17
20	LINK REIT	香港	投資証券	564,600	1,008.60 569,462,477	1,002.33 565,917,212	1.16
21	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	139,200	3,454.39 480,862,990	3,875.00 539,400,863	1.11
22	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	157,400	3,038.22 478,223,378	3,200.35 503,735,106	1.04
23	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	26,000	11,766.88 305,939,453	19,210.06 499,461,677	1.03
24	UDR INC	アメリカ	投資証券	72,000	4,604.27 331,510,353	6,538.36 470,762,057	0.97
25	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	36,700	11,712.96 429,867,294	12,553.38 460,709,112	0.95
26	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	47,600	8,050.13 383,189,727	8,959.38 426,466,845	0.88
27	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	44,100	6,936.78 305,912,808	9,649.97 425,563,739	0.88
28	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託受益証券	33,950	12,404.22 421,124,206	12,378.17 420,239,075	0.86
29	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	158,362	1,772.53 280,705,591	2,648.56 419,432,146	0.86
30	IRON MOUNTAIN INC	アメリカ	投資証券	74,700	3,269.06 244,201,230	5,331.26 398,245,286	0.82

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 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	0.86%

投資証券	96.96%
合計	97.83%

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

#### 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 202112	買建	185	886,263,180	892,832,829	1.84%
	ドイツ	STOXX 600 REAL 202112	買建	168	206,135,905	210,767,038	0.43%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2021年12 月	買建	5,202,000	593,203,105	591,740,900	1.22%
		ユーロ買/円売 2021年12 月	買建	490,000	64,614,095	62,928,887	0.13%

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

(注2) 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11月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	13,476円
純資産総額	10億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.2%
3カ月間	2.7%
6カ月間	11.5%
1年間	30.8%
3年間	30.6%
5年間	-
設定来	34.8%



※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	第5期 21年11月					
分配金	0円	0円	0円	0円	0円					

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

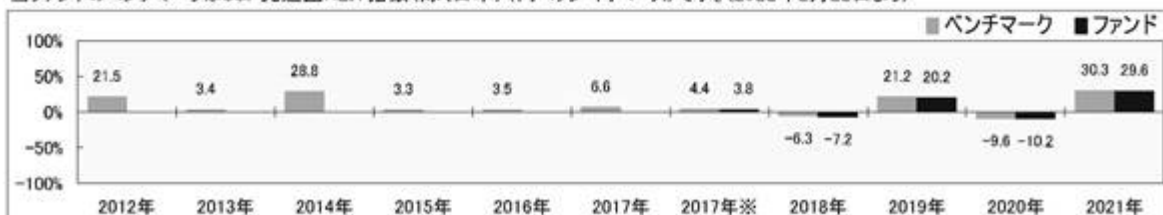
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート・先物	330	98.2%	日本円	100.0%	産業施設	17.1%	PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	6.8%
外国投資信託等	4	1.0%	韓国ウォン	0.2%	商業施設	16.3%	EQUINIX INC	特殊用途施設	アメリカ	4.4%
コール・ローン、その他		3.1%	英ポンド	0.1%	住宅	15.7%	SIMON PROPERTY GROUP INC	商業施設	アメリカ	3.1%
合計	334	-	イスラエル・シケル	0.0%	特殊用途施設	11.6%	PUBLIC STORAGE	貸倉庫	アメリカ	3.0%
国・地域別構成			香港ドル	0.0%	各種不動産	9.5%	DIGITAL REALTY TRUST INC	特殊用途施設	アメリカ	2.9%
アメリカ		75.7%	ユーロ	-0.0%	オフィス	8.6%	REALTY INCOME CORP	商業施設	アメリカ	2.3%
オーストラリア		6.6%	ニュージーランド・ドル	-0.0%	ヘルスケア	8.1%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	2.1%
イギリス		5.3%	カナダ・ドル	-0.0%	貸倉庫	6.7%	AVALONBAY COMMUNITIES INC	住宅	アメリカ	2.0%
シンガポール		3.3%	豪ドル	-0.0%	ホテル/リゾート	2.4%	DJ US REAL ESTATE 202112	-	アメリカ	1.8%
その他		8.1%	その他	-0.1%	その他	0.0%	GOODMAN GROUP	産業施設	オーストラリア	1.8%
合計		99.1%	合計	100.0%	合計	95.9%	合計			30.2%

※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(全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。

※先物の残玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはS&amp;P先進国REIT指数(除く日本)(円ヘッジ・円ベース)です。(2022年2月22日より)



※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11月30日までの騰落率を表しています。

・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジなし)】



## (1) 【投資状況】（2021年11月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	912,545,370	99.99
内 日本	912,545,370	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	83,400	0.01
純資産総額	912,628,770	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11月30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	289,623,388	2.2902 663,297,133	3.1508 912,545,370	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
第4計算期間末 (2020年11月30日)	602,823,641	602,823,641	0.9969	0.9969
2020年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	-
6月末日	805,644,126	-	1.2848	-
7月末日	832,570,865	-	1.3172	-
8月末日	854,620,758	-	1.3445	-
9月末日	840,731,428	-	1.3132	-
10月末日	922,695,473	-	1.4272	-
第5計算期間末 (2021年11月30日)	912,628,770	912,628,770	1.4202	1.4202

## 【分配の推移】

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

## 【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
第5計算期間	42.5

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	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
第5計算期間	194,621,133	156,693,618

(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11月30日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	14,202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	-0.5%
3カ月間	5.6%
6カ月間	13.9%
1年間	42.5%
3年間	35.2%
5年間	-
設定来	42.0%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 17年11月	第2期 18年11月	第3期 19年12月	第4期 20年11月	第5期 21年11月					
分配金	0円	0円	0円	0円	0円					

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	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	330	99.1%	米ドル	76.5%	産業施設	17.2%	PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	6.8%
外国投資信託等	4	1.0%	豪ドル	6.7%	商業施設	16.5%	EQUINIX INC	特殊用途施設	アメリカ	4.5%
コール・ロフ、その他		2.2%	英ポンド	5.6%	住宅	15.8%	SIMON PROPERTY GROUP INC	商業施設	アメリカ	3.2%
合計	334	-	ユーロ	4.1%	特殊用途施設	11.7%	PUBLIC STORAGE	貨倉庫	アメリカ	3.1%
国・地域別構成			シンガポール・ドル	3.1%	各種不動産	9.6%	DIGITAL REALTY TRUST INC	特殊用途施設	アメリカ	2.9%
アメリカ		76.4%	カナダ・ドル	1.9%	オフィス	8.7%	REALTY INCOME CORP	商業施設	アメリカ	2.3%
オーストラリア		6.7%	香港ドル	1.4%	ヘルスケア	8.1%	WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	2.1%
イギリス		5.4%	ニュージーランド・ドル	0.4%	貨倉庫	6.8%	AVALONBAY COMMUNITIES INC	住宅	アメリカ	2.0%
シンガポール		3.4%	韓国ウォン	0.2%	ホテル/リゾート	2.5%	DJ US REAL ESTATE 202112	-	アメリカ	1.8%
その他		8.2%	その他	-0.0%	その他	0.0%	GOODMAN GROUP	産業施設	オーストラリア	1.8%
合計		100.1%	合計	100.0%	合計	96.8%	合計			30.5%

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはS&amp;P先進国REIT指数(除く日本)(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11月30日までの騰落率を表しています。

・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 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、翌営業日の取扱いとなります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止（「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行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 前2.から前4.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をし

たときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2.から前4.までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。

6. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
8. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### 信託約款の変更等

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

#### 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

## 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を計算期間の末日ごとに作成し、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ます。）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

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

償還金は、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設

定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者(とします。)に、原則として信託終了日から起算して5営業日までに支払います。

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

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

< 換金請求権 >

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

### 第3 【ファンドの経理状況】

#### 【ダイワファンドラップオンライン 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5期計算期間（2020年12月1日から2021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】

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4期 2020年11月30日現在	第5期 2021年11月30日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	3,906,545	5,403,000
親投資信託受益証券	2,645,962,803	3,521,316,023
未収入金	10,640,000	-
流動資産合計	2,660,509,348	3,526,719,023
資産合計	2,660,509,348	3,526,719,023
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	11,743,586	996,860
未払受託者報酬	243,054	387,040
未払委託者報酬	2,309,389	3,677,201
その他未払費用	60,690	96,668
流動負債合計	14,356,719	5,157,769
負債合計	14,356,719	5,157,769
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 2,143,825,188	1 2,547,528,267
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	502,327,441	974,032,987
（分配準備積立金）	278,971,680	480,976,012
元本等合計	2,646,152,629	3,521,561,254
純資産合計	2,646,152,629	3,521,561,254
負債純資産合計	2,660,509,348	3,526,719,023

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期		第5期	
	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日		自 2020年12月1日 至 2021年11月30日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		11		-
有価証券売買等損益		5,021,739		310,693,220
<b>営業収益合計</b>		<b>5,021,750</b>		<b>310,693,220</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,491		955
受託者報酬		515,190		701,042
委託者報酬		4,895,175		6,660,590
その他費用		128,694		175,082
<b>営業費用合計</b>		<b>5,540,550</b>		<b>7,537,669</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>		<b>518,800</b>		<b>303,155,551</b>
経常利益又は経常損失( )		518,800		303,155,551
<b>当期純利益又は当期純損失( )</b>		<b>518,800</b>		<b>303,155,551</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		173,865,472		46,112,865
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>		<b>433,230,068</b>		<b>502,327,441</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額		97,607,370		336,669,178
<b>当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>97,607,370</b>		<b>336,669,178</b>
剰余金減少額又は欠損金増加額		201,856,669		122,006,318
<b>当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>201,856,669</b>		<b>122,006,318</b>
分配金		1 -		1 -
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>		<b>502,327,441</b>		<b>974,032,987</b>

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第5期	
	自 2020年12月1日	至 2021年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1. 1 期首元本額	2,416,486,034円	2,143,825,188円
期中追加設定元本額	931,798,024円	891,127,877円
期中一部解約元本額	1,204,458,870円	487,424,798円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,143,825,188口	2,547,528,267口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日	自 2020年12月1日 至 2021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(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>	<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(257,042,681円)、投資信託約款に規定される収益調整金(493,057,897円)及び分配準備積立金(223,933,331円)より分配対象額は974,033,909円(1万口当たり3,823.45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5期 自 2020年12月1日 至 2021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5期
	2021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4期	第5期
	2020年11月30日現在	2021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	163,574,157	289,822,505
合計	163,574,157	289,822,505

## (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4期	第5期
2020年11月30日現在	2021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5期
自 2020年12月1日
至 2021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4期	第5期
	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.2343円	1.3823円
(1万口当たり純資産額)	(12,343円)	(13,823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	2,681,477,325	3,521,316,023	
親投資信託受益証券 合計			3,521,316,023	
合計			3,521,316,023	

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

	2020年11月30日現在	2021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	12,212,008,294	8,845,838,998

株式	2 3	163,479,342,460	177,548,758,040
派生商品評価勘定		89,140,900	-
未収配当金		1,010,955,223	1,233,193,430
未収利息		814,653	551,974
前払金		-	211,095,600
その他未収収益	4	33,720,594	21,961,225
差入委託証拠金		-	18,795,000
流動資産合計		176,825,982,124	187,880,194,267
資産合計		176,825,982,124	187,880,194,267
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		23,231,250	355,476,200
前受金		102,752,600	-
未払解約金		189,585,900	44,822,370
受入担保金		9,568,784,085	4,816,603,995
流動負債合計		9,884,353,835	5,216,902,565
負債合計		9,884,353,835	5,216,902,565
純資産の部			
元本等			
元本	1	142,709,508,970	139,094,932,448
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		24,232,119,319	43,568,359,254
元本等合計		166,941,628,289	182,663,291,702
純資産合計		166,941,628,289	182,663,291,702
負債純資産合計		176,825,982,124	187,880,194,267

## 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	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1. 1 期首	2019年12月3日	2020年12月1日
期首元本額	147,704,616,967円	142,709,508,970円
期中追加設定元本額	28,551,522,466円	20,968,397,493円
期中一部解約元本額	33,546,630,463円	24,582,974,015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	3,193,110,083円	2,975,507,036円
ファンド		

ダイワ・トピックス・イン デックスファンドVA	6,674,458,363円	5,686,561,941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	930,834円	924,307円
ダイワ国内重視バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	32,952,471円	24,862,174円
ダイワ国内重視バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	668,546,231円	418,851,032円
ダイワ国際分散バランスファ ンド30VA(一般投資家私 募)	35,731,278円	21,795,176円
ダイワ国際分散バランスファ ンド50VA(一般投資家私 募)	908,394,726円	711,622,184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)	126,217,518円	242,143,159円
D-I's TOPIXイン デックス	38,327,788円	48,516,772円
為替ヘッジ付米国国債プラス 日本株式ファンド	10,549,517円	- 円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	23,213,652円	150,899,876円
iFree TOPIXイン デックス	2,041,017,760円	4,912,109,453円
iFree 8資産バランス	2,619,294,575円	3,289,496,110円
iFree 年金バランス	125,857,474円	524,441,173円
DCダイワ日本株式インデッ クス	64,944,239,094円	66,361,817,159円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	2,972,314,135円	2,933,677,304円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	3,751,798,888円	4,117,458,139円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	3,333,100,735円	4,042,208,265円
年金ダイワ日本株式インデッ クス	5,191,048,366円	6,020,854,667円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	11,676,676円	- 円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	46,996,347円	53,651,007円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	34,721,962円	58,568,334円
ダイワつみたてインデックス 日本株式	817,787,252円	1,539,852,892円
ダイワつみたてインデックス バランス30	10,918,252円	10,210,048円
ダイワつみたてインデックス バランス50	7,976,371円	9,943,370円
ダイワつみたてインデックス バランス70	11,268,546円	19,590,190円
ダイワ国内株式インデックス (ラップ専用)	- 円	721,071円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	141,666,674円	108,723,511円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	149,563,586円	125,845,796円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	7,748,159,579円	5,927,962,438円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	659,469,668円	524,674,963円
ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専 用)	99,902,437円	75,481,125円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専 用)	178,714,272円	141,439,467円
ダイワ・ノーロードTOP PIXファンド	149,232,217円	200,182,570円
ダイワファンドラップTO PIXインデックス	10,242,225,102円	10,416,484,453円
ダイワTOPPIXインデック ス(ダイワSMA専用)	9,426,768,765円	1,750,254,771円
ダイワファンドラップオンラ インTOPIXインデック ス	2,261,893,318円	2,681,477,325円
ダイワ・インデックスセレクト TOPIX	1,247,128,871円	1,175,509,780円
ダイワライフスタイル25	180,844,569円	150,358,577円
ダイワライフスタイル50	655,627,347円	597,518,476円

	ダイワライフスタイル75	519,251,046円	479,645,847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)	11,416,612,625円	10,563,090,510円
計		142,709,508,970円	139,094,932,448円
2.	期末日における受益権の総数	142,709,508,970口	139,094,932,448口
3.	2 貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 9,033,368,760円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 4,435,964,100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 740,845,000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 952,550,000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32,214,780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21,209,315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 2020年12月1日 至 2021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	2021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	2020年11月30日現在	2021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	9,890,799,472	12,356,661,736
合計	9,890,799,472	12,356,661,736

(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(2020年9月24日から2020年11月30日まで、及び2021年9月22日から2021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

種 類	2020年11月30日 現在				2021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	2,900,792,400	-	2,966,795,000	66,002,600	5,891,635,600	-	5,536,320,000	355,315,600
合計	2,900,792,400	-	2,966,795,000	66,002,600	5,891,635,600	-	5,536,320,000	355,315,600

## (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)

	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.1698円	1.3132円
(1万口当たり純資産額)	(11,698円)	(13,132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	3,200	2,900.00	9,280,000	貸付株式数 400株
日本水産	91,400	573.00	52,372,200	
マルハニチロ	14,300	2,277.00	32,561,100	
ハウスイ	600	879.00	527,400	貸付株式数 100株
カネコ種苗	2,800	1,348.00	3,774,400	
サカタのタネ	10,900	3,125.00	34,062,500	
ホクト	7,900	1,842.00	14,551,800	

ホクリヨウ	1,500	677.00	1,015,500		
ヒノキヤグループ	2,300	2,118.00	4,871,400		
ショーボンドHD	13,200	4,885.00	64,482,000	貸付株式数	3,200株
ミライト・ホールディングス	29,400	1,965.00	57,771,000	貸付株式数	3,400株
タマホーム	5,900	2,290.00	13,511,000	貸付株式数	2,200株
サンヨーホームズ	1,500	713.00	1,069,500	貸付株式数	300株
日本アクア	4,400	672.00	2,956,800		
ファーストコーポレーション	2,500	689.00	1,722,500	貸付株式数	1,000株
ベステラ	1,900	1,276.00	2,424,400	貸付株式数	700株
キャンディル	1,700	494.00	839,800	貸付株式数	600株
スペースバリューHD	9,600	1,146.00	11,001,600		
住石ホールディングス	21,600	126.00	2,721,600	貸付株式数	6,400株
日鉄鉱業	2,300	6,160.00	14,168,000		
三井松島HLDGS	3,600	1,293.00	4,654,800	貸付株式数	1,400株
INPEX	367,200	937.00	344,066,400		
石油資源開発	10,700	2,291.00	24,513,700	貸付株式数	1,800株
K&Oエナジーグループ	4,400	1,502.00	6,608,800		
ダイセキ環境ソリューション	1,800	1,658.00	2,984,400		
第一カッター興業	2,300	1,269.00	2,918,700		
明豊ファシリティワークス	2,900	841.00	2,438,900	貸付株式数	1,100株
安藤・間	50,300	841.00	42,302,300	貸付株式数	20,000株
東急建設	29,000	645.00	18,705,000		
コムシスホールディングス	29,500	2,476.00	73,042,000		
ビーアールホールディングス	12,700	353.00	4,483,100	貸付株式数	4,900株
高松コンストラクションGP	5,700	1,869.00	10,653,300	貸付株式数	2,100株
東建コーポレーション	2,800	8,950.00	25,060,000	貸付株式数	1,100株
ソネック	1,000	984.00	984,000	貸付株式数	100株
ヤマウラ	4,400	924.00	4,065,600	貸付株式数	1,600株
オリエンタル白石	32,300	227.00	7,332,100		
大成建設	61,000	3,310.00	201,910,000		
大林組	211,100	836.00	176,479,600		
清水建設	197,800	717.00	141,822,600		
飛島建設	5,500	977.00	5,373,500	貸付株式数	600株
長谷工コーポレーション	62,700	1,354.00	84,895,800		
松井建設	8,400	703.00	5,905,200		

銭高組	900	3,765.00	3,388,500	
鹿島建設	154,700	1,251.00	193,529,700	
不動テトラ	4,400	1,612.00	7,092,800	
大末建設	2,200	1,118.00	2,459,600	貸付株式数 600株
鉄建建設	4,500	1,717.00	7,726,500	
西松建設	12,800	3,385.00	43,328,000	
三井住友建設	47,600	414.00	19,706,400	貸付株式数 5,100株
大豊建設	3,100	3,620.00	11,222,000	貸付株式数 1,800株
佐田建設	4,600	478.00	2,198,800	貸付株式数 500株
ナカノフドー建設	5,000	333.00	1,665,000	
奥村組	12,400	3,140.00	38,936,000	
東鉄工業	9,800	2,273.00	22,275,400	貸付株式数 3,400株
イチケン	1,500	1,810.00	2,715,000	
富士ピー・エス	2,900	495.00	1,435,500	貸付株式数 700株
浅沼組	2,400	5,260.00	12,624,000	貸付株式数 200株
戸田建設	87,300	668.00	58,316,400	
熊谷組	10,700	2,628.00	28,119,600	
北野建設	1,200	2,050.00	2,460,000	
植木組	1,700	1,361.00	2,313,700	貸付株式数 700株
矢作建設	9,300	691.00	6,426,300	
ピーエス三菱	6,900	593.00	4,091,700	貸付株式数 1,000株
日本ハウスHLDGS	14,700	347.00	5,100,900	貸付株式数 5,600株
大東建託	21,600	12,290.00	265,464,000	
新日本建設	8,900	745.00	6,630,500	
NIPPO	17,700	4,010.00	70,977,000	
東亜道路	1,100	4,650.00	5,115,000	貸付株式数 300株
日本道路	2,000	7,800.00	15,600,000	
東亜建設	5,100	2,379.00	12,132,900	貸付株式数 2,600株
日本国土開発	20,300	532.00	10,799,600	
若築建設	3,500	1,900.00	6,650,000	
東洋建設	24,200	524.00	12,680,800	
五洋建設	83,700	651.00	54,488,700	貸付株式数 8,900株
世紀東急	10,200	824.00	8,404,800	
福田組	2,400	4,110.00	9,864,000	貸付株式数 800株
日本ドライケミカル	1,600	1,772.00	2,835,200	貸付株式数 200株
住友林業	54,400	2,287.00	124,412,800	
日本基礎技術	5,800	551.00	3,195,800	
巴コーポレーション	9,000	432.00	3,888,000	
大和ハウス	194,900	3,316.00	646,288,400	
ライト工業	13,300	2,025.00	26,932,500	

積水ハウス	228,800	2,210.00	505,648,000	
日特建設	4,300	641.00	2,756,300	貸付株式数 1,300株
北陸電気工事	3,800	1,051.00	3,993,800	
ユアテック	12,100	601.00	7,272,100	
日本リーテック	4,500	1,393.00	6,268,500	貸付株式数 500株
四電工	2,400	1,627.00	3,904,800	
中電工	10,100	2,027.00	20,472,700	
関電工	34,900	810.00	28,269,000	
きんでん	47,100	1,643.00	77,385,300	
東京エネシス	6,700	1,032.00	6,914,400	
トーエネック	2,100	3,120.00	6,552,000	
住友電設	5,200	1,926.00	10,015,200	貸付株式数 1,200株
日本電設工業	11,600	1,549.00	17,968,400	貸付株式数 400株
エクシオグループ	32,300	2,406.00	77,713,800	
新日本空調	5,700	2,093.00	11,930,100	貸付株式数 1,400株
日本工営	3,800	3,170.00	12,046,000	
九電工	16,300	3,360.00	54,768,000	
三機工業	13,600	1,373.00	18,672,800	貸付株式数 1,900株
日揮ホールディングス	64,700	957.00	61,917,900	
中外炉工業	2,000	1,552.00	3,104,000	貸付株式数 200株
ヤマト	6,200	738.00	4,575,600	
太平電業	4,900	2,706.00	13,259,400	
高砂熱学	19,100	1,908.00	36,442,800	
三晃金属	900	2,300.00	2,070,000	
NEC ネットエスアイ	22,300	1,809.00	40,340,700	
朝日工業社	1,300	2,809.00	3,651,700	貸付株式数 200株
明星工業	13,600	652.00	8,867,200	
大気社	10,200	2,900.00	29,580,000	貸付株式数 2,200株
ダイダン	4,700	2,050.00	9,635,000	
日比谷総合設備	7,000	1,864.00	13,048,000	貸付株式数 400株
ニッポン	19,800	1,567.00	31,026,600	
日清製粉G本社	76,400	1,636.00	124,990,400	
日東富士製粉	1,000	3,455.00	3,455,000	
昭和産業	6,400	2,617.00	16,748,800	
鳥越製粉	6,400	710.00	4,544,000	貸付株式数 2,400株
中部飼料	7,800	944.00	7,363,200	貸付株式数 3,100株
フィード・ワン	9,300	714.00	6,640,200	
東洋精糖	1,300	1,127.00	1,465,100	
日本甜菜糖	3,500	1,595.00	5,582,500	
DM三井製糖ホールディ	6,100	1,862.00	11,358,200	貸付株式数 400株

塩水港精糖	10,300	213.00	2,193,900	貸付株式数	900株
日新製糖	3,300	1,629.00	5,375,700		
L I F U L L	22,500	258.00	5,805,000	貸付株式数	7,600株
ミクシィ	14,800	2,021.00	29,910,800	貸付株式数	6,600株
ジェイエイシーリクルート メント	5,500	1,988.00	10,934,000	貸付株式数	500株
日本M & A センターホール デ	105,500	3,335.00	351,842,500		
メンバーズ	2,000	2,333.00	4,666,000	貸付株式数	700株
中広	1,100	386.00	424,600	貸付株式数	400株
U T グループ	9,400	4,050.00	38,070,000	貸付株式数	2,900株
アイティメディア	3,100	2,006.00	6,218,600	貸付株式数	200株
E・Jホールディングス	3,300	1,179.00	3,890,700	貸付株式数	1,300株
夢真ビーネックスグループ	17,600	1,666.00	29,321,600		
コシダカホールディングス	18,600	598.00	11,122,800	貸付株式数	6,100株
アルトナー	1,300	825.00	1,072,500		
パソナグループ	7,300	3,545.00	25,878,500		
C D S	1,500	1,638.00	2,457,000		
リンクアンドモチベーショ ン	14,500	707.00	10,251,500	貸付株式数	5,600株
エス・エム・エス	22,200	4,235.00	94,017,000		
サニーサイドアップG	2,100	730.00	1,533,000	貸付株式数	800株
パーソルホールディングス	64,200	3,280.00	210,576,000		
リニカル	3,400	851.00	2,893,400	貸付株式数	1,400株
クックパッド	21,700	256.00	5,555,200	貸付株式数	7,800株
エスクリ	3,100	412.00	1,277,200	貸付株式数	700株
アイ・ケイ・ケイホール ディンク	3,400	608.00	2,067,200	貸付株式数	1,200株
森永製菓	15,900	3,530.00	56,127,000		
中村屋	1,600	3,605.00	5,768,000		
江崎グリコ	18,600	3,505.00	65,193,000		
名糖産業	3,000	1,650.00	4,950,000	貸付株式数	400株
井村屋グループ	3,800	2,162.00	8,215,600		
不二家	4,100	2,232.00	9,151,200	貸付株式数	1,600株
山崎製パン	50,700	1,475.00	74,782,500		
第一屋製パン	1,300	529.00	687,700	貸付株式数	400株
モロゾフ	1,100	5,290.00	5,819,000		
亀田製菓	3,800	4,325.00	16,435,000		
寿スピリッツ	6,600	6,160.00	40,656,000	貸付株式数	1,400株
カルビー	30,800	2,548.00	78,478,400	貸付株式数	4,700株

森永乳業	12,600	5,440.00	68,544,000	
六甲バター	5,000	1,528.00	7,640,000	貸付株式数 2,000株
ヤクルト	50,100	5,670.00	284,067,000	
明治ホールディングス	44,700	6,660.00	297,702,000	
雪印メグミルク	16,300	1,920.00	31,296,000	貸付株式数 100株
プリマハム	8,500	2,371.00	20,153,500	貸付株式数 2,700株
日本ハム	25,900	3,870.00	100,233,000	
林兼産業	2,200	531.00	1,168,200	
丸大食品	6,600	1,433.00	9,457,800	
S Foods	6,100	3,285.00	20,038,500	貸付株式数 2,400株
柿安本店	2,300	2,590.00	5,957,000	貸付株式数 900株
伊藤ハム米久HLDGS	43,800	642.00	28,119,600	貸付株式数 1,400株
学情	2,800	1,079.00	3,021,200	貸付株式数 200株
スタジオアリス	3,000	2,022.00	6,066,000	貸付株式数 1,200株
クロスキャット	1,700	1,482.00	2,519,400	貸付株式数 600株
シミックホールディングス	3,600	1,546.00	5,565,600	
エプコ	1,500	809.00	1,213,500	貸付株式数 500株
システナ	96,000	472.00	45,312,000	
NJS	1,300	1,943.00	2,525,900	
デジタルアーツ	3,500	9,430.00	33,005,000	貸付株式数 500株
日鉄ソリューションズ	9,700	3,440.00	33,368,000	
総合警備保障	25,500	4,840.00	123,420,000	
キューブシステム	3,100	898.00	2,783,800	
いちご	74,300	284.00	21,101,200	貸付株式数 4,800株
WOW WORLD	900	1,396.00	1,256,400	貸付株式数 300株
日本駐車場開発	73,500	136.00	9,996,000	
コア	2,600	1,530.00	3,978,000	
カカクコム	47,800	3,175.00	151,765,000	
アイロムグループ	2,400	1,709.00	4,101,600	貸付株式数 100株
セントケア・ホールディング	4,300	744.00	3,199,200	貸付株式数 800株
サイネックス	1,300	625.00	812,500	貸付株式数 200株
ルネサンス	4,700	1,129.00	5,306,300	貸付株式数 1,500株
ディップ	11,400	3,980.00	45,372,000	貸付株式数 4,500株
SBSホールディングス	5,400	3,465.00	18,711,000	
デジタルホールディングス	4,900	1,390.00	6,811,000	貸付株式数 1,100株
新日本科学	8,100	1,615.00	13,081,500	
キャリアデザインセンター	1,600	965.00	1,544,000	
ベネフィット・ワン	23,500	5,320.00	125,020,000	
エムスリー	113,600	6,119.00	695,118,400	

ツカダ・グローバルHOLD	4,900	283.00	1,386,700	貸付株式数	1,600株
プラス	1,400	642.00	898,800	貸付株式数	300株
アウトソーシング	37,400	1,504.00	56,249,600	貸付株式数	14,000株
ウェルネット	6,300	449.00	2,828,700	貸付株式数	1,900株
ワールドホールディングス	2,600	2,529.00	6,575,400		
ディー・エヌ・エー	24,600	1,680.00	41,328,000		
博報堂DYHLDGS	89,300	1,693.00	151,184,900		
ぐるなび	10,700	469.00	5,018,300	貸付株式数	900株
タカミヤ	7,500	430.00	3,225,000		
ジャパンベストレスキューS	5,000	955.00	4,775,000		
ファンコミュニケーションズ	16,400	404.00	6,625,600	貸付株式数	6,300株
ライク	1,900	1,645.00	3,125,500		
ビジネス・ブレークスルー	2,600	412.00	1,071,200	貸付株式数	1,000株
エスプール	19,100	1,275.00	24,352,500		
WDBホールディングス	2,900	3,125.00	9,062,500	貸付株式数	800株
手間いらず	1,000	5,160.00	5,160,000	貸付株式数	300株
ティア	4,200	434.00	1,822,800		
CDG	500	1,390.00	695,000	貸付株式数	200株
バリューコマース	5,300	4,520.00	23,956,000		
インフォマート	71,500	1,026.00	73,359,000		
サッポロホールディングス	23,000	2,180.00	50,140,000		
アサヒグループホールディングン	159,000	4,194.00	666,846,000		
麒麟HD	248,500	1,817.00	451,524,500		
宝ホールディングス	46,000	1,220.00	56,120,000		
オエノンホールディングス	19,900	356.00	7,084,400	貸付株式数	7,700株
養命酒	2,100	1,770.00	3,717,000		
コカ・コーラボトラーズJHD	47,400	1,265.00	59,961,000		
サントリー食品インター	45,200	4,005.00	181,026,000		
ダイドーグループHD	3,500	4,910.00	17,185,000	貸付株式数	1,500株
伊藤園	20,500	6,670.00	136,735,000	貸付株式数	500株
キーコーヒー	6,900	1,941.00	13,392,900		
ユニカフェ	2,000	1,012.00	2,024,000	貸付株式数	800株
ジャパンフーズ	900	1,214.00	1,092,600	貸付株式数	300株
日清オイリオグループ	8,500	2,778.00	23,613,000		
不二製油グループ	14,600	2,236.00	32,645,600	貸付株式数	3,200株



かどや製油	800	4,040.00	3,232,000	貸付株式数	200株
J - オイルミルズ	6,300	1,651.00	10,401,300	貸付株式数	1,400株
ローソン	14,600	5,540.00	80,884,000	貸付株式数	3,400株
サンエー	5,000	3,990.00	19,950,000	貸付株式数	2,000株
カワチ薬品	5,100	2,159.00	11,010,900	貸付株式数	2,000株
エービーシー・マート	10,300	5,340.00	55,002,000	貸付株式数	4,100株
ハードオフコーポレーション	3,000	699.00	2,097,000		
高千穂交易	2,500	1,246.00	3,115,000	貸付株式数	1,000株
アスクル	11,200	1,419.00	15,892,800	貸付株式数	4,200株
ゲオホールディングス	8,900	1,189.00	10,582,100	貸付株式数	1,900株
アダストリア	7,200	1,863.00	13,413,600	貸付株式数	3,600株
ジーフット	4,100	384.00	1,574,400	貸付株式数	1,600株
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,000	380.00	380,000	貸付株式数	400株
オルパヘルスケアHLDGS	1,000	1,495.00	1,495,000		
伊藤忠食品	1,600	4,905.00	7,848,000		
くら寿司	7,100	3,740.00	26,554,000	貸付株式数	2,800株
キャンドウ	1,800	2,315.00	4,167,000	貸付株式数	1,200株
エレマテック	5,800	1,009.00	5,852,200		
パルグループHLDGS	5,900	1,546.00	9,121,400		
JALUX	1,700	2,552.00	4,338,400	貸付株式数	700株
エディオン	30,400	999.00	30,369,600	貸付株式数	12,100株
あらた	5,300	3,850.00	20,405,000	貸付株式数	2,000株
サーラコーポレーション	13,600	569.00	7,738,400	貸付株式数	5,400株
ワッツ	3,300	740.00	2,442,000	貸付株式数	1,200株
トーメンデバイス	1,000	6,720.00	6,720,000	貸付株式数	300株
ハローズ	3,000	2,647.00	7,941,000	貸付株式数	1,200株
J Pホールディングス	17,600	245.00	4,312,000	貸付株式数	7,200株
フジオフードG本社	5,700	1,344.00	7,660,800	貸付株式数	2,200株 (100株)
あみやき亭	1,600	2,870.00	4,592,000	貸付株式数	500株
東京エレクトロンデバイス	2,000	6,770.00	13,540,000	貸付株式数	300株
ひらまつ	14,200	194.00	2,754,800	貸付株式数	100株
フィールズ	5,900	532.00	3,138,800		
双日	74,200	1,606.00	119,165,200		
アルフレッサホールディングス	73,800	1,538.00	113,504,400		
大黒天物産	2,100	6,120.00	12,852,000	貸付株式数	800株

ハニーズホールディングス	5,300	1,000.00	5,300,000		
ファーマライズHD	1,900	751.00	1,426,900	貸付株式数	600株
キッコーマン	48,600	8,660.00	420,876,000		
味の素	149,200	3,407.00	508,324,400		
キューピー	35,500	2,309.00	81,969,500		
ハウス食品G本社	25,300	2,789.00	70,561,700	貸付株式数	300株
カゴメ	25,700	2,765.00	71,060,500		
焼津水産化工	3,400	931.00	3,165,400	貸付株式数	700株
アリアケジャパン	6,200	6,400.00	39,680,000		
ピエトロ	900	1,770.00	1,593,000	貸付株式数	300株
エバラ食品工業	1,500	2,307.00	3,460,500		
やまみ	800	1,767.00	1,413,600		
ニチレイ	32,200	2,601.00	83,752,200		
横浜冷凍	18,200	803.00	14,614,600	貸付株式数	6,900株
東洋水産	32,500	4,600.00	149,500,000	貸付株式数	3,500株
イトアンドHLDGS	2,600	2,079.00	5,405,400	貸付株式数	1,000株
大冷	800	1,910.00	1,528,000	貸付株式数	300株
ヨシムラ・フード・HLDGS	3,600	627.00	2,257,200	貸付株式数	1,400株
日清食品HD	26,500	8,340.00	221,010,000		
永谷園ホールディングス	3,000	1,933.00	5,799,000		
一正蒲鉾	2,800	853.00	2,388,400		
フジッコ	7,500	1,808.00	13,560,000		
ロックフィールド	7,500	1,438.00	10,785,000	貸付株式数	2,800株
日本たばこ産業	362,200	2,273.50	823,461,700		
ケンコーマヨネーズ	3,900	1,271.00	4,956,900	貸付株式数	1,500株
わらべや日洋HD	4,500	1,842.00	8,289,000	貸付株式数	1,700株
なとり	3,800	1,901.00	7,223,800	貸付株式数	1,500株
イフジ産業	1,500	927.00	1,390,500	貸付株式数	300株
ピックルスコーポレーション	3,400	1,765.00	6,001,000	貸付株式数	1,200株
北の達人コーポ	24,000	356.00	8,544,000	貸付株式数	9,400株 (2,500株)
ユーグレナ	35,300	795.00	28,063,500	貸付株式数	13,600株
スター・マイカ・HLDGS	3,500	1,239.00	4,336,500	貸付株式数	100株
ADワークスグループ	13,100	157.00	2,056,700	貸付株式数	5,200株
片倉工業	8,800	2,191.00	19,280,800	貸付株式数	1,200株
ゲンゼ	4,700	3,945.00	18,541,500	貸付株式数	600株
ヒューリック	157,900	1,076.00	169,900,400	貸付株式数	54,800株

神 栄	1,200	821.00	985,200		
ラサ商事	4,400	857.00	3,770,800		
アルペン	5,300	2,174.00	11,522,200	貸付株式数	2,000株
ハブ	2,200	660.00	1,452,000	貸付株式数	800株
ラクーンホールディングス	4,700	1,533.00	7,205,100	貸付株式数	1,800株
クオールホールディングス	8,200	1,381.00	11,324,200	貸付株式数	1,200株
アルコニックス	7,500	1,175.00	8,812,500		
神戸物産	51,600	4,280.00	220,848,000	貸付株式数	20,500株
ソリトンシステムズ	3,600	1,197.00	4,309,200		
ジズホールディングス	4,500	6,450.00	29,025,000	貸付株式数	1,700株
ビックカメラ	39,300	937.00	36,824,100	貸付株式数	15,700株 (300株)
D C Mホールディングス	40,900	1,051.00	42,985,900		
ペッパーフードサービス	9,200	391.00	3,597,200	貸付株式数	3,600株 (300株)
ハイパー	1,700	549.00	933,300	貸付株式数	600株
M o n o t a R O	84,200	2,256.00	189,955,200		
東京一番フーズ	1,700	585.00	994,500	貸付株式数	600株
D Dホールディングス	3,500	459.00	1,606,500	貸付株式数	1,400株
あい ホールディングス	9,500	1,938.00	18,411,000		
ディーブイエックス	2,100	1,005.00	2,110,500	貸付株式数	800株
きちりホールディングス	1,400	463.00	648,200	貸付株式数	500株
アークランドサービスHD	5,500	2,254.00	12,397,000	貸付株式数	2,000株
J . フロント リテイリ ング	79,400	932.00	74,000,800		
ドトール・日レスHD	11,400	1,517.00	17,293,800	貸付株式数	4,500株
マツキヨココカラ&カンパ ニー	40,800	4,450.00	181,560,000		
ブロンコビリー	3,800	2,278.00	8,656,400	貸付株式数	1,500株
Z O Z O	45,600	3,615.00	164,844,000		
トレジャー・ファクトリー	2,100	871.00	1,829,100		
物語コーポレーション	3,500	7,250.00	25,375,000	貸付株式数	1,400株
三越伊勢丹HD	116,500	776.00	90,404,000		
東洋紡	27,200	1,195.00	32,504,000		
ユニチカ	18,500	289.00	5,346,500		
富士紡ホールディングス	2,900	3,765.00	10,918,500	貸付株式数	400株
日清紡ホールディングス	40,900	819.00	33,497,100		
倉敷紡績	5,600	1,822.00	10,203,200	貸付株式数	400株
ダイワボウHD	32,200	1,809.00	58,249,800		
シキボウ	3,100	894.00	2,771,400	貸付株式数	400株

日東紡績	10,300	2,666.00	27,459,800		
トヨタ紡織	27,200	2,239.00	60,900,800		
マクニカ・富士エレHLD GS	16,000	2,558.00	40,928,000	貸付株式数	1,400株
Hamee	1,900	1,109.00	2,107,100	貸付株式数	900株
ラクト・ジャパン	3,000	2,336.00	7,008,000	貸付株式数	100株
ウエルシアHD	35,200	4,025.00	141,680,000		
クリエイトSDH	9,800	3,120.00	30,576,000	貸付株式数	3,700株
バイタルKSKHD	11,800	765.00	9,027,000		
八洲電機	4,600	900.00	4,140,000	貸付株式数	1,800株
メディアスホールディング ス	3,900	903.00	3,521,700	貸付株式数	1,400株
レスターホールディングス	6,100	1,852.00	11,297,200	貸付株式数	1,000株
ジューテックHD	1,600	1,033.00	1,652,800	貸付株式数	500株
丸善CHI HD	7,700	362.00	2,787,400	貸付株式数	2,500株
大光	2,500	689.00	1,722,500	貸付株式数	1,100株
OCHIホールディングス	2,000	1,256.00	2,512,000	貸付株式数	700株
TOKAIホールディング ス	31,500	826.00	26,019,000		
黒谷	1,500	588.00	882,000	貸付株式数	700株
ミサワ	1,900	653.00	1,240,700	貸付株式数	500株
ティーライフ	1,400	1,310.00	1,834,000	貸付株式数	300株
Cominix	500	721.00	360,500	貸付株式数	400株
エー・ピーホールディング ス	1,700	441.00	749,700	貸付株式数	400株
三洋貿易	7,700	969.00	7,461,300		
チムニー	2,000	1,229.00	2,458,000	貸付株式数	800株
シュッピン	5,500	973.00	5,351,500	貸付株式数	2,200株
ビューティガレージ	1,100	3,735.00	4,108,500	貸付株式数	400株
オイシックス・ラ・大地	9,500	3,340.00	31,730,000	貸付株式数	2,500株
ウイン・パートナーズ	4,600	940.00	4,324,000		
ネクステージ	13,700	2,290.00	31,373,000		
ジョイフル本田	19,400	1,560.00	30,264,000	貸付株式数	7,300株
鳥貴族ホールディングス	2,600	1,655.00	4,303,000	貸付株式数	900株
ホットランド	4,900	1,300.00	6,370,000	貸付株式数	1,900株 (200株)
すかいらくHD	92,600	1,469.00	136,029,400	貸付株式数	34,200株
SFPホールディングス	3,300	1,301.00	4,293,300	貸付株式数	1,300株
綿半ホールディングス	5,000	1,215.00	6,075,000	貸付株式数	1,400株
日本毛織	20,200	841.00	16,988,200	貸付株式数	8,000株

ダイトウボウ	12,100	100.00	1,210,000	貸付株式数	4,400株
トーア紡コーポレーション	2,300	427.00	982,100	貸付株式数	300株
ダイドーリミテッド	7,600	160.00	1,216,000	貸付株式数	3,000株
ヨシックスホールディングス	1,300	1,972.00	2,563,600	貸付株式数	500株
ユナイテッド・スーパーマケ	19,000	1,000.00	19,000,000	貸付株式数	7,600株
三栄建築設計	2,500	1,621.00	4,052,500		
野村不動産HLDGS	33,900	2,465.00	83,563,500		
三重交通グループHD	13,000	456.00	5,928,000	貸付株式数	5,100株
サムティ	10,400	2,286.00	23,774,400	貸付株式数	4,100株
日本商業開発	4,600	1,691.00	7,778,600	貸付株式数	1,700株
プレサンスコーポレーション	8,500	1,714.00	14,569,000	貸付株式数	4,300株
フィル・カンパニー	1,200	2,192.00	2,630,400	貸付株式数	400株
ハウスコム	700	1,255.00	878,500		
日本管理センター	3,700	1,022.00	3,781,400		
サンセイランディック	1,000	778.00	778,000	貸付株式数	700株
エストラスト	1,100	613.00	674,300		
フージャースHD	7,300	630.00	4,599,000	貸付株式数	3,600株
オープンハウス	21,200	6,440.00	136,528,000		
東急不動産HD	194,500	586.00	113,977,000		
飯田GHD	55,300	2,348.00	129,844,400		
イーランド	800	1,558.00	1,246,400		
帝国繊維	7,600	1,973.00	14,994,800	貸付株式数	2,900株
日本コークス工業	58,300	122.00	7,112,600		
ゴルフダイジェスト・オン	3,900	1,009.00	3,935,100	貸付株式数	1,400株
ミタチ産業	1,100	890.00	979,000	貸付株式数	600株
B E E N O S	3,600	2,732.00	9,835,200		
あさひ	5,600	1,284.00	7,190,400	貸付株式数	2,100株
日本調剤	4,200	1,267.00	5,321,400	貸付株式数	1,500株
コスモス薬品	6,700	17,610.00	117,987,000	貸付株式数	2,600株
シップヘルスケアHD	21,200	2,530.00	53,636,000	貸付株式数	3,200株
トーエル	3,100	774.00	2,399,400	貸付株式数	1,200株
ソフトクリエイイトHD	2,900	4,385.00	12,716,500		
オンリー	1,100	759.00	834,900		
セブン&アイ・HLDGS	259,400	4,554.00	1,181,307,600		
クリエイイト・レストランツ・ホール	31,700	680.00	21,556,000	貸付株式数	14,200株
明治電機工業	1,700	1,226.00	2,084,200	貸付株式数	300株

ツルハホールディングス	14,500	12,800.00	185,600,000	
デリカフーズHLDGS	2,800	591.00	1,654,800	貸付株式数 1,100株
スターティアホールディングス	1,600	1,134.00	1,814,400	貸付株式数 500株
サンマルクホールディングス	5,200	1,408.00	7,321,600	貸付株式数 300株
フェリシモ	1,600	1,321.00	2,113,600	貸付株式数 500株
トリドールホールディングス	16,600	2,421.00	40,188,600	貸付株式数 6,400株
帝人	61,900	1,301.00	80,531,900	
東レ	477,800	660.80	315,730,240	
クラレ	96,300	944.00	90,907,200	
旭化成	436,700	1,071.50	467,924,050	
TOKYO BASE	6,900	669.00	4,616,100	貸付株式数 2,400株
稲葉製作所	3,700	1,308.00	4,839,600	貸付株式数 1,400株
宮地エンジニアリングG	2,000	2,906.00	5,812,000	貸付株式数 200株
トーカロ	16,800	1,484.00	24,931,200	
アルファCO	2,500	1,070.00	2,675,000	貸付株式数 1,000株
SUMCO	102,400	2,488.00	254,771,200	貸付株式数 33,200株
川田テクノロジーズ	1,400	3,695.00	5,173,000	貸付株式数 100株
RS TECHNOLOGIES	2,200	6,440.00	14,168,000	貸付株式数 600株
信和	5,600	748.00	4,188,800	
ビーロット	3,900	503.00	1,961,700	貸付株式数 1,500株
ファーストブラザーズ	1,500	923.00	1,384,500	貸付株式数 600株 (200株)
ハウストゥ	2,900	905.00	2,624,500	貸付株式数 600株
シーアールイー	1,900	1,673.00	3,178,700	貸付株式数 700株
プロパティエージェント	700	1,740.00	1,218,000	貸付株式数 400株
ケイアイスター不動産	3,000	8,530.00	25,590,000	
アグレ都市デザイン	900	1,698.00	1,528,200	貸付株式数 400株
ジェイ・エス・ビー	1,400	2,734.00	3,827,600	貸付株式数 500株
テンポイノベーション	1,600	831.00	1,329,600	貸付株式数 600株
グローバルリンクマネジメン ト	800	932.00	745,600	貸付株式数 400株
住江織物	1,300	1,534.00	1,994,200	
日本フエルト	4,100	431.00	1,767,100	
イチカワ	800	1,355.00	1,084,000	
エコナックホールディング ス	13,500	94.00	1,269,000	

日東製網	900	1,451.00	1,305,900	貸付株式数	200株
芦森工業	1,200	904.00	1,084,800		
アツギ	5,200	666.00	3,463,200		
ウイルプラスHLDGS	1,000	883.00	883,000	貸付株式数	400株
JMホールディングス	4,900	1,722.00	8,437,800		
コメダホールディングス	14,600	1,944.00	28,382,400	貸付株式数	5,700株
サツドラホールディングス	3,000	680.00	2,040,000		
アレンザホールディングス	5,100	1,021.00	5,207,100	貸付株式数	2,000株
串カツ田中HLDGS	1,800	1,933.00	3,479,400		
バロックジャパン	4,900	824.00	4,037,600	貸付株式数	1,800株
クスリのアオキHLDGS	6,600	7,190.00	47,454,000		
ダイニック	2,500	685.00	1,712,500		
共和レザー	3,800	605.00	2,299,000		
ピーバンドットコム	1,200	586.00	703,200	貸付株式数	300株
力の源HD	3,300	596.00	1,966,800	貸付株式数	1,300株
FOOD & LIFE COMPANY	38,900	4,825.00	187,692,500		
アセンテック	2,200	1,167.00	2,567,400	貸付株式数	600株
セーレン	13,400	2,273.00	30,458,200	貸付株式数	6,400株
ソトー	1,800	825.00	1,485,000	貸付株式数	400株
東海染工	800	1,129.00	903,200	貸付株式数	100株
小松マテーレ	10,900	1,177.00	12,829,300		
ワコールホールディングス	16,500	2,013.00	33,214,500		
ホギメディカル	8,800	3,000.00	26,400,000	貸付株式数	800株
クラウドディアHLDGS	1,000	240.00	240,000	貸付株式数	600株
TSIホールディングス	22,100	345.00	7,624,500	貸付株式数	7,700株
マツオカコーポレーション	2,100	1,217.00	2,555,700	貸付株式数	800株
ワールド	8,600	1,189.00	10,225,400		
TIS	62,800	3,510.00	220,428,000		
JNSホールディングス	2,900	526.00	1,525,400	貸付株式数	1,300株
グリー	42,600	998.00	42,514,800		
コーエーテクモHD	21,100	4,755.00	100,330,500		
三菱総合研究所	2,700	3,710.00	10,017,000		
ボルテージ	2,000	344.00	688,000	貸付株式数	900株
電算	800	2,355.00	1,884,000	貸付株式数	100株
AGS	3,100	821.00	2,545,100	貸付株式数	200株
ファインデックス	6,100	1,014.00	6,185,400	貸付株式数	1,600株
ブレインパッド	1,700	5,640.00	9,588,000	貸付株式数	200株
KLab	12,100	556.00	6,727,600	貸付株式数	4,800株

ポールトゥウィン・ピット クル	9,400	964.00	9,061,600	
イーブックイニシアティブ	300	4,720.00	1,416,000	
ネクソン	148,800	2,254.00	335,395,200	
アイスタイル	21,600	275.00	5,940,000	貸付株式数 8,000株
エムアップホールディング ス	2,000	4,300.00	8,600,000	
エイチーム	4,600	1,058.00	4,866,800	貸付株式数 1,700株
エニグモ	7,200	975.00	7,020,000	
テクノスジャパン	5,300	520.00	2,756,000	
e n i s h	4,100	366.00	1,500,600	貸付株式数 1,600株
コロブラ	21,700	693.00	15,038,100	
オルトプラス	5,100	333.00	1,698,300	貸付株式数 2,000株
ブロードリーフ	33,800	480.00	16,224,000	貸付株式数 13,200株
クロス・マーケティングG	3,300	1,105.00	3,646,500	貸付株式数 1,100株
デジタルハーツHLDGS	3,000	2,478.00	7,434,000	
システム情報	5,400	880.00	4,752,000	貸付株式数 1,900株
メディアドゥ	2,400	4,575.00	10,980,000	貸付株式数 900株
じげん	18,300	309.00	5,654,700	
ブイキューブ	7,000	1,135.00	7,945,000	貸付株式数 2,600株
エンカレッジ・テクノロジ	1,100	611.00	672,100	貸付株式数 400株
サイバーリンクス	2,600	1,047.00	2,722,200	
ディー・エル・イー	4,300	296.00	1,272,800	
フィックスターズ	7,100	831.00	5,900,100	貸付株式数 2,800株
CARTA HOLDIN GS	2,700	2,130.00	5,751,000	貸付株式数 1,200株
オプティム	4,600	1,437.00	6,610,200	貸付株式数 1,800株
セレス	2,600	2,252.00	5,855,200	貸付株式数 900株
SHIFT	3,400	25,320.00	86,088,000	
特種東海製紙	4,000	4,025.00	16,100,000	
ティーガイア	5,900	1,616.00	9,534,400	貸付株式数 1,400株
セック	800	2,262.00	1,809,600	貸付株式数 300株
テクマトリックス	11,100	1,955.00	21,700,500	貸付株式数 4,000株
プロシップ	2,200	1,537.00	3,381,400	
ガンホー・オンライン・エ ンター	17,900	3,040.00	54,416,000	
GMOペイメントゲート ウェイ	12,900	15,230.00	196,467,000	
ザッパラス	4,100	533.00	2,185,300	
システムリサーチ	2,100	1,826.00	3,834,600	貸付株式数 600株



インターネットイニシア ティブ	18,000	4,860.00	87,480,000		
さくらインターネット	7,800	531.00	4,141,800	貸付株式数	2,700株
ヴィンクス	1,700	824.00	1,400,800	貸付株式数	700株
GMOグローバルサインH D	1,500	3,995.00	5,992,500	貸付株式数	500株 (400株)
S R Aホールディングス	3,000	2,758.00	8,274,000		
システムインテグレータ	1,800	544.00	979,200	貸付株式数	700株
朝日ネット	6,200	602.00	3,732,400		
e B A S E	8,600	644.00	5,538,400	貸付株式数	3,100株
アバント	7,700	1,341.00	10,325,700		
アドソル日進	2,700	1,708.00	4,611,600	貸付株式数	900株
フリービット	4,000	1,220.00	4,880,000	貸付株式数	100株 (100株)
コムチュア	7,400	3,535.00	26,159,000		
サイバーコム	800	1,160.00	928,000	貸付株式数	400株
アステリア	4,700	803.00	3,774,100	貸付株式数	1,900株
アイル	3,600	1,551.00	5,583,600		
王子ホールディングス	275,000	525.00	144,375,000		
日本製紙	30,900	1,066.00	32,939,400	貸付株式数	10,400株
三菱製紙	7,800	313.00	2,441,400		
北越コーポレーション	42,700	780.00	33,306,000		
中越パルプ	2,300	970.00	2,231,000		
巴川製紙	2,100	845.00	1,774,500	貸付株式数	200株
大王製紙	31,800	1,799.00	57,208,200		
阿波製紙	1,200	366.00	439,200		
マークライنز	3,600	2,648.00	9,532,800		
メディカル・データ・ビジ	8,900	1,329.00	11,828,100	貸付株式数	3,300株
g u m i	9,500	816.00	7,752,000		
ショーケース	1,900	500.00	950,000	貸付株式数	500株
モバイルファクトリー	2,100	969.00	2,034,900	貸付株式数	600株
テラスカイ	2,500	2,049.00	5,122,500	貸付株式数	900株
デジタル・インフォメー ション	2,800	1,391.00	3,894,800	貸付株式数	1,100株
P C Iホールディングス	2,900	1,140.00	3,306,000	貸付株式数	1,200株
パイプドHD	1,600	2,472.00	3,955,200		
アイピーシー	900	739.00	665,100	貸付株式数	300株
ネオジャパン	1,800	1,303.00	2,345,400	貸付株式数	700株
P R T I M E S	1,800	3,185.00	5,733,000	貸付株式数	500株
ラクス	22,700	3,070.00	69,689,000		

ランドコンピュータ	1,500	818.00	1,227,000		
ダブルスタンダード	2,000	3,745.00	7,490,000		
オープンドア	3,900	1,827.00	7,125,300	貸付株式数	1,500株
マイネット	2,600	601.00	1,562,600	貸付株式数	1,000株
アカツキ	3,000	2,738.00	8,214,000	貸付株式数	400株
ベネフィットジャパン	700	2,648.00	1,853,600		
UBICOMホールディングス	1,700	2,860.00	4,862,000	貸付株式数	700株
カナミックネットワーク	7,500	491.00	3,682,500	貸付株式数	1,500株
ノムラシステムコーポレーション	3,900	246.00	959,400	貸付株式数	1,400株
レンゴー	61,500	767.00	47,170,500	貸付株式数	3,200株
トーモク	4,100	1,761.00	7,220,100		
ザ・パック	5,100	2,680.00	13,668,000	貸付株式数	1,900株
チェンジ	12,600	2,110.00	26,586,000		
シンクロ・フード	3,700	354.00	1,309,800	貸付株式数	400株
オークネット	3,900	1,686.00	6,575,400	貸付株式数	1,400株
セグエグループ	2,000	735.00	1,470,000		
エイトレッド	900	2,261.00	2,034,900	貸付株式数	500株
マクロミル	13,500	919.00	12,406,500	貸付株式数	1,500株
ビーグリー	1,700	1,785.00	3,034,500		
オロ	2,100	3,400.00	7,140,000	貸付株式数	200株
ユーザーローカル	2,000	1,626.00	3,252,000	貸付株式数	800株
テモナ	2,000	483.00	966,000	貸付株式数	600株
ニーズウェル	1,800	569.00	1,024,200		
マネーフォワード	10,000	7,820.00	78,200,000		
サインポスト	2,100	1,439.00	3,021,900	貸付株式数	800株
昭和電工	57,200	2,502.00	143,114,400		
住友化学	483,500	524.00	253,354,000		
住友精化	2,800	3,020.00	8,456,000	貸付株式数	400株
日産化学	36,000	6,540.00	235,440,000		
ラサ工業	2,200	1,658.00	3,647,600		
クレハ	5,200	7,900.00	41,080,000	貸付株式数	700株
多木化学	2,600	5,450.00	14,170,000	貸付株式数	1,000株
テイカ	4,600	1,163.00	5,349,800		
石原産業	10,800	1,166.00	12,592,800	貸付株式数	1,300株
片倉コープアグリ	1,100	1,154.00	1,269,400	貸付株式数	200株
日本曹達	8,300	3,215.00	26,684,500	貸付株式数	900株
東ソー	94,900	1,631.00	154,781,900		
トクヤマ	21,000	1,784.00	37,464,000		

セントラル硝子	11,500	1,944.00	22,356,000	貸付株式数	2,800株
東亜合成	39,000	1,176.00	45,864,000	貸付株式数	2,300株
大阪ソーダ	6,000	2,555.00	15,330,000	貸付株式数	800株
関東電化	14,000	1,008.00	14,112,000	貸付株式数	1,800株
デンカ	24,000	3,345.00	80,280,000		
イビデン	35,400	7,070.00	250,278,000		
信越化学	113,200	19,000.00	2,150,800,000		
日本カ - バイド	1,900	1,255.00	2,384,500	貸付株式数	300株
電算システムHD	2,700	2,255.00	6,088,500		
堺化学	4,400	2,096.00	9,222,400	貸付株式数	1,700株
第一稀元素化学工	6,000	1,278.00	7,668,000	貸付株式数	800株
エア・ウォーター	62,200	1,677.00	104,309,400	貸付株式数	2,500株
日本酸素HLDGS	63,300	2,403.00	152,109,900		
日本化学工業	2,000	2,520.00	5,040,000		
東邦アセチレン	1,200	1,194.00	1,432,800	貸付株式数	400株
日本パ - カライジング	32,800	1,060.00	34,768,000		
高压ガス	10,100	736.00	7,433,600		
チタン工業	600	1,676.00	1,005,600	貸付株式数	300株
四国化成	8,400	1,366.00	11,474,400		
戸田工業	1,500	3,440.00	5,160,000		
ステラケミファ	3,200	2,500.00	8,000,000	貸付株式数	1,400株
保土谷化学	2,100	4,625.00	9,712,500		
日本触媒	11,000	5,070.00	55,770,000	貸付株式数	1,300株
大日精化	5,300	2,200.00	11,660,000		
カネカ	17,000	3,700.00	62,900,000		
協和キリン	79,100	3,170.00	250,747,000		
三菱瓦斯化学	61,100	1,889.00	115,417,900	貸付株式数	2,500株
三井化学	59,800	3,045.00	182,091,000		
JSR	61,400	4,240.00	260,336,000		
東京応化工業	11,400	7,120.00	81,168,000		
大阪有機化学	6,100	3,650.00	22,265,000		
三菱ケミカルHLDGS	440,000	892.20	392,568,000		
KHネオケム	11,100	3,080.00	34,188,000		
ダイセル	95,000	783.00	74,385,000		
住友ベ - クライト	10,400	5,310.00	55,224,000		
積水化学	137,800	1,845.00	254,241,000		
日本ゼオン	60,300	1,203.00	72,540,900		
アイカ工業	18,300	3,315.00	60,664,500		
宇部興産	32,100	1,900.00	60,990,000		
積水樹脂	10,200	2,019.00	20,593,800		

タキロンシーアイ	16,400	522.00	8,560,800	
旭有機材	5,000	1,490.00	7,450,000	
ニチバン	3,900	1,747.00	6,813,300	貸付株式数 1,200株
リケンテクノス	16,200	481.00	7,792,200	貸付株式数 700株
大倉工業	3,300	2,052.00	6,771,600	貸付株式数 1,300株
積水化成成品	14,700	476.00	6,997,200	
群栄化学	1,400	3,275.00	4,585,000	
タイガース ポリマー	9,600	427.00	4,099,200	
ミライアル	2,100	1,627.00	3,416,700	
ダイキアクシス	2,600	835.00	2,171,000	貸付株式数 900株
ダイキョーニシカワ	16,500	537.00	8,860,500	貸付株式数 6,200株
竹本容器	2,900	774.00	2,244,600	貸付株式数 900株
森六ホールディングス	3,500	1,710.00	5,985,000	
日本化薬	51,600	1,114.00	57,482,400	
カーリットホールディングス	6,300	653.00	4,113,900	
ソルクシーズ	6,000	463.00	2,778,000	
レグス	1,300	1,453.00	1,888,900	貸付株式数 600株
プレステージ・インター	23,800	690.00	16,422,000	貸付株式数 8,000株
フェイス	1,900	633.00	1,202,700	貸付株式数 400株
プロトコーポレーション	7,100	1,271.00	9,024,100	貸付株式数 3,000株
ハイマックス	1,600	1,094.00	1,750,400	貸付株式数 100株
アミューズ	3,600	1,895.00	6,822,000	
野村総合研究所	127,500	4,880.00	622,200,000	
ドリームインキュベータ	1,800	827.00	1,488,600	貸付株式数 700株
サイバネットシステム	5,300	682.00	3,614,600	
クイック	4,300	1,403.00	6,032,900	
T A C	4,200	217.00	911,400	
C Eホールディングス	3,300	468.00	1,544,400	貸付株式数 1,400株
日本システム技術	1,300	2,819.00	3,664,700	
電通グループ	66,200	3,610.00	238,982,000	
インテージホールディングス	8,800	1,751.00	15,408,800	貸付株式数 3,200株
テイクアンドギヴニーズ	3,100	900.00	2,790,000	貸付株式数 1,000株
東邦システムサイエンス	1,500	991.00	1,486,500	貸付株式数 600株
びあ	2,300	3,770.00	8,671,000	貸付株式数 900株
イオンファンタジー	2,500	1,738.00	4,345,000	貸付株式数 900株
ソースネクスト	28,000	185.00	5,180,000	貸付株式数 11,200株
シーティーエス	7,300	779.00	5,686,700	貸付株式数 2,600株
ネクシィーズグループ	2,300	792.00	1,821,600	貸付株式数 800株

インフォコム	7,200	1,909.00	13,744,800	
メディカルシステムネット ワーク	6,500	620.00	4,030,000	
日本精化	5,300	2,000.00	10,600,000	
扶桑化学工業	5,900	4,720.00	27,848,000	
トリケミカル	6,800	3,500.00	23,800,000	貸付株式数 2,400株
HEROZ	1,800	1,440.00	2,592,000	貸付株式数 700株
ラクスル	7,400	6,260.00	46,324,000	貸付株式数 2,800株
FIG	6,800	329.00	2,237,200	貸付株式数 2,700株
システムサポート	1,900	1,209.00	2,297,100	
ADEKA	30,200	2,411.00	72,812,200	
日油	22,500	5,600.00	126,000,000	貸付株式数 1,800株
ミヨシ油脂	2,400	1,267.00	3,040,800	貸付株式数 900株
新日本理化	13,000	244.00	3,172,000	貸付株式数 4,200株
ハリマ化成グループ	4,700	791.00	3,717,700	
イーソル	4,000	666.00	2,664,000	貸付株式数 1,600株
アルテリア・ネットワー クス	8,600	1,539.00	13,235,400	貸付株式数 3,100株
東海ソフト	900	1,031.00	927,900	貸付株式数 400株
ヒト・コミュニケーション ズHD	1,500	2,416.00	3,624,000	貸付株式数 600株
トピラスシステムズ	1,300	925.00	1,202,500	貸付株式数 200株
Sansan	24,000	3,130.00	75,120,000	貸付株式数 500株
花王	148,900	5,787.00	861,684,300	貸付株式数 47,000株
第一工業製薬	2,400	3,095.00	7,428,000	
石原ケミカル	3,400	1,265.00	4,301,000	
日華化学	2,100	818.00	1,717,800	貸付株式数 800株
ニイタカ	1,400	2,250.00	3,150,000	貸付株式数 500株
三洋化成	3,800	5,090.00	19,342,000	
武田薬品	529,200	3,031.00	1,604,005,200	
アステラス製薬	583,800	1,779.50	1,038,872,100	
大日本住友製薬	41,600	1,382.00	57,491,200	
塩野義製薬	84,700	7,923.00	671,078,100	
わかもと製薬	8,500	287.00	2,439,500	貸付株式数 3,100株
日本新薬	17,600	8,400.00	147,840,000	貸付株式数 800株
中外製薬	210,700	3,680.00	775,376,000	
科研製薬	10,600	4,045.00	42,877,000	貸付株式数 500株
エーザイ	80,600	6,873.00	553,963,800	
理研ビタミン	7,100	1,603.00	11,381,300	貸付株式数 800株
ロート製薬	34,600	3,235.00	111,931,000	

小野薬品	154,800	2,505.50	387,851,400		
久光製薬	17,800	3,990.00	71,022,000	貸付株式数	7,700株
有機合成薬品	4,300	266.00	1,143,800	貸付株式数	1,900株
持田製薬	8,600	3,180.00	27,348,000	貸付株式数	1,300株
参天製薬	125,700	1,504.00	189,052,800		
扶桑薬品	2,400	2,369.00	5,685,600		
日本ケミファ	900	2,041.00	1,836,900		
ツムラ	20,900	3,235.00	67,611,500	貸付株式数	2,400株
日医工	21,000	672.00	14,112,000	貸付株式数	8,200株
テルモ	190,400	4,628.00	881,171,200		
HUGグループHD	16,900	2,862.00	48,367,800	貸付株式数	1,800株
キッセイ薬品工業	11,900	2,284.00	27,179,600		
生化学工業	12,000	938.00	11,256,000		
栄研化学	12,000	1,893.00	22,716,000		
日水製薬	2,700	939.00	2,535,300		
鳥居薬品	3,700	2,778.00	10,278,600		
JCRファーマ	19,300	2,499.00	48,230,700		
東和薬品	9,800	2,626.00	25,734,800		
富士製薬工業	4,500	1,080.00	4,860,000		
ゼリア新薬工業	12,300	1,919.00	23,603,700	貸付株式数	4,900株
第一三共	529,200	2,824.50	1,494,725,400		
キョーリン製薬HD	13,600	1,688.00	22,956,800	貸付株式数	2,000株
大幸薬品	10,500	808.00	8,484,000	貸付株式数	4,000株
ダイト	4,400	2,841.00	12,500,400		
大塚ホールディングス	140,000	4,146.00	580,440,000		
大正製薬HD	16,100	5,580.00	89,838,000	貸付株式数	800株
ペプチドリーム	35,400	2,862.00	101,314,800		
大日本塗料	7,800	791.00	6,169,800		
日本ペイントHOLD	247,700	1,193.00	295,506,100		
関西ペイント	68,200	2,550.00	173,910,000	貸付株式数	3,100株
神東塗料	5,800	183.00	1,061,400		
中国塗料	16,400	862.00	14,136,800		
日本特殊塗料	4,900	793.00	3,885,700		
藤倉化成	7,500	490.00	3,675,000	貸付株式数	1,000株
太陽ホールディングス	9,800	3,225.00	31,605,000		
DIC	27,600	2,845.00	78,522,000		
サカティンクス	13,700	972.00	13,316,400	貸付株式数	3,100株
東洋インキSCホールディングン	13,500	1,875.00	25,312,500		
T&K TOKA	4,900	746.00	3,655,400		

アルプス技研	5,500	1,870.00	10,285,000	
サニックス	11,300	246.00	2,779,800	貸付株式数 4,400株
ダイオーズ	800	991.00	792,800	貸付株式数 400株
日本空調サービス	6,300	779.00	4,907,700	
オリエンタルランド	76,100	17,840.00	1,357,624,000	
フォーカスシステムズ	4,200	1,023.00	4,296,600	貸付株式数 1,300株
ダスキン	15,000	2,617.00	39,255,000	
パーク24	35,800	1,610.00	57,638,000	
明光ネットワークジャパン	8,100	541.00	4,382,100	貸付株式数 3,000株
ファルコホールディングス	2,900	1,693.00	4,909,700	貸付株式数 400株
クレスコ	4,700	1,920.00	9,024,000	
フジ・メディア・HD	63,700	1,128.00	71,853,600	貸付株式数 7,400株
秀英予備校	2,200	410.00	902,000	貸付株式数 600株
田谷	1,600	530.00	848,000	貸付株式数 600株
ラウンドワン	18,000	1,309.00	23,562,000	貸付株式数 6,100株
リゾートトラスト	29,800	1,860.00	55,428,000	貸付株式数 11,200株
オービック	20,800	20,990.00	436,592,000	
ジャストシステム	9,500	5,190.00	49,305,000	
TDCソフト	5,900	1,193.00	7,038,700	
Zホールディングス	960,600	752.00	722,371,200	
ビー・エム・エル	8,400	3,530.00	29,652,000	
トレンドマイクロ	35,300	6,550.00	231,215,000	
りらいあコミュニケーション	9,900	1,009.00	9,989,100	
IDホールディングス	3,700	833.00	3,082,100	
リソー教育	29,700	405.00	12,028,500	貸付株式数 5,000株
日本オラクル	13,500	11,160.00	150,660,000	
早稲田アカデミー	3,800	977.00	3,712,600	貸付株式数 400株
アルファシステムズ	1,700	3,810.00	6,477,000	貸付株式数 700株
フューチャー	7,900	4,055.00	32,034,500	
CAC HOLDINGS	3,600	1,497.00	5,389,200	貸付株式数 100株
SBテクノロジー	2,900	2,696.00	7,818,400	貸付株式数 1,000株
トーセ	1,700	713.00	1,212,100	貸付株式数 600株
ユー・エス・エス	71,800	1,666.00	119,618,800	
オービックビジネスC	6,500	5,100.00	33,150,000	貸付株式数 2,500株
伊藤忠テクノソリューションズ	30,500	3,695.00	112,697,500	
アイティフォー	7,500	792.00	5,940,000	貸付株式数 500株
東京個別指導学院	5,900	624.00	3,681,600	貸付株式数 2,200株
東計電算	900	5,150.00	4,635,000	貸付株式数 300株
サイバーエージェント	159,100	2,093.00	332,996,300	
楽天グループ	330,500	1,161.00	383,710,500	

エックスネット	900	984.00	885,600	貸付株式数	100株
クリーク・アンド・リバー社	3,500	1,999.00	6,996,500		
テー・オー・ダブリュー	10,800	312.00	3,369,600	貸付株式数	4,200株
大塚商会	35,900	5,190.00	186,321,000	貸付株式数	13,500株
サイボウズ	9,200	2,163.00	19,899,600		
山田コンサルティングG P	3,200	1,113.00	3,561,600	貸付株式数	600株
セントラルスポーツ	2,500	2,343.00	5,857,500	貸付株式数	900株
パラカ	1,900	1,506.00	2,861,400	貸付株式数	600株
電通国際情報S	9,800	3,680.00	36,064,000		
A C C E S S	7,300	763.00	5,569,900	貸付株式数	500株
デジタルガレージ	10,900	4,980.00	54,282,000		
イーエムシステムズ	11,700	695.00	8,131,500	貸付株式数	2,800株
ウェザーニューズ	2,000	9,620.00	19,240,000	貸付株式数	700株
C I J	4,000	805.00	3,220,000	貸付株式数	1,600株
ビジネスエンジニアリング	800	3,400.00	2,720,000	貸付株式数	300株
日本エンタープライズ	8,400	178.00	1,495,200	貸付株式数	400株
WOWOW	3,300	2,034.00	6,712,200	貸付株式数	1,300株
スカラ	6,500	608.00	3,952,000	貸付株式数	400株
インテリジェント ウェイブ	3,300	522.00	1,722,600		
フルキャストホールディングス	5,700	2,648.00	15,093,600	貸付株式数	500株
エン・ジャパン	10,400	3,540.00	36,816,000	貸付株式数	1,500株
あすか製薬HD	7,800	962.00	7,503,600		
サワイグループHD	14,800	4,200.00	62,160,000		
富士フイルムHLDGS	118,300	8,931.00	1,056,537,300		
コニカミノルタ	146,700	469.00	68,802,300		
資 生 堂	125,400	6,503.00	815,476,200		
ライオン	81,300	1,611.00	130,974,300		
高砂香料	4,500	2,750.00	12,375,000		
マンダム	14,500	1,424.00	20,648,000	貸付株式数	5,300株
ミルボン	8,500	5,760.00	48,960,000	貸付株式数	3,200株
ファンケル	27,300	3,425.00	93,502,500		
コーセー	12,800	13,670.00	174,976,000		
コタ	4,700	1,505.00	7,073,500		
シーボン	800	1,686.00	1,348,800	貸付株式数	200株
ポーラ・オルビスHD	28,900	2,022.00	58,435,800		
ノエビアホールディングス	5,700	5,250.00	29,925,000	貸付株式数	2,200株
アジュバンホールディング	1,900	1,090.00	2,071,000	貸付株式数	500株



エステー	4,400	1,537.00	6,762,800	
アグロカネショウ	2,500	1,172.00	2,930,000	貸付株式数 900株
コニシ	11,500	1,598.00	18,377,000	
長谷川香料	11,500	2,812.00	32,338,000	貸付株式数 2,400株
星光PMC	3,500	691.00	2,418,500	
小林製薬	18,900	8,920.00	168,588,000	
荒川化学工業	5,100	1,129.00	5,757,900	貸付株式数 1,900株
メック	5,200	4,120.00	21,424,000	貸付株式数 1,900株
日本高純度化学	1,700	2,560.00	4,352,000	
タカラバイオ	17,700	2,639.00	46,710,300	貸付株式数 100株
JCU	7,500	4,800.00	36,000,000	
新田ゼラチン	4,100	600.00	2,460,000	
OATアグリオ	1,300	2,118.00	2,753,400	貸付株式数 500株
デクセリアルズ	17,400	3,345.00	58,203,000	貸付株式数 2,000株
アース製薬	5,600	6,140.00	34,384,000	貸付株式数 2,200株
北興化学	6,400	846.00	5,414,400	
大成ラミック	2,000	2,740.00	5,480,000	
クミアイ化学	27,100	798.00	21,625,800	
日本農薬	12,100	465.00	5,626,500	
富士興産	2,100	1,032.00	2,167,200	
ニチレキ	8,700	1,307.00	11,370,900	
ユシロ化学	3,400	1,038.00	3,529,200	貸付株式数 500株
ビーピー・カストロール	2,400	1,365.00	3,276,000	
富士石油	18,900	242.00	4,573,800	
MORESCO	1,800	1,077.00	1,938,600	貸付株式数 700株
出光興産	74,500	2,931.00	218,359,500	
ENEOSホールディングス	1,010,700	423.40	427,930,380	
コスモエネルギーHLDGS	19,400	2,225.00	43,165,000	貸付株式数 1,100株
インフロニアHD	90,000	939.00	84,510,000	
横浜ゴム	39,200	1,766.00	69,227,200	
TOYO TIRE	35,700	1,726.00	61,618,200	
ブリヂストン	193,800	4,605.00	892,449,000	
住友ゴム	60,900	1,139.00	69,365,100	
藤倉コンポジット	6,200	788.00	4,885,600	貸付株式数 2,400株
オカモト	4,500	3,770.00	16,965,000	
アキレス	4,500	1,209.00	5,440,500	貸付株式数 500株
フコク	2,700	920.00	2,484,000	
ニッタ	8,200	2,602.00	21,336,400	

クリエートメディック	1,800	976.00	1,756,800	
住友理工	15,500	574.00	8,897,000	
三ツ星ベルト	9,600	1,932.00	18,547,200	
バンドー化学	11,100	850.00	9,435,000	貸付株式数 1,500株
A G C	62,000	5,550.00	344,100,000	
日本板硝子	34,200	502.00	17,168,400	
石塚硝子	1,000	1,905.00	1,905,000	貸付株式数 400株
有沢製作所	9,300	925.00	8,602,500	貸付株式数 3,600株
日本山村硝子	2,400	760.00	1,824,000	
日本電気硝子	28,000	2,939.00	82,292,000	
オハラ	2,800	1,363.00	3,816,400	貸付株式数 1,000株 (100株)
住友大阪セメント	13,300	3,450.00	45,885,000	
太平洋セメント	39,100	2,199.00	85,980,900	
リソルホールディングス	800	4,035.00	3,228,000	貸付株式数 200株
日本ヒュ - ム	6,400	666.00	4,262,400	
日本コンクリ - ト	13,300	252.00	3,351,600	貸付株式数 1,800株
三谷セキサン	3,100	7,080.00	21,948,000	貸付株式数 1,200株
アジアパイルHD	10,300	412.00	4,243,600	
東海カーボン	57,600	1,177.00	67,795,200	
日本カーボン	4,200	4,145.00	17,409,000	
東洋炭素	5,100	3,110.00	15,861,000	
ノリタケ	3,900	4,630.00	18,057,000	
T O T O	48,100	5,030.00	241,943,000	
日本碍子	73,300	1,797.00	131,720,100	
日本特殊陶業	51,500	1,888.00	97,232,000	
ダントーホールディングス	6,200	198.00	1,227,600	貸付株式数 1,800株
M A R U W A	2,400	13,400.00	32,160,000	
品川リフラクトリーズ	1,900	3,475.00	6,602,500	
黒崎播磨	1,400	3,900.00	5,460,000	
ヨータイ	5,000	1,211.00	6,055,000	貸付株式数 800株
イソライト	4,300	927.00	3,986,100	
東京窯業	14,700	294.00	4,321,800	貸付株式数 3,000株
ニッカトー	4,300	660.00	2,838,000	
フジインコーポレーテッド	5,600	7,350.00	41,160,000	
クニミネ工業	3,000	1,014.00	3,042,000	
エーアンドエーマテリアル	900	886.00	797,400	貸付株式数 200株
ニチアス	15,600	2,566.00	40,029,600	貸付株式数 800株
日本製鉄	297,600	1,699.50	505,771,200	

神戸製鋼所	123,700	549.00	67,911,300		
中山製鋼所	9,100	413.00	3,758,300		
合同製鐵	3,500	1,314.00	4,599,000		
J F Eホールディングス	179,700	1,316.00	236,485,200		
東京製鐵	22,400	1,203.00	26,947,200	貸付株式数	4,900株
共英製鋼	7,400	1,251.00	9,257,400	貸付株式数	2,800株
大和工業	12,600	3,485.00	43,911,000	貸付株式数	2,100株
東京鐵鋼	2,700	1,241.00	3,350,700		
大阪製鐵	3,300	1,013.00	3,342,900		
淀川製鋼所	8,400	2,280.00	19,152,000	貸付株式数	400株
丸一鋼管	23,200	2,427.00	56,306,400		
モリ工業	1,900	2,574.00	4,890,600		
大同特殊鋼	11,000	3,930.00	43,230,000		
日本高周波	2,300	349.00	802,700		
日本冶金工	4,600	2,043.00	9,397,800		
山陽特殊製鋼	6,500	1,818.00	11,817,000	貸付株式数	1,700株
愛知製鋼	3,800	2,427.00	9,222,600		
日立金属	71,500	2,102.00	150,293,000		
日本金属	1,700	901.00	1,531,700	貸付株式数	500株
大平洋金属	3,900	2,030.00	7,917,000		
新日本電工	44,300	292.00	12,935,600	貸付株式数	6,900株
栗本鉄工所	2,700	1,473.00	3,977,100		
虹 技	400	998.00	399,200	貸付株式数	200株
日本鑄鉄管	700	1,115.00	780,500		
日本製鋼所	20,300	3,425.00	69,527,500		
三菱製鋼	4,400	970.00	4,268,000	貸付株式数	1,800株
日亜鋼業	7,200	262.00	1,886,400		
日本精線	1,100	4,375.00	4,812,500	貸付株式数	100株
エンビプロHD	2,800	1,897.00	5,311,600	貸付株式数	1,100株
大紀アルミニウム	10,100	1,462.00	14,766,200		
日本軽金属HD	16,200	1,669.00	27,037,800		
三井金属	18,000	2,930.00	52,740,000		
東邦亜鉛	3,600	2,122.00	7,639,200		
三菱マテリアル	43,900	1,954.00	85,780,600		
住友鉱山	85,000	4,233.00	359,805,000		
D O W Aホールディングス	18,000	4,220.00	75,960,000		
古河機金	10,300	1,198.00	12,339,400		
エス・サイエンス	23,300	29.00	675,700	貸付株式数	3,100株
大阪チタニウム	7,100	780.00	5,538,000	貸付株式数	2,800株
東邦チタニウム	12,500	948.00	11,850,000	貸付株式数	2,200株

U A C J	10,000	2,295.00	22,950,000		
C K サンエツ	1,400	3,355.00	4,697,000		
古河電工	21,400	2,255.00	48,257,000		
住友電工	248,700	1,489.50	370,438,650		
フジクラ	74,100	573.00	42,459,300		
昭和電線 H L D G S	5,800	1,878.00	10,892,400	貸付株式数	1,000株
東京特殊電線	1,100	2,656.00	2,921,600	貸付株式数	400株
タツタ電線	12,500	461.00	5,762,500		
カナレ電気	800	1,703.00	1,362,400	貸付株式数	400株
平河ヒューテック	3,700	1,102.00	4,077,400	貸付株式数	1,400株
リョービ	7,800	1,007.00	7,854,600	貸付株式数	3,000株
アーレステイ	6,600	362.00	2,389,200	貸付株式数	1,700株
アサヒHD	26,500	1,914.00	50,721,000		
東洋製罐グループHD	43,500	1,386.00	60,291,000		
ホッカンホールディングス	5,100	1,410.00	7,191,000		
コロナ	3,700	890.00	3,293,000		
横河ブリッジ H L D G S	11,600	2,121.00	24,603,600		
駒井ハルテック	1,200	1,720.00	2,064,000	貸付株式数	200株
高田機工	600	2,636.00	1,581,600	貸付株式数	100株
三和ホールディングス	62,800	1,213.00	76,176,400		
文化シャツタ -	21,100	1,009.00	21,289,900	貸付株式数	7,700株
三協立山	9,400	684.00	6,429,600		
アルインコ	4,600	934.00	4,296,400	貸付株式数	1,800株
東洋シャツタ -	1,600	615.00	984,000		
L I X I L	104,800	2,789.00	292,287,200		
日本ファイルコン	7,900	515.00	4,068,500	貸付株式数	1,600株
ノーリツ	13,600	1,629.00	22,154,400	貸付株式数	400株
長府製作所	6,900	2,001.00	13,806,900	貸付株式数	2,600株
リンナイ	12,600	10,720.00	135,072,000		
ユニプレス	9,600	710.00	6,816,000	貸付株式数	1,600株
ダイニチ工業	3,800	776.00	2,948,800		
日東精工	9,500	593.00	5,633,500		
三洋工業	900	1,851.00	1,665,900	貸付株式数	100株
岡 部	13,100	674.00	8,829,400	貸付株式数	5,100株
ジーテクト	8,000	1,333.00	10,664,000		
東 プ レ	12,400	1,091.00	13,528,400		
高周波熱錬	11,800	553.00	6,525,400	貸付株式数	4,700株
東京製綱	2,900	760.00	2,204,000		
サンコール	5,400	447.00	2,413,800		
モリテックスチル	5,400	354.00	1,911,600	貸付株式数	2,100株

パイオラックス	9,300	1,610.00	14,973,000	
エイチワン	6,400	621.00	3,974,400	
日本発条	61,500	847.00	52,090,500	貸付株式数 7,600株
中央発條	4,400	838.00	3,687,200	
アドバネクス	1,100	1,119.00	1,230,900	貸付株式数 300株
三浦工業	28,800	3,985.00	114,768,000	
タクマ	22,900	1,370.00	31,373,000	
テクノプロ・ホールディング	38,600	3,120.00	120,432,000	
アトラグループ	1,900	280.00	532,000	貸付株式数 600株
インターワークス	1,300	417.00	542,100	
アイ・アールジャパンHD	3,000	7,090.00	21,270,000	
Keepers 技研	4,400	2,574.00	11,325,600	
ファーストロジック	1,500	731.00	1,096,500	
三機サービス	1,300	974.00	1,266,200	貸付株式数 400株
Gunosy	4,800	546.00	2,620,800	
デザインワン・ジャパン	2,100	193.00	405,300	貸付株式数 700株
イー・ガーディアン	3,200	3,485.00	11,152,000	
リブセンス	4,400	193.00	849,200	貸付株式数 2,400株 (2,400株)
ジャパンマテリアル	19,700	1,552.00	30,574,400	
ベクトル	9,000	1,249.00	11,241,000	貸付株式数 3,600株
ウチヤマホールディングス	3,000	293.00	879,000	貸付株式数 1,200株
チャームケアコーポレーション	5,400	1,482.00	8,002,800	貸付株式数 1,900株
キャリアリンク	2,500	1,264.00	3,160,000	貸付株式数 100株
IBJ	5,900	1,020.00	6,018,000	貸付株式数 2,000株
アサンテ	2,700	1,689.00	4,560,300	貸付株式数 900株
バリューHR	2,700	2,506.00	6,766,200	貸付株式数 1,000株
M&Aキャピタルパートナー	5,500	5,500.00	30,250,000	貸付株式数 300株
ライドオンエクスプレスHD	2,600	1,713.00	4,453,800	
ERIホールディングス	1,700	1,386.00	2,356,200	貸付株式数 300株
アビスト	900	2,753.00	2,477,700	貸付株式数 300株 (300株)
シグマクシス・ホールディング	3,900	2,801.00	10,923,900	
ウィルグループ	4,700	1,360.00	6,392,000	貸付株式数 1,600株
エスクローAJ	8,300	177.00	1,469,100	貸付株式数 3,800株

リクルートホールディングス	496,200	6,901.00	3,424,276,200	
エラン	9,700	1,239.00	12,018,300	
ツガミ	16,000	1,411.00	22,576,000	貸付株式数 5,700株
オークマ	7,600	4,745.00	36,062,000	
芝浦機械	7,300	3,370.00	24,601,000	
アマダ	104,400	1,063.00	110,977,200	
アイダエンジニア	16,900	922.00	15,581,800	
滝澤鉄工所	1,100	1,116.00	1,227,600	
F U J I	30,500	2,489.00	75,914,500	
牧野フライス	7,100	3,455.00	24,530,500	貸付株式数 700株
オーエスジー	30,500	1,646.00	50,203,000	
ダイジェット	500	1,074.00	537,000	
旭ダイヤモンド	17,000	634.00	10,778,000	貸付株式数 1,600株
D M G 森精機	39,700	1,774.00	70,427,800	
ソディック	16,100	767.00	12,348,700	
ディスコ	9,800	32,600.00	319,480,000	
日東工器	4,100	1,740.00	7,134,000	
日進工具	5,100	1,429.00	7,287,900	貸付株式数 600株
パンチ工業	5,800	510.00	2,958,000	
富士ダイス	2,800	643.00	1,800,400	
土木管理総合試験	2,500	332.00	830,000	貸付株式数 1,000株
ネットマーケティング	4,600	448.00	2,060,800	貸付株式数 1,200株
日本郵政	496,300	856.00	424,832,800	
ベルシステム24HLDGS	9,100	1,255.00	11,420,500	貸付株式数 4,300株
鎌倉新書	7,300	775.00	5,657,500	貸付株式数 2,900株 (1,800株)
S M N	2,100	645.00	1,354,500	貸付株式数 500株
一蔵	1,000	391.00	391,000	
グローバルキッズCOMP	1,700	759.00	1,290,300	貸付株式数 400株
エアトリ	4,600	3,155.00	14,513,000	貸付株式数 1,500株
アトラエ	4,900	2,481.00	12,156,900	
ストライク	2,600	5,660.00	14,716,000	
ソラスト	16,200	1,234.00	19,990,800	
セラク	2,000	1,758.00	3,516,000	貸付株式数 800株
インソース	6,700	2,453.00	16,435,100	貸付株式数 2,400株
豊田自動織機	54,400	9,320.00	507,008,000	
豊和工業	3,700	776.00	2,871,200	
O K K	2,900	742.00	2,151,800	

石川製作所	1,700	1,360.00	2,312,000	貸付株式数	600株
東洋機械金属	3,300	497.00	1,640,100	貸付株式数	700株
津田駒工業	800	655.00	524,000		
エンシュウ	900	628.00	565,200		
島精機製作所	9,500	1,908.00	18,126,000	貸付株式数	3,700株
オプトラン	8,300	2,243.00	18,616,900		
NCホールディングス	2,200	1,388.00	3,053,600	貸付株式数	100株
イワキポンプ	4,000	1,004.00	4,016,000		
フリーユ	6,000	1,272.00	7,632,000	貸付株式数	900株
ヤマシンフィルタ	14,800	523.00	7,740,400	貸付株式数	5,700株
日阪製作所	8,100	788.00	6,382,800		
やまびこ	12,600	1,248.00	15,724,800		
平田機工	3,100	5,970.00	18,507,000		
ペガサスミシン製造	6,600	436.00	2,877,600		
マルマエ	2,800	2,993.00	8,380,400	貸付株式数	100株
タツモ	3,100	1,669.00	5,173,900		
ナブテスコ	39,000	3,285.00	128,115,000		
三井海洋開発	7,300	1,398.00	10,205,400		
レオン自動機	6,900	1,309.00	9,032,100	貸付株式数	2,500株
S M C	19,800	72,650.00	1,438,470,000		
ホソカワミクロン	4,600	2,842.00	13,073,200		
ユニオンツール	2,600	3,745.00	9,737,000	貸付株式数	900株
オイレス工業	11,600	1,643.00	19,058,800	貸付株式数	3,500株
日精エーエスビー	2,200	2,844.00	6,256,800	貸付株式数	800株
サト - ホールディングス	8,800	2,126.00	18,708,800		
技研製作所	5,900	4,130.00	24,367,000		
日本エアーテック	3,000	1,210.00	3,630,000	貸付株式数	900株
カワタ	2,000	857.00	1,714,000		
日精樹脂工業	4,500	980.00	4,410,000	貸付株式数	700株
オカダアイヨン	1,800	1,417.00	2,550,600	貸付株式数	700株
ワイエイシイホールディングス	2,600	927.00	2,410,200		
小松製作所	304,800	2,592.00	790,041,600		
住友重機械	38,500	2,521.00	97,058,500		
日立建機	26,900	3,300.00	88,770,000		
日工	8,500	610.00	5,185,000	貸付株式数	2,200株
巴工業	3,400	2,288.00	7,779,200	貸付株式数	1,200株
井関農機	6,300	1,409.00	8,876,700		
T O W A	5,800	3,200.00	18,560,000	貸付株式数	800株
丸山製作所	1,200	1,456.00	1,747,200		

北川鉄工所	3,000	1,393.00	4,179,000	
シンニッタン	14,200	213.00	3,024,600	
ローツェ	3,300	11,950.00	39,435,000	
タカキタ	2,300	634.00	1,458,200	貸付株式数 900株
クボタ	328,200	2,369.00	777,505,800	
荏原実業	3,100	2,510.00	7,781,000	
東洋エンジニア	9,100	710.00	6,461,000	貸付株式数 3,100株
三菱化工機	2,100	2,265.00	4,756,500	
月島機械	12,000	1,068.00	12,816,000	
帝国電機製作所	4,500	1,391.00	6,259,500	
東京機械	3,400	1,222.00	4,154,800	
新東工業	13,600	677.00	9,207,200	貸付株式数 1,700株
渋谷工業	5,900	2,858.00	16,862,200	
アイチ コーポレーション	9,100	779.00	7,088,900	貸付株式数 2,500株
小森コーポレーション	16,800	630.00	10,584,000	貸付株式数 6,700株
鶴見製作所	5,000	1,530.00	7,650,000	
住友精密	900	2,082.00	1,873,800	
日本ギア工業	2,400	274.00	657,600	貸付株式数 900株
酒井重工業	1,100	2,753.00	3,028,300	
荏原製作所	28,000	6,100.00	170,800,000	貸付株式数 11,100株
石井鉄工所	700	2,996.00	2,097,200	
西島製作所	5,500	863.00	4,746,500	貸付株式数 900株
北越工業	6,000	946.00	5,676,000	貸付株式数 1,000株
ダイキン工業	85,800	23,150.00	1,986,270,000	
オルガノ	1,900	6,820.00	12,958,000	貸付株式数 400株
ト - ヨ - カネツ	2,600	2,494.00	6,484,400	
栗田工業	36,700	5,300.00	194,510,000	
椿本チエイン	9,500	2,875.00	27,312,500	貸付株式数 1,200株
大同工業	2,800	852.00	2,385,600	貸付株式数 400株
日 機 装	21,500	848.00	18,232,000	
木村化工機	6,300	986.00	6,211,800	貸付株式数 2,100株
レイズネクスト	9,800	1,121.00	10,985,800	
アネスト岩田	10,100	854.00	8,625,400	貸付株式数 3,600株
ダイフク	37,000	9,090.00	336,330,000	
サムコ	1,700	2,911.00	4,948,700	貸付株式数 700株
加藤製作所	2,600	765.00	1,989,000	貸付株式数 700株
油研工業	700	1,715.00	1,200,500	貸付株式数 200株
タダノ	34,900	1,008.00	35,179,200	
フジテック	24,800	2,382.00	59,073,600	
C K D	20,300	2,223.00	45,126,900	



キトー	5,600	1,754.00	9,822,400	
平和	18,700	1,848.00	34,557,600	
理想科学工業	5,700	2,022.00	11,525,400	
SANKYO	14,500	2,894.00	41,963,000	貸付株式数 6,300株
日本金銭機械	6,600	688.00	4,540,800	貸付株式数 2,600株
マースグループHLDGS	4,200	1,590.00	6,678,000	
フクシマガリレイ	4,700	4,180.00	19,646,000	貸付株式数 300株
オーイズミ	2,300	347.00	798,100	貸付株式数 200株
ダイコク電機	3,100	1,190.00	3,689,000	貸付株式数 1,000株
竹内製作所	10,100	2,718.00	27,451,800	貸付株式数 900株
アマノ	17,600	2,491.00	43,841,600	貸付株式数 6,700株
JUKI	9,200	919.00	8,454,800	
サンデンホールディングス	8,900	251.00	2,233,900	貸付株式数 100株
ジャノメ	5,600	622.00	3,483,200	貸付株式数 2,400株
ブラザー工業	82,100	1,954.00	160,423,400	
マックス	8,800	1,795.00	15,796,000	貸付株式数 100株
モリタホールディングス	10,500	1,273.00	13,366,500	
グローリー	17,400	2,075.00	36,105,000	貸付株式数 6,700株
新晃工業	6,500	1,831.00	11,901,500	
大和冷機工業	10,900	1,206.00	13,145,400	
セガサミーホールディングス	66,700	1,845.00	123,061,500	
日本ピストンリング	2,700	1,219.00	3,291,300	貸付株式数 900株
リケン	2,700	2,437.00	6,579,900	貸付株式数 700株
TPR	8,800	1,368.00	12,038,400	貸付株式数 3,300株
ツバキ・ナカシマ	15,000	1,370.00	20,550,000	
ホシザキ	19,700	8,620.00	169,814,000	
大豊工業	6,000	728.00	4,368,000	
日本精工	127,500	771.00	98,302,500	
NTN	154,300	210.00	32,403,000	
ジェイテクト	66,400	992.00	65,868,800	
不二越	6,000	3,860.00	23,160,000	
ミネベアミツミ	116,000	3,000.00	348,000,000	
日本トムソン	21,600	691.00	14,925,600	
THK	40,000	2,711.00	108,440,000	
ユーシン精機	4,600	728.00	3,348,800	
前澤給装工業	5,100	1,001.00	5,105,100	
イーグル工業	8,500	1,025.00	8,712,500	
前澤工業	4,900	580.00	2,842,000	
日本ピラ - 工業	7,400	3,200.00	23,680,000	貸付株式数 2,600株

キッツ	26,500	701.00	18,576,500	貸付株式数	4,100株
日立	323,800	6,688.00	2,165,574,400		
東芝	117,600	4,527.00	532,375,200		
三菱電機	673,700	1,424.50	959,685,650		
富士電機	40,700	5,940.00	241,758,000		
東洋電機製造	3,200	1,050.00	3,360,000		
安川電機	72,400	5,090.00	368,516,000		
シンフォニアテクノロジー	8,300	1,261.00	10,466,300	貸付株式数	3,000株
明電舎	11,600	2,588.00	30,020,800		
オリジン	1,300	1,262.00	1,640,600	貸付株式数	200株
山洋電気	3,000	5,670.00	17,010,000	貸付株式数	400株
デンヨー	6,100	1,657.00	10,107,700		
ベイカレントコンサルティング	4,500	47,300.00	212,850,000		
ORCHESTRA HOLDINGS	1,200	3,970.00	4,764,000	貸付株式数	400株
アイモバイル	2,600	1,281.00	3,330,600	貸付株式数	700株
キャリアインデックス	2,300	1,073.00	2,467,900	貸付株式数	400株
MS - Japan	3,000	935.00	2,805,000	貸付株式数	900株
船場	1,200	790.00	948,000		
グレイステクノロジー	8,400	422.00	3,544,800	貸付株式数	3,300株
ジャパンエレベーターSHD	20,400	2,125.00	43,350,000		
フルテック	1,600	1,410.00	2,256,000	貸付株式数	300株
グリーンズ	2,800	488.00	1,366,400	貸付株式数	900株
ツナググループHLDGS	2,100	289.00	606,900	貸付株式数	600株
GAMEWITH	1,700	504.00	856,800	貸付株式数	100株
ソウルドアウト	1,500	997.00	1,495,500	貸付株式数	600株
MS&CONSULTING	800	671.00	536,800	貸付株式数	100株
ミダックホールディングス	2,800	4,965.00	13,902,000	貸付株式数	1,100株
日総工産	5,300	808.00	4,282,400	貸付株式数	1,900株
キュービーネットHLDGS	3,100	1,653.00	5,124,300		
RPAホールディングス	9,000	372.00	3,348,000	貸付株式数	3,600株
三桜工業	9,500	937.00	8,901,500	貸付株式数	3,600株
マキタ	81,900	4,984.00	408,189,600	貸付株式数	3,000株
東芝テック	7,300	4,355.00	31,791,500		
芝浦メカトロニクス	1,200	8,250.00	9,900,000		

マブチモーター	15,700	3,730.00	58,561,000	貸付株式数	6,200株
日本電産	174,500	13,000.00	2,268,500,000		
ユーエムシーエレクトロニクス	2,900	481.00	1,394,900	貸付株式数	600株
トレックス・セミコンダクター	3,400	3,785.00	12,869,000	貸付株式数	300株
東光高岳	4,000	1,304.00	5,216,000	貸付株式数	1,300株
ダブル・スコープ	19,300	829.00	15,999,700	貸付株式数	6,200株
宮越ホールディングス	2,700	1,203.00	3,248,100	貸付株式数	1,000株
ダイヘン	7,500	4,300.00	32,250,000		
ヤーマン	11,500	1,008.00	11,592,000	貸付株式数	4,300株
JVCケンウッド	54,900	165.00	9,058,500	貸付株式数	5,100株
ミマキエンジニアリング	6,200	882.00	5,468,400		
I - P E X	3,200	1,940.00	6,208,000	貸付株式数	500株
日新電機	16,000	1,417.00	22,672,000		
大崎電気	13,200	441.00	5,821,200	貸付株式数	1,900株
オムロン	56,300	10,965.00	617,329,500		
日東工業	9,500	1,487.00	14,126,500	貸付株式数	1,400株
I D E C	8,200	2,688.00	22,041,600	貸付株式数	1,000株
正興電機製作所	2,300	1,181.00	2,716,300	貸付株式数	800株
不二電機工業	1,000	1,257.00	1,257,000	貸付株式数	400株
ジーエス・ユアサ コーポ	22,400	2,306.00	51,654,400		
サクサホールディングス	1,500	1,348.00	2,022,000		
メルコホールディングス	1,900	3,900.00	7,410,000	貸付株式数	700株
テクノメディカ	1,400	1,600.00	2,240,000	貸付株式数	500株
ダイヤモンドエレクトリックHD	1,900	1,291.00	2,452,900	貸付株式数	700株
日本電気	85,500	5,120.00	437,760,000		
富士通	60,600	18,795.00	1,138,977,000		
沖電気	27,400	838.00	22,961,200		
岩崎通信機	2,500	854.00	2,135,000		
電気興業	3,500	2,518.00	8,813,000		
サンケン電気	7,500	5,780.00	43,350,000		
ナカヨ	1,100	1,299.00	1,428,900		
アイホン	3,800	2,087.00	7,930,600		
ルネサスエレクトロニクス	364,400	1,442.00	525,464,800		
セイコーエプソン	83,500	1,830.00	152,805,000		
ワコム	52,200	874.00	45,622,800	貸付株式数	20,800株
アルバック	12,500	6,500.00	81,250,000		
アクセル	2,800	813.00	2,276,400	貸付株式数	1,100株

E I Z O	5,200	3,940.00	20,488,000	貸付株式数	700株
ジャパンディスプレイ	61,700	37.00	2,282,900		
日本信号	18,000	861.00	15,498,000		
京三製作所	15,200	431.00	6,551,200		
能美防災	9,300	1,999.00	18,590,700		
ホーチキ	5,400	1,246.00	6,728,400		
星和電機	4,400	498.00	2,191,200		
エレコム	15,600	1,325.00	20,670,000		
パナソニック	718,200	1,242.50	892,363,500		
シャープ	76,800	1,270.00	97,536,000	貸付株式数	28,400株
アンリツ	43,300	1,765.00	76,424,500	貸付株式数	16,100株
富士通ゼネラル	18,300	2,580.00	47,214,000	貸付株式数	3,500株
ソニーグループ	421,700	13,825.00	5,830,002,500		
T D K	97,500	4,500.00	438,750,000		
帝国通信工業	2,700	1,225.00	3,307,500	貸付株式数	1,000株
タムラ製作所	25,800	689.00	17,776,200	貸付株式数	9,800株
アルプスアルパイン	59,400	1,023.00	60,766,200		
池上通信機	2,000	703.00	1,406,000	貸付株式数	800株
日本電波工業	6,000	1,684.00	10,104,000	貸付株式数	100株
鈴木	2,900	914.00	2,650,600	貸付株式数	1,100株
日本トリム	1,300	3,360.00	4,368,000		
ローランド ディー . ジー .	4,000	2,584.00	10,336,000	貸付株式数	1,500株
フオスタ - 電機	6,600	703.00	4,639,800		
S M K	1,500	2,281.00	3,421,500	貸付株式数	600株
ヨコオ	4,900	2,684.00	13,151,600		
ティアック	11,200	123.00	1,377,600		
ホシデン	15,800	1,174.00	18,549,200	貸付株式数	2,000株
ヒロセ電機	10,400	19,050.00	198,120,000		
日本航空電子	15,800	1,815.00	28,677,000		
T O A	7,400	725.00	5,365,000	貸付株式数	1,000株
マクセル	13,400	1,309.00	17,540,600		
古野電気	8,000	1,146.00	9,168,000	貸付株式数	400株
ユニデンホールディングス	1,400	3,350.00	4,690,000		
スミダコーポレーション	6,200	1,122.00	6,956,400		
アイコム	2,400	2,310.00	5,544,000	貸付株式数	400株
リオン	2,600	2,135.00	5,551,000	貸付株式数	400株
本多通信工業	4,700	426.00	2,002,200	貸付株式数	1,700株
横河電機	67,200	2,135.00	143,472,000		
新電元工業	2,700	3,380.00	9,126,000		

アズビル	39,600	5,020.00	198,792,000	
東亜ディーケーケー	2,800	840.00	2,352,000	貸付株式数 1,100株
日本光電工業	27,800	3,345.00	92,991,000	
チノー	1,900	1,431.00	2,718,900	貸付株式数 700株
共和電業	6,600	388.00	2,560,800	
日本電子材料	3,300	2,194.00	7,240,200	貸付株式数 1,200株
堀場製作所	12,400	6,750.00	83,700,000	
アドバンテスト	50,000	9,990.00	499,500,000	
小野測器	2,300	488.00	1,122,400	
エスペック	5,300	2,103.00	11,145,900	貸付株式数 800株
キーエンス	61,000	70,330.00	4,290,130,000	
日置電機	3,300	8,860.00	29,238,000	貸付株式数 100株
シスメックス	56,900	14,160.00	805,704,000	
日本マイクロニクス	11,700	1,794.00	20,989,800	貸付株式数 3,400株
メガチップス	6,300	4,755.00	29,956,500	貸付株式数 1,700株
OBARA GROUP	2,900	3,320.00	9,628,000	貸付株式数 1,400株
IMAGICA GROUP	5,600	787.00	4,407,200	
澤藤電機	800	1,692.00	1,353,600	貸付株式数 300株
デンソー	148,200	8,331.00	1,234,654,200	
原田工業	2,900	972.00	2,818,800	
コーセル	8,200	898.00	7,363,600	
イリソ電子工業	5,700	4,575.00	26,077,500	貸付株式数 2,200株
オプテックスグループ	11,300	1,485.00	16,780,500	
千代田インテグレ	2,700	2,169.00	5,856,300	
アイ・オー・データ	2,400	775.00	1,860,000	貸付株式数 900株
レーザーテック	29,600	29,745.00	880,452,000	
スタンレー電気	46,900	2,952.00	138,448,800	
岩崎電気	2,600	2,246.00	5,839,600	
ウシオ電機	35,000	2,107.00	73,745,000	
岡谷電機	4,600	321.00	1,476,600	貸付株式数 200株
ヘリオステクノH	6,200	272.00	1,686,400	
エノモト	1,800	1,695.00	3,051,000	
日本セラミック	6,700	2,862.00	19,175,400	貸付株式数 2,400株
遠藤照明	3,300	1,023.00	3,375,900	貸付株式数 500株
古河電池	4,900	1,463.00	7,168,700	貸付株式数 1,900株
双信電機	3,300	635.00	2,095,500	
山一電機	4,700	2,305.00	10,833,500	
函研	4,600	3,735.00	17,181,000	貸付株式数 1,700株
日本電子	14,000	9,470.00	132,580,000	

カ シ オ	48,800	1,474.00	71,931,200	
ファナック	59,100	22,245.00	1,314,679,500	
日本シイエムケイ	12,800	504.00	6,451,200	貸付株式数 5,500株
エンプラス	1,700	2,521.00	4,285,700	貸付株式数 600株
大真空	10,000	1,570.00	15,700,000	
ロ - ム	30,100	10,630.00	319,963,000	
浜松ホトニクス	48,300	6,980.00	337,134,000	
三井ハイテック	6,700	9,160.00	61,372,000	
新光電気工業	19,700	5,350.00	105,395,000	貸付株式数 100株
京 セ ラ	94,700	6,731.00	637,425,700	
協栄産業	500	1,491.00	745,500	
太陽誘電	32,600	6,260.00	204,076,000	
村田製作所	197,700	8,380.00	1,656,726,000	
双葉電子工業	10,800	689.00	7,441,200	
日東電工	40,800	7,900.00	322,320,000	
北陸電気工業	2,200	1,266.00	2,785,200	
東海理化電機	17,500	1,484.00	25,970,000	
ニチコン	21,800	1,162.00	25,331,600	
日本ケミコン	6,300	1,801.00	11,346,300	貸付株式数 700株
K O A	9,900	1,530.00	15,147,000	
三井E & S H D	21,700	379.00	8,224,300	
日立造船	56,700	841.00	47,684,700	
三菱重工業	105,800	2,561.00	270,953,800	
川崎重工業	49,000	1,908.00	93,492,000	
I H I	41,900	2,141.00	89,707,900	
名村造船所	21,900	201.00	4,401,900	貸付株式数 8,100株
サノヤスホールディングス	9,800	121.00	1,185,800	貸付株式数 1,300株
スプリックス	1,900	1,494.00	2,838,600	
マネジメントソリューションズ	3,400	3,260.00	11,084,000	貸付株式数 1,200株
プロレド・パートナーズ	1,700	1,152.00	1,958,400	貸付株式数 500株
AND FACTORY	1,200	419.00	502,800	貸付株式数 600株
ギークス	1,200	2,011.00	2,413,200	
カーブスホールディングス	18,200	774.00	14,086,800	貸付株式数 6,100株
フォーラムエンジニアリング	4,300	829.00	3,564,700	
日本車輛	2,200	2,008.00	4,417,600	
三菱ロジスネクスト	9,100	1,027.00	9,345,700	貸付株式数 1,900株
近畿車輛	600	996.00	597,600	貸付株式数 200株
一家ホールディングス	1,500	541.00	811,500	

フルサト・マルカHD	6,300	1,999.00	12,593,700	貸付株式数	2,500株
ヤマエグループHD	4,500	1,003.00	4,513,500	貸付株式数	600株
F P G	22,700	551.00	12,507,700	貸付株式数	2,900株
島根銀行	2,200	538.00	1,183,600	貸付株式数	300株
じもとホールディングス	5,000	585.00	2,925,000		
全国保証	15,900	4,960.00	78,864,000	貸付株式数	6,400株
めぶきフィナンシャルG	344,200	224.00	77,100,800		
東京きらぼしFG	8,800	1,393.00	12,258,400		
九州フィナンシャルG	135,700	380.00	51,566,000		
かんぼ生命保険	66,800	1,758.00	117,434,400	貸付株式数	23,900株
ゆうちょ銀行	156,700	928.00	145,417,600	貸付株式数	37,600株
富山第一銀行	16,100	266.00	4,282,600		
コンコルディア・フィナンシャル	379,000	413.00	156,527,000		
ジェイリース	2,500	2,055.00	5,137,500	貸付株式数	500株
西日本フィナンシャルHD	43,300	682.00	29,530,600		
イントラスト	3,100	725.00	2,247,500	貸付株式数	900株
日本モーゲージサービス	3,900	1,038.00	4,048,200		
C a s a	2,600	878.00	2,282,800	貸付株式数	900株
アルヒ	10,100	1,001.00	10,110,100	貸付株式数	3,800株
プレミアグループ	3,400	3,500.00	11,900,000		
日産自動車	793,500	562.90	446,661,150		
いすゞ自動車	211,000	1,532.00	323,252,000		
トヨタ自動車	3,409,900	2,001.00	6,823,209,900		
日野自動車	84,600	944.00	79,862,400		
三菱自動車工業	250,800	366.00	91,792,800	貸付株式数	19,800株
エフテック	5,300	496.00	2,628,800		
レシップホールディングス	2,900	550.00	1,595,000		
G M B	1,600	703.00	1,124,800	貸付株式数	400株
ファルテック	1,000	665.00	665,000		
武蔵精密工業	15,400	1,772.00	27,288,800		
日産車体	9,500	676.00	6,422,000	貸付株式数	3,700株
新明和工業	19,500	845.00	16,477,500		
極東開発工業	12,100	1,402.00	16,964,200		
トピー工業	5,400	1,051.00	5,675,400		
ティラド	2,000	2,855.00	5,710,000	貸付株式数	300株
タチエス	11,600	1,144.00	13,270,400	貸付株式数	3,900株
N O K	32,400	1,214.00	39,333,600		
フタバ産業	16,300	385.00	6,275,500		
K Y B	6,900	2,904.00	20,037,600	貸付株式数	800株

市光工業	9,800	496.00	4,860,800	
大同メタル工業	12,200	568.00	6,929,600	貸付株式数 5,200株
プレス工業	33,300	373.00	12,420,900	
ミクニ	9,000	287.00	2,583,000	
太平洋工業	14,100	1,051.00	14,819,100	
河西工業	7,200	266.00	1,915,200	貸付株式数 1,200株
アイシン	49,200	4,170.00	205,164,000	
マ ッ ダ	211,900	918.00	194,524,200	
今仙電機製作所	4,100	551.00	2,259,100	貸付株式数 2,000株
本田技研	529,900	3,101.00	1,643,219,900	
スズキ	153,900	4,585.00	705,631,500	
S U B A R U	192,600	2,142.50	412,645,500	
安永	3,200	963.00	3,081,600	貸付株式数 1,200株
ヤマハ発動機	87,800	2,859.00	251,020,200	
小糸製作所	36,900	6,530.00	240,957,000	貸付株式数 2,200株
T B K	6,500	393.00	2,554,500	貸付株式数 900株
エクセディ	9,900	1,610.00	15,939,000	
ミツバ	12,700	459.00	5,829,300	
豊田合成	22,000	2,269.00	49,918,000	
愛三工業	10,600	761.00	8,066,600	
盟和産業	400	979.00	391,600	貸付株式数 300株
日本プラスト	4,700	495.00	2,326,500	貸付株式数 600株
ヨ ロ ズ	6,000	1,054.00	6,324,000	貸付株式数 2,200株
エフ・シー・シー	10,600	1,436.00	15,221,600	
新家工業	1,600	1,705.00	2,728,000	
シマノ	27,100	31,400.00	850,940,000	
テイ・エス テック	28,000	1,333.00	37,324,000	貸付株式数 1,900株
3 3 F G	6,000	1,355.00	8,130,000	
第四北越フィナンシャルG	10,800	2,300.00	24,840,000	貸付株式数 600株
ひろぎんH L D G S	98,700	622.00	61,391,400	貸付株式数 600株
マーキュリアホールディングス	2,200	727.00	1,599,400	
おきなわF G	5,800	2,066.00	11,982,800	
L I T A L I C O	5,600	4,190.00	23,464,000	
十六F G	8,900	1,976.00	17,586,400	
北國F H D	6,200	2,114.00	13,106,800	
ジャムコ	3,800	827.00	3,142,600	貸付株式数 1,500株
小 野 建	6,100	1,572.00	9,589,200	
はるやまH L D G S	3,100	558.00	1,729,800	
南 陽	1,200	1,895.00	2,274,000	



ノジマ	10,800	2,225.00	24,030,000	貸付株式数	700株
佐島電機	4,000	931.00	3,724,000		
カップ・クリエイト	9,300	1,327.00	12,341,100	貸付株式数	3,700株
エコートレーディング	1,300	591.00	768,300	貸付株式数	400株
伯東	4,400	2,225.00	9,790,000		
コンドレーテック	5,300	960.00	5,088,000		
中山福	3,300	358.00	1,181,400	貸付株式数	300株
ライトオン	5,000	695.00	3,475,000	貸付株式数	1,800株
ナガイレーベン	8,900	2,342.00	20,843,800	貸付株式数	2,300株
三菱食品	6,400	2,690.00	17,216,000	貸付株式数	1,400株
良品計画	76,300	1,835.00	140,010,500		
三城ホールディングス	7,900	235.00	1,856,500	貸付株式数	2,800株
松田産業	5,200	2,701.00	14,045,200		
第一興商	12,900	3,580.00	46,182,000	貸付株式数	1,300株
メディパルHD	71,600	2,040.00	146,064,000		
アドヴァングループ	6,800	883.00	6,004,400	貸付株式数	400株
SPK	2,500	1,300.00	3,250,000	貸付株式数	300株
萩原電気HL DGS	2,400	1,992.00	4,780,800		
アルビス	2,100	2,114.00	4,439,400	貸付株式数	700株
アズワン	4,800	14,050.00	67,440,000		
スズデン	2,200	1,623.00	3,570,600		
尾家産業	1,800	1,046.00	1,882,800	貸付株式数	400株
シモジマ	4,200	1,079.00	4,531,800		
ドウシシャ	7,100	1,468.00	10,422,800	貸付株式数	500株
小津産業	1,200	1,901.00	2,281,200		
コナカ	7,800	311.00	2,425,800		
高速	3,900	1,473.00	5,744,700		
ハウスローゼ	800	1,661.00	1,328,800		
G-7ホールディングス	7,800	1,654.00	12,901,200		
たけびし	3,000	1,387.00	4,161,000		
イオン北海道	11,600	1,334.00	15,474,400	貸付株式数	4,600株
コジマ	12,300	556.00	6,838,800	貸付株式数	4,400株
ヒマラヤ	2,200	914.00	2,010,800		
コーナン商事	9,600	3,320.00	31,872,000		
ネットワンシステムズ	25,200	3,410.00	85,932,000	貸付株式数	2,700株
エコス	2,500	1,748.00	4,370,000	貸付株式数	900株
ワタミ	8,200	850.00	6,970,000	貸付株式数	3,400株
マルシェ	1,500	402.00	603,000	貸付株式数	600株
リックス	3,400	1,443.00	4,906,200		
システムソフト	18,400	118.00	2,171,200	貸付株式数	2,700株

パンパシフィックHD	132,600	1,936.00	256,713,600	
丸文	5,600	856.00	4,793,600	
西松屋チェーン	14,900	1,497.00	22,305,300	貸付株式数 5,800株
ゼンショーホールディングス	32,400	2,581.00	83,624,400	貸付株式数 300株
ハピネット	6,000	1,429.00	8,574,000	貸付株式数 100株
幸楽苑ホールディングス	4,200	1,413.00	5,934,600	貸付株式数 1,600株
ハークスレイ	3,200	448.00	1,433,600	
橋本総業HLDGS	1,400	1,910.00	2,674,000	貸付株式数 500株
日本ライフライン	19,500	1,058.00	20,631,000	貸付株式数 1,100株
サイゼリヤ	10,200	2,926.00	29,845,200	貸付株式数 3,700株
タカショー	5,100	715.00	3,646,500	貸付株式数 2,000株
VTホールディングス	25,200	421.00	10,609,200	貸付株式数 9,500株
アルゴグラフィックス	5,300	2,841.00	15,057,300	
魚力	1,900	1,952.00	3,708,800	貸付株式数 700株
IDOM	20,100	689.00	13,848,900	貸付株式数 3,300株
日本エム・ディ・エム	3,900	1,936.00	7,550,400	
ポプラ	1,800	174.00	313,200	貸付株式数 600株
フジ・コーポレーション	3,600	1,164.00	4,190,400	
ユナイテッドアローズ	7,000	1,903.00	13,321,000	貸付株式数 2,100株
進和	3,700	1,940.00	7,178,000	貸付株式数 1,500株
エスケイジャパン	2,600	437.00	1,136,200	
ダイトロン	2,700	2,014.00	5,437,800	
ハイデイ日高	9,600	1,571.00	15,081,600	貸付株式数 3,800株
シークス	9,400	1,331.00	12,511,400	貸付株式数 3,700株
YU-WA CREATION H	3,600	210.00	756,000	貸付株式数 400株
コロワイド	27,300	1,522.00	41,550,600	貸付株式数 10,900株 (2,200株)
ピーシーデポコーポ	7,900	321.00	2,535,900	貸付株式数 3,500株
田中商事	2,100	621.00	1,304,100	貸付株式数 500株
オーハシテクニカ	3,500	1,469.00	5,141,500	貸付株式数 400株
壱番屋	4,700	4,435.00	20,844,500	貸付株式数 1,800株
白銅	2,000	2,355.00	4,710,000	貸付株式数 500株
トップカルチャー	2,500	300.00	750,000	
PLANT	1,600	697.00	1,115,200	貸付株式数 500株
スギホールディングス	13,300	7,140.00	94,962,000	貸付株式数 5,200株
ダイコー通産	800	1,174.00	939,200	貸付株式数 300株
薬王堂ホールディングス	3,300	2,138.00	7,055,400	
島津製作所	86,600	4,810.00	416,546,000	

J M S	5,900	590.00	3,481,000	貸付株式数	2,100株
クボテック	1,000	285.00	285,000	貸付株式数	600株
長野計器	5,100	1,691.00	8,624,100		
ブイ・テクノロジー	2,900	3,445.00	9,990,500	貸付株式数	1,000株
スター精密	10,400	1,446.00	15,038,400		
東京計器	4,100	969.00	3,972,900	貸付株式数	1,600株
愛知時計	1,000	4,505.00	4,505,000		
インターアクション	3,400	2,325.00	7,905,000	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
オーバル	6,600	253.00	1,669,800		
東京精密	11,400	4,800.00	54,720,000		
マニー	26,800	1,660.00	44,488,000	貸付株式数	10,600株
ニコン	102,700	1,177.00	120,877,900		
トプコン	31,500	1,791.00	56,416,500	貸付株式数	3,300株
オリンパス	353,000	2,539.00	896,267,000		
理研計器	5,400	5,370.00	28,998,000	貸付株式数	700株
S C R E E Nホールディングス	11,700	11,500.00	134,550,000		
キヤノン電子	6,200	1,486.00	9,213,200		
タムロン	5,600	2,523.00	14,128,800	貸付株式数	2,000株
H O Y A	131,400	18,020.00	2,367,828,000		
シード	2,900	561.00	1,626,900	貸付株式数	1,100株
ノーリツ鋼機	6,200	2,743.00	17,006,600		
エー・アンド・デイ	6,100	1,118.00	6,819,800		
朝日インテック	73,800	2,488.00	183,614,400		
キヤノン	334,500	2,500.00	836,250,000		
リコー	186,900	1,003.00	187,460,700		
シチズン時計	78,400	519.00	40,689,600		
リズム	2,000	1,190.00	2,380,000	貸付株式数	600株
大研医器	5,000	545.00	2,725,000		
メニコン	22,300	3,755.00	83,736,500	貸付株式数	8,900株
シンシア	800	554.00	443,200	貸付株式数	200株
中本パックス	1,800	1,595.00	2,871,000	貸付株式数	700株
スノーピーク	9,000	3,875.00	34,875,000	貸付株式数	1,700株
パラマウントベッドHD	12,800	1,931.00	24,716,800		
トランザクション	4,500	967.00	4,351,500	貸付株式数	1,400株
粧美堂	1,900	384.00	729,600	貸付株式数	300株
ニホンフラッシュ	5,800	1,065.00	6,177,000	貸付株式数	200株
前田工織	7,600	3,510.00	26,676,000	貸付株式数	2,000株
永大産業	8,800	272.00	2,393,600		

アートネイチャー	6,000	646.00	3,876,000	貸付株式数	1,100株
バンダイナムコHLDGS	60,300	8,837.00	532,871,100		
アイフィスジャパン	1,800	646.00	1,162,800	貸付株式数	700株
共立印刷	9,700	141.00	1,367,700	貸付株式数	400株
SHOEI	6,500	4,800.00	31,200,000		
フランスベッドHLDGS	9,800	853.00	8,359,400	貸付株式数	3,400株
マーベラス	10,400	716.00	7,446,400		
パイロットコーポレーション	11,300	4,145.00	46,838,500	貸付株式数	4,500株
萩原工業	4,300	1,326.00	5,701,800	貸付株式数	1,500株
エイベックス	11,700	1,695.00	19,831,500		
トッパン・フォームズ	9,300	1,546.00	14,377,800	貸付株式数	3,700株
フジシールインターナショナル	16,300	2,058.00	33,545,400	貸付株式数	4,700株
タカラトミー	28,000	999.00	27,972,000	貸付株式数	3,000株
広済堂ホールディングス	4,200	819.00	3,439,800	貸付株式数	1,300株
エステールホールディングス	1,300	636.00	826,800	貸付株式数	700株
レック	8,800	819.00	7,207,200		
タカノ	2,100	640.00	1,344,000	貸付株式数	800株
三光合成	8,500	374.00	3,179,000	貸付株式数	300株
プロネクサス	5,300	1,015.00	5,379,500		
ホクシン	6,900	156.00	1,076,400		
ウッドワン	2,000	952.00	1,904,000	貸付株式数	200株
大建工業	4,000	2,158.00	8,632,000	貸付株式数	800株
きもと	12,700	210.00	2,667,000		
凸版印刷	102,100	1,723.00	175,918,300		
大日本印刷	79,400	2,663.00	211,442,200		
共同印刷	1,900	2,761.00	5,245,900		
NISSHA	13,800	1,578.00	21,776,400		
光村印刷	600	1,475.00	885,000	貸付株式数	200株
藤森工業	6,000	3,580.00	21,480,000		
ヴィア・ホールディングス	8,500	153.00	1,300,500		
TAKARA & COMPANY	3,300	1,731.00	5,712,300	貸付株式数	1,200株
前澤化成工業	4,500	1,251.00	5,629,500	貸付株式数	1,600株
未来工業	2,500	1,616.00	4,040,000		
アシックス	59,700	2,818.00	168,234,600		
ツツミ	1,700	2,070.00	3,519,000	貸付株式数	600株
ウェーブロックHLDGS	2,300	706.00	1,623,800	貸付株式数	900株

ジェイ エス ピー	3,700	1,515.00	5,605,500	貸付株式数	1,400株
ニ チ ハ	9,400	2,791.00	26,235,400		
エフピコ	12,500	3,745.00	46,812,500		
小松ウオール工業	2,000	1,846.00	3,692,000		
ヤマハ	40,000	5,820.00	232,800,000		
河合楽器	1,900	3,210.00	6,099,000		
クリナップ	6,300	512.00	3,225,600		
ビジョン	40,800	2,301.00	93,880,800	貸付株式数	16,200株
天馬	6,300	2,402.00	15,132,600		
兼松サステック	500	1,788.00	894,000		
キングジム	5,700	853.00	4,862,100		
象印マホービン	18,300	1,591.00	29,115,300		
リンテック	16,500	2,500.00	41,250,000		
信越ポリマー	11,700	951.00	11,126,700		
東 リ	16,500	219.00	3,613,500		
イトーキ	12,900	342.00	4,411,800		
任 天 堂	38,000	50,100.00	1,903,800,000		
三菱鉛筆	11,000	1,213.00	13,343,000	貸付株式数	500株
松 風	2,700	2,027.00	5,472,900	貸付株式数	1,200株
タカラスタンダ - ド	14,000	1,366.00	19,124,000	貸付株式数	200株
コ ク ヨ	32,500	1,656.00	53,820,000		
ナカバヤシ	5,800	499.00	2,894,200	貸付株式数	600株
ニ フ コ	23,100	3,120.00	72,072,000		
立川ブラインド	3,200	1,090.00	3,488,000	貸付株式数	1,100株
グローブライド	6,000	3,460.00	20,760,000	貸付株式数	700株
オカムラ	23,600	1,275.00	30,090,000		
バルカー	7,200	2,442.00	17,582,400		
MUTOHホールディング ス	900	1,648.00	1,483,200		
伊 藤 忠	465,300	3,260.00	1,516,878,000		
丸 紅	654,000	1,017.50	665,445,000		
スクロール	10,200	767.00	7,823,400		
高 島	1,000	2,147.00	2,147,000	貸付株式数	100株
ヨンドシーホールディング ス	6,200	1,595.00	9,889,000	貸付株式数	2,400株
三陽商会	3,200	823.00	2,633,600	貸付株式数	900株
長瀬産業	36,000	1,683.00	60,588,000		
ナイガイ	2,700	310.00	837,000	貸付株式数	700株
蝶 理	3,600	1,712.00	6,163,200	貸付株式数	800株
豊田通商	66,900	4,955.00	331,489,500		

オンワードホールディングス	41,800	288.00	12,038,400	貸付株式数	15,700株
三共生興	8,500	547.00	4,649,500	貸付株式数	1,900株
兼松	25,900	1,231.00	31,882,900	貸付株式数	900株
美津濃	6,800	2,131.00	14,490,800		
ツカモトコーポレーション	1,100	1,360.00	1,496,000		
ルックホールディングス	2,100	1,290.00	2,709,000	貸付株式数	800株
三井物産	516,000	2,557.00	1,319,412,000		
日本紙パルプ	3,300	3,575.00	11,797,500		
東京エレクトロン	42,700	59,840.00	2,555,168,000		
カメイ	7,800	992.00	7,737,600	貸付株式数	1,100株
東都水産	400	4,500.00	1,800,000		
OUGホールディングス	1,000	2,525.00	2,525,000	貸付株式数	400株
スターゼン	5,000	1,844.00	9,220,000		
セイコーHD	9,700	2,198.00	21,320,600		
山善	29,200	972.00	28,382,400	貸付株式数	1,900株
椿本興業	1,500	3,880.00	5,820,000		
住友商事	420,700	1,546.00	650,402,200		
日本ユニシス	20,600	3,280.00	67,568,000	貸付株式数	1,600株
内田洋行	2,800	4,635.00	12,978,000		
三菱商事	497,900	3,391.00	1,688,378,900		
第一実業	3,300	4,890.00	16,137,000		
キヤノンマーケティングJPN	16,400	2,200.00	36,080,000		
西華産業	3,300	1,507.00	4,973,100		
佐藤商事	5,100	1,063.00	5,421,300		
菱洋エレクトロ	3,900	2,249.00	8,771,100	貸付株式数	1,500株
東京産業	6,600	739.00	4,877,400	貸付株式数	2,000株
ユアサ商事	6,600	2,797.00	18,460,200	貸付株式数	700株
神鋼商事	1,700	3,145.00	5,346,500		
トルク	9,200	207.00	1,904,400	貸付株式数	3,000株
阪和興業	13,500	3,070.00	41,445,000		
正栄食品	4,300	3,775.00	16,232,500	貸付株式数	1,700株
カナデン	6,900	986.00	6,803,400		
菱電商事	6,300	1,677.00	10,565,100	貸付株式数	1,600株
ニプロ	49,900	1,075.00	53,642,500	貸付株式数	12,200株
岩谷産業	16,100	5,730.00	92,253,000		
ナイス	2,500	1,612.00	4,030,000		
ニチモウ	1,000	2,029.00	2,029,000	貸付株式数	100株
極東貿易	2,100	2,332.00	4,897,200	貸付株式数	700株

アステナホールディングス	10,800	486.00	5,248,800		
兼松エレクトロニクス	3,600	3,600.00	12,960,000		
三愛石油	16,300	1,184.00	19,299,200		
稲畑産業	15,600	1,529.00	23,852,400	貸付株式数	2,000株
G S I クレオス	3,200	1,021.00	3,267,200	貸付株式数	1,200株
明和産業	6,400	819.00	5,241,600	貸付株式数	2,400株
クワザワホールディングス	2,700	572.00	1,544,400	貸付株式数	900株
ゴ - ルドウイン	11,900	6,450.00	76,755,000		
ユニ・チャ - ム	129,800	4,888.00	634,462,400		
デサント	12,900	4,610.00	59,469,000		
キ ン グ	3,200	550.00	1,760,000	貸付株式数	100株
ワ キ タ	13,800	1,026.00	14,158,800		
ヤマトインタ - ナショナル	5,800	302.00	1,751,600	貸付株式数	2,200株
東邦ホールディングス	21,400	1,692.00	36,208,800	貸付株式数	8,300株
サンゲツ	17,600	1,519.00	26,734,400	貸付株式数	100株
ミツウロコグループ	9,900	1,165.00	11,533,500		
シナネンホールディングス	2,500	3,420.00	8,550,000	貸付株式数	400株
伊藤忠エネクス	14,900	951.00	14,169,900		
サンリオ	20,500	2,479.00	50,819,500	貸付株式数	500株
サンワ テクノス	3,900	1,675.00	6,532,500	貸付株式数	500株
リョーサン	7,200	2,108.00	15,177,600		
新光商事	9,500	873.00	8,293,500	貸付株式数	3,600株
トーホー	3,100	1,375.00	4,262,500	貸付株式数	1,200株
三信電気	2,900	1,395.00	4,045,500		
東陽テクニカ	6,900	1,077.00	7,431,300		
モスフード サービス	8,700	3,055.00	26,578,500	貸付株式数	1,000株
加賀電子	6,200	2,932.00	18,178,400		
三益半導体	5,200	2,341.00	12,173,200		
ソーダニツカ	6,400	676.00	4,326,400		
立花エレテック	5,100	1,519.00	7,746,900	貸付株式数	1,800株
木曽路	8,700	2,088.00	18,165,600	貸付株式数	3,400株
S R S ホールディングス	9,100	742.00	6,752,200	貸付株式数	3,600株
千 趣 会	11,900	388.00	4,617,200	貸付株式数	4,700株
タカキュー	7,300	122.00	890,600	貸付株式数	2,200株
リテールパートナーズ	8,000	1,212.00	9,696,000	貸付株式数	3,200株
ケーヨー	12,300	803.00	9,876,900		
上新電機	7,600	2,048.00	15,564,800		
日本瓦斯	32,600	1,417.00	46,194,200		
ロイヤルホールディングス	11,600	1,819.00	21,100,400	貸付株式数	4,500株
東 天 紅	500	1,001.00	500,500		

いなげや	8,100	1,301.00	10,538,100	貸付株式数	2,900株
チヨダ	6,400	702.00	4,492,800	貸付株式数	2,500株
ライフコーポレーション	6,200	3,355.00	20,801,000		
リンガーハット	8,200	2,136.00	17,515,200	貸付株式数	3,200株
MrMaxHD	8,300	529.00	4,390,700	貸付株式数	3,500株
テナアライド	6,600	308.00	2,032,800	貸付株式数	2,600株
AOKIホールディングス	13,300	614.00	8,166,200	貸付株式数	2,400株
オークワ	10,200	955.00	9,741,000	貸付株式数	4,000株
コメリ	10,200	2,444.00	24,928,800		
青山商事	13,700	719.00	9,850,300	貸付株式数	2,900株
しまむら	7,700	9,700.00	74,690,000		
はせがわ	3,400	230.00	782,000	貸付株式数	600株
高島屋	49,200	995.00	48,954,000		
松屋	13,300	838.00	11,145,400	貸付株式数	1,700株
エイチ・ツー・オーリテイ リング	32,500	790.00	25,675,000	貸付株式数	12,400株
近鉄百貨店	2,500	2,428.00	6,070,000	貸付株式数	1,000株
丸井グループ	56,400	2,086.00	117,650,400		
クレディセゾン	42,800	1,124.00	48,107,200		
アクシアルリテイリング	5,100	3,260.00	16,626,000	貸付株式数	2,100株
井筒屋	3,100	309.00	957,900	貸付株式数	1,200株
イオン	255,100	2,644.50	674,611,950		
イズミ	11,900	3,145.00	37,425,500	貸付株式数	4,700株
フォーバル	3,000	991.00	2,973,000		
平和堂	12,200	1,853.00	22,606,600	貸付株式数	5,200株
フジ	8,000	1,920.00	15,360,000	貸付株式数	3,200株
ヤオコー	7,500	6,690.00	50,175,000	貸付株式数	2,900株
ゼビオホールディングス	9,000	879.00	7,911,000	貸付株式数	2,900株
ケーズホールディングス	61,200	1,149.00	70,318,800		
PALTAC	9,300	4,405.00	40,966,500	貸付株式数	2,000株
三谷産業	9,400	297.00	2,791,800	貸付株式数	1,500株
OLYMPICグループ	3,400	611.00	2,077,400	貸付株式数	700株
日産東京販売HD	8,900	225.00	2,002,500		
新生銀行	43,300	1,916.00	82,962,800		
あおぞら銀行	37,000	2,472.00	91,464,000		
三菱UFJフィナンシャル G	4,258,400	601.40	2,561,001,760		
りそなホールディングス	760,700	415.60	316,146,920		
三井住友トラストHD	125,500	3,560.00	446,780,000		



三井住友フィナンシャルG	459,700	3,703.00	1,702,269,100		
千葉銀行	221,500	661.00	146,411,500		
群馬銀行	127,200	331.00	42,103,200	貸付株式数	13,600株
武蔵野銀行	9,900	1,558.00	15,424,200	貸付株式数	3,800株
千葉興業銀行	15,800	245.00	3,871,000	貸付株式数	2,000株
筑波銀行	26,200	157.00	4,113,400	貸付株式数	2,500株
七十七銀行	20,600	1,156.00	23,813,600	貸付株式数	7,900株
青森銀行	5,100	1,593.00	8,124,300		
秋田銀行	4,200	1,430.00	6,006,000		
山形銀行	7,400	811.00	6,001,400		
岩手銀行	4,400	1,610.00	7,084,000		
東邦銀行	54,800	194.00	10,631,200	貸付株式数	22,600株
東北銀行	3,100	964.00	2,988,400		
みちのく銀行	4,500	731.00	3,289,500		
ふくおかフィナンシャルG	55,900	1,838.00	102,744,200		
静岡銀行	161,800	800.00	129,440,000		
スルガ銀行	63,000	471.00	29,673,000		
八十二銀行	149,300	356.00	53,150,800		
山梨中央銀行	6,900	788.00	5,437,200	貸付株式数	800株
大垣共立銀行	13,200	1,771.00	23,377,200	貸付株式数	2,600株
福井銀行	5,900	1,332.00	7,858,800		
清水銀行	2,800	1,516.00	4,244,800		
富山銀行	1,200	1,696.00	2,035,200	貸付株式数	100株
滋賀銀行	12,400	1,751.00	21,712,400	貸付株式数	1,200株
南都銀行	10,200	1,790.00	18,258,000	貸付株式数	400株
百五銀行	63,600	318.00	20,224,800		
京都銀行	23,900	4,825.00	115,317,500		
紀陽銀行	23,400	1,359.00	31,800,600		
ほくほくフィナンシャルG	41,300	770.00	31,801,000	貸付株式数	4,100株
山陰合同銀行	39,300	564.00	22,165,200	貸付株式数	3,600株
中国銀行	53,100	836.00	44,391,600	貸付株式数	6,100株
鳥取銀行	2,000	1,102.00	2,204,000		
伊予銀行	88,300	524.00	46,269,200	貸付株式数	32,800株
百十四銀行	6,900	1,350.00	9,315,000		
四国銀行	9,700	704.00	6,828,800	貸付株式数	3,700株
阿波銀行	10,200	2,035.00	20,757,000		
大分銀行	3,900	1,680.00	6,552,000	貸付株式数	400株
宮崎銀行	4,100	1,952.00	8,003,200		
佐賀銀行	3,700	1,408.00	5,209,600	貸付株式数	200株

琉球銀行	14,600	712.00	10,395,200	
セブン銀行	196,900	228.00	44,893,200	貸付株式数 88,100株
みずほフィナンシャルG	849,700	1,402.00	1,191,279,400	
高知銀行	2,500	719.00	1,797,500	
山口フィナンシャルG	77,000	621.00	47,817,000	貸付株式数 8,300株
芙蓉総合リース	7,000	7,180.00	50,260,000	
みずほリース	10,500	2,964.00	31,122,000	貸付株式数 3,900株
東京センチュリー	12,900	5,420.00	69,918,000	貸付株式数 6,100株
S B Iホールディングス	81,900	2,924.00	239,475,600	貸付株式数 32,600株
日本証券金融	26,300	814.00	21,408,200	
アイフル	113,800	352.00	40,057,600	
日本アジア投資	5,900	187.00	1,103,300	貸付株式数 500株
長野銀行	2,200	1,100.00	2,420,000	
名古屋銀行	4,900	2,193.00	10,745,700	貸付株式数 600株
北洋銀行	101,200	231.00	23,377,200	貸付株式数 12,700株
愛知銀行	2,400	3,505.00	8,412,000	
中京銀行	2,600	1,185.00	3,081,000	
大光銀行	2,300	1,266.00	2,911,800	
愛媛銀行	9,300	720.00	6,696,000	
トマト銀行	2,300	1,005.00	2,311,500	貸付株式数 300株
京葉銀行	28,000	422.00	11,816,000	貸付株式数 10,000株
栃木銀行	31,700	174.00	5,515,800	
北日本銀行	2,100	1,414.00	2,969,400	貸付株式数 700株
東和銀行	12,200	480.00	5,856,000	
福島銀行	7,700	202.00	1,555,400	
大東銀行	3,100	656.00	2,033,600	
リコーリース	6,000	3,615.00	21,690,000	貸付株式数 2,000株
イオンフィナンシャルサー ビス	36,100	1,227.00	44,294,700	貸付株式数 3,800株
ア コ ム	132,000	337.00	44,484,000	貸付株式数 50,900株
ジャックス	7,700	2,753.00	21,198,100	
オ リ コ	181,600	124.00	22,518,400	
オリックス	403,000	2,245.00	904,735,000	
三菱H C キャピタル	246,300	534.00	131,524,200	
ジャフコ グループ	8,700	7,120.00	61,944,000	
九州 リースサービス	3,300	566.00	1,867,800	貸付株式数 500株
トモニホールディングス	51,200	291.00	14,899,200	貸付株式数 900株
大和証券G本社	497,100	630.90	313,620,390	
野村ホールディングス	1,013,000	477.40	483,606,200	
岡三証券グループ	52,000	369.00	19,188,000	貸付株式数 6,600株

丸三証券	19,700	499.00	9,830,300		
東洋証券	21,700	143.00	3,103,100	貸付株式数	8,600株
東海東京HD	75,500	372.00	28,086,000	貸付株式数	30,200株
光世証券	1,400	500.00	700,000	貸付株式数	600株
水戸証券	17,800	269.00	4,788,200	貸付株式数	5,000株
いちよし証券	12,400	619.00	7,675,600	貸付株式数	5,200株
松井証券	32,500	781.00	25,382,500		
SOMPOホールディングス	117,000	4,674.00	546,858,000		
日本取引所グループ	168,300	2,459.00	413,849,700		
マネックスG	54,100	931.00	50,367,100		
極東証券	8,900	732.00	6,514,800	貸付株式数	1,700株
岩井コスモホールディング	6,300	1,292.00	8,139,600	貸付株式数	800株
アイザワ証券グループ	11,000	986.00	10,846,000	貸付株式数	2,900株
フィデアホール	5,900	1,197.00	7,062,300	貸付株式数	200株
池田泉州HD	74,900	149.00	11,160,100	貸付株式数	29,900株
アニコムホールディングス	20,500	777.00	15,928,500		
MS&AD	148,900	3,316.00	493,752,400	貸付株式数	44,000株
マネーパートナーズGP	9,100	218.00	1,983,800		
スパークス・グループ	31,600	312.00	9,859,200	貸付株式数	12,100株
小林洋行	2,300	246.00	565,800		
第一生命HLDGS	326,800	2,287.00	747,391,600		
東京海上HD	218,700	5,708.00	1,248,339,600		
アドバンテッジリスクマネ	3,300	657.00	2,168,100	貸付株式数	1,300株
イー・ギャランティ	9,800	2,457.00	24,078,600		
アサックス	4,200	684.00	2,872,800	貸付株式数	1,100株
NECキャピタルソリューション	3,000	1,914.00	5,742,000		
T&Dホールディングス	172,400	1,342.00	231,360,800		
アドバンスクリエイト	3,200	981.00	3,139,200	貸付株式数	1,100株
三井不動産	302,300	2,336.00	706,172,800		
三菱地所	435,500	1,565.00	681,557,500		
平和不動産	11,500	3,400.00	39,100,000		
東京建物	65,400	1,608.00	105,163,200		
ダイビル	16,900	1,464.00	24,741,600	貸付株式数	400株
京阪神ビルディング	10,500	1,377.00	14,458,500		
住友不動産	139,100	3,539.00	492,274,900		
太平洋興発	2,200	591.00	1,300,200	貸付株式数	200株
テーオーシー	12,100	556.00	6,727,600	貸付株式数	3,300株

東京楽天地	1,000	3,980.00	3,980,000	貸付株式数	400株
スターツコーポレーション	8,800	2,429.00	21,375,200		
フジ住宅	7,700	664.00	5,112,800		
空港施設	7,200	525.00	3,780,000		
明和地所	3,400	550.00	1,870,000		
ゴールドクレスト	4,700	1,492.00	7,012,400	貸付株式数	2,300株
リログループ	35,200	2,093.00	73,673,600		
エスリード	2,500	1,599.00	3,997,500	貸付株式数	1,000株
日神グループHLDGS	9,300	465.00	4,324,500	貸付株式数	4,100株
日本エスコ	13,100	750.00	9,825,000		
タカラレーベン	29,300	266.00	7,793,800	貸付株式数	11,200株
AVANTIA	2,800	828.00	2,318,400	貸付株式数	600株
イオンモール	33,100	1,607.00	53,191,700	貸付株式数	13,200株
毎日コムネット	2,700	727.00	1,962,900		
ファースト住建	2,900	1,184.00	3,433,600	貸付株式数	900株
ランド	371,200	11.00	4,083,200	貸付株式数	119,600株
カチタス	16,400	4,190.00	68,716,000		
東祥	4,900	1,674.00	8,202,600	貸付株式数	1,500株
トーセイ	9,300	963.00	8,955,900	貸付株式数	3,600株
穴吹興産	1,100	1,865.00	2,051,500	貸付株式数	600株
サンフロンティア不動産	8,500	958.00	8,143,000		
インテリックス	900	654.00	588,600		
ランドビジネス	2,300	247.00	568,100		
サンネクスタグループ	2,300	1,005.00	2,311,500	貸付株式数	800株
グランディハウス	5,200	458.00	2,381,600		
東武鉄道	65,800	2,565.00	168,777,000		
相鉄ホールディングス	21,400	1,975.00	42,265,000	貸付株式数	2,300株
東急	169,800	1,571.00	266,755,800		
京浜急行	86,300	1,122.00	96,828,600		
小田急電鉄	100,100	2,187.00	218,918,700		
京王電鉄	34,900	5,110.00	178,339,000		
京成電鉄	46,900	3,110.00	145,859,000		
富士急行	8,100	4,105.00	33,250,500	貸付株式数	3,600株
新京成電鉄	1,600	1,970.00	3,152,000	貸付株式数	300株
東日本旅客鉄道	118,500	6,986.00	827,841,000		
西日本旅客鉄道	81,600	4,898.00	399,676,800		
東海旅客鉄道	56,000	15,600.00	873,600,000		
西武ホールディングス	87,800	1,085.00	95,263,000	貸付株式数	32,300株
鴻池運輸	10,600	1,089.00	11,543,400		
西日本鉄道	18,600	2,544.00	47,318,400		

ハマキョウレックス	4,700	2,850.00	13,395,000	貸付株式数	600株
サカイ引越センター	3,100	4,195.00	13,004,500	貸付株式数	500株
近鉄グループHLDGS	63,700	3,260.00	207,662,000		
阪急阪神HLDGS	79,600	3,365.00	267,854,000	貸付株式数	2,800株
南海電鉄	28,400	2,032.00	57,708,800	貸付株式数	11,900株
京阪ホールディングス	28,300	2,548.00	72,108,400		
神戸電鉄	1,500	3,205.00	4,807,500	貸付株式数	500株
名古屋鉄道	52,400	1,660.00	86,984,000	貸付株式数	3,800株
山陽電鉄	4,700	1,930.00	9,071,000	貸付株式数	1,700株
トランコム	1,800	8,050.00	14,490,000	貸付株式数	700株
日本通運	22,100	6,470.00	142,987,000		
ヤマトホールディングス	89,300	2,504.00	223,607,200		
山 九	17,600	4,510.00	79,376,000		
日 新	5,000	1,523.00	7,615,000		
丸 運	4,300	250.00	1,075,000	貸付株式数	1,400株
丸全昭和運輸	5,200	3,165.00	16,458,000		
センコーグループHLDGS	32,300	926.00	29,909,800	貸付株式数	13,900株
トナミホールディングス	1,500	3,520.00	5,280,000		
ニッコンホールディングス	21,300	1,983.00	42,237,900		
日石輸送	600	2,607.00	1,564,200		
福山通運	10,500	3,760.00	39,480,000		
セイノーホールディングス	43,300	1,147.00	49,665,100	貸付株式数	8,200株
エスライン	1,800	900.00	1,620,000		
神奈川中央交通	1,600	3,220.00	5,152,000		
日立物流	12,300	4,630.00	56,949,000	貸付株式数	200株
丸和運輸機関	13,800	1,380.00	19,044,000	貸付株式数	5,300株
C & F ロジホールディングス	6,500	1,502.00	9,763,000		
日本郵船	53,400	7,400.00	395,160,000		
商船三井	35,300	6,500.00	229,450,000		
川崎汽船	19,800	4,870.00	96,426,000		
NSユニテッド海運	3,500	3,230.00	11,305,000		
明治海運	7,500	686.00	5,145,000	貸付株式数	3,000株
飯野海運	29,300	517.00	15,148,100	貸付株式数	3,900株
共栄タンカー	1,100	819.00	900,900	貸付株式数	400株
九州旅客鉄道	49,500	2,395.00	118,552,500		
SGホールディングス	120,500	2,510.00	302,455,000		
日本航空	146,200	2,056.00	300,587,200		
ANAホールディングス	162,000	2,239.50	362,799,000		

パスコ	1,100	1,298.00	1,427,800		
TREホールディングス	8,800	1,775.00	15,620,000	貸付株式数	100株
人・夢・技術グループ	2,600	1,813.00	4,713,800		
西本WISMETTACHD	1,500	3,220.00	4,830,000	貸付株式数	600株
シルバーライフ	1,500	1,287.00	1,930,500	貸付株式数	500株
ヤマシタヘルスケアHLDGS	900	1,985.00	1,786,500	貸付株式数	200株
GENKY DRUG STORES	2,900	5,120.00	14,848,000	貸付株式数	800株
国際紙パルプ商事	15,900	311.00	4,944,900		
ナルミヤ・インターナショナル	1,600	1,038.00	1,660,800	貸付株式数	500株
ブックオフGHD	3,800	970.00	3,686,000	貸付株式数	1,500株
三菱倉庫	20,100	2,774.00	55,757,400		
三井倉庫HOLD	6,900	2,280.00	15,732,000		
住友倉庫	22,500	1,817.00	40,882,500	貸付株式数	400株
渋沢倉庫	3,800	2,097.00	7,968,600		
ヤマタネ	2,900	1,516.00	4,396,400		
東陽倉庫	10,600	305.00	3,233,000	貸付株式数	300株
乾汽船	4,500	2,009.00	9,040,500	貸付株式数	1,700株
日本トランスシティ	14,000	554.00	7,756,000		
ケイヒン	1,000	1,279.00	1,279,000	貸付株式数	200株
中央倉庫	3,500	934.00	3,269,000		
川西倉庫	1,200	1,067.00	1,280,400	貸付株式数	400株
安田倉庫	5,000	930.00	4,650,000		
ファイズホールディングス	1,400	552.00	772,800	貸付株式数	500株
東洋埠頭	1,900	1,407.00	2,673,300		
宇徳	5,400	516.00	2,786,400		
上組	35,000	2,099.00	73,465,000		
サンリツ	1,900	797.00	1,514,300	貸付株式数	400株
キムラユニティー	1,500	1,173.00	1,759,500	貸付株式数	400株
キューソー流通システム	3,000	882.00	2,646,000	貸付株式数	600株
近鉄エクスプレス	12,000	2,728.00	32,736,000	貸付株式数	400株
東海運	3,600	298.00	1,072,800	貸付株式数	1,400株
エーアイテイナー	4,100	1,139.00	4,669,900		
内外トランスライン	2,700	1,826.00	4,930,200	貸付株式数	900株
ショーエイコーポ	2,500	687.00	1,717,500	貸付株式数	600株
日本コンセプト	2,100	1,644.00	3,452,400	貸付株式数	800株
TBSホールディングス	40,200	1,715.00	68,943,000	貸付株式数	5,500株

日本テレビH L D S	55,400	1,150.00	63,710,000	
朝日放送グループHD	6,400	682.00	4,364,800	
テレビ朝日HD	16,000	1,492.00	23,872,000	貸付株式数 8,100株
スカパーJ S A T H D	56,300	405.00	22,801,500	貸付株式数 22,400株
テレビ東京HD	4,800	2,027.00	9,729,600	
日本B S 放送	2,400	1,102.00	2,644,800	貸付株式数 900株
ビジョン	11,900	1,319.00	15,696,100	
スマートバリュー	1,800	500.00	900,000	貸付株式数 600株
U S E N - N E X T H L D G S	6,800	3,235.00	21,998,000	貸付株式数 2,500株
ワイヤレスゲート	2,900	324.00	939,600	貸付株式数 1,000株
コネクシオ	4,600	1,407.00	6,472,200	
日本通信	55,100	270.00	14,877,000	貸付株式数 5,100株
クロップス	1,100	1,109.00	1,219,900	貸付株式数 400株
日本電信電話	772,600	3,125.00	2,414,375,000	
K D D I	481,600	3,300.00	1,589,280,000	
ソフトバンク	1,000,600	1,562.50	1,563,437,500	
光通信	7,800	16,460.00	128,388,000	
エムティーアイ	7,600	584.00	4,438,400	貸付株式数 2,500株
GMOインターネット	23,700	2,858.00	67,734,600	貸付株式数 9,000株
ファイバーゲート	2,200	1,079.00	2,373,800	貸付株式数 800株
アイドママーケティングコム	1,000	313.00	313,000	貸付株式数 600株
K A D O K A W A	19,300	6,020.00	116,186,000	
学研ホールディングス	9,600	978.00	9,388,800	貸付株式数 3,700株
ゼンリン	10,900	935.00	10,191,500	貸付株式数 4,600株
昭文社ホールディングス	2,700	478.00	1,290,600	貸付株式数 1,000株
インプレスホールディングス	8,900	210.00	1,869,000	
東京電力HD	503,800	303.00	152,651,400	貸付株式数 94,500株
中部電力	205,400	1,146.00	235,388,400	
関西電力	254,700	1,027.00	261,576,900	
中国電力	104,800	891.00	93,376,800	
北陸電力	62,400	563.00	35,131,200	
東北電力	156,800	786.00	123,244,800	貸付株式数 11,300株
四国電力	60,200	755.00	45,451,000	
九州電力	138,300	811.00	112,161,300	貸付株式数 5,200株
北海道電力	58,100	469.00	27,248,900	貸付株式数 22,400株
沖縄電力	13,900	1,389.00	19,307,100	
電源開発	57,200	1,445.00	82,654,000	

エフオン	4,500	655.00	2,947,500	貸付株式数	200株
イーレックス	10,200	2,558.00	26,091,600		
レノバ	13,100	5,350.00	70,085,000		
東京瓦斯	129,100	1,945.00	251,099,500		
大阪瓦斯	121,800	1,827.00	222,528,600		
東邦瓦斯	30,900	3,205.00	99,034,500		
北海道瓦斯	3,100	1,471.00	4,560,100	貸付株式数	400株
広島ガス	11,700	351.00	4,106,700	貸付株式数	1,600株
西部ガスHLDGS	7,400	2,120.00	15,688,000		
静岡ガス	19,300	968.00	18,682,400		
メタウォーター	7,900	1,950.00	15,405,000		
アイネット	3,000	1,300.00	3,900,000		
松竹	4,400	10,960.00	48,224,000	貸付株式数	800株
東宝	39,000	5,050.00	196,950,000		
エイチ・アイ・エス	14,500	1,941.00	28,144,500	貸付株式数	5,700株
東映	2,200	18,600.00	40,920,000	貸付株式数	200株
ラックランド	1,700	2,908.00	4,943,600	貸付株式数	600株
NTTデータ	175,800	2,394.00	420,865,200		
共立メンテナンス	11,500	3,995.00	45,942,500	貸付株式数	4,500株
イチネンホールディングス	6,200	1,300.00	8,060,000		
建設技術研究所	3,800	2,364.00	8,983,200		
スペース	3,900	893.00	3,482,700		
アインホールディングス	9,700	6,110.00	59,267,000		
燦ホールディングス	2,700	1,386.00	3,742,200		
ピー・シー・エー	3,900	1,463.00	5,705,700	貸付株式数	1,100株
スバル興業	400	7,970.00	3,188,000	貸付株式数	100株
東京テアトル	2,300	1,209.00	2,780,700		
タナベ経営	2,000	721.00	1,442,000		
ビジネスB太田昭和	2,600	1,964.00	5,106,400		
ナガワ	2,000	11,420.00	22,840,000	貸付株式数	700株
東京都競馬	4,800	3,990.00	19,152,000	貸付株式数	1,900株
常磐興産	2,600	1,401.00	3,642,600	貸付株式数	1,000株
カナモト	11,000	2,154.00	23,694,000		
DTS	12,500	2,367.00	29,587,500	貸付株式数	2,200株
スクウェア・エニックス・HD	30,700	5,930.00	182,051,000		
シーイーシー	7,200	1,242.00	8,942,400		
カプコン	62,300	2,829.00	176,246,700		
西尾レントオール	5,800	2,519.00	14,610,200	貸付株式数	2,000株
アイ・エス・ビー	3,000	1,013.00	3,039,000		



アゴーラ ホスピタリ ティーG	52,200	23.00	1,200,600	
日本空港ビルデング	25,300	5,000.00	126,500,000	
トランス・コスモス	8,100	3,150.00	25,515,000	貸付株式数 1,400株
乃村工藝社	27,700	1,003.00	27,783,100	
ジャステック	3,600	1,018.00	3,664,800	貸付株式数 1,400株
S C S K	45,900	2,155.00	98,914,500	
藤田観光	2,900	2,237.00	6,487,300	貸付株式数 1,100株
K N T - C Tホールディン グス	4,100	1,412.00	5,789,200	貸付株式数 1,500株
日本管財	6,700	2,736.00	18,331,200	貸付株式数 1,800株
トーカイ	5,600	1,949.00	10,914,400	貸付株式数 2,200株
白 洋 舎	800	1,868.00	1,494,400	貸付株式数 300株
セコム	63,300	7,664.00	485,131,200	
日本システムウエア	2,300	2,152.00	4,949,600	
セントラル警備保障	3,000	2,407.00	7,221,000	
アイネス	5,700	1,390.00	7,923,000	貸付株式数 2,700株
丹青社	13,000	810.00	10,530,000	
メイテック	7,800	6,660.00	51,948,000	貸付株式数 900株
T K C	11,500	3,290.00	37,835,000	
富士ソフト	7,200	5,280.00	38,016,000	
応用地質	7,100	1,963.00	13,937,300	
船井総研ホールディン	13,100	2,559.00	33,522,900	
N S D	21,600	2,117.00	45,727,200	
進学会ホールディングス	2,100	341.00	716,100	貸付株式数 900株
丸紅建材リース	300	1,741.00	522,300	貸付株式数 100株
オ オ バ	4,300	760.00	3,268,000	貸付株式数 1,800株
コナミホールディングス	24,000	5,810.00	139,440,000	
いであ	1,700	1,815.00	3,085,500	貸付株式数 600株
学 究 社	2,200	1,457.00	3,205,400	
ベネッセホールディングス	21,500	2,199.00	47,278,500	貸付株式数 3,300株
イオンディライト	7,800	3,545.00	27,651,000	貸付株式数 3,100株
ナック	2,400	929.00	2,229,600	貸付株式数 300株
福井コンピュータH L D S	3,000	3,820.00	11,460,000	
ダイセキ	11,800	5,160.00	60,888,000	貸付株式数 5,100株
ステップ	2,600	1,772.00	4,607,200	貸付株式数 800株
日鉄物産	4,600	4,605.00	21,183,000	貸付株式数 900株
泉州電業	1,900	4,590.00	8,721,000	貸付株式数 700株
元気寿司	1,800	2,446.00	4,402,800	
トラスコ中山	14,200	2,631.00	37,360,200	

ヤマダホールディングス	242,500	396.00	96,030,000	貸付株式数	96,800株
オートバックスセブン	22,200	1,309.00	29,059,800	貸付株式数	9,300株
モリト	4,900	641.00	3,140,900		
アークランドサカモト	10,400	1,659.00	17,253,600		
ニトリホールディングス	26,300	18,030.00	474,189,000		
グルメ杵屋	5,300	982.00	5,204,600	貸付株式数	2,100株
愛眼	4,100	189.00	774,900		
ケーユーホールディングス	3,400	934.00	3,175,600	貸付株式数	200株
吉野家ホールディングス	23,100	2,225.00	51,397,500	貸付株式数	9,200株
加藤産業	9,600	3,170.00	30,432,000		
北恵	1,700	819.00	1,392,300	貸付株式数	600株
イノテック	3,900	1,354.00	5,280,600		
イエローハット	11,500	1,550.00	17,825,000	貸付株式数	2,200株
松屋フーズHLDGS	3,200	3,430.00	10,976,000	貸付株式数	1,200株
JBCホールディングス	4,200	1,763.00	7,404,600		
JKホールディングス	5,300	1,030.00	5,459,000	貸付株式数	2,200株
サガミホールディングス	10,300	991.00	10,207,300	貸付株式数	4,000株
日伝	6,300	2,180.00	13,734,000	貸付株式数	100株
関西スーパーマーケット	5,000	1,834.00	9,170,000	貸付株式数	400株
ミロク情報サービス	5,700	1,464.00	8,344,800	貸付株式数	2,600株
北沢産業	4,400	249.00	1,095,600		
杉本商事	3,000	2,090.00	6,270,000	貸付株式数	400株
因幡電機産業	18,400	2,459.00	45,245,600		
王将フードサービス	4,400	5,780.00	25,432,000	貸付株式数	1,500株
プレナス	7,500	1,935.00	14,512,500		
ミニストップ	5,400	1,361.00	7,349,400	貸付株式数	1,900株
アークス	12,700	2,067.00	26,250,900	貸付株式数	5,000株
パローホールディングス	14,600	2,116.00	30,893,600		
東テック	2,300	2,325.00	5,347,500		
ミスミグループ本社	83,300	4,785.00	398,590,500		
藤久	1,600	771.00	1,233,600	貸付株式数	500株
アルテック	6,300	298.00	1,877,400		
ベルク	2,900	5,260.00	15,254,000	貸付株式数	500株
大庄	3,500	923.00	3,230,500	貸付株式数	1,400株
タキヒヨー	2,000	1,690.00	3,380,000	貸付株式数	800株
ファーストリテイリング	8,900	67,400.00	599,860,000		
ソフトバンクグループ	396,100	6,030.00	2,388,483,000		
蔵王産業	900	1,856.00	1,670,400		
スズケン	26,000	3,085.00	80,210,000	貸付株式数	3,300株
サンドラッグ	25,000	2,989.00	74,725,000		

サクスパーホールディング	6,100	520.00	3,172,000		
ジェコス	4,500	768.00	3,456,000		
ヤマザワ	1,400	1,680.00	2,352,000	貸付株式数	500株
やまや	1,300	2,328.00	3,026,400	貸付株式数	500株
グローセル	7,300	392.00	2,861,600	貸付株式数	2,100株
ベルーナ	14,900	667.00	9,938,300	貸付株式数	5,700株
合計			177,548,758,040		

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

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

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

(2) 株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

**【ダイワ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5期計算期間(2020年12月1日から2021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】

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4期 2020年11月30日現在	第5期 2021年11月30日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	6,646,461	6,628,705
親投資信託受益証券	3,369,117,428	3,374,132,488
未収入金	2,260,000	120,000
流動資産合計	3,378,023,889	3,380,881,193
資産合計	3,378,023,889	3,380,881,193
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	3,407,283	724,525
未払受託者報酬	334,762	354,042
未払委託者報酬	4,770,876	5,045,793
その他未払費用	83,614	88,429
流動負債合計	8,596,535	6,212,789
負債合計	8,596,535	6,212,789
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 2,298,185,009	1 1,833,901,672
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,071,242,345	1,540,766,732
（分配準備積立金）	725,970,183	1,046,017,628
元本等合計	3,369,427,354	3,374,668,404
純資産合計	3,369,427,354	3,374,668,404
負債純資産合計	3,378,023,889	3,380,881,193

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期		第5期	
	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日		自 2020年12月1日 至 2021年11月30日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		13		-
有価証券売買等損益		543,557,423		740,199,060
営業収益合計		543,557,436		740,199,060
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,923		1,339
受託者報酬		603,298		708,036
委託者報酬		8,598,025		10,090,800
その他費用		150,717		176,849
営業費用合計		9,353,963		10,977,024
<b>営業利益</b>		534,203,473		729,222,036
経常利益		534,203,473		729,222,036
<b>当期純利益</b>		534,203,473		729,222,036
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		22,224,511		129,604,024
期首剰余金又は期首欠損金( )		549,963,489		1,071,242,345
剰余金増加額又は欠損金減少額		185,885,163		329,583,165
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		185,885,163		329,583,165
剰余金減少額又は欠損金増加額		176,585,269		459,676,790
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		176,585,269		459,676,790
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )		1,071,242,345		1,540,766,732

## (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5期	
	自 2020年12月1日	至 2021年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1. 1 期首元本額	1,803,208,621円	2,298,185,009円
期中追加設定元本額	1,186,063,315円	503,558,139円
期中一部解約元本額	691,086,927円	967,841,476円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,298,185,009口	1,833,901,672口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日	自 2020年12月1日 至 2021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(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>	<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(599,618,174円)、投資信託約款に規定される収益調整金(494,750,295円)及び分配準備積立金(446,399,454円)より分配対象額は1,540,767,923円(1万口当たり8,401.58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5期 自 2020年12月1日 至 2021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5期
	2021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4期	第5期
	2020年11月30日現在	2021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	525,718,724	640,660,755
合計	525,718,724	640,660,755

## (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4期	第5期
2020年11月30日現在	2021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5期
自 2020年12月1日
至 2021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4期	第5期
	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.4661円	1.8402円
(1万口当たり純資産額)	(14,661円)	(18,402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	1,138,524,932	3,374,132,488	
親投資信託受益証券 合計			3,374,132,488	
合計			3,374,132,488	

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

	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	190,759,416	170,499,695

コール・ローン	1,771,762,663	2,022,467,907
株式	58,258,068,193	76,523,797,150
新株予約権証券	339,438	-
投資証券	1,445,356,342	1,902,993,076
派生商品評価勘定	562,322,330	835,409,584
未収入金	1,577,292	11,421,770
未収配当金	70,550,815	84,152,640
差入委託証拠金	579,571,081	748,621,975
流動資産合計	62,880,307,570	82,299,363,797
資産合計	62,880,307,570	82,299,363,797
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	315,926,545	9,294,015
未払金	-	10,922,729
未払解約金	2,260,000	3,240,000
その他未払費用	-	83,023
流動負債合計	318,186,545	23,539,767
負債合計	318,186,545	23,539,767
純資産の部		
元本等		
元本	1	26,586,986,393
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	35,975,134,632	54,514,096,767
元本等合計	62,562,121,025	82,275,824,030
純資産合計	62,562,121,025	82,275,824,030
負債純資産合計	62,880,307,570	82,299,363,797

## 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	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1. 1 期首	2019年12月3日	2020年12月1日
期首元本額	24,374,861,574円	26,586,986,393円
期中追加設定元本額	10,181,262,768円	6,902,835,120円
期中一部解約元本額	7,969,137,949円	5,728,094,250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）	20,735,729,595円	21,329,154,782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）	1,431,778,262円	1,138,524,932円
iFree 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	852,840,980円	1,553,864,915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)	3,566,637,556円	3,740,182,634円
計	26,586,986,393円	27,761,727,263円
2. 期末日における受益権の総数	26,586,986,393口	27,761,727,263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 2020年12月1日 至 2021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	2021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	2020年11月30日現在	2021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	5,760,707,661	11,446,405,422
新株予約権証券	22,807	-
投資証券	91,977,896	430,773,544
合計	5,668,752,572	11,877,178,966

（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（2020年1月11日から2020年11月30日まで、及び2021年1月13日から2021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	2020年11月30日 現在				2021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	2,687,761,304	-	2,926,736,137	238,974,833	2,988,965,000	-	3,055,897,771	66,932,771

合計	2,687,761,304	-	2,926,736,137	238,974,833	2,988,965,000	-	3,055,897,771	66,932,771

## (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	2020年11月30日 現在				2021年11月30日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	54,250,863,772	-	54,243,441,600	7,422,172	80,196,929,768	-	79,437,746,970	759,182,798
アメリカ・ドル	39,552,874,994	-	39,234,451,555	318,423,439	58,645,426,218	-	58,488,051,926	157,374,292
イギリス・ポンド	2,316,093,489	-	2,370,724,188	54,630,699	3,518,705,343	-	3,421,709,496	96,995,847
イスラエル・シェケル	59,858,151	-	61,146,761	1,288,610	109,632,262	-	109,730,969	98,707
オーストラリア・ドル	1,181,968,356	-	1,239,950,980	57,982,624	1,739,465,672	-	1,651,270,226	88,195,446
カナダ・ドル	1,788,306,856	-	1,823,271,520	34,964,664	2,859,792,381	-	2,773,108,499	86,683,882
シンガポール・ドル	209,011,366	-	212,167,384	3,156,018	259,144,977	-	255,038,606	4,106,371
スイス・フラン	1,774,145,508	-	1,784,840,268	10,694,760	2,382,488,912	-	2,357,165,145	25,323,767
スウェーデン・クローナ	602,573,643	-	626,525,510	23,951,867	957,236,295	-	904,038,764	53,197,531
デンマーク・クローネ	475,836,647	-	485,223,309	9,386,662	681,739,696	-	664,199,386	17,540,310



ニュージー ランド・ドル	66,767,482	-	70,687,700	3,920,218	55,546,276	-	52,709,316	2,836,960
ノルウェー・ クローネ	110,749,078	-	118,900,600	8,151,522	181,739,077	-	169,571,043	12,168,034
ユーロ	5,540,018,954	-	5,647,747,536	107,728,582	8,105,568,523	-	7,894,030,752	211,537,771
香港・ドル	572,659,248	-	567,804,289	4,854,959	700,444,136	-	697,122,842	3,321,294
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	54,269,539,992	-	54,262,116,600	7,420,952	80,196,929,768	-	79,437,746,970	759,182,798

## (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)

	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1口当たり純資産額	2.3531円	2.9636円
(1万口当たり純資産額)	(23,531円)	(29,636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	175.510	227,285.450	
	PALO ALTO NETWORKS INC	1,220	551.180	672,439.600	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	2,271	197.740	449,067.540	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,594	86.080	137,211.520	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	746	122.410	91,317.860	
	SYNCHRONY FINANCIAL	7,238	47.120	341,054.560	
	ABBOTT LABORATORIES	21,242	128.030	2,719,613.260	
	HOWMET AEROSPACE INC	3,950	28.500	112,575.000	
	VERISK ANALYTICS INC	1,943	229.160	445,257.880	
	LAS VEGAS SANDS CORP	4,729	37.260	176,202.540	
	AMPHENOL CORP-CL A	6,905	82.930	572,631.650	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	443	564.320	249,993.760	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	7,482	105.390	788,527.980	
	QORVO INC	1,283	150.840	193,527.720	
	AFLAC INC	8,471	55.700	471,834.700	
	DARDEN RESTAURANTS INC	1,870	141.750	265,072.500	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1,835	107.850	197,904.750	
	ADOBE INC	5,719	687.490	3,931,755.310	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,872	62.960	180,821.120	
	LULULEMON ATHLETICA INC	1,607	463.260	744,458.820	
	GARMIN LTD	2,068	139.240	287,948.320	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2,602	291.350	758,092.700	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	8,391	207.660	1,742,475.060	
	WR BERKLEY CORP	1,771	79.470	140,741.370	
	AUTOZONE INC	261	1,838.690	479,898.090	
DOLLAR TREE INC	2,566	141.350	362,704.100		
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	12,365	8.590	106,215.350		
PINNACLE WEST CAPITAL	1,508	66.290	99,965.320		
CELANESE CORP	1,297	159.790	207,247.630		
DR HORTON INC	4,397	98.760	434,247.720		
DENTSPLY SIRONA INC	2,450	48.690	119,290.500		

AUTODESK INC	2,684	261.150	700,926.600	
MOODY'S CORP	2,035	397.270	808,444.450	
DEVON ENERGY CORP	7,748	43.920	340,292.160	
ALBEMARLE CORP	1,427	275.890	393,695.030	
ATMOS ENERGY CORP	1,654	93.800	155,145.200	
ALLIANT ENERGY CORP	3,614	57.280	207,009.920	
CITIGROUP INC	24,866	65.040	1,617,284.640	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	5,105	235.900	1,204,269.500	
AMERICAN ELECTRIC POWER	5,918	83.310	493,028.580	
ALLEGHANY CORP	146	664.730	97,050.580	
DOMINO'S PIZZA INC	526	533.950	280,857.700	
HESS CORP	3,807	76.070	289,598.490	
DAVITA INC	1,000	96.910	96,910.000	
DANAHER CORP	7,675	326.520	2,506,041.000	
FORTIVE CORP	4,335	76.230	330,457.050	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	6,622	131.900	873,441.800	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	6,580	64.810	426,449.800	
BUNGE LTD	1,838	90.580	166,486.040	
TE CONNECTIVITY LTD	4,002	159.390	637,878.780	
APPLE INC	201,515	160.240	32,290,763.600	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	3,757	113.320	425,743.240	
BOEING CO/THE	6,698	198.500	1,329,553.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,063	118.460	244,382.980	
BECTON DICKINSON AND CO	3,485	243.610	848,980.850	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	2,000	10.120	20,240.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	1,400	90.550	126,770.000	
NISOURCE INC	4,026	25.250	101,656.500	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,708	95.620	163,318.960	
BOSTON BEER COMPANY INC-A	116	442.370	51,314.920	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	9,978	57.010	568,845.780	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	49,371	51.660	2,550,505.860	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	15,959	282.120	4,502,353.080	
ANSYS INC	1,038	397.720	412,833.360	
TRUIST FINANCIAL CORP	16,080	61.060	981,844.800	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	8,615	148.880	1,282,601.200	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	27,284	54.640	1,490,797.760	
JPMORGAN CHASE & CO	36,551	161.230	5,893,117.730	

T ROWE PRICE GROUP INC	2,658	207.020	550,259.160	
LKQ CORP	3,300	57.600	190,080.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	547	155.100	84,839.700	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,665	74.190	271,906.350	
CADENCE DESIGN SYS INC	3,359	186.690	627,091.710	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,348	293.710	395,921.080	
DOLLAR GENERAL CORP	2,825	225.070	635,822.750	
SERVICENOW INC	2,419	672.820	1,627,551.580	
CATERPILLAR INC	6,572	195.920	1,287,586.240	
BROWN & BROWN INC	2,886	65.410	188,773.260	
ESSENTIAL UTILITIES INC	2,478	48.440	120,034.320	
CHARLES RIVER LABORATORIES	640	375.310	240,198.400	
CMS ENERGY CORP	3,384	61.130	206,863.920	
MOSAIC CO/THE	5,209	36.030	187,680.270	
DELTA AIR LINES INC	1,650	36.240	59,796.000	
CORNING INC	9,983	38.460	383,946.180	
CISCO SYSTEMS INC	50,501	55.760	2,815,935.760	
MORGAN STANLEY	17,009	97.230	1,653,785.070	
ZILLOW GROUP INC - A	1,016	54.160	55,026.560	
MSCI INC	1,006	645.490	649,362.940	
FAIR ISAAC CORP	398	350.660	139,562.680	
LENNOX INTERNATIONAL INC	450	322.120	144,954.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,780	78.480	218,174.400	
BROADCOM INC	4,879	564.340	2,753,414.860	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,416	180.740	255,927.840	
ARAMARK	3,173	34.380	109,087.740	
DTE ENERGY COMPANY	2,281	111.490	254,308.690	
CENTENE CORP	6,844	73.770	504,881.880	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,358	129.700	176,132.600	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5,532	48.780	269,850.960	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,475	164.810	407,904.750	
GARTNER INC	1,048	325.000	340,600.000	
SPLUNK INC	2,029	125.000	253,625.000	
DOMINION ENERGY INC	9,740	74.420	724,850.800	
MONSTER BEVERAGE CORP	4,768	86.850	414,100.800	
SMITH (A.O.) CORP	1,400	80.860	113,204.000	
DEERE & CO	3,623	348.090	1,261,130.070	
POOL CORP	438	560.100	245,323.800	
GLOBAL PAYMENTS INC	3,567	120.260	428,967.420	

VMWARE INC-CLASS A	2,335	120.380	281,087.300	
CABLE ONE INC	60	1,825.970	109,558.200	
BURLINGTON STORES INC	766	293.370	224,721.420	
NASDAQ INC	1,427	209.080	298,357.160	
VAIL RESORTS INC	553	333.450	184,397.850	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	6,360	36.840	234,302.400	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	874	138.140	120,734.360	
CONSOLIDATED EDISON INC	3,780	80.350	303,723.000	
COGNEX CORP	2,439	78.660	191,851.740	
TELEFLEX INC	563	308.950	173,938.850	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	979	195.870	191,756.730	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	852	447.380	381,167.760	
BIO-RAD LABORATORIES-A	300	749.560	224,868.000	
CATALENT INC	2,000	133.960	267,920.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,757	294.090	516,716.130	
MOLINA HEALTHCARE INC	800	297.530	238,024.000	
IDEX CORP	953	234.420	223,402.260	
COLGATE-PALMOLIVE CO	9,715	77.710	754,952.650	
ROLLINS INC	2,685	35.330	94,861.050	
AMETEK INC	2,597	140.010	363,605.970	
CHURCH & DWIGHT CO INC	3,047	93.750	285,656.250	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	1,644	57.830	95,072.520	
HEICO CORP	535	140.180	74,996.300	
GENERAC HOLDINGS INC	716	424.580	303,999.280	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	480	469.430	225,326.400	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3,422	89.170	305,139.740	
TYLER TECHNOLOGIES INC	509	521.280	265,331.520	
COSTCO WHOLESALE CORP	5,260	554.880	2,918,668.800	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	1,128	118.470	133,634.160	
EPAM SYSTEMS INC	749	634.170	474,993.330	
RPM INTERNATIONAL INC	1,750	93.020	162,785.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	353	1,678.100	592,369.300	
UGI CORP	2,085	43.400	90,489.000	
CUMMINS INC	1,763	217.270	383,047.010	
ACTIVISION BLIZZARD INC	9,322	60.310	562,209.820	
CDW CORP/DE	1,792	194.800	349,081.600	

COSTAR GROUP INC	4,920	79.990	393,550.800	
SVB FINANCIAL GROUP	690	724.500	499,905.000	
AMERCO	70	717.230	50,206.100	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,239	357.220	442,595.580	
MERCADOLIBRE INC	556	1,234.100	686,159.600	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	837	152.310	127,483.470	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,477	138.070	480,069.390	
IPG PHOTONICS CORP	250	163.180	40,795.000	
DEXCOM INC	1,188	571.010	678,359.880	
NORDSON CORP	750	262.150	196,612.500	
COPART INC	2,495	148.010	369,284.950	
SEAGEN INC	1,545	165.310	255,403.950	
ALIGN TECHNOLOGY INC	909	634.470	576,733.230	
TRANSDIGM GROUP INC	637	584.220	372,148.140	
BIO-TECHNE CORP	507	479.690	243,202.830	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	1,203	84.740	101,942.220	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	2,457	102.080	250,810.560	
KINDER MORGAN INC	27,851	16.010	445,894.510	
HCA HEALTHCARE INC	3,261	229.920	749,769.120	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	420	352.960	148,243.200	
COTERRA ENERGY INC	9,500	20.840	197,980.000	
T-MOBILE US INC	7,624	113.400	864,561.600	
ZILLOW GROUP INC - C	1,786	54.260	96,908.360	
COCA-COLA CO/THE	48,885	54.580	2,668,143.300	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	2,575	51.820	133,436.500	
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,946	126.760	246,674.960	
FRANKLIN RESOURCES INC	3,851	33.750	129,971.250	
CSX CORP	27,223	35.620	969,683.260	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,166	291.920	340,378.720	
EXPEDIA GROUP INC	1,563	166.500	260,239.500	
AUTOLIV INC	800	95.930	76,744.000	
AMAZON.COM INC	5,465	3,561.570	19,463,980.050	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7,371	110.710	816,043.410	
EXXON MOBIL CORP	51,519	61.590	3,173,055.210	
AES CORP	8,341	23.620	197,014.420	
EVEREST RE GROUP LTD	571	264.370	150,955.270	

EOG RESOURCES INC	7,238	88.390	639,766.820	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	1,914	114.260	218,693.640	
ABIOMED INC	555	319.120	177,111.600	
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,989	120.230	239,137.470	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	3,683	153.420	565,045.860	
FORD MOTOR CO	47,597	19.670	936,232.990	
NOVAVAX INC	975	193.960	189,111.000	
DISCOVERY INC - A	1,521	24.590	37,401.390	
EXACT SCIENCES CORP	2,219	86.570	192,098.830	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	2,416	27.640	66,778.240	
LIBERTY BROADBAND-A	324	156.340	50,654.160	
DISCOVERY INC-C	4,554	24.050	109,523.700	
FORTINET INC	1,595	343.300	547,563.500	
MARKEL CORP	177	1,243.740	220,141.980	
NEXTERA ENERGY INC	23,399	88.660	2,074,555.340	
MASIMO CORP	693	288.290	199,784.970	
FREEMPORT-MCMORAN INC	18,297	37.980	694,920.060	
INSULET CORP	769	295.870	227,524.030	
US BANCORP	17,143	57.400	984,008.200	
UNITED RENTALS INC	918	357.020	327,744.360	
F5 NETWORKS INC	659	231.070	152,275.130	
FASTENAL CO	6,716	60.940	409,273.040	
FISERV INC	7,206	97.470	702,368.820	
GENERAL ELECTRIC CO	13,227	98.400	1,301,536.800	
GENERAL MOTORS CO	15,498	59.860	927,710.280	
ZENDESK INC	1,305	95.110	124,118.550	
GENERAL DYNAMICS CORP	2,875	194.440	559,015.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	4,078	386.540	1,576,310.120	
ALPHABET INC-CL A	3,631	2,910.610	10,568,424.910	
ALPHABET INC-CL C	3,509	2,922.280	10,254,280.520	
OWENS CORNING	1,763	87.130	153,610.190	
GENERAL MILLS INC	7,849	63.520	498,568.480	
FIRSTENERGY CORP	5,840	39.050	228,052.000	
GENUINE PARTS CO	1,770	132.910	235,250.700	
IHS MARKIT LTD	4,417	130.130	574,784.210	
FIFTH THIRD BANCORP	8,100	42.990	348,219.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,478	214.680	531,977.040	
HALLIBURTON CO	10,230	22.250	227,617.500	
HOME DEPOT INC	12,845	406.820	5,225,602.900	

ASSURANT INC	840	156.040	131,073.600	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	19,088	15.370	293,382.560	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	500	181.720	90,860.000	
HERSHEY CO/THE	1,725	179.160	309,051.000	
HUMANA INC	1,569	428.070	671,641.830	
NXP SEMICONDUCTORS NV	3,362	223.940	752,886.280	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	917	222.080	203,647.360	
HENRY SCHEIN INC	1,870	73.770	137,949.900	
HP INC	15,338	35.930	551,094.340	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	14,115	14.610	206,220.150	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	1,395	49.730	69,373.350	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	2,762	60.050	165,858.100	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,028	49.890	101,176.920	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	5,011	41.730	209,109.030	
KRAFT HEINZ CO/THE	8,390	34.780	291,804.200	
ENPHASE ENERGY INC	1,558	256.710	399,954.180	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	10,757	118.500	1,274,704.500	
INTERNATIONAL PAPER CO	4,047	47.220	191,099.340	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,500	102.960	154,440.000	
ZOETIS INC	5,648	223.550	1,262,610.400	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	2,908	192.930	561,040.440	
CHENIERE ENERGY INC	3,538	106.600	377,150.800	
ALLEGION PLC	1,110	128.680	142,834.800	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	5,108	27.920	142,615.360	
WASTE CONNECTIONS INC	3,431	137.190	470,698.890	
JUNIPER NETWORKS INC	4,912	31.840	156,398.080	
JM SMUCKER CO/THE	1,393	129.370	180,212.410	
JOHNSON & JOHNSON	31,789	159.750	5,078,292.750	
PLUG POWER INC	6,251	41.620	260,166.620	
ABBVIE INC	21,165	116.890	2,473,976.850	
HOLOGIC INC	3,042	75.970	231,100.740	
KIMBERLY-CLARK CORP	3,987	135.040	538,404.480	
KROGER CO	8,674	42.350	367,343.900	
KLA CORP	1,830	413.840	757,327.200	



LOCKHEED MARTIN CORP	2,982	341.230	1,017,547.860	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	976	212.980	207,868.480	
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	2,872	75.870	217,898.640	
LOWE'S COS INC	8,470	248.580	2,105,472.600	
ELI LILLY & CO	9,769	254.830	2,489,434.270	
LAM RESEARCH CORP	1,756	680.540	1,195,028.240	
LOEWS CORP	2,873	55.110	158,331.030	
LINCOLN NATIONAL CORP	2,643	68.340	180,622.620	
MCDONALD'S CORP	9,035	250.300	2,261,460.500	
3M CO	6,954	176.230	1,225,503.420	
META PLATFORMS INC CLASS A	28,943	338.030	9,783,602.290	
S&P GLOBAL INC	2,923	464.930	1,358,990.390	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	767	418.340	320,866.780	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	575	347.210	199,645.750	
PHILLIPS 66	5,107	69.860	356,775.020	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	5,659	41.130	232,754.670	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2,992	86.990	260,274.080	
METLIFE INC	9,065	59.890	542,902.850	
MARVELL TECHNOLOGY INC	10,485	75.020	786,584.700	
ARISTA NETWORKS INC	2,372	126.600	300,295.200	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	1,203	84.250	101,352.750	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,048	259.500	531,456.000	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	284	1,536.220	436,286.480	
BAKER HUGHES CO	8,446	23.530	198,734.380	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,460	340.580	497,246.800	
MERCK & CO. INC.	30,320	74.890	2,270,664.800	
DUPONT DE NEMOURS INC	6,657	77.040	512,855.280	
MASCO CORP	3,543	67.340	238,585.620	
M & T BANK CORP	1,371	152.160	208,611.360	
MARSH & MCLENNAN COS	6,048	167.030	1,010,197.440	
BLACK KNIGHT INC	1,644	73.140	120,242.160	
HEICO CORP-CLASS A	1,018	127.000	129,286.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	3,361	150.770	506,737.970	
WORKDAY INC-CLASS A	2,303	281.590	648,501.770	
WAYFAIR INC- CLASS A	880	267.510	235,408.800	
SQUARE INC - A	4,673	212.870	994,741.510	

TRANSUNION	2,293	114.130	261,700.090
VISTRA CORP	4,285	20.090	86,085.650
NOVOCURE LTD	1,054	93.350	98,390.900
NETAPP INC	2,703	91.520	247,378.560
NIKE INC -CL B	15,254	169.870	2,591,196.980
NORFOLK SOUTHERN CORP	2,993	268.740	804,338.820
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	6,646	84.400	560,922.400
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,623	100.570	263,795.110
ALLY FINANCIAL INC	5,094	47.710	243,034.740
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,835	356.390	653,975.650
APTIV PLC	3,232	165.490	534,863.680
NEWMONT CORP	9,252	55.400	512,560.800
MCKESSON CORP	1,850	223.270	413,049.500
XYLEM INC	1,972	123.800	244,133.600
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	18,791	87.350	1,641,393.850
NUCOR CORP	3,692	112.070	413,762.440
SUNRUN INC	1,500	47.860	71,790.000
WESTERN UNION CO	4,350	16.160	70,296.000
GODADDY INC - CLASS A	1,930	69.090	133,343.700
NEWELL BRANDS INC	4,058	22.350	90,696.300
EVERGY INC	2,654	65.260	173,200.040
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	10,238	30.060	307,754.280
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	269	204.190	54,927.110
OKTA INC	1,634	223.610	365,378.740
COUPA SOFTWARE INC	880	202.660	178,340.800
LIBERTY BROADBAND-C	1,878	159.940	300,367.320
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	4,877	30.190	147,236.630
LINDE PLC	5,729	320.740	1,837,519.460
WIX.COM LTD	785	159.370	125,105.450
EQUITABLE HOLDINGS INC	6,184	32.240	199,372.160
KKR & CO INC	6,489	76.310	495,175.590
PAYCHEX INC	3,657	123.730	452,480.610
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	838	644.150	539,797.700
ALTRIA GROUP INC	22,086	43.480	960,299.280
P G & E CORP	15,515	12.380	192,075.700
PFIZER INC	66,999	52.400	3,510,747.600
CIGNA CORP	4,086	199.610	815,606.460
DELL TECHNOLOGIES -C	3,276	57.570	188,599.320
ALTICE USA INC- A	4,147	15.990	66,310.530

XCEL ENERGY INC	6,528	65.590	428,171.520	
STERIS PLC	1,329	226.690	301,271.010	
SEA LTD-ADR	700	297.960	208,572.000	
FOX CORP - CLASS B	1,530	34.490	52,769.700	
FOX CORP - CLASS A	4,192	36.920	154,768.640	
STRYKER CORP	4,086	243.500	994,941.000	
LYFT INC-A	3,649	41.820	152,601.180	
DOW INC	8,718	56.860	495,705.480	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	1,508	97.300	146,728.400	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	2,723	218.980	596,282.540	
PARKER HANNIFIN CORP	1,538	309.140	475,457.320	
UBER TECHNOLOGIES INC	15,186	39.700	602,884.200	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,037	183.360	556,864.320	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	29,125	149.020	4,340,207.500	
EXELON CORP	11,882	54.170	643,647.940	
TELADOC HEALTH INC	1,985	106.410	211,223.850	
INGERSOLL-RAND INC	4,986	59.800	298,162.800	
NVR INC	45	5,281.730	237,677.850	
CONOCOPHILLIPS	16,766	72.150	1,209,666.900	
TWILIO INC - A	2,053	293.230	602,001.190	
DOCUSIGN INC	2,565	251.500	645,097.500	
PAYCOM SOFTWARE INC	601	447.430	268,905.430	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	1,470	112.970	166,065.900	
PEPSICO INC	16,768	164.140	2,752,299.520	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	409	176.960	72,376.640	
DROPBOX INC-CLASS A	5,414	24.950	135,079.300	
MONGODB INC	712	525.980	374,497.760	
SNAP INC - A	11,675	48.850	570,323.750	
CORTEVA INC	8,530	46.590	397,412.700	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,901	105.030	514,752.030	
AMCOR PLC	17,457	11.580	202,152.060	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	2,336	224.570	524,595.520	
ROKU INC	1,556	231.280	359,871.680	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,092	173.320	362,585.440	
ACCENTURE PLC-CL A	7,559	365.820	2,765,233.380	

10X GENOMICS INC-CLASS A	818	144.450	118,160.100
PENTAIR PLC	1,575	76.800	120,960.000
QUALCOMM INC	13,524	183.740	2,484,899.760
INVESCO LTD	3,700	23.240	85,988.000
ADVANCE AUTO PARTS INC	819	227.270	186,134.130
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,193	70.920	226,447.560
DATADOG INC - CLASS A	2,536	182.990	464,062.640
PINTEREST INC- CLASS A	7,735	40.540	313,576.900
AVALARA INC	1,257	142.700	179,373.900
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,261	654.400	825,198.400
REPUBLIC SERVICES INC	2,667	138.230	368,659.410
BOOKING HOLDINGS INC	501	2,182.010	1,093,187.010
ROSS STORES INC	4,110	111.660	458,922.600
PACKAGING CORP OF AMERICA	998	133.700	133,432.600
RESMED INC	1,660	256.920	426,487.200
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,558	156.700	244,138.600
ROBERT HALF INTL INC	1,499	114.760	172,025.240
MODERNA INC	4,239	368.510	1,562,113.890
HUBSPOT INC	564	851.910	480,477.240
PERKINELMER INC	1,163	185.220	215,410.860
CARRIER GLOBAL CORP	9,733	55.980	544,853.340
OTIS WORLDWIDE CORP	4,866	83.580	406,700.280
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	2,300	73.350	168,705.000
AVANTOR INC	6,686	39.780	265,969.080
CARLYLE GROUP INC/THE	1,476	56.800	83,836.800
DYNATRACE INC	2,339	64.470	150,795.330
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	5,400	107.060	578,124.000
REGIONS FINANCIAL CORP	10,825	23.540	254,820.500
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	1,476	41.340	61,017.840
IAC/INTERACTIVECORP	1,021	130.810	133,557.010
MATCH GROUP INC	3,162	134.080	423,960.960
CHEVRON CORP	23,190	114.850	2,663,371.500
PELOTON INTERACTIVE INC-A	3,174	44.390	140,893.860
ZSCALER INC	1,089	355.920	387,596.880
EDISON INTERNATIONAL	4,985	66.070	329,358.950
ETSY INC	1,662	281.480	467,819.760
TESLA INC	9,886	1,136.990	11,240,283.140
SNOWFLAKE INC-CLASS A	2,454	364.780	895,170.120

NORTONLIFELOCK INC	7,944	25.310	201,062.640	
DRAFTKINGS INC - CL A	4,134	35.200	145,516.800	
UNITY SOFTWARE INC	752	170.330	128,088.160	
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,895	184.150	348,964.250	
SYNOPSYS INC	1,776	355.870	632,025.120	
CARVANA CO	964	291.970	281,459.080	
CHEWY INC - CLASS A	856	68.660	58,772.960	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	2,934	191.090	560,658.060	
PPD INC	1,937	47.200	91,426.400	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,590	668.190	1,062,422.100	
VIATRIS INC	13,745	12.520	172,087.400	
DOORDASH INC - A	949	183.010	173,676.490	
AIRBNB INC-CLASS A	1,631	180.080	293,710.480	
CBRE GROUP INC - A	3,849	97.960	377,048.040	
TWITTER INC	9,599	45.780	439,442.220	
SOUTHERN CO/THE	12,564	62.820	789,270.480	
SYSCO CORP	6,160	73.200	450,912.000	
TRAVELERS COS INC/THE	2,958	152.400	450,799.200	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	600	50.490	30,294.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,925	61.520	118,426.000	
STEEL DYNAMICS INC	2,300	61.400	141,220.000	
SCHLUMBERGER LTD	17,899	29.650	530,705.350	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	2,026	57.900	117,305.400	
AT&T INC	85,556	23.890	2,043,932.840	
SOUTHWEST AIRLINES CO	1,758	44.540	78,301.320	
ON SEMICONDUCTOR CORP	5,554	63.020	350,013.080	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	2,595	93.480	242,580.600	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,057	334.280	1,021,893.960	
SEMPRA ENERGY	3,807	124.200	472,829.400	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	2,264	50.060	113,335.840	
CLARIVATE PLC	4,721	22.830	107,780.430	
OAK STREET HEALTH INC	1,654	30.670	50,728.180	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	19,770	21.070	416,553.900	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	2,606	104.060	271,180.360	
TEXAS INSTRUMENTS INC	10,981	194.380	2,134,486.780	
SALESFORCE.COM INC	11,624	296.740	3,449,305.760	
WESTROCK CO	2,618	46.120	120,742.160	

JOHNSON CONTROLS INTERNATION	8,322	78.360	652,111.920	
TERADYNE INC	2,096	154.450	323,727.200	
UNION PACIFIC CORP	8,074	239.460	1,933,400.040	
MARATHON PETROLEUM CORP	8,128	61.780	502,147.840	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	18,223	82.940	1,511,415.620	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	8,773	204.640	1,795,306.720	
IQVIA HOLDINGS INC	2,435	266.690	649,390.150	
VOYA FINANCIAL INC	1,800	62.250	112,050.000	
AMEREN CORPORATION	2,861	85.090	243,442.490	
UNITEDHEALTH GROUP INC	11,428	452.000	5,165,456.000	
VERISIGN INC	1,365	244.460	333,687.900	
VALERO ENERGY CORP	4,584	68.170	312,491.280	
ULTA BEAUTY INC	635	401.420	254,901.700	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	3,008	49.950	150,249.600	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	992	121.270	120,299.840	
ANTHEM INC	2,998	416.220	1,247,827.560	
WALT DISNEY CO/THE	21,761	147.810	3,216,493.410	
WELLS FARGO & CO	49,646	49.160	2,440,597.360	
WASTE MANAGEMENT INC	5,034	166.830	839,822.220	
WILLIAMS COS INC	14,542	28.010	407,321.420	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,393	226.700	315,793.100	
WHIRLPOOL CORP	870	222.780	193,818.600	
WALMART INC	18,485	142.630	2,636,515.550	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,492	123.500	307,762.000	
WYNN RESORTS LTD	1,145	83.000	95,035.000	
WABTEC CORP	1,898	92.470	175,508.060	
TJX COMPANIES INC	14,567	70.670	1,029,449.890	
WATERS CORP	760	341.220	259,327.200	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	650	607.200	394,680.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	8,695	46.080	400,665.600	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,452	230.390	334,526.280	
WESTERN DIGITAL CORP	3,531	58.990	208,293.690	
WEC ENERGY GROUP INC	4,189	90.490	379,062.610	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	5,855	64.250	376,183.750	
VISA INC-CLASS A SHARES	20,264	196.290	3,977,620.560	

PPL CORP	10,194	28.440	289,917.360	
PULTEGROUP INC	3,556	51.510	183,169.560	
PPG INDUSTRIES INC	2,834	157.360	445,958.240	
NORTHERN TRUST CORP	2,260	119.940	271,064.400	
NVIDIA CORP	30,067	333.760	10,035,161.920	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	5,160	200.880	1,036,540.800	
TYSON FOODS INC-CL A	3,322	81.880	272,005.360	
NETFLIX INC	5,301	663.840	3,519,015.840	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	4,690	648.770	3,042,731.300	
NRG ENERGY INC	3,000	36.630	109,890.000	
GLOBE LIFE INC	1,215	88.470	107,491.050	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,106	214.450	451,631.700	
TEXTRON INC	2,831	72.790	206,068.490	
NEWS CORP - CLASS A	3,749	21.820	81,803.180	
OMNICOM GROUP	2,546	67.470	171,778.620	
ORACLE CORP	22,574	92.940	2,098,027.560	
MASTERCARD INC - A	10,604	323.010	3,425,198.040	
ONEOK INC	5,526	62.460	345,153.960	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	11,062	12.950	143,252.900	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,269	481.480	610,998.120	
YUM! BRANDS INC	3,601	125.250	451,025.250	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	1,413	169.600	239,644.800	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	2,206	45.330	99,997.980	
BANK OF AMERICA CORP	92,634	45.590	4,223,184.060	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	622	431.880	268,629.360	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,838	87.400	248,041.200	
AMERICAN EXPRESS CO	8,172	157.860	1,290,031.920	
ANALOG DEVICES INC	6,480	183.200	1,187,136.000	
ADVANCED MICRO DEVICES	14,631	161.910	2,368,905.210	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	10,084	54.950	554,115.800	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,940	154.920	300,544.800	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,266	69.890	228,260.740	
AVERY DENNISON CORP	1,131	215.530	243,764.430	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	6,560	79.710	522,897.600	

EMERSON ELECTRIC CO	7,175	90.860	651,920.500	
AON PLC-CLASS A	2,711	296.690	804,326.590	
AMGEN INC	6,999	203.470	1,424,086.530	
EATON CORP PLC	5,056	167.380	846,273.280	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2,019	226.970	458,252.430	
APPLIED MATERIALS INC	10,956	151.220	1,656,766.320	
CME GROUP INC	4,290	225.330	966,665.700	
ECOLAB INC	3,106	227.150	705,527.900	
EQUIFAX INC	1,441	284.060	409,330.460	
GILEAD SCIENCES INC	14,898	70.650	1,052,543.700	
KEURIG DR PEPPER INC	9,236	35.170	324,830.120	
HORMEL FOODS CORP	3,315	42.490	140,854.350	
STATE STREET CORP	4,152	93.190	386,924.880	
SCHWAB (CHARLES) CORP	17,379	80.100	1,392,057.900	
BAXTER INTERNATIONAL INC	6,096	76.030	463,478.880	
CAMPBELL SOUP CO	2,166	41.200	89,239.200	
CROWN HOLDINGS INC	1,597	108.400	173,114.800	
CARDINAL HEALTH INC	3,319	47.470	157,552.930	
FEDEX CORP	2,979	240.570	716,658.030	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	5,487	147.020	806,698.740	
FMC CORP	1,360	103.540	140,814.400	
CERNER CORP	4,133	72.860	301,130.380	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,005	147.190	442,305.950	
CITRIX SYSTEMS INC	1,412	82.370	116,306.440	
INTEL CORP	48,345	50.000	2,417,250.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	5,231	34.020	177,958.620	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	4,866	68.610	333,856.260	
ILLINOIS TOOL WORKS	3,768	238.110	897,198.480	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	15,300	6.270	95,931.000	
ILLUMINA INC	1,787	370.810	662,637.470	
SEALED AIR CORP	1,450	64.200	93,090.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	4,255	334.740	1,424,318.700	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,330	111.110	147,776.300	
SNAP-ON INC	500	212.820	106,410.000	
CARMAX INC	1,990	146.480	291,495.200	
DUKE ENERGY CORP	9,133	100.220	915,309.260	
TARGET CORP	6,000	249.160	1,494,960.000	
DOVER CORP	1,713	171.800	294,293.400	



WW GRAINGER INC	588	495.580	291,401.040	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,750	146.090	255,657.500	
CINTAS CORP	1,162	434.730	505,156.260	
CONAGRA BRANDS INC	5,567	31.510	175,416.170	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	1,500	53.290	79,935.000	
CLOROX COMPANY	1,628	169.160	275,392.480	
ENTERGY CORP	2,243	105.070	235,672.010	
MICROSOFT CORP	86,366	336.630	29,073,386.580	
INCYTE CORP	2,689	70.370	189,224.930	
CVS HEALTH CORP	16,017	92.020	1,473,884.340	
MEDTRONIC PLC	16,174	110.280	1,783,668.720	
MICRON TECHNOLOGY INC	13,586	86.140	1,170,298.040	
BLACKROCK INC	1,834	928.000	1,701,952.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	5,636	26.590	149,861.240	
HASBRO INC	1,449	99.130	143,639.370	
KELLOGG CO	3,690	63.870	235,680.300	
KEYCORP	11,782	22.830	268,983.060	
KANSAS CITY SOUTHERN	1,176	296.190	348,319.440	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC- A	17,319	60.640	1,050,224.160	
COOPER COS INC/THE	647	381.190	246,629.930	
CHUBB LTD	5,452	185.040	1,008,838.080	
ARROW ELECTRONICS INC	1,000	124.420	124,420.000	
ALLSTATE CORP	3,477	113.140	393,387.780	
EBAY INC	8,308	70.550	586,129.400	
PAYPAL HOLDINGS INC	13,370	187.240	2,503,398.800	
EASTMAN CHEMICAL CO	1,492	110.180	164,388.560	
XILINX INC	2,892	233.080	674,067.360	
DISH NETWORK CORP-A	2,984	33.130	98,859.920	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,783	340.050	946,359.150	
TRIMBLE INC	2,938	86.530	254,225.140	
LENNAR CORP-A	3,394	107.250	364,006.500	
LEAR CORP	600	169.000	101,400.000	
PROGRESSIVE CORP	6,980	94.970	662,890.600	
PACCAR INC	4,170	86.120	359,120.400	
BIOGEN INC	1,948	236.110	459,942.280	
IDEXX LABORATORIES INC	1,024	631.300	646,451.200	
STARBUCKS CORP	14,274	110.730	1,580,560.020	

	PTC INC	1,200	110.320	132,384.000	
	EVERSOURCE ENERGY	4,290	85.270	365,808.300	
	INTUIT INC	3,263	694.660	2,266,675.580	
	BORGLWARNER INC	3,081	44.810	138,059.610	
	BEST BUY CO INC	2,987	110.950	331,407.650	
	BALL CORP	3,860	94.810	365,966.600	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	17,149	38.590	661,779.910	
	ELECTRONIC ARTS INC	3,677	124.880	459,183.760	
	VULCAN MATERIALS CO	1,606	199.350	320,156.100	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3,207	190.110	609,682.770	
	VF CORP	4,216	73.730	310,845.680	
	VIACOMCBS INC - CLASS B	7,202	32.280	232,480.560	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	628	174.380	109,510.640	
	CARNIVAL CORP	9,986	18.160	181,345.760	
	COMCAST CORP-CLASS A	54,820	51.530	2,824,874.600	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	1,600	58.370	93,392.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	23,100	5.560	128,436.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 497,667,170.280 (56,619,593,962)	
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	3.277	822,792.430	
	UNILEVER PLC	31,426	39.210	1,232,213.460	
	BARCLAYS PLC	203,715	1.832	373,368.850	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	103,103	1.225	126,301.170	
	PRUDENTIAL PLC	31,421	12.945	406,744.840	
	NATWEST GROUP PLC	82,339	2.104	173,241.250	
	EVRAZ PLC	7,441	5.720	42,562.520	
	JOHNSON MATTHEY PLC	1,758	21.330	37,498.140	
	BAE SYSTEMS PLC	37,796	5.498	207,802.400	
	AVIVA PLC	51,081	3.782	193,188.340	
	AVEVA GROUP PLC	1,140	32.200	36,708.000	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	60,542	15.250	923,265.500	
	INFORMA PLC	16,200	4.740	76,788.000	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	57,901	1.460	84,564.410	
	AUTO TRADER GROUP PLC	14,499	7.324	106,190.670	
	DCC PLC	938	56.340	52,846.920	
	OCADO GROUP PLC	6,234	18.340	114,331.560	

SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	740	158.400	117,216.000	
HALMA PLC	3,978	30.290	120,493.620	
ENTAIN PLC	7,337	17.460	128,104.020	
JD SPORTS FASHION PLC	6,411	11.415	73,181.560	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	10,888	6.440	70,118.720	
M&G PLC	25,964	1.903	49,422.470	
RELX PLC	24,203	23.430	567,076.290	
DIAGEO PLC	27,910	38.235	1,067,138.850	
RIO TINTO PLC	13,627	46.215	629,771.800	
STANDARD CHARTERED PLC	31,951	4.142	132,341.040	
TESCO PLC	86,791	2.790	242,146.890	
SMITH & NEPHEW PLC	11,297	12.400	140,082.800	
GLENCORE PLC	129,226	3.571	461,530.650	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,200	13.415	42,928.000	
SMITHS GROUP PLC	4,080	14.560	59,404.800	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	16,879	2.672	45,100.680	
PEARSON PLC	8,271	6.146	50,833.560	
SAINSBURY (J) PLC	17,631	2.897	51,077.000	
NEXT PLC	1,685	79.620	134,159.700	
TAYLOR WIMPEY PLC	32,236	1.555	50,126.980	
WHITBREAD PLC	1,785	28.750	51,318.750	
BUNZL PLC	3,159	28.670	90,568.530	
VODAFONE GROUP PLC	363,521	1.101	400,309.320	
CRODA INTERNATIONAL PLC	1,749	100.650	176,036.850	
KINGFISHER PLC	17,229	3.260	56,166.540	
WPP PLC	13,021	10.605	138,087.700	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	8,244	10.885	89,735.940	
SEVERN TRENT PLC	3,327	29.070	96,715.890	
RENTOKIL INITIAL PLC	22,242	6.186	137,589.010	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	8,677	61.640	534,850.280	
ST JAMES'S PLACE PLC	4,883	15.625	76,296.870	
SCHROEDERS PLC	1,227	35.170	43,153.590	
SSE PLC	12,460	15.580	194,126.800	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	12,368	6.928	85,685.500	
ASTRAZENECA PLC	18,618	83.670	1,557,768.060	
FERGUSON PLC	2,724	115.550	314,758.200	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	68,232	2.849	194,392.960	
3I GROUP PLC	13,293	13.880	184,506.840	

	ASSTEAD GROUP PLC	5,921	61.300	362,957.300	
	SAGE GROUP PLC/THE	11,548	7.770	89,727.960	
	NATIONAL GRID PLC	45,105	10.012	451,591.260	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	865,213	0.468	404,919.680	
	IMPERIAL BRANDS PLC	10,806	15.630	168,897.780	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	1,812	43.250	78,369.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	25,815	25.560	659,831.400	
	BHP GROUP PLC	26,934	20.190	543,797.460	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,964	19.070	94,663.480	
	HSBC HOLDINGS PLC	244,846	4.164	1,019,661.160	
	ANGLO AMERICAN PLC	16,885	26.835	453,108.970	
	MONDI PLC	5,921	17.480	103,499.080	
	COMPASS GROUP PLC	21,992	15.220	334,718.240	
	PERSIMMON PLC	2,688	27.590	74,161.920	
	BT GROUP PLC	102,757	1.634	167,904.930	
	COCA-COLA HBC AG-DI	2,574	23.530	60,566.220	
	BURBERRY GROUP PLC	5,136	17.950	92,191.200	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	2,268	46.000	104,328.000	
	INTERTEK GROUP PLC	1,897	54.800	103,955.600	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	3,750	68.700	257,625.000	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	51,812	15.948	826,297.770	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	44,623	15.940	711,290.620	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2,039	22.300	45,469.700	
	ADMIRAL GROUP PLC	1,570	30.130	47,304.100	
	ANTOFAGASTA PLC	3,460	13.980	48,370.800	
	ABRDN PLC	33,046	2.358	77,922.460	
	EXPERIAN PLC	11,347	33.830	383,869.010	
	イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 21,431,731.620 (3,248,193,244)	
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	19.750	237,000.000	
	AZRIELI GROUP LTD	530	290.900	154,177.000	
	ICL GROUP LTD	11,096	28.520	316,457.920	
	ELBIT SYSTEMS LTD	300	471.000	141,300.000	

	BANK HAPOALIM BM	15,160	30.740	466,018.400	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	19,043	31.040	591,094.720	
	NICE LTD	800	884.700	707,760.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,883	117.100	220,499.300	
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル 2,834,307.340 (102,066,808)	
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	3.360	76,688.640	
	BHP GROUP LTD	36,548	38.570	1,409,656.360	
	SOUTH32 LTD	56,387	3.570	201,301.590	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	10,576	21.240	224,634.240	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	20,554	17.600	361,750.400	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	41,983	27.200	1,141,937.600	
	WESTPAC BANKING CORP	44,270	20.920	926,128.400	
	SANTOS LTD	18,270	6.390	116,745.300	
	AUSNET SERVICES	28,500	2.520	71,820.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	35,190	26.620	936,757.800	
	RIO TINTO LTD	4,169	95.390	397,680.910	
	ORIGIN ENERGY LTD	20,968	4.920	103,162.560	
	AURIZON HOLDINGS LTD	29,047	3.410	99,050.270	
	XERO LTD	1,426	141.210	201,365.460	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	953	31.110	29,647.830	
	COLES GROUP LTD	16,696	18.030	301,028.880	
	WISETECH GLOBAL LTD	2,509	51.810	129,991.290	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	14,832	9.660	143,277.120	
	EVOLUTION MINING LTD	17,017	4.120	70,110.040	
	AFTERPAY LTD	3,000	110.550	331,650.000	
	REECE LTD	6,358	23.460	149,158.680	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	13,906	6.850	95,256.100	
	OIL SEARCH LTD	17,345	3.910	67,818.950	
	SEEK LTD	2,600	34.300	89,180.000	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	10,173	11.920	121,262.160	
	NEWCREST MINING LTD	11,981	24.180	289,700.580	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	21,856	93.780	2,049,655.680	
	AMPOL LTD	2,000	28.930	57,860.000	

	ORICA LTD	5,845	14.380	84,051.100	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	15,348	11.600	178,036.800	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	15,779	40.100	632,737.900	
	TABCORP HOLDINGS LTD	17,352	4.990	86,586.480	
	CROWN RESORTS LTD	3,000	11.100	33,300.000	
	QANTAS AIRWAYS LTD	6,373	4.900	31,227.700	
	TELSTRA CORP LTD	35,114	4.000	140,456.000	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	5,826	54.930	320,022.180	
	MACQUARIE GROUP LTD	4,277	194.010	829,780.770	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	6,462	44.590	288,140.580	
	CSL LTD	5,550	307.000	1,703,850.000	
	WESFARMERS LTD	13,798	58.210	803,181.580	
	COCHLEAR LTD	805	226.670	182,469.350	
	BLUESCOPE STEEL LTD	7,092	20.330	144,180.360	
	SUNCORP GROUP LTD	14,504	10.650	154,467.600	
	ASX LTD	2,260	91.020	205,705.200	
	COMPUTERSHARE LTD	6,054	19.140	115,873.560	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	27,097	4.370	118,413.890	
	SONIC HEALTHCARE LTD	5,223	42.700	223,022.100	
	AGL ENERGY LTD	8,466	5.330	45,123.780	
	BRAMBLES LTD	18,337	10.100	185,203.700	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,064	66.200	136,636.800	
	REA GROUP LTD	608	161.000	97,888.000	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	1,551	32.630	50,609.130	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,288	130.170	167,658.960	
	オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 17,152,900.360 (1,394,359,270)	
カナダ・ドル	株		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	IMPERIAL OIL LTD	2,300	42.850	98,555.000	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	250	2,205.320	551,330.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERN	3,721	72.960	271,484.160	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	6,300	53.950	339,885.000	
	INTACT FINANCIAL CORP	2,379	161.360	383,875.440	
	BCE INC	900	64.860	58,374.000	
	FRANCO-NEVADA CORP	2,200	179.960	395,912.000	
	SUNCOR ENERGY INC	17,348	31.950	554,268.600	

METRO INC/CN	3,000	62.150	186,450.000	
NATIONAL BANK OF CANADA	3,941	101.870	401,469.670	
BANK OF NOVA SCOTIA	15,075	81.430	1,227,557.250	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	5,700	145.590	829,863.000	
TORONTO-DOMINION BANK	21,760	93.590	2,036,518.400	
GREAT-WEST LIFECO INC	3,900	37.450	146,055.000	
ROYAL BANK OF CANADA	17,086	129.730	2,216,566.780	
TC ENERGY CORP	12,144	61.020	741,026.880	
PEMBINA PIPELINE CORP	6,375	38.550	245,756.250	
BARRICK GOLD CORP	21,848	24.430	533,746.640	
CAE INC	2,300	31.540	72,542.000	
THOMSON REUTERS CORP	2,284	156.000	356,304.000	
EMPIRE CO LTD 'A'	1,800	37.110	66,798.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,034	106.730	110,358.820	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	3,206	19.570	62,741.420	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,560	63.460	98,997.600	
HYDRO ONE LTD	4,800	31.120	149,376.000	
LOBLAW COMPANIES LTD	2,489	96.860	241,084.540	
NORTHLAND POWER INC	3,003	38.840	116,636.520	
WSP GLOBAL INC	1,200	181.840	218,208.000	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	974	110.940	108,055.560	
PARKLAND CORP	2,800	34.170	95,676.000	
QUEBECOR INC -CL B	2,300	29.000	66,700.000	
EMERA INC	2,731	59.350	162,084.850	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	1,000	35.300	35,300.000	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	4,306	57.720	248,542.320	
IVANHOE MINES LTD-CL A	14,261	10.330	147,316.130	
AGNICO EAGLE MINES LTD	2,900	64.600	187,340.000	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	7,000	17.540	122,780.000	
B2GOLD CORP	16,400	5.120	83,968.000	
AIR CANADA	1,700	21.300	36,210.000	
KINROSS GOLD CORP	14,757	7.700	113,628.900	
BANK OF MONTREAL	7,855	137.010	1,076,213.550	
POWER CORP OF CANADA	6,300	41.830	263,529.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	1,356	2,000.000	2,712,000.000	
NUTRIEN LTD	6,906	87.260	602,617.560	
CANOPY GROWTH CORP	2,000	14.090	28,180.000	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	3,193	50.920	162,587.560	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	1,532	47.720	73,107.040	

CAMECO CORP	2,800	31.830	89,124.000	
FIRSTSERVICE CORP	422	253.080	106,799.760	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	2,405	51.180	123,087.900	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	1,560	68.160	106,329.600	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	1,000	122.830	122,830.000	
TELUS CORP	600	29.490	17,694.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	4,400	33.890	149,116.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	743	174.050	129,319.150	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	15,200	53.430	812,136.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	300	566.740	170,022.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,693	100.370	370,666.410	
WESTON (GEORGE) LTD	901	136.480	122,968.480	
PAN AMERICAN SILVER CORP	1,218	32.620	39,731.160	
BLACKBERRY LTD	6,400	12.560	80,384.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	7,266	68.670	498,956.220	
ENBRIDGE INC	24,695	48.740	1,203,634.300	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	15,913	73.870	1,175,493.310	
MANULIFE FINANCIAL CORP	22,184	23.920	530,641.280	
BAUSCH HEALTH COS INC	4,300	31.790	136,697.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	8,045	91.440	735,634.800	
IA FINANCIAL CORP INC	1,100	69.880	76,868.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	2,800	53.280	149,184.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	8,793	163.760	1,439,941.680	
CGI INC - CLASS A	2,800	107.430	300,804.000	
ONEX CORPORATION	1,600	95.610	152,976.000	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	6,800	37.240	253,232.000	
IGM FINANCIAL INC	300	48.870	14,661.000	
TMX GROUP LTD	794	128.610	102,116.340	
OPEN TEXT CORP	3,210	62.040	199,148.400	
SAPUTO INC	2,900	28.980	84,042.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	6,300	28.070	176,841.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	10,013	47.510	475,717.630	
YAMANA GOLD INC	11,900	5.160	61,404.000	
FORTIS INC	6,200	55.960	346,952.000	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	1,355	88.660	120,134.300	
LUNDIN MINING CORP	6,600	10.420	68,772.000	



	CENOVUS ENERGY INC	14,100	15.860	223,626.000	
	DOLLARAMA INC	3,529	56.410	199,070.890	
	ATCO LTD -CLASS I	800	42.540	34,032.000	
	ALTAGAS LTD	4,700	24.940	117,218.000	
	KEYERA CORP	2,200	28.790	63,338.000	
カナダ・ドル 小計				カナダ・ドル 30,418,922.050 (2,715,192,982)	
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	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD	33,400	3.370	112,558.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	15,900	26.530	421,827.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	21,300	30.790	655,827.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	17,750	4.910	87,152.500	
	KEPPEL CORP LTD	17,300	5.210	90,133.000	
	UOL GROUP LTD	3,000	6.870	20,610.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	5,200	7.000	36,400.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	44,700	11.340	506,898.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	45,000	0.790	35,550.000	
	VENTURE CORP LTD	3,200	18.810	60,192.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	128,400	2.410	309,444.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	14,100	3.840	54,144.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	11,800	9.230	108,914.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	15,800	4.190	66,202.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 2,565,851.500 (213,504,504)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	UBS GROUP AG-REG	42,554	15.755	670,438.270	
	ROCHE HOLDING AG-BR	280	383.000	107,240.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	130	890.000	115,700.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	1,754	43.740	76,719.960	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	8,388	357.500	2,998,710.000	
	SIKA AG-REG	1,690	363.700	614,653.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	112,300.000	112,300.000	
	ABB LTD-REG	21,074	31.940	673,103.560	
	SWISS RE AG	3,666	86.660	317,695.560	

NESTLE SA-REG	34,292	120.100	4,118,469.200	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	287	1,575.000	452,025.000	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	489	240.300	117,506.700	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	30,122	8.866	267,061.650	
JULIUS BAER GROUP LTD	2,684	57.180	153,471.120	
SGS SA-REG	65	2,846.000	184,990.000	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	467	234.000	109,278.000	
VIFOR PHARMA AG	665	105.200	69,958.000	
TEMENOS AG - REG	793	121.300	96,190.900	
ALCON INC	5,853	73.080	427,737.240	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	500	273.200	136,600.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,792	381.800	684,185.600	
BALOISE HOLDING AG - REG	611	138.300	84,501.300	
CLARIANT AG-REG	1,568	18.110	28,396.480	
NOVARTIS AG-REG	26,942	74.240	2,000,174.080	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	56	2,210.000	123,760.000	
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	6,087	138.900	845,484.300	
SWISSCOM AG-REG	276	513.400	141,698.400	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS- REG	784	70.800	55,507.200	
GEBERIT AG-REG	456	698.000	318,288.000	
GIVAUDAN-REG	113	4,524.000	511,212.000	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	111	1,945.000	215,895.000	
SONOVA HOLDING AG-REG	672	344.200	231,302.400	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	2,165	75.440	163,327.600	
LONZA GROUP AG-REG	913	730.400	666,855.200	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	450	53.050	23,872.500	
HOLCIM LTD	6,587	45.480	299,576.760	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	381	524.600	199,872.600	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	640	266.100	170,304.000	
SWISS PRIME SITE-REG	946	88.600	83,815.600	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	14	11,330.000	158,620.000	
スイス・フラン 小計			スイス・フラン 18,826,497.180 (2,320,365,777)	
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	1,297	534.200	692,857.400	
ERICSSON LM-B SHS	38,464	93.820	3,608,692.480	

VOLVO AB-B SHS	18,873	198.320	3,742,893.360	
SKF AB-B SHARES	4,000	210.300	841,200.000	
ELECTROLUX AB-SER B	2,600	203.700	529,620.000	
SWEDISH MATCH AB	21,880	66.980	1,465,522.400	
TELE2 AB-B SHS	7,026	131.150	921,459.900	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN- A	21,779	131.500	2,863,938.500	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	15,482	96.340	1,491,535.880	
SWEDBANK AB - A SHARES	10,821	183.560	1,986,302.760	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	10,352	162.620	1,683,442.240	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	8,201	150.700	1,235,890.700	
SKANSKA AB-B SHS	3,709	210.300	780,002.700	
SANDVIK AB	14,657	229.400	3,362,315.800	
INVESTOR AB-B SHS	21,928	211.850	4,645,446.800	
ATLAS COPCO AB-A SHS	8,575	557.600	4,781,420.000	
VOLVO AB-A SHS	3,923	202.000	792,446.000	
SECURITAS AB-B SHS	2,500	132.950	332,375.000	
TELIA CO AB	36,421	35.375	1,288,392.870	
ALFA LAVAL AB	4,840	361.600	1,750,144.000	
ATLAS COPCO AB-B SHS	4,813	475.300	2,287,618.900	
ASSA ABLOY AB-B	12,635	259.000	3,272,465.000	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	1,638	275.000	450,450.000	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	1,988	684.800	1,361,382.400	
LUNDBERGS AB-B SHS	948	507.800	481,394.400	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	924	341.900	315,915.600	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	16,716	127.100	2,124,603.600	
LUNDIN ENERGY AB	1,900	338.700	643,530.000	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	7,260	292.400	2,122,824.000	
EMBRACER GROUP AB	7,090	95.080	674,117.200	
BOLIDEN AB	3,171	306.400	971,594.400	
EPIROC AB-A	8,660	218.200	1,889,612.000	
EPIROC AB-B	4,015	180.500	724,707.500	
HUSQVARNA AB-B SHS	5,400	131.450	709,830.000	
NORDEA BANK ABP	45,291	107.240	4,857,006.840	
EQT AB	2,960	531.400	1,572,944.000	
EVOLUTION AB	2,064	1,003.400	2,071,017.600	
SINCH AB	6,400	123.550	790,720.000	
KINNEVIK AB - B	3,641	328.550	1,196,250.550	
HEXAGON AB-B SHS	27,076	133.500	3,614,646.000	

	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	1,300	271.500	352,950.000	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 71,281,478.780 (893,156,929)	
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	21,344	715.700	15,275,900.800	
	DANSKE BANK A/S	7,236	109.700	793,789.200	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	39	18,520.000	722,280.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	12,785	221.500	2,831,877.500	
	GN STORE NORD A/S	1,159	385.600	446,910.400	
	CARLSBERG AS-B	1,232	1,063.000	1,309,616.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	2,981	488.600	1,456,516.600	
	COLOPLAST-B	1,519	1,074.500	1,632,165.500	
	DSV PANALPINA A/S	2,580	1,427.500	3,682,950.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	143	2,743.000	392,249.000	
	DEMANT A/S	1,314	314.600	413,384.400	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	66	19,660.000	1,297,560.000	
	TRYG A/S	4,594	158.250	727,000.500	
	PANDORA A/S	1,325	843.000	1,116,975.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,262	492.100	621,030.200	
	GENMAB A/S	919	2,550.000	2,343,450.000	
	ORSTED A/S	2,246	846.200	1,900,565.200	
	AMBU A/S-B	2,091	191.000	399,381.000	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 37,363,601.300 (645,269,395)	
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	4.490	67,350.000	
	MERCURY NZ LTD	3,294	5.850	19,269.900	
	A2 MILK CO LTD	7,000	6.200	43,400.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	16,860	4.355	73,425.300	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	13,289	7.785	103,454.860	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	9,200	33.000	303,600.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	4,419	12.100	53,469.900	
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル	

				663,969.960	
				(51,477,591)	
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	
	DNB BANK	12,838	201.800	2,590,708.400	
	NORSK HYDRO ASA	13,050	60.500	789,525.000	
	ORKLA ASA	7,483	84.100	629,320.300	
	TELENOR ASA	8,746	137.900	1,206,073.400	
	EQUINOR ASA	14,248	227.150	3,236,433.200	
	SCHIBSTED ASA-CL A	1,712	410.400	702,604.800	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,756	445.400	1,227,522.400	
	MOWI ASA	4,677	210.400	984,040.800	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,000	207.300	414,600.000	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	1,700	358.000	608,600.000	
	ADEVINTA ASA	4,582	131.950	604,594.900	
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 12,994,023.200 (163,854,633)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	8,930	25.010	223,339.300	
	BAYER AG-REG	11,583	45.320	524,941.560	
	EVONIK INDUSTRIES AG	1,800	26.700	48,060.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	25,558	10.678	272,908.320	
	COMMERZBANK AG	9,689	6.235	60,410.910	
	VOLKSWAGEN AG	420	255.400	107,268.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	2,272	164.520	373,789.440	
	SIEMENS AG-REG	9,095	144.560	1,314,773.200	
	E.ON SE	30,006	10.992	329,825.950	
	UNIPER SE	2,066	38.680	79,912.880	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	3,729	85.780	319,873.620	
	GEA GROUP AG	1,300	44.570	57,941.000	
	CONTINENTAL AG	1,474	93.250	137,450.500	
	BASF SE	11,283	57.980	654,188.340	
	ALLIANZ SE-REG	5,014	192.080	963,089.120	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	2,141	71.100	152,225.100	
	RWE AG	7,526	35.020	263,560.520	
	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,700	5.501	9,351.700	
	BRENNTAG SE	2,121	76.340	161,917.140	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	4,835	33.780	163,326.300	

UNITED INTERNET AG-REG SHARE	959	33.020	31,666.180	
SAP SE	12,283	116.800	1,434,654.400	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,704	239.100	407,426.400	
ZALANDO SE	2,856	81.500	232,764.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	2,128	59.620	126,871.360	
KION GROUP AG	600	93.900	56,340.000	
COVESTRO AG	1,945	50.680	98,572.600	
RATIONAL AG	74	811.600	60,058.400	
SARTORIUS AG-VORZUG	388	580.000	225,040.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	2,102	75.000	157,650.000	
DELIVERY HERO SE	2,148	119.300	256,256.400	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	560	177.500	99,400.000	
BECHTLE AG	819	63.240	51,793.560	
NEMETSCHKE SE	1,139	107.550	122,499.450	
SCOUT24 AG	1,460	59.760	87,249.600	
AROWNTOWN SA	16,064	5.520	88,673.280	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	2,894	64.460	186,547.240	
KNORR-BREMSE AG	1,357	90.440	122,727.080	
HELLOFRESH SE	1,814	94.500	171,423.000	
TEAMVIEWER AG	1,461	12.350	18,043.350	
SIEMENS ENERGY AG	4,732	24.090	113,993.880	
BEIERSDORF AG	1,275	89.260	113,806.500	
FUCHS PETROLUB PREF	700	39.800	27,860.000	
MERCK KGAA	1,692	219.600	371,563.200	
ADIDAS AG	2,188	254.300	556,408.400	
PUMA SE	1,295	106.350	137,723.250	
HENKEL AG & CO KGAA	1,311	66.800	87,574.800	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	41,135	16.040	659,805.400	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	2,561	53.520	137,064.720	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	10,110	82.800	837,108.000	
QIAGEN N.V.	2,521	49.230	124,108.830	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	15,510	40.220	623,812.200	
HANNOVER RUECK SE	644	155.500	100,142.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	11,691	53.580	626,403.780	
DEUTSCHE BOERSE AG	2,404	142.200	341,848.800	
LANXESS AG	1,529	51.240	78,345.960	
MTU AERO ENGINES AG	666	167.650	111,654.900	

SYMRISE AG	1,656	125.900	208,490.400
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	6,240	2.357	14,707.680
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	900	70.500	63,450.000
VONOVIA SE	6,249	49.170	307,263.330
LEG IMMOBILIEN SE	1,073	124.150	133,212.950
KONINKLIJKE PHILIPS NV	11,420	31.745	362,527.900
NN GROUP NV	3,100	43.890	136,059.000
ARCELORMITTAL	8,031	24.440	196,277.640
HEINEKEN NV	3,123	93.440	291,813.120
AEGON NV	17,967	3.939	70,772.010
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	12,130	30.255	366,993.150
AKZO NOBEL N.V.	2,504	94.460	236,527.840
KONINKLIJKE DSM NV	2,230	191.800	427,714.000
WOLTERS KLUWER	3,300	100.300	330,990.000
ING GROEP NV	45,601	12.158	554,416.950
KONINKLIJKE KPN NV	37,607	2.619	98,492.730
ASML HOLDING NV	4,916	704.800	3,464,796.800
ABN AMRO BANK NV-CVA	4,030	12.672	51,068.160
ADYEN NV	225	2,460.500	553,612.500
JUST EAT TAKEAWAY	2,381	58.150	138,455.150
PROSUS NV	11,299	70.680	798,613.320
JDE PEET'S NV	1,476	25.050	36,973.800
INPOST SA	3,182	10.312	32,812.780
ASM INTERNATIONAL NV	602	396.400	238,632.800
VOPAK	630	33.180	20,903.400
RANDSTAD NV	2,020	56.100	113,322.000
HEINEKEN HOLDING NV	1,285	77.300	99,330.500
TOTALENERGIES SE	29,962	41.200	1,234,434.400
MICHELIN (CGDE)	2,146	128.350	275,439.100
AIR LIQUIDE SA	5,759	147.360	848,646.240
KERING	888	683.800	607,214.400
SCHNEIDER ELECTRIC SE	6,338	151.240	958,559.120
BOUYGUES SA	2,721	29.910	81,385.110
BNP PARIBAS	13,400	55.380	742,092.000
THALES SA	1,404	73.880	103,727.520
DANONE	7,551	54.330	410,245.830

CARREFOUR SA	8,022	15.170	121,693.740	
SUEZ	2,950	19.770	58,321.500	
VIVENDI	8,930	11.200	100,016.000	
L'OREAL	2,956	401.800	1,187,720.800	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	6,975	57.240	399,249.000	
LEGRAND SA	3,459	95.780	331,303.020	
PERNOD RICARD SA	2,544	206.600	525,590.400	
EURAZEO SE	560	73.450	41,132.000	
SOCIETE GENERALE SA	11,065	27.485	304,121.520	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	3,337	697.200	2,326,556.400	
ACCOR SA	1,850	26.670	49,339.500	
CAPGEMINI SE	1,981	201.900	399,963.900	
VALEO SA	3,703	24.570	90,982.710	
PUBLICIS GROUPE	2,918	57.960	169,127.280	
BUREAU VERITAS SA	3,227	28.310	91,356.370	
EIFFAGE	945	82.320	77,792.400	
SODEXO SA	1,248	75.140	93,774.720	
IPSEN	276	86.780	23,951.280	
ORPEA	524	83.600	43,806.400	
AMUNDI SA	437	75.050	32,796.850	
TELEPERFORMANCE	701	357.400	250,537.400	
UBISOFT ENTERTAINMENT	977	44.890	43,857.530	
FAURECIA	1,041	37.140	38,662.740	
EUROFINS SCIENTIFIC	1,480	112.980	167,210.400	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	399	513.200	204,766.800	
SEB SA	216	133.300	28,792.800	
ESSILORLUXOTTICA	3,506	180.380	632,412.280	
DASSAULT AVIATION SA	220	84.450	18,579.000	
WORLDLINE SA	3,135	47.470	148,818.450	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	878	41.830	36,726.740	
AXA SA	24,318	24.235	589,346.730	
EDENRED	3,007	40.500	121,783.500	
RENAULT SA	2,554	29.145	74,436.330	
HERMES INTERNATIONAL	405	1,640.000	664,200.000	
STMICROELECTRONICS NV	8,575	43.025	368,939.370	
REMY COINTREAU	253	213.400	53,990.200	
ATOS SE	946	37.360	35,342.560	
DASSAULT SYSTEMES SE	8,165	53.430	436,255.950	



WENDEL	555	103.500	57,442.500	
ORANGE	25,792	9.604	247,706.360	
ALSTOM	5,106	32.370	165,281.220	
CNP ASSURANCES	1,349	21.580	29,111.420	
SANOFI	13,326	85.610	1,140,838.860	
VINCI SA	6,438	84.160	541,822.080	
AIRBUS SE	6,981	99.690	695,935.890	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	7,351	28.240	207,592.240	
CREDIT AGRICOLE SA	14,609	12.132	177,236.380	
BIOMERIEUX	457	127.350	58,198.950	
ENGIE	21,099	12.894	272,050.500	
EDF	6,760	12.345	83,452.200	
SAFRAN SA	3,931	101.600	399,389.600	
ARKEMA	838	116.000	97,208.000	
ADP	350	104.400	36,540.000	
SCOR SE	1,535	26.700	40,984.500	
GETLINK SE	4,973	12.895	64,126.830	
BOLLORE	7,300	4.766	34,791.800	
UCB SA	1,921	97.040	186,413.840	
KBC GROUP NV	3,011	72.580	218,538.380	
COLRUYT SA	350	41.350	14,472.500	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,139	96.820	110,277.980	
SOLVAY SA	873	99.220	86,619.060	
UMICORE	2,270	43.070	97,768.900	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	8,926	50.840	453,797.840	
AGEAS	1,654	46.310	76,596.740	
PROXIMUS	2,269	16.030	36,372.070	
ELIA GROUP SA/NV	700	109.100	76,370.000	
SOFINA	239	406.800	97,225.200	
ARGENX SE	516	250.900	129,464.400	
PRYSMIAN SPA	4,145	33.290	137,987.050	
ASSICURAZIONI GENERALI	12,944	17.800	230,403.200	
MEDIOBANCA SPA	9,971	9.724	96,958.000	
TENARIS SA	4,700	8.922	41,933.400	
UNICREDIT SPA	29,471	10.570	311,508.470	
TELECOM ITALIA SPA	108,503	0.471	51,115.760	
TELECOM ITALIA-RSP	48,381	0.445	21,553.730	
INTESA SANPAOLO	191,098	2.143	409,523.010	
ATLANTIA SPA	6,027	16.160	97,396.320	

POSTE ITALIANE SPA	7,727	11.195	86,503.760	
MONCLER SPA	2,435	64.600	157,301.000	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	1,285	54.960	70,623.600	
ENI SPA	28,190	11.800	332,642.000	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	8,500	13.085	111,222.500	
DIASORIN SPA	277	185.100	51,272.700	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	2,414	10.275	24,803.850	
NEXI SPA	8,078	13.795	111,436.010	
AMPLIFON SPA	1,750	42.760	74,830.000	
ENEL SPA	98,337	6.789	667,609.890	
SNAM SPA	24,300	4.997	121,427.100	
TERNA SPA	19,900	6.496	129,270.400	
EXOR NV	1,088	78.880	85,821.440	
CNH INDUSTRIAL NV	11,691	14.945	174,721.990	
FINECOBANK SPA	5,972	15.555	92,894.460	
STELLANTIS NV	24,803	15.568	386,133.100	
FERRARI NV	1,722	235.800	406,047.600	
TELEFONICA SA	75,491	3.961	299,057.590	
ENDESA SA	3,760	20.150	75,764.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	83,583	4.802	401,407.350	
IBERDROLA SA	72,039	9.916	714,338.720	
REPSOL SA	17,685	9.912	175,293.720	
GRIFOLS SA	2,795	16.730	46,760.350	
BANCO SANTANDER SA	207,370	2.783	577,214.390	
AMADEUS IT GROUP SA	5,400	58.080	313,632.000	
NATURGY ENERGY GROUP SA	3,978	24.630	97,978.140	
CAIXABANK SA	46,859	2.287	107,166.530	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	3,583	21.540	77,177.820	
AENA SME SA	866	129.350	112,017.100	
CELLNEX TELECOM SA	6,512	53.240	346,698.880	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	12,417	29.670	368,412.390	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	3,293	23.480	77,319.640	
ENAGAS SA	3,675	20.120	73,941.000	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	5,147	18.520	95,322.440	
FERROVIAL SA	6,055	25.100	151,980.500	

	UPM-KYMMENE OYJ	6,525	32.700	213,367.500	
	NOKIA OYJ	65,261	5.019	327,544.950	
	WARTSILA OYJ ABP	4,116	12.335	50,770.860	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	8,853	15.440	136,690.320	
	ELISA OYJ	1,734	53.280	92,387.520	
	SAMPO OYJ-A SHS	6,809	43.060	293,195.540	
	FORTUM OYJ	4,400	25.560	112,464.000	
	KESKO OYJ-B SHS	4,245	27.970	118,732.650	
	KONE OYJ-B	3,796	59.160	224,571.360	
	NESTE OYJ	5,778	42.980	248,338.440	
	ORION OYJ-CLASS B	1,763	36.930	65,107.590	
	VERBUND AG	1,216	89.750	109,136.000	
	OMV AG	1,209	47.250	57,125.250	
	ERSTE GROUP BANK AG	3,489	38.760	135,233.640	
	VOESTALPINE AG	1,800	29.480	53,064.000	
	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	1,100	25.540	28,094.000	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	3,055	45.870	140,132.850	
	KINGSPAN GROUP PLC	2,088	99.980	208,758.240	
	JERONIMO MARTINS	2,900	19.500	56,550.000	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	35,964	4.866	175,000.820	
	GALP ENERGIA SGPS SA	7,183	8.390	60,265.370	
	EDP RENOVAVEIS SA	4,383	22.460	98,442.180	
	KERRY GROUP PLC-A	1,822	108.350	197,413.700	
	CRH PLC	9,200	43.400	399,280.000	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	1,785	122.050	217,859.250	
	ユーロ 小計			ユーロ 58,643,837.190 (7,530,455,133)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	23,500	47.800	1,123,300.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	23,000	43.650	1,003,950.000	
	MTR CORP	16,500	42.000	693,000.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	16,000	96.750	1,548,000.000	
	SINO LAND CO	34,000	9.650	328,100.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	37,552	50.500	1,896,376.000	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	8,000	44.050	352,400.000	
	CLP HOLDINGS LTD	17,000	76.800	1,305,600.000	

HENDERSON LAND DEVELOPMENT	20,565	33.050	679,673.250	
HONG KONG & CHINA GAS	172,027	11.840	2,036,799.680	
HANG SENG BANK LTD	8,000	140.900	1,127,200.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	17,500	31.600	553,000.000	
WH GROUP LTD	169,500	5.100	864,450.000	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	14,900	445.000	6,630,500.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	37,000	16.000	592,000.000	
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	26,000	19.380	503,880.000	
SJM HOLDINGS LTD	10,000	5.580	55,800.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	8,000	19.400	155,200.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	28,552	45.300	1,293,405.600	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	5,500	46.500	255,750.000	
AIA GROUP LTD	150,000	83.900	12,585,000.000	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	22,000	28.800	633,600.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	20,000	40.250	805,000.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	19,200	20.200	387,840.000	
ESR CAYMAN LTD	18,000	25.850	465,300.000	
SANDS CHINA LTD	29,000	18.680	541,720.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	35,000	14.560	509,600.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	17,000	164.700	2,799,900.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	45,000	24.000	1,080,000.000	
WYNN MACAU LTD	16,800	7.190	120,792.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 42,927,136.530 (626,306,922)	
合計			76,523,797,150 [76,523,797,150]	

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,679	404,269.620	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	4,012	641,679.280	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,915	211,301.100	
		VORNADO REALTY TRUST	2,128	88,482.240	

SBA COMMUNICATIONS CORP	1,280	455,129.600	
EQUITY RESIDENTIAL	4,406	379,885.320	
EQUINIX INC	1,081	886,420.000	
AMERICAN TOWER CORP	5,453	1,455,623.820	
HOST HOTELS & RESORTS INC	6,701	110,030.420	
INVITATION HOMES INC	6,976	287,899.520	
VICI PROPERTIES INC	8,607	242,114.910	
VENTAS INC	4,401	216,177.120	
WEYERHAEUSER CO	8,683	336,466.250	
AGNC INVESTMENT CORP	7,559	119,658.970	
CROWN CASTLE INTL CORP	5,102	948,104.660	
IRON MOUNTAIN INC	3,474	162,791.640	
SUN COMMUNITIES INC	1,214	238,854.500	
PROLOGIS INC	8,863	1,358,520.640	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,648	338,268.480	
CAMDEN PROPERTY TRUST	1,177	198,736.450	
DUKE REALTY CORP	4,971	295,525.950	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	771	267,151.500	
WELLTOWER INC	4,901	402,078.040	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	6,434	219,142.040	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,452	304,920.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,950	165,399.000	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	15,632	130,527.200	
REALTY INCOME CORP	6,508	454,258.400	
PUBLIC STORAGE	1,857	616,319.730	
REGENCY CENTERS CORP	1,939	137,203.640	
UDR INC	3,700	212,639.000	
WP CAREY INC	2,702	212,782.500	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,164	60,072.640	
DIGITAL REALTY TRUST INC	3,415	576,417.850	
EXTRA SPACE STORAGE INC	1,797	364,880.850	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	8,597	184,749.530	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 13,684,482.410 (1,556,883,564)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	
LAND SECURITIES GROUP PLC	10,295	77,315.450	
SEGRO PLC	13,286	188,329.050	

	BRITISH LAND CO PLC	14,580	76,020.120	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 341,664.620 (51,782,690)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	DEXUS/AU	13,949	151,346.650	
	LENDLEASE GROUP	14,733	156,169.800	
	TRANSURBAN GROUP	33,406	457,328.140	
	SYDNEY AIRPORT	18,747	154,475.280	
	APA GROUP	14,243	138,157.100	
	SCENTRE GROUP	64,017	194,611.680	
	GPT GROUP	30,647	159,057.930	
	MIRVAC GROUP	61,117	177,239.300	
	STOCKLAND	18,729	81,471.150	
	GOODMAN GROUP	20,198	495,860.900	
VICINITY CENTRES	50,371	85,378.840		
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 2,251,096.770 (182,991,656)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1,600	93,536.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,400	30,968.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 124,504.000 (11,113,227)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	30,500	91,195.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	56,826	121,607.640	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	46,000	87,860.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	37,600	78,584.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 379,246.640 (31,557,112)	
ユーロ			ユーロ	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,751	105,060.000	
	GECINA SA	578	68,984.300	
	KLEPIERRE	2,394	45,617.670	
	COVIVIO	353	25,896.080	

ユーロ 小計			ユーロ	
			245,558.050	
			(31,532,110)	
香港・ドル	LINK REIT	26,000	香港・ドル	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	52,000	1,786,200.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	34,000	397,800.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル	
			2,545,080.000	
			(37,132,717)	
投資証券 合計			1,902,993,076	
			[1,902,993,076]	
合計			1,902,993,076	
			[1,902,993,076]	

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 598銘柄	97.3%	2.7%	74.3%
	投資証券 36銘柄			
イギリス・ポンド	株式 82銘柄	98.4%	1.6%	4.2%
	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	88.4%	11.6%	2.0%
	投資証券 11銘柄			
カナダ・ドル	株式 88銘柄	99.6%	0.4%	3.5%
	投資証券 2銘柄			
シンガポール・ドル	株式 14銘柄	87.1%	12.9%	0.3%
	投資証券 4銘柄			
スイス・フラン	株式 40銘柄	100%	-%	3.0%
スウェーデン・クローナ	株式 41銘柄	100%	-%	1.1%
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	100%	-%	0.8%
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 11銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式 230銘柄	99.6%	0.4%	9.6%
	投資証券 4銘柄			

香港・ドル	株式	30銘柄	94.4%	5.6%	0.8%
	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5期計算期間(2020年12月1日から2021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】

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4期 2020年11月30日現在	第5期 2021年11月30日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	26,395,175	27,262,842
親投資信託受益証券	2,493,659,423	2,608,113,005
未収入金	1,770,000	-
流動資産合計	2,521,824,598	2,635,375,847
資産合計	2,521,824,598	2,635,375,847
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	4,321,652	2,014,805
未払受託者報酬	240,611	275,692
未払委託者報酬	3,549,526	4,067,136
その他未払費用	60,077	68,843
流動負債合計	8,171,866	6,426,476
負債合計	8,171,866	6,426,476
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,873,069,139	1,473,643,378
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	640,583,593	1,155,305,993
（分配準備積立金）	398,853,797	800,456,378
元本等合計	2,513,652,732	2,628,949,371
純資産合計	2,513,652,732	2,628,949,371
負債純資産合計	2,521,824,598	2,635,375,847

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期		第5期	
	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日		自 2020年12月1日 至 2021年11月30日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		85		4
有価証券売買等損益		251,645,124		726,623,582
<b>営業収益合計</b>		<b>251,645,209</b>		<b>726,623,586</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		8,792		6,935
受託者報酬		443,721		547,523
委託者報酬		6,546,008		8,077,271
その他費用		110,990		136,733
<b>営業費用合計</b>		<b>7,109,511</b>		<b>8,768,462</b>
<b>営業利益</b>		<b>244,535,698</b>		<b>717,855,124</b>
経常利益		244,535,698		717,855,124
<b>当期純利益</b>		<b>244,535,698</b>		<b>717,855,124</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		12,747,709		157,604,428
期首剰余金又は期首欠損金( )		383,354,841		640,583,593
剰余金増加額又は欠損金減少額		119,705,037		242,451,909
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		119,705,037		242,451,909
剰余金減少額又は欠損金増加額		119,759,692		287,980,205
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		119,759,692		287,980,205
分配金		1 -		1 -
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>		<b>640,583,593</b>		<b>1,155,305,993</b>

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第5期	
	自 2020年12月1日	至 2021年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1. 1 期首元本額	1,462,100,428円	1,873,069,139円
期中追加設定元本額	950,256,999円	415,335,713円
期中一部解約元本額	539,288,288円	814,761,474円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,873,069,139口	1,473,643,378口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日	自 2020年12月1日 至 2021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(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>	<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(560,252,154円)、投資信託約款に規定される収益調整金(354,855,620円)及び分配準備積立金(240,204,224円)より分配対象額は1,155,311,998円(1万口当たり7,839.83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5期 自 2020年12月1日 至 2021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5期
	2021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4期	第5期
	2020年11月30日現在	2021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	258,646,609	599,399,202
合計	258,646,609	599,399,202

## (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4期	第5期
2020年11月30日現在	2021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5期
自 2020年12月1日
至 2021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4期	第5期
	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.3420円	1.7840円
(1万口当たり純資産額)	(13,420円)	(17,840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	270,194,117	497,292,272	
	外国株式インデックスマザーファンド	513,644,174	2,110,820,733	
親投資信託受益証券 合計			2,608,113,005	
合計			2,608,113,005	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

当ファンドは、「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

	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		

預金		365,587,927	1,248,475,444
コール・ローン		3,752,997,009	9,574,164,291
株式		151,364,986,629	229,141,995,652
新株予約権証券		868,069	-
投資証券		3,711,750,912	5,638,901,532
派生商品評価勘定		619,719,431	448,705,586
未収入金		12,393,192	24,502,132
未収配当金		182,217,065	248,294,417
差入委託証拠金		2,380,060,115	4,653,123,326
流動資産合計		162,390,580,349	250,978,162,380
資産合計		162,390,580,349	250,978,162,380
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		23,156,487	130,578,047
未払金		1,712,592	4,990,970
未払解約金		82,467,100	65,382,000
流動負債合計		107,336,179	200,951,017
負債合計		107,336,179	200,951,017
純資産の部			
元本等			
元本	1	54,067,455,177	61,024,141,090
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		108,215,788,993	189,753,070,273
元本等合計		162,283,244,170	250,777,211,363
純資産合計		162,283,244,170	250,777,211,363
負債純資産合計		162,390,580,349	250,978,162,380

## 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	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1. 1 期首	2019年12月3日	2020年12月1日
期首元本額	48,893,612,273円	54,067,455,177円
期中追加設定元本額	16,107,558,260円	13,499,704,777円
期中一部解約元本額	10,933,715,356円	6,543,018,864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	429,418,774円	372,377,534円
VA		
ダイワ国内重視バランスファ	6,511,702円	4,453,234円
ンド30VA(一般投資家私		
募)		
ダイワ国内重視バランスファ	109,450,582円	59,956,664円
ンド50VA(一般投資家私		
募)		

ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	14,001,565円	7,408,815円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	353,394,455円	236,485,519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)	22,667,766円	36,674,409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)	535,920,559円	508,352,729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)	2,255,476,207円	2,520,260,966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)	662,541,353円	513,644,174円
D-I's 外国株式インデッ クス	11,396,584円	15,304,858円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	6,026,400円	32,174,123円
iFree 外国株式イン デッ クス(為替ヘッジなし)	2,011,620,301円	4,063,382,462円
iFree 8資産バランス	1,021,183,359円	1,116,648,157円
iFree 年金バランス	49,879,929円	171,426,649円
DCダイワ外国株式インデッ クス	33,018,813,032円	38,249,671,210円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	579,030,840円	500,854,698円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	976,488,397円	919,288,192円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	722,361,053円	740,101,154円
大和DC海外株式インデッ クス ファンド	1,541,641,973円	1,732,619,609円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2020	2,282,168円	- 円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2030	11,422,149円	12,075,244円

DCダイワ・ターゲットイ ヤー2040	7,627,380円	10,707,802円
ダイワつみたてインデックス 外国株式	452,466,523円	811,486,824円
ダイワつみたてインデックス バランス30	2,121,988円	1,690,959円
ダイワつみたてインデックス バランス50	2,068,375円	2,170,527円
ダイワつみたてインデックス バランス70	2,463,419円	3,559,196円
ダイワ世界バランスファンド 40VA	161,683,743円	107,882,488円
ダイワ世界バランスファンド 60VA	284,495,474円	208,152,302円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	2,255,482,425円	1,461,676,506円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	110,264,809円	73,896,117円
ダイワバランスファンド 2020-07(適格機関投資家専 用)	271,255,135円	211,630,253円
ダイワバランスファンド 2021-02(適格機関投資家専 用)	-円	212,845,169円
ダイワ・インデックスセレク ト 外国株式	798,778,255円	927,057,365円
ダイワ・ノーロード 外国株 式ファンド	183,907,812円	324,437,993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)	2,325,979,029円	1,929,148,713円
ダイワ投信倶楽部外国株式イ ンデックス	2,735,745,325円	2,822,903,027円
ダイワライフスタイル25	17,629,498円	12,346,386円
ダイワライフスタイル50	63,519,419円	49,688,514円
ダイワライフスタイル75	50,437,420円	39,700,549円
計	54,067,455,177円	61,024,141,090円
2. 期末日における受益権の総数	54,067,455,177口	61,024,141,090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 2020年12月1日 至 2021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	2021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	2020年11月30日現在	2021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	17,672,692,878	41,450,751,465
新株予約権証券	30,829	-
投資証券	288,804,566	1,091,405,878
合計	17,383,919,141	42,542,157,343

(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12月3日から2020年11月30日まで、及び2020年12月1日から2021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	2020年11月30日 現在				2021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	6,984,505,406	-	7,583,915,003	599,409,597	15,914,463,645	-	16,312,448,688	397,985,043
合計	6,984,505,406	-	7,583,915,003	599,409,597	15,914,463,645	-	16,312,448,688	397,985,043

## (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	2020年11月30日 現在				2021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	4,081,862,053	-	4,079,015,400	2,846,653	9,828,774,794	-	9,748,917,290	79,857,504
アメリカ・ドル	3,024,714,845	-	3,001,843,000	22,871,845	7,046,626,660	-	7,027,555,314	19,071,346
イギリス・ポ ンド	165,466,538	-	169,006,600	3,540,062	308,287,051	-	301,604,400	6,682,651
オーストラ リア・ドル	112,156,038	-	117,657,000	5,500,962	286,703,319	-	274,744,314	11,959,005
カナダ・ドル	129,630,400	-	131,901,000	2,270,600	439,283,847	-	428,403,360	10,880,487
スイス・フラン	173,808,703	-	174,769,600	960,897	443,805,440	-	440,052,480	3,752,960
ユーロ	476,085,529	-	483,838,200	7,752,671	1,304,068,477	-	1,276,557,422	27,511,055
合計	4,081,862,053	-	4,079,015,400	2,846,653	9,828,774,794	-	9,748,917,290	79,857,504

## (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)

	2020年11月30日現在	2021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)	3.0015円 (30,015円)	4.1095円 (41,095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	4,250	175.510	745,917.500	
	PALO ALTO NETWORKS INC	3,510	551.180	1,934,641.800	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	6,750	197.740	1,334,745.000	
	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	4,750	86.080	408,880.000	
	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,150	122.410	263,181.500	
	SYNCHRONY FINANCIAL	21,100	47.120	994,232.000	
	ABBOTT LABORATORIES	64,366	128.030	8,240,778.980	
	HOWMET AEROSPACE INC	14,133	28.500	402,790.500	
	VERISK ANALYTICS INC	5,650	229.160	1,294,754.000	
	LAS VEGAS SANDS CORP	12,650	37.260	471,339.000	
	AMPHENOL CORP-CL A	21,600	82.930	1,791,288.000	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1,610	564.320	908,555.200	
	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	22,562	105.390	2,377,809.180	
	QORVO INC	4,070	150.840	613,918.800	
	AFLAC INC	23,600	55.700	1,314,520.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	4,800	141.750	680,400.000	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,050	107.850	652,492.500	
	ADOBE INC	17,320	687.490	11,907,326.800	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,650	62.960	481,644.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	4,530	463.260	2,098,567.800		
GARMIN LTD	5,650	139.240	786,706.000		



AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	7,950	291.350	2,316,232.500	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	25,150	207.660	5,222,649.000	
WR BERKLEY CORP	5,275	79.470	419,204.250	
AUTOZONE INC	820	1,838.690	1,507,725.800	
DOLLAR TREE INC	8,321	141.350	1,176,173.350	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	41,900	8.590	359,921.000	
PINNACLE WEST CAPITAL	4,100	66.290	271,789.000	
CELANESE CORP	4,150	159.790	663,128.500	
DR HORTON INC	12,566	98.760	1,241,018.160	
DENTSPLY SIRONA INC	7,950	48.690	387,085.500	
AUTODESK INC	8,020	261.150	2,094,423.000	
MOODY'S CORP	6,160	397.270	2,447,183.200	
DEVON ENERGY CORP	23,300	43.920	1,023,336.000	
ALBEMARLE CORP	4,310	275.890	1,189,085.900	
ATMOS ENERGY CORP	4,850	93.800	454,930.000	
ALLIANT ENERGY CORP	9,050	57.280	518,384.000	
CITIGROUP INC	74,873	65.040	4,869,739.920	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	15,500	235.900	3,656,450.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	18,300	83.310	1,524,573.000	
ALLEGHANY CORP	480	664.730	319,070.400	
DOMINO'S PIZZA INC	1,430	533.950	763,548.500	
HESS CORP	10,200	76.070	775,914.000	
DAVITA INC	2,750	96.910	266,502.500	
DANAHER CORP	23,250	326.520	7,591,590.000	
FORTIVE CORP	11,700	76.230	891,891.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	20,550	131.900	2,710,545.000	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	20,150	64.810	1,305,921.500	
BUNGE LTD	5,100	90.580	461,958.000	
TE CONNECTIVITY LTD	11,925	159.390	1,900,725.750	
APPLE INC	605,600	160.240	97,041,344.000	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	11,050	113.320	1,252,186.000	
BOEING CO/THE	20,130	198.500	3,995,805.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	5,565	118.460	659,229.900	
BECTON DICKINSON AND CO	10,619	243.610	2,586,894.590	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	7,600	10.120	76,912.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	4,900	90.550	443,695.000	
NISOURCE INC	13,900	25.250	350,975.000	

C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,900	95.620	468,538.000	
BOSTON BEER COMPANY INC-A	320	442.370	141,558.400	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	30,071	57.010	1,714,347.710	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	150,204	51.660	7,759,538.640	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	48,850	282.120	13,781,562.000	
ANSYS INC	3,200	397.720	1,272,704.000	
TRUIST FINANCIAL CORP	49,067	61.060	2,996,031.020	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	24,950	148.880	3,714,556.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	81,000	54.640	4,425,840.000	
JPMORGAN CHASE & CO	109,770	161.230	17,698,217.100	
T ROWE PRICE GROUP INC	8,300	207.020	1,718,266.000	
LKQ CORP	10,250	57.600	590,400.000	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,830	155.100	283,833.000	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11,412	74.190	846,656.280	
CADENCE DESIGN SYS INC	10,050	186.690	1,876,234.500	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,220	293.710	1,239,456.200	
DOLLAR GENERAL CORP	8,850	225.070	1,991,869.500	
SERVICENOW INC	7,150	672.820	4,810,663.000	
CATERPILLAR INC	19,850	195.920	3,889,012.000	
BROWN & BROWN INC	8,550	65.410	559,255.500	
ESSENTIAL UTILITIES INC	8,300	48.440	402,052.000	
CHARLES RIVER LABORATORIES	1,800	375.310	675,558.000	
CMS ENERGY CORP	10,650	61.130	651,034.500	
MOSAIC CO/THE	12,800	36.030	461,184.000	
DELTA AIR LINES INC	5,750	36.240	208,380.000	
CORNING INC	29,400	38.460	1,130,724.000	
CISCO SYSTEMS INC	152,950	55.760	8,528,492.000	
MORGAN STANLEY	50,652	97.230	4,924,893.960	
ZILLOW GROUP INC - A	2,100	54.160	113,736.000	
MSCI INC	3,000	645.490	1,936,470.000	
FAIR ISAAC CORP	1,000	350.660	350,660.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,200	322.120	386,544.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,500	78.480	667,080.000	
BROADCOM INC	14,812	564.340	8,359,004.080	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	4,350	180.740	786,219.000	
ARAMARK	8,500	34.380	292,230.000	
DTE ENERGY COMPANY	7,170	111.490	799,383.300	
CENTENE CORP	21,387	73.770	1,577,718.990	

CBOE GLOBAL MARKETS INC	3,950	129.700	512,315.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	15,700	48.780	765,846.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7,500	164.810	1,236,075.000	
GARTNER INC	3,150	325.000	1,023,750.000	
SPLUNK INC	6,010	125.000	751,250.000	
DOMINION ENERGY INC	29,441	74.420	2,190,999.220	
MONSTER BEVERAGE CORP	14,300	86.850	1,241,955.000	
SMITH (A.O.) CORP	5,000	80.860	404,300.000	
DEERE & CO	10,800	348.090	3,759,372.000	
POOL CORP	1,480	560.100	828,948.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	10,684	120.260	1,284,857.840	
VMWARE INC-CLASS A	7,480	120.380	900,442.400	
CABLE ONE INC	200	1,825.970	365,194.000	
BURLINGTON STORES INC	2,400	293.370	704,088.000	
NASDAQ INC	4,200	209.080	878,136.000	
VAIL RESORTS INC	1,490	333.450	496,840.500	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	18,400	36.840	677,856.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,630	138.140	363,308.200	
CONSOLIDATED EDISON INC	12,600	80.350	1,012,410.000	
COGNEX CORP	6,500	78.660	511,290.000	
TELEFLEX INC	1,720	308.950	531,394.000	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,050	195.870	597,403.500	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2,710	447.380	1,212,399.800	
BIO-RAD LABORATORIES-A	790	749.560	592,152.400	
CATALENT INC	6,200	133.960	830,552.000	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,050	294.090	1,485,154.500	
MOLINA HEALTHCARE INC	2,120	297.530	630,763.600	
IDEX CORP	2,760	234.420	646,999.200	
COLGATE-PALMOLIVE CO	29,350	77.710	2,280,788.500	
ROLLINS INC	8,087	35.330	285,713.710	
AMETEK INC	8,445	140.010	1,182,384.450	
CHURCH & DWIGHT CO INC	8,900	93.750	834,375.000	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	5,550	57.830	320,956.500	
HEICO CORP	1,600	140.180	224,288.000	
GENERAC HOLDINGS INC	2,320	424.580	985,025.600	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,400	469.430	657,202.000	

LYONDELLBASELL INDU-CL A	9,700	89.170	864,949.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,500	521.280	781,920.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	16,060	554.880	8,911,372.800	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	2,800	118.470	331,716.000	
EPAM SYSTEMS INC	2,000	634.170	1,268,340.000	
RPM INTERNATIONAL INC	4,600	93.020	427,892.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,000	1,678.100	1,678,100.000	
UGI CORP	7,650	43.400	332,010.000	
CUMMINS INC	5,350	217.270	1,162,394.500	
ACTIVISION BLIZZARD INC	28,350	60.310	1,709,788.500	
CDW CORP/DE	5,100	194.800	993,480.000	
COSTAR GROUP INC	14,500	79.990	1,159,855.000	
SVB FINANCIAL GROUP	2,020	724.500	1,463,490.000	
AMERCO	370	717.230	265,375.100	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,640	357.220	1,300,280.800	
MERCADOLIBRE INC	1,610	1,234.100	1,986,901.000	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2,760	152.310	420,375.600	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,016	138.070	1,382,909.120	
IPG PHOTONICS CORP	1,420	163.180	231,715.600	
DEXCOM INC	3,540	571.010	2,021,375.400	
NORDSON CORP	1,910	262.150	500,706.500	
COPART INC	7,830	148.010	1,158,918.300	
SEAGEN INC	4,950	165.310	818,284.500	
ALIGN TECHNOLOGY INC	2,710	634.470	1,719,413.700	
TRANSDIGM GROUP INC	1,890	584.220	1,104,175.800	
BIO-TECHNE CORP	1,400	479.690	671,566.000	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,350	84.740	283,879.000	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	7,750	102.080	791,120.000	
KINDER MORGAN INC	73,381	16.010	1,174,829.810	
HCA HEALTHCARE INC	9,800	229.920	2,253,216.000	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,400	352.960	494,144.000	
COTERRA ENERGY INC	29,000	20.840	604,360.000	
T-MOBILE US INC	22,677	113.400	2,571,571.800	
ZILLOW GROUP INC - C	5,950	54.260	322,847.000	
COCA-COLA CO/THE	148,650	54.580	8,113,317.000	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	7,350	51.820	380,877.000	
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,150	126.760	779,574.000	

FRANKLIN RESOURCES INC	11,150	33.750	376,312.500	
CSX CORP	82,100	35.620	2,924,402.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	3,460	291.920	1,010,043.200	
EXPEDIA GROUP INC	5,175	166.500	861,637.500	
AUTOLIV INC	2,950	95.930	282,993.500	
AMAZON.COM INC	16,470	3,561.570	58,659,057.900	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	22,690	110.710	2,512,009.900	
EXXON MOBIL CORP	153,605	61.590	9,460,531.950	
AES CORP	24,600	23.620	581,052.000	
EVEREST RE GROUP LTD	1,500	264.370	396,555.000	
EOG RESOURCES INC	21,000	88.390	1,856,190.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	6,000	114.260	685,560.000	
ABIOMED INC	1,610	319.120	513,783.200	
AMERISOURCEBERGEN CORP	5,680	120.230	682,906.400	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	11,170	153.420	1,713,701.400	
FORD MOTOR CO	143,323	19.670	2,819,163.410	
NOVAVAX INC	2,600	193.960	504,296.000	
DISCOVERY INC - A	6,290	24.590	154,671.100	
EXACT SCIENCES CORP	6,250	86.570	541,062.500	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5,637	27.640	155,806.680	
LIBERTY BROADBAND-A	850	156.340	132,889.000	
DISCOVERY INC-C	11,389	24.050	273,905.450	
FORTINET INC	5,050	343.300	1,733,665.000	
MARKEL CORP	510	1,243.740	634,307.400	
NEXTERA ENERGY INC	71,180	88.660	6,310,818.800	
MASIMO CORP	1,920	288.290	553,516.800	
FREEMPORT-MCMORAN INC	53,608	37.980	2,036,031.840	
INSULET CORP	2,440	295.870	721,922.800	
US BANCORP	51,200	57.400	2,938,880.000	
UNITED RENTALS INC	2,570	357.020	917,541.400	
F5 NETWORKS INC	2,250	231.070	519,907.500	
FASTENAL CO	21,050	60.940	1,282,787.000	
FISERV INC	21,933	97.470	2,137,809.510	
GENERAL ELECTRIC CO	39,856	98.400	3,921,830.400	
GENERAL MOTORS CO	47,650	59.860	2,852,329.000	
ZENDESK INC	4,370	95.110	415,630.700	
GENERAL DYNAMICS CORP	8,750	194.440	1,701,350.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	12,350	386.540	4,773,769.000	

ALPHABET INC-CL A	10,900	2,910.610	31,725,649.000	
ALPHABET INC-CL C	10,557	2,922.280	30,850,509.960	
OWENS CORNING	3,900	87.130	339,807.000	
GENERAL MILLS INC	22,050	63.520	1,400,616.000	
FIRSTENERGY CORP	19,768	39.050	771,940.400	
GENUINE PARTS CO	5,100	132.910	677,841.000	
IHS MARKIT LTD	13,884	130.130	1,806,724.920	
FIFTH THIRD BANCORP	25,900	42.990	1,113,441.000	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,550	214.680	1,620,834.000	
HALLIBURTON CO	32,600	22.250	725,350.000	
HOME DEPOT INC	38,550	406.820	15,682,911.000	
ASSURANT INC	2,250	156.040	351,090.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	52,900	15.370	813,073.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,510	181.720	274,397.200	
HERSHEY CO/THE	5,390	179.160	965,672.400	
HUMANA INC	4,720	428.070	2,020,490.400	
NXP SEMICONDUCTORS NV	10,100	223.940	2,261,794.000	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	2,820	222.080	626,265.600	
HENRY SCHEIN INC	5,100	73.770	376,227.000	
HP INC	47,300	35.930	1,699,489.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	47,600	14.610	695,436.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	5,978	49.730	297,285.940	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY- C	7,000	60.050	420,350.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2,950	49.890	147,175.500	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	14,400	41.730	600,912.000	
KRAFT HEINZ CO/THE	24,303	34.780	845,258.340	
ENPHASE ENERGY INC	4,690	256.710	1,203,969.900	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	32,400	118.500	3,839,400.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	13,750	47.220	649,275.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	4,900	102.960	504,504.000	
ZOETIS INC	17,300	223.550	3,867,415.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	8,779	192.930	1,693,732.470	
CHENIERE ENERGY INC	8,850	106.600	943,410.000	
ALLEGION PLC	3,300	128.680	424,644.000	

LIBERTY GLOBAL PLC- C	12,973	27.920	362,206.160	
WASTE CONNECTIONS INC	9,487	137.190	1,301,521.530	
JUNIPER NETWORKS INC	12,200	31.840	388,448.000	
JM SMUCKER CO/THE	4,050	129.370	523,948.500	
JOHNSON & JOHNSON	95,500	159.750	15,256,125.000	
PLUG POWER INC	18,600	41.620	774,132.000	
ABBVIE INC	64,072	116.890	7,489,376.080	
HOLOGIC INC	9,150	75.970	695,125.500	
KIMBERLY-CLARK CORP	12,200	135.040	1,647,488.000	
KROGER CO	26,400	42.350	1,118,040.000	
KLA CORP	5,560	413.840	2,300,950.400	
LOCKHEED MARTIN CORP	9,030	341.230	3,081,306.900	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	2,930	212.980	624,031.400	
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	9,700	75.870	735,939.000	
LOWE'S COS INC	26,000	248.580	6,463,080.000	
ELI LILLY & CO	29,535	254.830	7,526,404.050	
LAM RESEARCH CORP	5,200	680.540	3,538,808.000	
LOEWS CORP	8,300	55.110	457,413.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	6,649	68.340	454,392.660	
MCDONALD'S CORP	27,050	250.300	6,770,615.000	
3M CO	21,040	176.230	3,707,879.200	
META PLATFORMS INC CLASS A	86,900	338.030	29,374,807.000	
S&P GLOBAL INC	8,770	464.930	4,077,436.100	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,310	418.340	966,365.400	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	1,920	347.210	666,643.200	
PHILLIPS 66	15,750	69.860	1,100,295.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	16,050	41.130	660,136.500	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	9,200	86.990	800,308.000	
METLIFE INC	27,000	59.890	1,617,030.000	
MARVELL TECHNOLOGY INC	29,950	75.020	2,246,849.000	
ARISTA NETWORKS INC	8,480	126.600	1,073,568.000	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4,800	84.250	404,400.000	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,228	259.500	1,616,166.000	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	850	1,536.220	1,305,787.000	
BAKER HUGHES CO	26,523	23.530	624,086.190	
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,190	340.580	1,427,030.200	
MERCK & CO. INC.	91,821	74.890	6,876,474.690	

DUPONT DE NEMOURS INC	20,751	77.040	1,598,657.040	
MASCO CORP	9,100	67.340	612,794.000	
M & T BANK CORP	4,689	152.160	713,478.240	
MARSH & MCLENNAN COS	18,520	167.030	3,093,395.600	
BLACK KNIGHT INC	5,600	73.140	409,584.000	
HEICO CORP-CLASS A	2,720	127.000	345,440.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	10,172	150.770	1,533,632.440	
WORKDAY INC-CLASS A	6,900	281.590	1,942,971.000	
WAYFAIR INC- CLASS A	2,710	267.510	724,952.100	
SQUARE INC - A	14,200	212.870	3,022,754.000	
TRANSUNION	6,900	114.130	787,497.000	
VISTRA CORP	15,650	20.090	314,408.500	
NOVOCURE LTD	3,450	93.350	322,057.500	
NETAPP INC	8,200	91.520	750,464.000	
NIKE INC -CL B	46,200	169.870	7,847,994.000	
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,050	268.740	2,432,097.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,100	84.400	1,696,440.000	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,855	100.570	689,407.350	
ALLY FINANCIAL INC	13,650	47.710	651,241.500	
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,710	356.390	2,034,986.900	
APTIV PLC	9,750	165.490	1,613,527.500	
NEWMONT CORP	29,311	55.400	1,623,829.400	
MCKESSON CORP	5,750	223.270	1,283,802.500	
XYLEM INC	6,670	123.800	825,746.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	56,500	87.350	4,935,275.000	
NUCOR CORP	10,950	112.070	1,227,166.500	
SUNRUN INC	6,100	47.860	291,946.000	
WESTERN UNION CO	15,246	16.160	246,375.360	
GODADDY INC - CLASS A	6,000	69.090	414,540.000	
NEWELL BRANDS INC	13,442	22.350	300,428.700	
EVERGY INC	8,250	65.260	538,395.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	34,324	30.060	1,031,779.440	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	900	204.190	183,771.000	
OKTA INC	4,510	223.610	1,008,481.100	
COUPA SOFTWARE INC	2,550	202.660	516,783.000	
LIBERTY BROADBAND-C	5,600	159.940	895,664.000	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	15,755	30.190	475,643.450	
LINDE PLC	18,846	320.740	6,044,666.040	



WIX.COM LTD	2,130	159.370	339,458.100	
EQUITABLE HOLDINGS INC	14,300	32.240	461,032.000	
KKR & CO INC	18,800	76.310	1,434,628.000	
PAYCHEX INC	11,700	123.730	1,447,641.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,480	644.150	1,597,492.000	
ALTRIA GROUP INC	66,700	43.480	2,900,116.000	
P G & E CORP	55,100	12.380	682,138.000	
PFIZER INC	203,113	52.400	10,643,121.200	
CIGNA CORP	12,620	199.610	2,519,078.200	
DELL TECHNOLOGIES -C	10,101	57.570	581,514.570	
ALTICE USA INC- A	10,900	15.990	174,291.000	
XCEL ENERGY INC	19,700	65.590	1,292,123.000	
STERIS PLC	3,600	226.690	816,084.000	
SEA LTD-ADR	2,700	297.960	804,492.000	
FOX CORP - CLASS B	5,433	34.490	187,384.170	
FOX CORP - CLASS A	12,199	36.920	450,387.080	
STRYKER CORP	12,330	243.500	3,002,355.000	
LYFT INC-A	9,200	41.820	384,744.000	
DOW INC	27,368	56.860	1,556,144.480	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	3,850	97.300	374,605.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	7,740	218.980	1,694,905.200	
PARKER HANNIFIN CORP	4,660	309.140	1,440,592.400	
UBER TECHNOLOGIES INC	44,500	39.700	1,766,650.000	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8,450	183.360	1,549,392.000	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	88,667	149.020	13,213,156.340	
EXELON CORP	35,772	54.170	1,937,769.240	
TELADOC HEALTH INC	5,100	106.410	542,691.000	
INGERSOLL-RAND INC	14,708	59.800	879,538.400	
NVR INC	120	5,281.730	633,807.600	
CONOCOPHILLIPS	49,202	72.150	3,549,924.300	
TWILIO INC - A	5,950	293.230	1,744,718.500	
DOCUSIGN INC	7,100	251.500	1,785,650.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	1,890	447.430	845,642.700	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	5,000	112.970	564,850.000	
PEPSICO INC	50,100	164.140	8,223,414.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,500	176.960	265,440.000	

DROPBOX INC-CLASS A	11,400	24.950	284,430.000	
MONGODB INC	2,020	525.980	1,062,479.600	
SNAP INC - A	34,750	48.850	1,697,537.500	
CORTEVA INC	26,918	46.590	1,254,109.620	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,300	105.030	1,501,929.000	
AMCOR PLC	56,400	11.580	653,112.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	6,900	224.570	1,549,533.000	
ROKU INC	4,220	231.280	976,001.600	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	6,550	173.320	1,135,246.000	
ACCENTURE PLC-CL A	23,050	365.820	8,432,151.000	
10X GENOMICS INC-CLASS A	2,750	144.450	397,237.500	
PENTAIR PLC	5,925	76.800	455,040.000	
QUALCOMM INC	40,850	183.740	7,505,779.000	
INVESCO LTD	14,100	23.240	327,684.000	
ADVANCE AUTO PARTS INC	2,350	227.270	534,084.500	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	10,000	70.920	709,200.000	
DATADOG INC - CLASS A	6,800	182.990	1,244,332.000	
PINTEREST INC- CLASS A	19,900	40.540	806,746.000	
AVALARA INC	3,050	142.700	435,235.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,800	654.400	2,486,720.000	
REPUBLIC SERVICES INC	8,250	138.230	1,140,397.500	
BOOKING HOLDINGS INC	1,500	2,182.010	3,273,015.000	
ROSS STORES INC	13,100	111.660	1,462,746.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,450	133.700	461,265.000	
RESMED INC	5,330	256.920	1,369,383.600	
QUEST DIAGNOSTICS INC	4,730	156.700	741,191.000	
ROBERT HALF INTL INC	4,150	114.760	476,254.000	
MODERNA INC	12,370	368.510	4,558,468.700	
HUBSPOT INC	1,590	851.910	1,354,536.900	
PERKINELMER INC	4,130	185.220	764,958.600	
CARRIER GLOBAL CORP	30,237	55.980	1,692,667.260	
OTIS WORLDWIDE CORP	14,938	83.580	1,248,518.040	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	6,300	73.350	462,105.000	
AVANTOR INC	19,350	39.780	769,743.000	
CARLYLE GROUP INC/THE	5,700	56.800	323,760.000	
DYNATRACE INC	6,700	64.470	431,949.000	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	15,820	107.060	1,693,689.200	

REGIONS FINANCIAL CORP	35,185	23.540	828,254.900	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	6,550	41.340	270,777.000	
IAC/INTERACTIVECORP	2,880	130.810	376,732.800	
MATCH GROUP INC	9,370	134.080	1,256,329.600	
CHEVRON CORP	70,118	114.850	8,053,052.300	
PELTON INTERACTIVE INC-A	9,400	44.390	417,266.000	
ZSCALER INC	3,000	355.920	1,067,760.000	
EDISON INTERNATIONAL	14,000	66.070	924,980.000	
ETSY INC	4,650	281.480	1,308,882.000	
TESLA INC	29,620	1,136.990	33,677,643.800	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	7,000	364.780	2,553,460.000	
NORTONLIFELOCK INC	21,400	25.310	541,634.000	
DRAFTKINGS INC - CL A	11,700	35.200	411,840.000	
UNITY SOFTWARE INC	2,100	170.330	357,693.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	5,852	184.150	1,077,645.800	
SYNOPSYS INC	5,580	355.870	1,985,754.600	
CARVANA CO	2,620	291.970	764,961.400	
CHEWY INC - CLASS A	3,250	68.660	223,145.000	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	8,500	191.090	1,624,265.000	
PPD INC	4,400	47.200	207,680.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC- A	4,785	668.190	3,197,289.150	
VIATRIS INC	43,321	12.520	542,378.920	
DOORDASH INC - A	2,700	183.010	494,127.000	
AIRBNB INC-CLASS A	4,600	180.080	828,368.000	
CBRE GROUP INC - A	12,150	97.960	1,190,214.000	
TWITTER INC	29,200	45.780	1,336,776.000	
SOUTHERN CO/THE	38,650	62.820	2,427,993.000	
SYSCO CORP	18,750	73.200	1,372,500.000	
TRAVELERS COS INC/THE	9,103	152.400	1,387,297.200	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,000	50.490	100,980.000	
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,300	61.520	264,536.000	
STEEL DYNAMICS INC	7,650	61.400	469,710.000	
SCHLUMBERGER LTD	50,352	29.650	1,492,936.800	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	5,850	57.900	338,715.000	
AT&T INC	258,991	23.890	6,187,294.990	
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,550	44.540	247,197.000	
ON SEMICONDUCTOR CORP	15,500	63.020	976,810.000	

CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,500	93.480	701,100.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,170	334.280	3,065,347.600	
SEMPRA ENERGY	11,400	124.200	1,415,880.000	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	6,500	50.060	325,390.000	
CLARIVATE PLC	12,500	22.830	285,375.000	
OAK STREET HEALTH INC	3,600	30.670	110,412.000	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	56,000	21.070	1,179,920.000	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	7,950	104.060	827,277.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	33,500	194.380	6,511,730.000	
SALESFORCE.COM INC	35,216	296.740	10,449,995.840	
WESTROCK CO	9,880	46.120	455,665.600	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	25,934	78.360	2,032,188.240	
TERADYNE INC	6,050	154.450	934,422.500	
UNION PACIFIC CORP	24,080	239.460	5,766,196.800	
MARATHON PETROLEUM CORP	23,488	61.780	1,451,088.640	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	54,929	82.940	4,555,811.260	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	26,200	204.640	5,361,568.000	
IQVIA HOLDINGS INC	7,044	266.690	1,878,564.360	
VOYA FINANCIAL INC	4,350	62.250	270,787.500	
AMEREN CORPORATION	9,200	85.090	782,828.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	34,216	452.000	15,465,632.000	
VERISIGN INC	3,700	244.460	904,502.000	
VALERO ENERGY CORP	14,792	68.170	1,008,370.640	
ULTA BEAUTY INC	1,890	401.420	758,683.800	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	9,888	49.950	493,905.600	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,830	121.270	343,194.100	
ANTHEM INC	8,920	416.220	3,712,682.400	
WALT DISNEY CO/THE	65,862	147.810	9,735,062.220	
WELLS FARGO & CO	149,922	49.160	7,370,165.520	
WASTE MANAGEMENT INC	15,200	166.830	2,535,816.000	
WILLIAMS COS INC	43,800	28.010	1,226,838.000	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,250	226.700	963,475.000	
WHIRLPOOL CORP	2,320	222.780	516,849.600	
WALMART INC	56,100	142.630	8,001,543.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	7,650	123.500	944,775.000	
WYNN RESORTS LTD	3,700	83.000	307,100.000	
WABTEC CORP	6,511	92.470	602,072.170	
TJX COMPANIES INC	43,800	70.670	3,095,346.000	

WATERS CORP	2,230	341.220	760,920.600	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1,890	607.200	1,147,608.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	26,500	46.080	1,221,120.000	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,743	230.390	1,092,739.770	
WESTERN DIGITAL CORP	11,250	58.990	663,637.500	
WEC ENERGY GROUP INC	11,430	90.490	1,034,300.700	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	18,250	64.250	1,172,562.500	
VISA INC-CLASS A SHARES	61,250	196.290	12,022,762.500	
PPL CORP	27,900	28.440	793,476.000	
PULTEGROUP INC	9,450	51.510	486,769.500	
PPG INDUSTRIES INC	8,530	157.360	1,342,280.800	
NORTHERN TRUST CORP	7,300	119.940	875,562.000	
NVIDIA CORP	90,380	333.760	30,165,228.800	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	15,463	200.880	3,106,207.440	
TYSON FOODS INC-CL A	10,850	81.880	888,398.000	
NETFLIX INC	16,070	663.840	10,667,908.800	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	14,240	648.770	9,238,484.800	
NRG ENERGY INC	8,650	36.630	316,849.500	
GLOBE LIFE INC	3,655	88.470	323,357.850	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,450	214.450	1,383,202.500	
TEXTRON INC	8,300	72.790	604,157.000	
NEWS CORP - CLASS A	14,137	21.820	308,469.340	
OMNICOM GROUP	7,950	67.470	536,386.500	
ORACLE CORP	68,133	92.940	6,332,281.020	
MASTERCARD INC - A	32,050	323.010	10,352,470.500	
ONEOK INC	16,400	62.460	1,024,344.000	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	34,752	12.950	450,038.400	
ROPER TECHNOLOGIES INC	3,800	481.480	1,829,624.000	
YUM! BRANDS INC	10,850	125.250	1,358,962.500	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	4,250	169.600	720,800.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	6,950	45.330	315,043.500	
BANK OF AMERICA CORP	279,401	45.590	12,737,891.590	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1,720	431.880	742,833.600	

BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	6,750	87.400	589,950.000	
AMERICAN EXPRESS CO	24,750	157.860	3,907,035.000	
ANALOG DEVICES INC	19,391	183.200	3,552,431.200	
ADVANCED MICRO DEVICES	44,150	161.910	7,148,326.500	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	31,172	54.950	1,712,901.400	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	5,950	154.920	921,774.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,450	69.890	590,570.500	
AVERY DENNISON CORP	3,030	215.530	653,055.900	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	19,150	79.710	1,526,446.500	
EMERSON ELECTRIC CO	21,550	90.860	1,958,033.000	
AON PLC-CLASS A	8,240	296.690	2,444,725.600	
AMGEN INC	20,850	203.470	4,242,349.500	
EATON CORP PLC	14,586	167.380	2,441,404.680	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,250	226.970	1,418,562.500	
APPLIED MATERIALS INC	33,250	151.220	5,028,065.000	
CME GROUP INC	13,120	225.330	2,956,329.600	
ECOLAB INC	9,400	227.150	2,135,210.000	
EQUIFAX INC	4,430	284.060	1,258,385.800	
GILEAD SCIENCES INC	45,650	70.650	3,225,172.500	
KEURIG DR PEPPER INC	25,500	35.170	896,835.000	
HORMEL FOODS CORP	10,550	42.490	448,269.500	
STATE STREET CORP	12,463	93.190	1,161,426.970	
SCHWAB (CHARLES) CORP	52,540	80.100	4,208,454.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	18,200	76.030	1,383,746.000	
CAMPBELL SOUP CO	7,000	41.200	288,400.000	
CROWN HOLDINGS INC	4,980	108.400	539,832.000	
CARDINAL HEALTH INC	10,400	47.470	493,688.000	
FEDEX CORP	9,200	240.570	2,213,244.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	16,504	147.020	2,426,418.080	
FMC CORP	4,650	103.540	481,461.000	
CERNER CORP	10,850	72.860	790,531.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,013	147.190	1,326,623.470	
CITRIX SYSTEMS INC	4,600	82.370	378,902.000	
INTEL CORP	146,500	50.000	7,325,000.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	14,200	34.020	483,084.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	13,150	68.610	902,221.500	
ILLINOIS TOOL WORKS	11,550	238.110	2,750,170.500	

SIRIUS XM HOLDINGS INC	38,600	6.270	242,022.000
ILLUMINA INC	5,330	370.810	1,976,417.300
SEALED AIR CORP	5,400	64.200	346,680.000
INTUITIVE SURGICAL INC	12,870	334.740	4,308,103.800
CHECK POINT SOFTWARE TECH	4,350	111.110	483,328.500
SNAP-ON INC	2,020	212.820	429,896.400
CARMAX INC	5,800	146.480	849,584.000
DUKE ENERGY CORP	28,028	100.220	2,808,966.160
TARGET CORP	17,950	249.160	4,472,422.000
DOVER CORP	5,200	171.800	893,360.000
WW GRAINGER INC	1,580	495.580	783,016.400
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,720	146.090	689,544.800
CINTAS CORP	3,420	434.730	1,486,776.600
CONAGRA BRANDS INC	17,300	31.510	545,123.000
LAMB WESTON HOLDINGS INC	5,450	53.290	290,430.500
CLOROX COMPANY	4,430	169.160	749,378.800
ENTERGY CORP	7,420	105.070	779,619.400
MICROSOFT CORP	259,600	336.630	87,389,148.000
INCYTE CORP	6,930	70.370	487,664.100
CVS HEALTH CORP	47,769	92.020	4,395,703.380
MEDTRONIC PLC	48,898	110.280	5,392,471.440
MICRON TECHNOLOGY INC	40,850	86.140	3,518,819.000
BLACKROCK INC	5,510	928.000	5,113,280.000
CENTERPOINT ENERGY INC	21,100	26.590	561,049.000
HASBRO INC	4,700	99.130	465,911.000
KELLOGG CO	9,300	63.870	593,991.000
KEYCORP	35,400	22.830	808,182.000
KANSAS CITY SOUTHERN	3,350	296.190	992,236.500
MONDELEZ INTERNATIONAL INC- A	51,061	60.640	3,096,339.040
COOPER COS INC/THE	1,770	381.190	674,706.300
CHUBB LTD	16,219	185.040	3,001,163.760
ARROW ELECTRONICS INC	2,700	124.420	335,934.000
ALLSTATE CORP	10,950	113.140	1,238,883.000
EBAY INC	24,900	70.550	1,756,695.000
PAYPAL HOLDINGS INC	40,500	187.240	7,583,220.000
EASTMAN CHEMICAL CO	5,050	110.180	556,409.000
XILINX INC	8,850	233.080	2,062,758.000

	DISH NETWORK CORP-A	8,900	33.130	294,857.000	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	8,470	340.050	2,880,223.500	
	TRIMBLE INC	9,050	86.530	783,096.500	
	LENNAR CORP-A	10,050	107.250	1,077,862.500	
	LEAR CORP	2,150	169.000	363,350.000	
	PROGRESSIVE CORP	21,390	94.970	2,031,408.300	
	PACCAR INC	12,537	86.120	1,079,686.440	
	BIOGEN INC	5,520	236.110	1,303,327.200	
	IDEXX LABORATORIES INC	3,090	631.300	1,950,717.000	
	STARBUCKS CORP	42,750	110.730	4,733,707.500	
	PTC INC	4,020	110.320	443,486.400	
	EVERSOURCE ENERGY	12,410	85.270	1,058,200.700	
	INTUIT INC	9,880	694.660	6,863,240.800	
	BORGWARNER INC	8,750	44.810	392,087.500	
	BEST BUY CO INC	8,250	110.950	915,337.500	
	BALL CORP	11,984	94.810	1,136,203.040	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	51,797	38.590	1,998,846.230	
	ELECTRONIC ARTS INC	10,570	124.880	1,319,981.600	
	VULCAN MATERIALS CO	4,900	199.350	976,815.000	
	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	9,350	190.110	1,777,528.500	
	VF CORP	12,250	73.730	903,192.500	
	VIACOMCBS INC - CLASS B	22,025	32.280	710,967.000	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	2,200	174.380	383,636.000	
	CARNIVAL CORP	30,000	18.160	544,800.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	166,090	51.530	8,558,617.700	
	JARDINE MATHESON HLDGS LTD	8,300	58.370	484,471.000	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	44,800	5.560	249,088.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 1,496,632,493.350 (170,271,878,768)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	BP PLC	733,000	3.277	2,402,041.000	
	UNILEVER PLC	94,860	39.210	3,719,460.600	
	BARCLAYS PLC	622,300	1.832	1,140,551.440	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	300,500	1.225	368,112.500	
	PRUDENTIAL PLC	95,100	12.945	1,231,069.500	
	NATWEST GROUP PLC	210,291	2.104	442,452.260	
	EVRAZ PLC	17,400	5.720	99,528.000	



JOHNSON MATTHEY PLC	7,064	21.330	150,675.120	
BAE SYSTEMS PLC	117,000	5.498	643,266.000	
AVIVA PLC	142,366	3.782	538,428.210	
AVEVA GROUP PLC	4,400	32.200	141,680.000	
GLAXOSMITHKLINE PLC	182,300	15.250	2,780,075.000	
INFORMA PLC	52,700	4.740	249,798.000	
MELROSE INDUSTRIES PLC	159,540	1.460	233,008.170	
AUTO TRADER GROUP PLC	35,000	7.324	256,340.000	
DCC PLC	3,400	56.340	191,556.000	
OCADO GROUP PLC	17,500	18.340	320,950.000	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2,750	158.400	435,600.000	
HALMA PLC	13,700	30.290	414,973.000	
ENTAIN PLC	21,200	17.460	370,152.000	
JD SPORTS FASHION PLC	17,200	11.415	196,338.000	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	23,500	6.440	151,340.000	
M&G PLC	91,700	1.903	174,550.950	
RELX PLC	70,396	23.430	1,649,378.280	
DIAGEO PLC	84,700	38.235	3,238,504.500	
RIO TINTO PLC	40,700	46.215	1,880,950.500	
STANDARD CHARTERED PLC	97,000	4.142	401,774.000	
TESCO PLC	280,684	2.790	783,108.360	
SMITH & NEPHEW PLC	31,950	12.400	396,180.000	
GLENCORE PLC	364,525	3.571	1,301,901.030	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	12,450	13.415	167,016.750	
SMITHS GROUP PLC	14,383	14.560	209,416.480	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	46,583	2.672	124,469.770	
PEARSON PLC	25,763	6.146	158,339.390	
SAINSBURY (J) PLC	59,525	2.897	172,443.920	
NEXT PLC	4,850	79.620	386,157.000	
TAYLOR WIMPEY PLC	127,700	1.555	198,573.500	
WHITBREAD PLC	7,361	28.750	211,628.750	
BUNZL PLC	11,905	28.670	341,316.350	
VODAFONE GROUP PLC	1,014,183	1.101	1,116,818.310	
CRODA INTERNATIONAL PLC	5,011	100.650	504,357.150	
KINGFISHER PLC	73,711	3.260	240,297.860	
WPP PLC	42,900	10.605	454,954.500	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	24,827	10.885	270,241.890	
SEVERN TRENT PLC	9,083	29.070	264,042.810	

RENTOKIL INITIAL PLC	67,300	6.186	416,317.800	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	26,000	61.640	1,602,640.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	19,450	15.625	303,906.250	
SCHRODERS PLC	4,150	35.170	145,955.500	
SSE PLC	37,600	15.580	585,808.000	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	36,700	6.928	254,257.600	
ASTRAZENECA PLC	56,100	83.670	4,693,887.000	
FERGUSON PLC	8,087	115.550	934,452.850	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	215,200	2.849	613,104.800	
3I GROUP PLC	35,091	13.880	487,063.080	
ASHTED GROUP PLC	16,150	61.300	989,995.000	
SAGE GROUP PLC/THE	40,114	7.770	311,685.780	
NATIONAL GRID PLC	129,634	10.012	1,297,895.600	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,575,465	0.468	1,205,317.620	
IMPERIAL BRANDS PLC	34,100	15.630	532,983.000	
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	3,832	43.250	165,734.000	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	79,060	25.560	2,020,773.600	
BHP GROUP PLC	76,827	20.190	1,551,137.130	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	12,850	19.070	245,049.500	
HSBC HOLDINGS PLC	741,650	4.164	3,088,601.420	
ANGLO AMERICAN PLC	46,583	26.835	1,250,054.800	
MONDI PLC	17,600	17.480	307,648.000	
COMPASS GROUP PLC	64,739	15.220	985,327.580	
PERSIMMON PLC	11,200	27.590	309,008.000	
BT GROUP PLC	320,600	1.634	523,860.400	
COCA-COLA HBC AG-DI	7,150	23.530	168,239.500	
BURBERRY GROUP PLC	14,289	17.950	256,487.550	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	6,436	46.000	296,056.000	
INTERTEK GROUP PLC	5,850	54.800	320,580.000	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	12,049	68.700	827,766.300	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	148,900	15.948	2,374,657.200	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	134,618	15.940	2,145,810.920	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,700	22.300	127,110.000	
ADMIRAL GROUP PLC	7,050	30.130	212,416.500	
ANTOFAGASTA PLC	14,100	13.980	197,118.000	

	ABRDN PLC	77,862	2.358	183,598.590	
	EXPERIAN PLC	33,654	33.830	1,138,514.820	
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 64,194,636.540 (9,729,339,114)	
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	44,300	19.750	874,925.000	
	AZRIELI GROUP LTD	1,650	290.900	479,985.000	
	ICL GROUP LTD	28,100	28.520	801,412.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	950	471.000	447,450.000	
	BANK HAPOALIM BM	44,100	30.740	1,355,634.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	56,200	31.040	1,744,448.000	
	NICE LTD	2,400	884.700	2,123,280.000	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,400	117.100	632,340.000		
イスラエル・シュケル 小計				イスラエル・シュケル 8,459,474.000 (304,635,810)	
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	97,000	3.360	325,920.000	
	BHP GROUP LTD	103,400	38.570	3,988,138.000	
	SOUTH32 LTD	160,100	3.570	571,557.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	33,550	21.240	712,602.000	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	59,100	17.600	1,040,160.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	115,950	27.200	3,153,840.000	
	WESTPAC BANKING CORP	128,948	20.920	2,697,592.160	
	SANTOS LTD	62,900	6.390	401,931.000	
	AUSNET SERVICES	65,000	2.520	163,800.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	100,850	26.620	2,684,627.000	
	RIO TINTO LTD	13,000	95.390	1,240,070.000	
	ORIGIN ENERGY LTD	59,000	4.920	290,280.000	
	AURIZON HOLDINGS LTD	60,000	3.410	204,600.000	
	XERO LTD	4,750	141.210	670,747.500	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,400	31.110	105,774.000	
	COLES GROUP LTD	46,845	18.030	844,615.350	
WISETECH GLOBAL LTD	5,400	51.810	279,774.000		
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	37,000	9.660	357,420.000		
EVOLUTION MINING LTD	59,500	4.120	245,140.000		

AFTERPAY LTD	7,600	110.550	840,180.000	
REECE LTD	10,500	23.460	246,330.000	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	47,300	6.850	324,005.000	
OIL SEARCH LTD	64,200	3.910	251,022.000	
SEEK LTD	11,700	34.300	401,310.000	
TREASURY WINE ESTATES LTD	25,600	11.920	305,152.000	
NEWCREST MINING LTD	28,500	24.180	689,130.000	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	62,350	93.780	5,847,183.000	
AMPOL LTD	7,950	28.930	229,993.500	
ORICA LTD	13,100	14.380	188,378.000	
QBE INSURANCE GROUP LTD	51,950	11.600	602,620.000	
WOOLWORTHS GROUP LTD	44,100	40.100	1,768,410.000	
TABCORP HOLDINGS LTD	78,263	4.990	390,532.370	
CROWN RESORTS LTD	13,400	11.100	148,740.000	
QANTAS AIRWAYS LTD	30,500	4.900	149,450.000	
TELSTRA CORP LTD	143,500	4.000	574,000.000	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	15,650	54.930	859,654.500	
MACQUARIE GROUP LTD	11,984	194.010	2,325,015.840	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	21,130	44.590	942,186.700	
CSL LTD	16,000	307.000	4,912,000.000	
WESFARMERS LTD	40,300	58.210	2,345,863.000	
COCHLEAR LTD	2,320	226.670	525,874.400	
BLUESCOPE STEEL LTD	17,800	20.330	361,874.000	
SUNCORP GROUP LTD	43,657	10.650	464,947.050	
ASX LTD	6,700	91.020	609,834.000	
COMPUTERSHARE LTD	18,200	19.140	348,348.000	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	86,136	4.370	376,414.320	
SONIC HEALTHCARE LTD	15,950	42.700	681,065.000	
AGL ENERGY LTD	21,500	5.330	114,595.000	
BRAMBLES LTD	50,400	10.100	509,040.000	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,150	66.200	407,130.000	
REA GROUP LTD	1,800	161.000	289,800.000	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	4,400	32.630	143,572.000	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	2,200	130.170	286,374.000	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 49,438,611.690	

			(4,018,864,744)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル
IMPERIAL OIL LTD	9,100		42.850	389,935.000
CONSTELLATION SOFTWARE INC	700		2,205.320	1,543,724.000
RESTAURANT BRANDS INTERN	9,687		72.960	706,763.520
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	16,100		53.950	868,595.000
INTACT FINANCIAL CORP	6,450		161.360	1,040,772.000
BCE INC	4,930		64.860	319,759.800
FRANCO-NEVADA CORP	6,900		179.960	1,241,724.000
SUNCOR ENERGY INC	54,230		31.950	1,732,648.500
METRO INC/CN	8,600		62.150	534,490.000
NATIONAL BANK OF CANADA	12,000		101.870	1,222,440.000
BANK OF NOVA SCOTIA	43,500		81.430	3,542,205.000
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	15,950		145.590	2,322,160.500
TORONTO-DOMINION BANK	65,200		93.590	6,102,068.000
GREAT-WEST LIFECO INC	9,800		37.450	367,010.000
ROYAL BANK OF CANADA	51,050		129.730	6,622,716.500
TC ENERGY CORP	35,250		61.020	2,150,955.000
PEMBINA PIPELINE CORP	19,729		38.550	760,552.950
BARRICK GOLD CORP	63,300		24.430	1,546,419.000
CAE INC	10,900		31.540	343,786.000
THOMSON REUTERS CORP	6,212		156.000	969,072.000
EMPIRE CO LTD 'A'	5,900		37.110	218,949.000
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3,500		106.730	373,555.000
BALLARD POWER SYSTEMS INC	7,800		19.570	152,646.000
CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,450		63.460	345,857.000
HYDRO ONE LTD	11,300		31.120	351,656.000
LOBLAW COMPANIES LTD	5,960		96.860	577,285.600
NORTHLAND POWER INC	7,900		38.840	306,836.000
WSP GLOBAL INC	4,300		181.840	781,912.000
TOROMONT INDUSTRIES LTD	2,800		110.940	310,632.000
PARKLAND CORP	5,100		34.170	174,267.000
QUEBECOR INC -CL B	6,000		29.000	174,000.000
EMERA INC	9,000		59.350	534,150.000
CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,800		35.300	169,440.000
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	12,700		57.720	733,044.000
IVANHOE MINES LTD-CL A	22,500		10.330	232,425.000
AGNICO EAGLE MINES LTD	8,700		64.600	562,020.000

ALGONQUIN POWER & UTILITIES	21,500	17.540	377,110.000	
B2GOLD CORP	34,700	5.120	177,664.000	
AIR CANADA	6,500	21.300	138,450.000	
KINROSS GOLD CORP	43,200	7.700	332,640.000	
BANK OF MONTREAL	23,100	137.010	3,164,931.000	
POWER CORP OF CANADA	20,100	41.830	840,783.000	
SHOPIFY INC - CLASS A	4,100	2,000.000	8,200,000.000	
NUTRIEN LTD	20,319	87.260	1,773,035.940	
CANOPY GROWTH CORP	8,400	14.090	118,356.000	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	9,600	50.920	488,832.000	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	4,700	47.720	224,284.000	
CAMECO CORP	14,000	31.830	445,620.000	
FIRSTSERVICE CORP	1,400	253.080	354,312.000	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	6,500	51.180	332,670.000	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	3,900	68.160	265,824.000	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	1,900	122.830	233,377.000	
TELUS CORP	10,800	29.490	318,492.000	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	17,000	33.890	576,130.000	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,200	174.050	382,910.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	42,000	53.430	2,244,060.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,000	566.740	566,740.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	10,200	100.370	1,023,774.000	
WESTON (GEORGE) LTD	2,737	136.480	373,545.760	
PAN AMERICAN SILVER CORP	7,000	32.620	228,340.000	
BLACKBERRY LTD	19,400	12.560	243,664.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	20,850	68.670	1,431,769.500	
ENBRIDGE INC	72,700	48.740	3,543,398.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	46,125	73.870	3,407,253.750	
MANULIFE FINANCIAL CORP	69,100	23.920	1,652,872.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	10,500	31.790	333,795.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	24,000	91.440	2,194,560.000	
IA FINANCIAL CORP INC	3,700	69.880	258,556.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,000	53.280	372,960.000	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	25,550	163.760	4,184,068.000	
CGI INC - CLASS A	7,900	107.430	848,697.000	
ONEX CORPORATION	2,600	95.610	248,586.000	

	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	16,000	37.240	595,840.000	
	IGM FINANCIAL INC	3,100	48.870	151,497.000	
	TMX GROUP LTD	1,900	128.610	244,359.000	
	OPEN TEXT CORP	9,900	62.040	614,196.000	
	SAPUTO INC	8,700	28.980	252,126.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	20,400	28.070	572,628.000	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	30,200	47.510	1,434,802.000	
	YAMANA GOLD INC	32,300	5.160	166,668.000	
	FORTIS INC	16,600	55.960	928,936.000	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	3,800	88.660	336,908.000	
	LUNDIN MINING CORP	22,100	10.420	230,282.000	
	CENOVUS ENERGY INC	46,700	15.860	740,662.000	
	DOLLARAMA INC	10,700	56.410	603,587.000	
	ATCO LTD -CLASS I	2,900	42.540	123,366.000	
	ALTAGAS LTD	10,300	24.940	256,882.000	
	KEYERA CORP	7,400	28.790	213,046.000	
カナダ・ドル 小計				カナダ・ドル 89,694,316.320 (8,006,114,675)	
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	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD	102,400	3.370	345,088.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	45,200	26.530	1,199,156.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	69,900	30.790	2,152,221.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	48,475	4.910	238,012.250	
	KEPPEL CORP LTD	56,300	5.210	293,323.000	
	UOL GROUP LTD	17,100	6.870	117,477.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	7.000	112,700.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	129,300	11.340	1,466,262.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	209,000	0.790	165,110.000	
	VENTURE CORP LTD	9,900	18.810	186,219.000	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	320,150	2.410	771,561.500	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	56,500	3.840	216,960.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	31,500	9.230	290,745.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	74,400	4.190	311,736.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 7,866,570.750 (654,577,352)	

スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
UBS GROUP AG-REG		130,600	15.755	2,057,603.000	
ROCHE HOLDING AG-BR		1,100	383.000	421,300.000	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		280	890.000	249,200.000	
ADECCO GROUP AG-REG		5,150	43.740	225,261.000	
ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN		25,000	357.500	8,937,500.000	
SIKA AG-REG		5,100	363.700	1,854,870.000	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		4	112,300.000	449,200.000	
ABB LTD-REG		62,700	31.940	2,002,638.000	
SWISS RE AG		10,700	86.660	927,262.000	
NESTLE SA-REG		102,700	120.100	12,334,270.000	
PARTNERS GROUP HOLDING AG		800	1,575.000	1,260,000.000	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		1,500	240.300	360,450.000	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		90,920	8.866	806,096.720	
JULIUS BAER GROUP LTD		8,000	57.180	457,440.000	
SGS SA-REG		210	2,846.000	597,660.000	
SCHINDLER HOLDING AG-REG		690	234.000	161,460.000	
VIFOR PHARMA AG		1,750	105.200	184,100.000	
TEMENOS AG - REG		2,300	121.300	278,990.000	
ALCON INC		17,800	73.080	1,300,824.000	
SWATCH GROUP AG/THE-BR		970	273.200	265,004.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG		5,342	381.800	2,039,575.600	
BALOISE HOLDING AG - REG		1,700	138.300	235,110.000	
CLARIANT AG-REG		7,700	18.110	139,447.000	
NOVARTIS AG-REG		79,100	74.240	5,872,384.000	
BARRY CALLEBAUT AG-REG		120	2,210.000	265,200.000	
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG		18,600	138.900	2,583,540.000	
SWISSCOM AG-REG		900	513.400	462,060.000	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS- REG		1,010	70.800	71,508.000	
GEBERIT AG-REG		1,300	698.000	907,400.000	
GIVAUDAN-REG		330	4,524.000	1,492,920.000	
STRAUMANN HOLDING AG-REG		360	1,945.000	700,200.000	
SONOVA HOLDING AG-REG		1,992	344.200	685,646.400	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG		6,200	75.440	467,728.000	
LONZA GROUP AG-REG		2,690	730.400	1,964,776.000	
SWATCH GROUP AG/THE-REG		1,900	53.050	100,795.000	



	HOLCIM LTD	18,540	45.480	843,199.200	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,110	524.600	582,306.000	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1,920	266.100	510,912.000	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,700	88.600	239,220.000	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	34	11,330.000	385,220.000	
スイス・フラン 小計				スイス・フラン 55,680,275.920 (6,862,594,007)	
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	3,870	534.200	2,067,354.000	
	ERICSSON LM-B SHS	112,830	93.820	10,585,710.600	
	VOLVO AB-B SHS	55,650	198.320	11,036,508.000	
	SKF AB-B SHARES	14,400	210.300	3,028,320.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	8,600	203.700	1,751,820.000	
	SWEDISH MATCH AB	61,300	66.980	4,105,874.000	
	TELE2 AB-B SHS	18,800	131.150	2,465,620.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN- A	62,000	131.500	8,153,000.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	54,850	96.340	5,284,249.000	
	SWEDBANK AB - A SHARES	34,100	183.560	6,259,396.000	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	28,200	162.620	4,585,884.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	22,900	150.700	3,451,030.000	
	SKANSKA AB-B SHS	12,850	210.300	2,702,355.000	
	SANDVIK AB	43,100	229.400	9,887,140.000	
	INVESTOR AB-B SHS	70,000	211.850	14,829,500.000	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	25,450	557.600	14,190,920.000	
	VOLVO AB-A SHS	8,000	202.000	1,616,000.000	
	SECURITAS AB-B SHS	11,950	132.950	1,588,752.500	
	TELIA CO AB	100,200	35.375	3,544,575.000	
	ALFA LAVAL AB	11,900	361.600	4,303,040.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	14,900	475.300	7,081,970.000	
	ASSA ABLOY AB-B	38,750	259.000	10,036,250.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,743	275.000	1,304,325.000	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	4,000	684.800	2,739,200.000	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,000	507.800	1,523,400.000	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	5,700	341.900	1,948,830.000	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	54,300	127.100	6,901,530.000	
	LUNDIN ENERGY AB	7,550	338.700	2,557,185.000	

	ESSITY AKTIEBOLAG-B	23,000	292.400	6,725,200.000	
	EMBRACER GROUP AB	20,000	95.080	1,901,600.000	
	BOLIDEN AB	10,400	306.400	3,186,560.000	
	EPIROC AB-A	24,950	218.200	5,444,090.000	
	EPIROC AB-B	14,800	180.500	2,671,400.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	15,850	131.450	2,083,482.500	
	NORDEA BANK ABP	125,000	107.240	13,405,000.000	
	EQT AB	9,100	531.400	4,835,740.000	
	EVOLUTION AB	6,550	1,003.400	6,572,270.000	
	SINCH AB	19,400	123.550	2,396,870.000	
	KINNEVIK AB - B	9,300	328.550	3,055,515.000	
	HEXAGON AB-B SHS	76,400	133.500	10,199,400.000	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,200	271.500	1,683,300.000	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 213,690,165.600 (2,677,537,775)	
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	64,800	715.700	46,377,360.000	
	DANSKE BANK A/S	26,000	109.700	2,852,200.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	120	18,520.000	2,222,400.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	38,650	221.500	8,560,975.000	
	GN STORE NORD A/S	4,850	385.600	1,870,160.000	
	CARLSBERG AS-B	3,900	1,063.000	4,145,700.000	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	7,850	488.600	3,835,510.000	
	COLOPLAST-B	4,500	1,074.500	4,835,250.000	
	DSV PANALPINA A/S	7,910	1,427.500	11,291,525.000	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	300	2,743.000	822,900.000	
	DEMANT A/S	3,875	314.600	1,219,075.000	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	230	19,660.000	4,521,800.000	
	TRYG A/S	13,200	158.250	2,088,900.000	
	PANDORA A/S	3,800	843.000	3,203,400.000	
	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,050	492.100	1,993,005.000	
	GENMAB A/S	2,520	2,550.000	6,426,000.000	
	ORSTED A/S	7,050	846.200	5,965,710.000	
	AMBU A/S-B	6,300	191.000	1,203,300.000	
デンマーク・クローネ 小計				デンマーク・クローネ 113,435,170.000 (1,959,025,386)	

ニュージーランド 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	47,500	4.490	213,275.000	
	MERCURY NZ LTD	26,000	5.850	152,100.000	
	A2 MILK CO LTD	26,200	6.200	162,440.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	72,789	4.355	316,996.090	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	48,300	7.785	376,015.500	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	23,200	33.000	765,600.000	
RYMAN HEALTHCARE LTD	16,500	12.100	199,650.000		
ニュージーランド・ドル 小計				ニュージーランド・ドル 2,186,076.590 (169,486,518)	
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	
	DNB BANK	36,750	201.800	7,416,150.000	
	NORSK HYDRO ASA	50,700	60.500	3,067,350.000	
	ORKLA ASA	29,050	84.100	2,443,105.000	
	TELENOR ASA	27,800	137.900	3,833,620.000	
	EQUINOR ASA	38,223	227.150	8,682,354.450	
	SCHIBSTED ASA-CL A	2,800	410.400	1,149,120.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,660	445.400	2,966,364.000	
	MOWI ASA	16,600	210.400	3,492,640.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,350	207.300	1,523,655.000	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	3,650	358.000	1,306,700.000	
ADEVINTA ASA	10,600	131.950	1,398,670.000		
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 37,279,728.450 (470,097,376)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	27,891	25.010	697,553.910	
	BAYER AG-REG	35,220	45.320	1,596,170.400	
	EVONIK INDUSTRIES AG	7,000	26.700	186,900.000	
	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	73,900	10.678	789,104.200	
	COMMERZBANK AG	32,935	6.235	205,349.720	
	VOLKSWAGEN AG	1,110	255.400	283,494.000	
	VOLKSWAGEN AG-PREF	6,550	164.520	1,077,606.000	
	SIEMENS AG-REG	27,350	144.560	3,953,716.000	
	E.ON SE	79,300	10.992	871,665.600	
UNIPER SE	6,650	38.680	257,222.000		

BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	11,750	85.780	1,007,915.000	
GEA GROUP AG	5,050	44.570	225,078.500	
CONTINENTAL AG	3,960	93.250	369,270.000	
BASF SE	32,870	57.980	1,905,802.600	
ALLIANZ SE-REG	14,740	192.080	2,831,259.200	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,400	71.100	455,040.000	
RWE AG	22,700	35.020	794,954.000	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,650	5.501	53,084.650	
BRENTAG SE	5,350	76.340	408,419.000	
FRESENIUS SE & CO KGAA	14,800	33.780	499,944.000	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3,320	33.020	109,626.400	
SAP SE	37,392	116.800	4,367,385.600	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,040	239.100	1,205,064.000	
ZALANDO SE	7,650	81.500	623,475.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	5,350	59.620	318,967.000	
KION GROUP AG	2,400	93.900	225,360.000	
COVESTRO AG	6,700	50.680	339,556.000	
RATIONAL AG	190	811.600	154,204.000	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,210	580.000	701,800.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	5,300	75.000	397,500.000	
DELIVERY HERO SE	5,800	119.300	691,940.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,400	177.500	248,500.000	
BECHTLE AG	2,850	63.240	180,234.000	
NEMETSCHKE SE	2,000	107.550	215,100.000	
SCOUT24 AG	3,600	59.760	215,136.000	
AROUNDTOWN SA	32,500	5.520	179,400.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,100	64.460	651,046.000	
KNORR-BREMSE AG	2,500	90.440	226,100.000	
HELLOFRESH SE	5,700	94.500	538,650.000	
TEAMVIEWER AG	5,350	12.350	66,072.500	
SIEMENS ENERGY AG	14,325	24.090	345,089.250	
BEIERSDORF AG	3,610	89.260	322,228.600	
FUCHS PETROLUB PREF	2,350	39.800	93,530.000	
MERCK KGAA	4,600	219.600	1,010,160.000	
ADIDAS AG	6,810	254.300	1,731,783.000	
PUMA SE	3,860	106.350	410,511.000	
HENKEL AG & CO KGAA	3,750	66.800	250,500.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	119,200	16.040	1,911,968.000	

FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	7,220	53.520	386,414.400	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	30,650	82.800	2,537,820.000	
QIAGEN N.V.	7,698	49.230	378,972.540	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	46,700	40.220	1,878,274.000	
HANNOVER RUECK SE	2,200	155.500	342,100.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	35,450	53.580	1,899,411.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	6,710	142.200	954,162.000	
LANXESS AG	2,800	51.240	143,472.000	
MTU AERO ENGINES AG	1,790	167.650	300,093.500	
SYMRISE AG	4,400	125.900	553,960.000	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	33,800	2.357	79,666.600	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	1,950	70.500	137,475.000	
VONOVIA SE	19,500	49.170	958,815.000	
LEG IMMOBILIEN SE	2,550	124.150	316,582.500	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	32,260	31.745	1,024,093.700	
NN GROUP NV	9,900	43.890	434,511.000	
ARCELORMITTAL	25,700	24.440	628,108.000	
HEINEKEN NV	9,200	93.440	859,648.000	
AEGON NV	64,244	3.939	253,057.110	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	37,383	30.255	1,131,022.660	
AKZO NOBEL N.V.	6,768	94.460	639,305.280	
KONINKLIJKE DSM NV	6,200	191.800	1,189,160.000	
WOLTERS KLUWER	9,600	100.300	962,880.000	
ING GROEP NV	139,600	12.158	1,697,256.800	
KONINKLIJKE KPN NV	121,150	2.619	317,291.850	
ASML HOLDING NV	15,010	704.800	10,579,048.000	
ABN AMRO BANK NV-CVA	15,150	12.672	191,980.800	
ADYEN NV	700	2,460.500	1,722,350.000	
JUST EAT TAKEAWAY	6,450	58.150	375,067.500	
PROSUS NV	33,380	70.680	2,359,298.400	
JDE PEET'S NV	2,600	25.050	65,130.000	
INPOST SA	7,000	10.312	72,184.000	
ASM INTERNATIONAL NV	1,700	396.400	673,880.000	
VOPAK	2,300	33.180	76,314.000	
RANDSTAD NV	4,300	56.100	241,230.000	

HEINEKEN HOLDING NV	3,950	77.300	305,335.000	
TOTALENERGIES SE	89,350	41.200	3,681,220.000	
MICHELIN (CGDE)	6,050	128.350	776,517.500	
AIR LIQUIDE SA	16,977	147.360	2,501,730.720	
KERING	2,700	683.800	1,846,260.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	19,350	151.240	2,926,494.000	
BOUYGUES SA	8,200	29.910	245,262.000	
BNP PARIBAS	40,300	55.380	2,231,814.000	
THALES SA	3,850	73.880	284,438.000	
DANONE	23,400	54.330	1,271,322.000	
CARREFOUR SA	21,200	15.170	321,604.000	
SUEZ	12,625	19.770	249,596.250	
VIVENDI	27,891	11.200	312,379.200	
L'OREAL	9,040	401.800	3,632,272.000	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	17,900	57.240	1,024,596.000	
LEGRAND SA	9,467	95.780	906,749.260	
PERNOD RICARD SA	7,487	206.600	1,546,814.200	
EURAZEO SE	1,254	73.450	92,106.300	
SOCIETE GENERALE SA	29,000	27.485	797,065.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	9,910	697.200	6,909,252.000	
ACCOR SA	6,150	26.670	164,020.500	
CAPGEMINI SE	5,720	201.900	1,154,868.000	
VALEO SA	7,700	24.570	189,189.000	
PUBLICIS GROUPE	8,000	57.960	463,680.000	
BUREAU VERITAS SA	10,600	28.310	300,086.000	
EIFFAGE	3,040	82.320	250,252.800	
SODEXO SA	2,950	75.140	221,663.000	
IPSEN	1,150	86.780	99,797.000	
ORPEA	1,800	83.600	150,480.000	
AMUNDI SA	2,250	75.050	168,862.500	
TELEPERFORMANCE	2,100	357.400	750,540.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,000	44.890	134,670.000	
FAURECIA	3,857	37.140	143,248.980	
EUROFINS SCIENTIFIC	4,750	112.980	536,655.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,000	513.200	513,200.000	
SEB SA	997	133.300	132,900.100	
ESSILORLUXOTTICA	10,150	180.380	1,830,857.000	
DASSAULT AVIATION SA	1,000	84.450	84,450.000	

WORLDLINE SA	8,514	47.470	404,159.580	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,500	41.830	146,405.000	
AXA SA	69,400	24.235	1,681,909.000	
EDENRED	8,850	40.500	358,425.000	
RENAULT SA	6,400	29.145	186,528.000	
HERMES INTERNATIONAL	1,130	1,640.000	1,853,200.000	
STMICROELECTRONICS NV	24,400	43.025	1,049,810.000	
REMY COINTREAU	750	213.400	160,050.000	
ATOS SE	3,200	37.360	119,552.000	
DASSAULT SYSTEMES SE	23,450	53.430	1,252,933.500	
WENDEL	930	103.500	96,255.000	
ORANGE	71,400	9.604	685,725.600	
ALSTOM	11,400	32.370	369,018.000	
CNP ASSURANCES	5,850	21.580	126,243.000	
SANOFI	40,725	85.610	3,486,467.250	
VINCI SA	18,850	84.160	1,586,416.000	
AIRBUS SE	21,100	99.690	2,103,459.000	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	19,700	28.240	556,328.000	
CREDIT AGRICOLE SA	41,600	12.132	504,691.200	
BIOMERIEUX	1,340	127.350	170,649.000	
ENGIE	64,623	12.894	833,248.960	
EDF	20,250	12.345	249,986.250	
SAFRAN SA	12,200	101.600	1,239,520.000	
ARKEMA	2,220	116.000	257,520.000	
ADP	910	104.400	95,004.000	
SCOR SE	5,550	26.700	148,185.000	
GETLINK SE	14,200	12.895	183,109.000	
BOLLORE	28,600	4.766	136,307.600	
UCB SA	4,530	97.040	439,591.200	
KBC GROUP NV	8,900	72.580	645,962.000	
COLRUYT SA	1,600	41.350	66,160.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,000	96.820	387,280.000	
SOLVAY SA	2,600	99.220	257,972.000	
UMICORE	7,000	43.070	301,490.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	27,200	50.840	1,382,848.000	
AGEAS	6,290	46.310	291,289.900	
PROXIMUS	4,950	16.030	79,348.500	
ELIA GROUP SA/NV	1,050	109.100	114,555.000	
SOFINA	600	406.800	244,080.000	

ARGENX SE	1,640	250.900	411,476.000	
PRYSMIAN SPA	8,850	33.290	294,616.500	
ASSICURAZIONI GENERALI	39,443	17.800	702,085.400	
MEDIOBANCA SPA	22,365	9.724	217,477.260	
TENARIS SA	15,700	8.922	140,075.400	
UNICREDIT SPA	76,356	10.570	807,082.920	
TELECOM ITALIA SPA	343,982	0.471	162,049.920	
TELECOM ITALIA-RSP	203,950	0.445	90,859.720	
INTESA SANPAOLO	594,537	2.143	1,274,092.790	
ATLANTIA SPA	17,257	16.160	278,873.120	
POSTE ITALIANE SPA	17,700	11.195	198,151.500	
MONCLER SPA	7,400	64.600	478,040.000	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	3,850	54.960	211,596.000	
ENI SPA	90,400	11.800	1,066,720.000	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	19,500	13.085	255,157.500	
DIASORIN SPA	850	185.100	157,335.000	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	11,200	10.275	115,080.000	
NEXI SPA	15,850	13.795	218,650.750	
AMPLIFON SPA	4,300	42.760	183,868.000	
ENEL SPA	291,134	6.789	1,976,508.720	
SNAM SPA	70,100	4.997	350,289.700	
TERNA SPA	49,000	6.496	318,304.000	
EXOR NV	3,780	78.880	298,166.400	
CNH INDUSTRIAL NV	36,600	14.945	546,987.000	
FINECOBANK SPA	21,900	15.555	340,654.500	
STELLANTIS NV	73,200	15.568	1,139,577.600	
FERRARI NV	4,495	235.800	1,059,921.000	
TELEFONICA SA	186,727	3.961	739,719.010	
ENDESA SA	10,350	20.150	208,552.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	236,700	4.802	1,136,751.750	
IBERDROLA SA	211,934	9.916	2,101,537.540	
REPSOL SA	53,400	9.912	529,300.800	
GRIFOLS SA	9,800	16.730	163,954.000	
BANCO SANTANDER SA	619,950	2.783	1,725,630.820	
AMADEUS IT GROUP SA	16,050	58.080	932,184.000	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,300	24.630	253,689.000	
CAIXABANK SA	160,500	2.287	367,063.500	



ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	8,876	21.540	191,189.040	
AENA SME SA	2,600	129.350	336,310.000	
CELLNEX TELECOM SA	18,005	53.240	958,586.200	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	39,000	29.670	1,157,130.000	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	8,500	23.480	199,580.000	
ENAGAS SA	7,950	20.120	159,954.000	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	15,700	18.520	290,764.000	
FERROVIAL SA	17,670	25.100	443,517.000	
UPM-KYMMENE OYJ	19,150	32.700	626,205.000	
NOKIA OYJ	191,300	5.019	960,134.700	
WARTSILA OYJ ABP	17,000	12.335	209,695.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	19,700	15.440	304,168.000	
ELISA OYJ	5,100	53.280	271,728.000	
SAMPO OYJ-A SHS	17,800	43.060	766,468.000	
FORTUM OYJ	15,900	25.560	406,404.000	
KESKO OYJ-B SHS	9,800	27.970	274,106.000	
KONE OYJ-B	12,100	59.160	715,836.000	
NESTE OYJ	15,100	42.980	648,998.000	
ORION OYJ-CLASS B	3,600	36.930	132,948.000	
VERBUND AG	2,430	89.750	218,092.500	
OMV AG	5,300	47.250	250,425.000	
ERSTE GROUP BANK AG	10,000	38.760	387,600.000	
VOESTALPINE AG	4,250	29.480	125,290.000	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	5,250	25.540	134,085.000	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	8,600	45.870	394,482.000	
KINGSPAN GROUP PLC	5,400	99.980	539,892.000	
JERONIMO MARTINS	8,500	19.500	165,750.000	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	99,200	4.866	482,707.200	
GALP ENERGIA SGPS SA	16,750	8.390	140,532.500	
EDP RENOVAVEIS SA	11,000	22.460	247,060.000	
KERRY GROUP PLC-A	5,600	108.350	606,760.000	
CRH PLC	28,100	43.400	1,219,540.000	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,030	122.050	735,961.500	
ユーロ 小計			ユーロ 172,118,377.880 (22,101,720,904)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル

POWER ASSETS HOLDINGS LTD	52,500	47.800	2,509,500.000	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	83,000	43.650	3,622,950.000	
MTR CORP	58,500	42.000	2,457,000.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	51,000	96.750	4,934,250.000	
SINO LAND CO	126,000	9.650	1,215,900.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	104,669	50.500	5,285,784.500	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	18,500	44.050	814,925.000	
CLP HOLDINGS LTD	62,000	76.800	4,761,600.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	55,507	33.050	1,834,506.350	
HONG KONG & CHINA GAS	422,475	11.840	5,002,104.000	
HANG SENG BANK LTD	28,800	140.900	4,057,920.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	58,500	31.600	1,848,600.000	
WH GROUP LTD	361,000	5.100	1,841,100.000	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	46,100	445.000	20,514,500.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	78,000	16.000	1,248,000.000	
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	69,000	19.380	1,337,220.000	
SJM HOLDINGS LTD	71,000	5.580	396,180.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	45,000	19.400	873,000.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	91,169	45.300	4,129,955.700	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	23,500	46.500	1,092,750.000	
AIA GROUP LTD	461,400	83.900	38,711,460.000	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	54,000	28.800	1,555,200.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,000	40.250	2,535,750.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	67,900	20.200	1,371,580.000	
ESR CAYMAN LTD	75,000	25.850	1,938,750.000	
SANDS CHINA LTD	92,800	18.680	1,733,504.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	82,000	14.560	1,193,920.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	53,000	164.700	8,729,100.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	141,500	24.000	3,396,000.000	
WYNN MACAU LTD	54,000	7.190	388,260.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 131,331,269.550 (1,916,123,223)	
合計			229,141,995,652	

## (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			アメリカ・ドル	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,087	1,224,847.860	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	11,857	1,896,408.580	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,470	603,559.800	
		VORNADO REALTY TRUST	5,897	245,197.260	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,040	1,436,502.800	
		EQUITY RESIDENTIAL	13,050	1,125,171.000	
		EQUINIX INC	3,288	2,696,160.000	
		AMERICAN TOWER CORP	16,450	4,391,163.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	24,943	409,564.060	
		INVITATION HOMES INC	20,850	860,479.500	
		VICI PROPERTIES INC	19,800	556,974.000	
		VENTAS INC	13,800	677,856.000	
		WEYERHAEUSER CO	27,564	1,068,105.000	
		AGNC INVESTMENT CORP	19,600	310,268.000	
		CROWN CASTLE INTL CORP	15,750	2,926,822.500	
		IRON MOUNTAIN INC	10,260	480,783.600	
		SUN COMMUNITIES INC	4,100	806,675.000	
		PROLOGIS INC	26,952	4,131,202.560	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,100	1,046,826.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,450	582,532.500	
		DUKE REALTY CORP	13,800	820,410.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,400	831,600.000	
		WELLTOWER INC	15,300	1,255,212.000	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	19,800	674,388.000	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,250	892,500.000	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,150	521,643.000	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	50,800	424,180.000	
REALTY INCOME CORP	19,445	1,357,261.000			
PUBLIC STORAGE	5,670	1,881,816.300			
REGENCY CENTERS CORP	5,700	403,332.000			
UDR INC	10,550	606,308.500			
WP CAREY INC	6,400	504,000.000			
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	8,300	230,408.000			
DIGITAL REALTY TRUST INC	10,300	1,738,537.000			

	EXTRA SPACE STORAGE INC	4,900	994,945.000	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	21,650	465,258.500	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 41,078,898.320 (4,673,546,262)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	23,562	176,950.620	
	SEGRO PLC	43,100	610,942.500	
	BRITISH LAND CO PLC	29,550	154,073.700	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 941,966.820 (142,764,491)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	DEXUS/AU	36,150	392,227.500	
	LENDLEASE GROUP	23,500	249,100.000	
	TRANSURBAN GROUP	95,400	1,306,026.000	
	SYDNEY AIRPORT	45,800	377,392.000	
	APA GROUP	41,400	401,580.000	
	SCENTRE GROUP	181,922	553,042.880	
	GPT GROUP	68,160	353,750.400	
	MIRVAC GROUP	136,100	394,690.000	
	STOCKLAND	83,800	364,530.000	
	GOODMAN GROUP	58,200	1,428,810.000	
	VICINITY CENTRES	137,273	232,677.730	
オーストラリア・ドル	小計		オーストラリア・ドル 6,053,826.510 (492,115,557)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,900	169,534.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5,800	128,296.000	
カナダ・ドル	小計		カナダ・ドル 297,830.000 (26,584,306)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	124,500	372,255.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	190,870	408,461.800	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	114,300	218,313.000	

	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	77,500	161,975.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 1,161,004.800 (96,607,209)	
ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,600	276,000.000	ユーロ
	GECINA SA	1,600	190,960.000	
	KLEPIERRE	7,150	136,243.250	
	COVIVIO	1,750	128,380.000	
ユーロ 小計			ユーロ 731,583.250 (93,942,605)	
香港・ドル	LINK REIT	81,500	5,599,050.000	香港・ドル
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	92,000	703,800.000	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	138,000	1,465,560.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 7,768,410.000 (113,341,102)	
投資証券 合計			5,638,901,532 [5,638,901,532]	
合計			5,638,901,532 [5,638,901,532]	

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 598銘柄	97.3%	2.7%	74.6%
	投資証券 36銘柄			
イギリス・ポンド	株式 82銘柄	98.6%	1.4%	4.2%
	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	89.1%	10.9%	1.9%
	投資証券 11銘柄			
カナダ・ドル	株式 88銘柄	99.7%	0.3%	3.4%
	投資証券 2銘柄			

シンガポール・ドル	株式	14銘柄	87.1%	12.9%	0.3%
	投資証券	4銘柄			
スイス・フラン	株式	40銘柄	100%	-%	2.9%
スウェーデン・クローナ	株式	41銘柄	100%	-%	1.1%
デンマーク・クローネ	株式	18銘柄	100%	-%	0.8%
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	11銘柄	100%	-%	0.2%
ユーロ	株式	230銘柄	99.6%	0.4%	9.5%
	投資証券	4銘柄			
香港・ドル	株式	30銘柄	94.4%	5.6%	0.9%
	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

	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	94,440,539	659,917,348
コール・ローン	84,736,581	600,473,265
株式	10,885,466,209	13,499,628,357
投資証券	370,527,886	1,239,446,103
派生商品評価勘定	30,470,879	-
未収入金	158,585	-
未収配当金	4,962,173	13,553,472
差入委託証拠金	120,253,166	205,263,401
流動資産合計	11,591,016,018	16,218,281,946
資産合計	11,591,016,018	16,218,281,946
負債の部		

流動負債		
派生商品評価勘定	136,357	80,747,580
未払解約金	22,960,464	11,533,875
流動負債合計	23,096,821	92,281,455
負債合計	23,096,821	92,281,455
純資産の部		
元本等		
元本	1	7,600,562,331
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,967,356,866	7,364,096,449
元本等合計	11,567,919,197	16,126,000,491
純資産合計	11,567,919,197	16,126,000,491
負債純資産合計	11,591,016,018	16,218,281,946

## 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。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)新株予約権証券</p>

	<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、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	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1. 1 期首	2019年12月3日	2020年12月1日
期首元本額	5,229,878,945円	7,600,562,331円
期中追加設定元本額	2,845,361,975円	2,668,922,872円
期中一部解約元本額	474,678,589円	1,507,581,161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)	24,807,196円	39,405,208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)	268,661,195円	277,391,903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)	331,827,564円	270,194,117円
D-I's 新興国株式インデックス	124,780,786円	125,705,126円
iFree 新興国株式インデックス	2,774,751,964円	3,749,273,501円
iFree 8資産バランス	2,062,394,720円	2,353,124,357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)	433,627,020円	314,532,254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	1,094,619,655円	1,182,115,153円
ダイワ・インデックスセレク ト 新興国株式	393,670,881円	363,852,121円
ダイワ・ノーロード 新興国 株式ファンド	91,421,350円	86,310,302円
計	7,600,562,331円	8,761,904,042円
2. 期末日における受益権の総数	7,600,562,331口	8,761,904,042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 2020年12月1日 至 2021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	2021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	2020年11月30日現在	2021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	1,024,011,630	559,723,185
投資証券	39,343,894	67,043,105
合計	1,063,355,524	626,766,290

（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（2020年7月7日から2020年11月30日まで、及び2021年7月6日から2021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	2020年11月30日 現在				2021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	303,239,326	-	333,590,789	30,351,463	1,381,410,130	-	1,302,515,754	78,894,376
合計	303,239,326	-	333,590,789	30,351,463	1,381,410,130	-	1,302,515,754	78,894,376

## (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	2020年11月30日 現在				2021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	413,383	-	412,587	796	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	413,383	-	412,587	796	-	-	-	-
買 建	84,564,346	-	84,546,609	17,737	521,810,396	-	519,957,192	1,853,204
アメリカ・ドル	84,564,346	-	84,546,609	17,737	521,810,396	-	519,957,192	1,853,204
合計	84,977,729	-	84,959,196	16,941	521,810,396	-	519,957,192	1,853,204

## (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)

	2020年11月30日現在	2021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)	1.5220円 (15,220円)	1.8405円 (18,405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	
	JOYY INC-ADR	1,000	52.800	52,800.000	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	5,200	2.160	11,232.000	
	SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PEF	29,000	5.090	147,610.000	
	BAIDU INC - SPON ADR	2,800	150.290	420,812.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	5,600	9.660	54,096.000	
	CANADIAN SOLAR INC	2,300	39.060	89,838.000	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	3,400	30.980	105,332.000	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	35,350	8.080	285,628.000	
	TRIP.COM GROUP LTD-ADR	9,300	27.120	252,216.000	
	VTB BANK JSC -GDR-REG S	191,217	1.218	232,902.300	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	7,290	29.240	213,159.600	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	9,608	37.780	362,990.240	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	36,075	5.085	183,441.370	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	16,993	28.960	492,117.280	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	20,694	16.020	331,517.880	
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	156,977	16.830	2,641,922.910		
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	2,498	219.000	547,062.000		
LUKOIL PJSC-SPON ADR	20,288	88.420	1,793,864.960		

	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	91,299	7.636	697,159.160	
	GAZPROM PJSC-SPON ADR	392,339	9.036	3,545,175.200	
	SEVERSTAL - GDR REG S	13,460	21.680	291,812.800	
	TATNEFT PJSC - PREF	15,509	5.871	91,066.450	
	SISTEMA PJSFC	319,200	0.334	106,794.100	
	INTER RAO UES PJSC	2,726,100	0.057	157,285.060	
	ALROSA PJSC	180,310	1.672	301,581.810	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	56,619	2.031	115,010.060	
	AEROFLOT PJSC	164,910	0.816	134,706.400	
	アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 13,659,133.580 (1,553,999,628)	
インド・ルピー		株	インド・ルピー	インド・ルピー	
	TATA STEEL LTD	34,872	1,114.750	38,873,562.000	
	AXIS BANK LTD	43,190	651.100	28,121,009.000	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,950	7,149.500	13,941,525.000	
	TATA POWER CO LTD	79,437	218.650	17,368,900.050	
	BANK OF BARODA	73,629	86.250	6,350,501.250	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	5,223	2,329.400	12,166,456.200	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	66,496	296.450	19,712,739.200	
	STATE BANK OF INDIA	78,270	465.100	36,403,377.000	
	NTPC LTD	240,522	126.500	30,426,033.000	
	JSW STEEL LTD	31,764	625.600	19,871,558.400	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	86,798	200.250	17,381,299.500	
	INDIAN OIL CORP LTD	230,471	118.800	27,379,954.800	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	68,605	367.450	25,208,907.250	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	22,088	352.650	7,789,333.200	
	ULTRATECH CEMENT LTD	1,097	7,388.250	8,104,910.250	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	5,346	1,403.250	7,501,774.500	
	TECH MAHINDRA LTD	9,274	1,536.650	14,250,892.100	
	YES BANK LTD	17,640	12.150	214,326.000	
	TATA MOTORS LTD-A-DVR	28,202	257.550	7,263,425.100	
	REC LTD	53,060	128.900	6,839,434.000	
	COAL INDIA LTD	144,050	154.250	22,219,712.500	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE L	62,266	230.900	14,377,219.400	
	GAIL INDIA LTD	69,194	130.350	9,019,437.900	

	HINDALCO INDUSTRIES LTD	64,018	420.150	26,897,162.700	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	13,620	1,683.950	22,935,399.000	
	WIPRO LTD	16,049	630.600	10,120,499.400	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	10,898	3,502.000	38,164,796.000	
	INFOSYS LTD	48,724	1,696.350	82,652,957.400	
	LARSEN & TOUBRO LTD	13,549	1,767.250	23,944,470.250	
	TATA MOTORS LTD	110,373	461.450	50,931,620.850	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	21,890	2,713.800	59,405,082.000	
	ICICI BANK LTD	22,299	718.400	16,019,601.600	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	55,200	2,441.500	134,770,800.000	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	238,025	144.100	34,299,402.500	
	ITC LTD	80,434	221.500	17,816,131.000	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	23,485	850.800	19,981,038.000	
	HERO MOTOCORP LTD	2,967	2,490.800	7,390,203.600	
	BHARTI AIRTEL LTD	29,016	739.350	21,452,979.600	
	UPL LTD	13,776	689.350	9,496,485.600	
	SUN PHARMACEUTICAL INDUS	14,760	751.050	11,085,498.000	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	16,274	1,133.150	18,440,883.100	
	VEDANTA LTD	132,916	346.800	46,095,268.800	
	インド・ルピー 小計			インド・ルピー 1,042,686,567.000 (1,595,310,448)	
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	493,300	5,975.000	2,947,467,500.000	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	101,300	7,800.000	790,140,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,806,100	4,140.000	7,477,254,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	425,000	6,950.000	2,953,750,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	597,000	7,400.000	4,417,800,000.000	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	547,400	7,175.000	3,927,595,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	857,000	1,540.000	1,319,780,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,345,200	4,170.000	5,609,484,000.000	
	ADARO ENERGY TBK PT	1,289,500	1,690.000	2,179,255,000.000	
	インドネシア・ルピア 小計			インドネシア・ルピア 31,622,525,500.000 (252,980,204)	

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	73,700	18.070	1,331,759.000
BANK OF BEIJING CO LTD -A	149,500	4.400	657,800.000
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	17,500	16.680	291,900.000
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	24,900	48.660	1,211,634.000
IND & COMM BK OF CHINA-A	379,600	4.580	1,738,568.000
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	9,300	18.560	172,608.000
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	9,400	28.820	270,908.000
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	2,900	58.740	170,346.000
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	300	1,985.000	595,500.000
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	8,000	36.120	288,960.000
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	50,000	13.950	697,500.000
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	173,300	8.590	1,488,647.000
CITIC SECURITIES CO-A	14,800	23.800	352,240.000
CHINA MERCHANTS BANK-A	38,800	49.820	1,933,016.000
PING AN BANK CO LTD-A	46,400	17.510	812,464.000
GF SECURITIES CO LTD-A	13,400	23.030	308,602.000
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	394,000	4.640	1,828,160.000
HAIER SMART HOME CO LTD-A	10,100	26.840	271,084.000
SAIC MOTOR CORP LTD-A	63,000	20.090	1,265,670.000
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	33,700	4.650	156,705.000
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	42,100	6.200	261,020.000
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	28,900	3.820	110,398.000
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	17,160	16.390	281,252.400
METALLURGICAL CORP OF CHINA	90,300	3.780	341,334.000
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	70,400	5.250	369,600.000
JIANGXI COPPER CO LTD-A	6,800	22.960	156,128.000
YANZHOU COAL MINING CO-A	8,100	22.970	186,057.000
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	30,600	5.760	176,256.000



AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	804,600	2.920	2,349,432.000	
BANK OF CHINA LTD-A	258,100	3.060	789,786.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	208,900	4.060	848,134.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	331,500	4.580	1,518,270.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	39,800	19.570	778,886.000	
CHINA VANKE CO LTD -A	34,400	18.460	635,024.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	15,300	27.250	416,925.000	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	48,700	4.540	221,098.000	
CHINA MINSHENG BANKING-A	303,300	3.890	1,179,837.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	253,000	3.340	845,020.000	
CGN POWER CO LTD-A	18,900	2.900	54,810.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	15,400	15.640	240,856.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	22,900	11.850	271,365.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	185,000	5.320	984,200.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	91,500	6.660	609,390.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	5,200	38.080	198,016.000	
HUAXIA BANK CO LTD-A	117,400	5.680	666,832.000	
AIR CHINA LTD-A	20,700	7.980	165,186.000	
BYD CO LTD -A	700	304.460	213,122.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	7,100	15.720	111,612.000	
WEICHAO POWER CO LTD-A	9,800	15.370	150,626.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	13,000	10.250	133,250.000	
HUANENG POWER INTL INC-A	66,500	6.230	414,295.000	
オフショア・人民元 小計			オフショア・人民元 31,522,088.400 (562,041,988)	
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	13,173	111.200	1,464,837.600	
SAUDI TELECOM CO	5,452	111.000	605,172.000	
AL RAJHI BANK	24,162	135.000	3,261,870.000	
ETIHAD ETISALAT CO	17,690	30.950	547,505.500	
ALINMA BANK	32,925	23.020	757,933.500	
THE SAUDI NATIONAL BANK	11,842	60.600	717,625.200	
SAUDI ARABIAN OIL CO	28,037	34.900	978,491.300	

	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	28,525	16.480	470,092.000	
	SAUDI ELECTRICITY CO	36,617	24.000	878,808.000	
サウジアラビア・リアル 小計				サウジアラビア・リアル 9,682,335.100 (294,052,516)	
シンガポール・ ドル	株 YANGZIJIANG SHIPBUILDING	142,700	シンガポール・ドル 1.300	シンガポール・ドル 185,510.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 185,510.000 (15,436,287)	
タイ・パーツ	株 CHAROEN POKPHAND FOODS NON- VOTING	3,277	タイ・パーツ 0.000	タイ・パーツ 0.000	
	CP ALL NON-VOTING DR PCL	9,646	7.500	72,345.000	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	27,100	117.000	3,170,700.000	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	45,800	381.000	17,449,800.000	
	KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	38,500	136.000	5,236,000.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL- NVDR	113,900	28.250	3,217,675.000	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	16,900	136.500	2,306,850.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	164,100	123.500	20,266,350.000	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	3,168,300	1.200	3,801,960.000	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	91,700	39.750	3,645,075.000	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	41,200	211.000	8,693,200.000	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	641,800	11.500	7,380,700.000	
	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	496,400	10.700	5,311,480.000	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI- NVDR	152,000	22.700	3,450,400.000	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	67,000	113.500	7,604,500.000	
	IRPC PCL - NVDR	1,120,200	3.860	4,323,972.000	
	BANGCHAK CORP PCL-NVDR	104,800	24.400	2,557,120.000	
	PTT PCL-NVDR	1,036,800	36.000	37,324,800.000	
	THAI OIL PCL-NVDR	96,100	48.500	4,660,850.000	
	CP ALL PCL-NVDR	144,700	59.500	8,609,650.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PC- NVDR	53,900	59.750	3,220,525.000	
	BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	18,700	117.000	2,187,900.000	

	LAND & HOUSES PUB - NVDR	327,100	8.500	2,780,350.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	229,400	24.600	5,643,240.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	140,400	57.000	8,002,800.000	
タイ・パーツ 小計				タイ・パーツ 170,918,242.000 (577,703,658)	
チリ・ペソ		株	チリ・ペソ	チリ・ペソ	
	CENCOSUD SA	46,115	1,270.000	58,566,050.000	
	BANCO SANTANDER CHILE	2,898,696	37.550	108,846,034.800	
	ENEL AMERICAS SA	1,221,763	108.000	131,950,404.000	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	1,472	53,920.000	79,370,240.000	
	FALABELLA SA	21,593	2,700.000	58,301,100.000	
	BANCO DE CHILE	1,034,539	80.000	82,763,120.000	
チリ・ペソ 小計				チリ・ペソ 519,796,948.800 (70,198,577)	
トルコ・リラ		株	トルコ・リラ	トルコ・リラ	
	IS YATIRIM MENKUL DEGERLER A	32,496	19.680	639,521.280	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	241,841	11.400	2,756,987.400	
	AKBANK T.A.S.	334,274	6.600	2,206,208.400	
	TURKIYE IS BANKASI-C	249,856	6.630	1,656,545.280	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	87,760	18.480	1,621,804.800	
	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	19,990	155.400	3,106,446.000	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	84,222	22.840	1,923,630.480	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	127,923	13.100	1,675,791.300	
	TURKIYE HALK BANKASI	110,822	4.870	539,703.140	
	YAPI VE KREDI BANKASI	237,787	3.170	753,784.790	
	KOC HOLDING AS	80,781	29.020	2,344,264.620	
	TURK HAVA YOLLARI AO	129,489	17.320	2,242,749.480	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	12,396	69.450	860,902.200	
トルコ・リラ 小計				トルコ・リラ 22,328,339.170 (199,304,988)	
ブラジル・リアル		株	ブラジル・リアル	ブラジル・リアル	

XP INC BDR	12,405	167.350	2,075,976.750	
GETNET ADQUIRENCIA E SERVICO	8,300	3.770	31,291.000	
CIA PARANAENSE DE ENERGIA	16,400	5.570	91,348.000	
ENERGISA SA-UNITS	10,600	45.400	481,240.000	
RUMO SA	28,500	17.620	502,170.000	
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	176,500	4.190	739,535.000	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	18,400	21.250	391,000.000	
VIBRA ENERGIA SA	75,500	21.660	1,635,330.000	
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	10,800	23.090	249,372.000	
TIM SA	48,526	13.890	674,026.140	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS- PR	443,800	29.470	13,078,786.000	
BANCO BRADESCO SA-PREF	421,218	20.270	8,538,088.860	
ITAU UNIBANCO HOLDING S- PREF	485,736	22.660	11,006,777.760	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	18,500	22.540	416,990.000	
VALE SA	94,890	69.500	6,594,855.000	
GERDAU SA-PREF	57,000	25.800	1,470,600.000	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	367,300	30.160	11,077,768.000	
CIA ENERGETICA MINAS GER- PRF	107,487	13.450	1,445,700.150	
ITAUSA SA	136,100	9.820	1,336,502.000	
BRASKEM SA-PREF A	26,100	52.200	1,362,420.000	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	22,200	32.290	716,838.000	
BANCO DO BRASIL S.A.	154,300	30.810	4,753,983.000	
COSAN SA	64,400	21.480	1,383,312.000	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	37,200	32.920	1,224,624.000	
CIA PARANAENSE DE ENERGI- PFB	79,200	6.100	483,120.000	
EMBRAER SA	71,200	19.750	1,406,200.000	
METALURGICA GERDAU SA-PREF	94,900	10.750	1,020,175.000	
CCR SA	88,600	11.510	1,019,786.000	
BRF SA	57,100	20.400	1,164,840.000	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	26,000	34.300	891,800.000	
LOJAS RENNER S.A.	21,675	28.940	627,274.500	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	14,784	5.640	83,381.760	

	JBS SA	96,500	34.730	3,351,445.000	
	SUZANO SA	12,245	55.670	681,679.150	
	MARFRIG GLOBAL FOODS SA	37,900	23.880	905,052.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	90,600	11.500	1,041,900.000	
	CIELO SA	244,228	2.070	505,551.960	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	37,000	22.780	842,860.000	
	SUL AMERICA SA - UNITS	18,818	25.420	478,353.560	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GER	18,654	17.550	327,377.700	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	33,200	33.760	1,120,832.000	
	RAIA DROGASIL SA	23,500	22.610	531,335.000	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	36,900	50.320	1,856,808.000	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	73,200	14.190	1,038,708.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	51,600	20.280	1,046,448.000	
	LOJAS AMERICANAS SA	4,693	5.640	26,468.520	
	COGNA EDUCACAO	264,300	2.410	636,963.000	
	BANCO BRADESCO S.A.	126,765	17.440	2,210,781.600	
	AMBEV SA	187,200	16.340	3,058,848.000	
ブラジル・リアル 小計				ブラジル・リアル 97,636,522.410 (1,980,898,585)	
マレーシア・リンギット		株	マレーシア・リンギット	マレーシア・リンギット	
	MALAYAN BANKING BHD	58,300	8.050	469,315.000	
	GENTING BHD	87,800	4.580	402,124.000	
	PUBLIC BANK BERHAD	261,700	3.960	1,036,332.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	136,000	5.110	694,960.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	49,700	9.260	460,222.000	
マレーシア・リンギット 小計				マレーシア・リンギット 3,062,953.000 (82,245,495)	
メキシコ・ペソ		株	メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	8,800	249.660	2,197,008.000	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	896,500	18.570	16,648,005.000	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	75,800	39.770	3,014,566.000	
	CEMEX SAB-CPO	896,719	13.720	12,302,984.680	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICAN-UBD	75,600	154.800	11,702,880.000	

	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	57,400	87.780	5,038,572.000	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	159,300	69.790	11,117,547.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	65,300	125.960	8,225,188.000	
メキシコ・ペソ	小計			メキシコ・ペソ 70,246,750.680 (368,999,157)	
香港・ドル	株		香港・ドル	香港・ドル	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	460,000	3.740	1,720,400.000	
	CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	62,000	12.100	750,200.000	
	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	78,000	23.950	1,868,100.000	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	51,000	12.800	652,800.000	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	49,200	17.560	863,952.000	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,079,800	3.520	7,320,896.000	
	DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	246,000	7.280	1,790,880.000	
	GOME RETAIL HOLDINGS LTD	354,000	0.670	237,180.000	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	29,000	37.850	1,097,650.000	
	FOSUN INTERNATIONAL LTD	71,500	8.630	617,045.000	
	TENCENT HOLDINGS LTD	21,500	462.400	9,941,600.000	
	AIR CHINA LTD-H	110,000	5.040	554,400.000	
	SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	60,500	9.150	553,575.000	
	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	258,000	2.340	603,720.000	
	PETROCHINA CO LTD-H	2,052,000	3.410	6,997,320.000	
	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	15,500	65.000	1,007,500.000	
	HUANENG POWER INTL INC-H	612,000	3.450	2,111,400.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	35,500	36.400	1,292,200.000	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	105,000	16.400	1,722,000.000	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	4,708,000	5.070	23,869,560.000	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	124,200	11.000	1,366,200.000	
	CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	704,000	3.390	2,386,560.000	
	GF SECURITIES CO LTD-H	50,000	13.820	691,000.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD-H	48,400	11.380	550,792.000	
	HENGAN INTL GROUP CO LTD	27,500	38.550	1,060,125.000	

POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	475,000	5.410	2,569,750.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	76,000	4.440	337,440.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	245,000	16.540	4,052,300.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	109,120	8.270	902,422.400	
SINOPHARM GROUP CO-H	102,800	18.340	1,885,352.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	110,000	34.300	3,773,000.000	
YANZHOU COAL MINING CO-H	182,000	12.220	2,224,040.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	128,500	5.640	724,740.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	22,000	41.650	916,300.000	
BYD CO LTD-H	5,000	302.200	1,511,000.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,523,000	2.600	6,559,800.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	82,000	5.770	473,140.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	25,400	10.440	265,176.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	35,800	21.300	762,540.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	390,000	2.320	904,800.000	
CITIC LTD	215,000	7.160	1,539,400.000	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	116,500	7.480	871,420.000	
IND & COMM BK OF CHINA-H	5,490,000	4.160	22,838,400.000	
CHINA TOWER CORP LTD-H	1,676,000	1.000	1,676,000.000	
MEITUAN-CLASS B	5,200	245.000	1,274,000.000	
SEAZEN GROUP LTD	124,000	5.630	698,120.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	95,100	130.000	12,363,000.000	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	86,000	10.840	932,240.000	
JD.COM INC - CL A	14,400	350.600	5,048,640.000	
NETEASE INC	13,500	178.800	2,413,800.000	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	215,000	1.980	425,700.000	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	25,000	28.750	718,750.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	318,000	18.300	5,819,400.000	
CGN POWER CO LTD-H	457,000	2.140	977,980.000	

PING AN INSURANCE GROUP CO-H	194,000	55.550	10,776,700.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	104,000	14.040	1,460,160.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	76,050	12.880	979,524.000	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	733,580	3.030	2,222,747.400	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	244,000	6.990	1,705,560.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	6,000	122.900	737,400.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	89,900	18.160	1,632,584.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	290,000	1.850	536,500.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	96,000	7.750	744,000.000	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	6,400	152.000	972,800.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	33,000	45.700	1,508,100.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	360,000	6.800	2,448,000.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	41,500	33.350	1,384,025.000	
WEICHAI POWER CO LTD-H	56,000	13.820	773,920.000	
SUNNY OPTICAL TECH	3,700	237.600	879,120.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	292,000	3.800	1,109,600.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	88,200	23.150	2,041,830.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	60,600	14.420	873,852.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	195,000	13.080	2,550,600.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	13,200	150.000	1,980,000.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	66,000	8.890	586,740.000	
KUNLUN ENERGY CO LTD	202,000	7.350	1,484,700.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	62,000	10.240	634,880.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	128,000	7.800	998,400.000	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	268,000	8.650	2,318,200.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	852,100	4.650	3,962,265.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	142,000	2.280	323,760.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	198,000	2.630	520,740.000	
CHINA MERCHANTS BANK-H	101,000	60.950	6,155,950.000	



	BANK OF CHINA LTD-H	3,350,000	2.730	9,145,500.000	
	CITIC SECURITIES CO LTD-H	44,000	18.240	802,560.000	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	240,000	2.710	650,400.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	127,200	6.570	835,704.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	94,000	7.300	686,200.000	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	58,000	38.600	2,238,800.000	
香港・ドル 小計				香港・ドル 225,747,526.800 (3,293,656,416)	
台湾・ドル		株	台湾・ドル	台湾・ドル	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	22,000	161.500	3,553,000.000	
	TAIWAN CEMENT	148,145	46.500	6,888,742.500	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	116,000	101.000	11,716,000.000	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	9,000	176.000	1,584,000.000	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	88,112	67.300	5,929,937.600	
	FORMOSA PLASTICS CORP	80,600	103.000	8,301,800.000	
	NAN YA PLASTICS CORP	62,140	82.700	5,138,978.000	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	59,390	79.300	4,709,627.000	
	CHINA STEEL CORP	320,686	32.900	10,550,569.400	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	67,616	60.600	4,097,529.600	
	DELTA ELECTRONICS INC	34,000	253.500	8,619,000.000	
	YAGEO CORPORATION	8,000	459.500	3,676,000.000	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	75,000	30.900	2,317,500.000	
	ACER INC	173,000	27.800	4,809,400.000	
	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	67,000	65.000	4,355,000.000	
	QUANTA COMPUTER INC	72,000	86.600	6,235,200.000	
	AU OPTRONICS CORP	668,000	20.650	13,794,200.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	83,400	112.500	9,382,500.000	
	MEDIATEK INC	16,003	1,030.000	16,483,090.000	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	36,000	149.000	5,364,000.000	
	EVA AIRWAYS CORP	169,000	23.750	4,013,750.000	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	122,720	30.450	3,736,824.000	
	FUBON FINANCIAL HOLDING CO	214,434	73.500	15,760,899.000	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	196,838	59.300	11,672,493.400	
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	412,000	16.200	6,674,400.000	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	219,124	27.200	5,960,172.800	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	255,381	24.300	6,205,758.300	

MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	176,993	33.900	6,000,062.700	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	448,231	10.650	4,773,660.150	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	247,028	24.300	6,002,780.400	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	148,214	23.300	3,453,386.200	
LARGAN PRECISION CO LTD	2,000	1,995.000	3,990,000.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	8,000	470.000	3,760,000.000	
TAIWAN MOBILE CO LTD	34,000	98.200	3,338,800.000	
WISTRON CORP	133,110	29.300	3,900,123.000	
INNOLUX CORP	660,000	17.850	11,781,000.000	
PEGATRON CORP	168,000	67.000	11,256,000.000	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	24,000	98.400	2,361,600.000	
CHAILLEASE HOLDING CO LTD	27,794	242.000	6,726,148.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	32,400	97.200	3,149,280.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	36,000	97.200	3,499,200.000	
COMPAL ELECTRONICS	185,000	23.350	4,319,750.000	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	214,000	593.000	126,902,000.000	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	916,902	103.500	94,899,357.000	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	13,000	277.500	3,607,500.000	
ASUSTEK COMPUTER INC	31,760	355.500	11,290,680.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	206,000	62.400	12,854,400.000	
台湾・ドル 小計			台湾・ドル 519,396,099.050 (2,126,719,267)	
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	24,142	172.960	4,175,600.320	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,503	1,764.320	2,651,772.960	
NEPI ROCKCASTLE PLC	15,107	98.740	1,491,665.180	
MULTICHOICE GROUP LTD	11,808	122.260	1,443,646.080	
OLD MUTUAL LTD	129,577	12.460	1,614,529.420	
VODACOM GROUP LTD	14,150	137.150	1,940,672.500	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	15,717	195.300	3,069,530.100	
NEDBANK GROUP LTD	15,655	162.060	2,537,049.300	
BIDVEST GROUP LTD	9,087	184.390	1,675,551.930	

BID CORP LTD	6,849	296.450	2,030,386.050	
STANDARD BANK GROUP LTD	32,036	128.990	4,132,323.640	
SASOL LTD	27,310	258.780	7,067,281.800	
DISCOVERY LTD	13,047	133.360	1,739,947.920	
SANLAM LTD	53,072	55.320	2,935,943.040	
FIRSTRAND LTD	121,528	55.250	6,714,422.000	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	27,895	51.160	1,427,108.200	
ABSA GROUP LTD	25,581	131.920	3,374,645.520	
NASPERS LTD-N SHS	2,673	2,461.490	6,579,562.770	
MTN GROUP LTD	43,366	159.410	6,912,974.060	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	6,445	191.240	1,232,541.800	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	11,970	224.220	2,683,913.400	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	12,225	322.460	3,942,073.500	
MR PRICE GROUP LTD	7,944	198.930	1,580,299.920	
SIBANYE STILLWATER LTD	34,477	48.380	1,667,997.260	
南アフリカ・ランド 小計			南アフリカ・ランド 74,621,438.670 (526,081,143)	
合計			13,499,628,357 [13,499,628,357]	

## (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	504,600	アメリカ・ドル 10,894,314.000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 10,894,314.000 (1,239,446,103)	
投資証券 合計				1,239,446,103 [1,239,446,103]	
合計				1,239,446,103 [1,239,446,103]	

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 27銘柄 投資証券 1銘柄	55.6%	44.4%	19.0%
インド・ルピー	株式 42銘柄	100%	-%	10.8%
インドネシア・ルピア	株式 9銘柄	100%	-%	1.7%
オフショア・人民元	株式 51銘柄	100%	-%	3.8%
サウジアラビア・リアル	株式 9銘柄	100%	-%	2.0%
シンガポール・ドル	株式 1銘柄	100%	-%	0.1%
タイ・バーツ	株式 25銘柄	100%	-%	3.9%
チリ・ペソ	株式 6銘柄	100%	-%	0.5%
トルコ・リラ	株式 13銘柄	100%	-%	1.4%
ブラジル・リアル	株式 49銘柄	100%	-%	13.4%
マレーシア・リンギット	株式 5銘柄	100%	-%	0.6%
メキシコ・ペソ	株式 8銘柄	100%	-%	2.5%
香港・ドル	株式 89銘柄	100%	-%	22.3%
台湾・ドル	株式 47銘柄	100%	-%	14.4%
南アフリカ・ランド	株式 24銘柄	100%	-%	3.6%

## 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 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5期計算期間（2020年12月1日から2021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】

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4期 2020年11月30日現在	第5期 2021年11月30日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	5,048,214	5,351,695
親投資信託受益証券	2,400,061,917	3,038,297,670
未収入金	4,102,533	-
流動資産合計	2,409,212,664	3,043,649,365
資産合計	2,409,212,664	3,043,649,365
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	5,442,381	612,482
未払受託者報酬	126,560	163,057
未払委託者報酬	1,139,425	1,467,893
その他未払費用	63,209	81,462
流動負債合計	6,771,575	2,324,894
負債合計	6,771,575	2,324,894
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 2,366,238,389	1 2,995,991,358
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	36,202,700	45,333,113
（分配準備積立金）	26,383,258	21,171,812
元本等合計	2,402,441,089	3,041,324,471
純資産合計	2,402,441,089	3,041,324,471
負債純資産合計	2,409,212,664	3,043,649,365

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期		第5期	
	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日		自 2020年12月1日 至 2021年11月30日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		18		-
有価証券売買等損益		17,964,515		3,671,954
<b>営業収益合計</b>		<b>17,964,497</b>		<b>3,671,954</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		1,780		1,386
受託者報酬		247,070		307,685
委託者報酬		2,224,406		2,769,899
その他費用		123,430		153,717
<b>営業費用合計</b>		<b>2,596,686</b>		<b>3,232,687</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>		<b>20,561,183</b>		<b>439,267</b>
経常利益又は経常損失( )		20,561,183		439,267
<b>当期純利益又は当期純損失( )</b>		<b>20,561,183</b>		<b>439,267</b>
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		1,971,258		960,095
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>		<b>51,900,371</b>		<b>36,202,700</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額		17,121,458		16,610,485
<b>当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額</b>		<b>17,121,458</b>		<b>16,610,485</b>
剰余金減少額又は欠損金増加額		14,229,204		8,879,434
<b>当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額</b>		<b>14,229,204</b>		<b>8,879,434</b>
分配金		1 -		1 -
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>		<b>36,202,700</b>		<b>45,333,113</b>

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第5期	
	自 2020年12月1日	至 2021年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1. 1 期首元本額	2,083,243,207円	2,366,238,389円
期中追加設定元本額	862,550,219円	1,226,825,775円
期中一部解約元本額	579,555,037円	597,072,806円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,366,238,389口	2,995,991,358口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日	自 2020年12月1日 至 2021年11月30日



1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(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。	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(37,681,657円)及び分配準備積立金(21,171,812円)より分配対象額は58,853,469円(1万口当たり196.44円)であり、分配を行っておりません。
------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第5期 自 2020年12月1日 至 2021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。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、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5期 2021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4期 2020年11月30日現在	第5期 2021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	16,932,525	4,070,368
合計	16,932,525	4,070,368

## （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4期 2020年11月30日現在	第5期 2021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5期 自 2020年12月1日 至 2021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4期 2020年11月30日現在	第5期 2021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)	1.0153円 (10,153円)	1.0151円 (10,151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	2,139,796,937	3,038,297,670	
親投資信託受益証券 合計			3,038,297,670	
合計			3,038,297,670	

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

	2020年11月30日現在	2021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	327,212,168	304,345,621
国債証券	79,869,797,660	85,097,080,600
地方債証券	4,128,711,500	3,514,853,500

特殊債券	3,097,138,700	2,703,089,900
社債券	2,777,936,600	2,976,109,700
未収入金	101,092,000	403,578,000
未収利息	196,593,327	195,282,238
前払費用	3,411,279	2,741,434
流動資産合計	90,501,893,234	95,197,080,993
資産合計	90,501,893,234	95,197,080,993
負債の部		
流動負債		
未払金	100,000,000	100,000,000
未払解約金	142,747,138	17,470,022
流動負債合計	242,747,138	117,470,022
負債合計	242,747,138	117,470,022
純資産の部		
元本等		
元本	1 63,632,169,674	66,960,247,306
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	26,626,976,422	28,119,363,665
元本等合計	90,259,146,096	95,079,610,971
純資産合計	90,259,146,096	95,079,610,971
負債純資産合計	90,501,893,234	95,197,080,993

## 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

個別法に基づき、時価で評価しております。

時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1. 1 期首	2019年12月3日	2020年12月1日
期首元本額	57,670,399,195円	63,632,169,674円
期中追加設定元本額	27,218,615,082円	13,191,022,279円
期中一部解約元本額	21,256,844,603円	9,862,944,647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)	65,126,538円	59,050,508円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	505,967,183円	412,666,474円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	62,478,037円	49,180,012円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	718,126,297円	693,952,196円
DCダイワ日本債券インデッ クス	8,503,141,748円	9,573,099,389円
ダイワ国内債券インデックス (ラップ専用)	- 円	704,912円
ダイワ・バランスファンド3 5VA	10,269,709,415円	10,117,083,683円
ダイワ・バランスファンド2 5VA(適格機関投資家専 用)	1,737,338,049円	1,686,540,655円

ダイワ国内バランスファンド 25VA(適格機関投資家専用)	226,910,962円	219,254,803円
ダイワ国内バランスファンド 30VA(適格機関投資家専用)	339,059,642円	314,922,939円
ダイワ・ノーロード 日本債券 ファンド	90,548,180円	61,401,829円
ダイワファンドラップ 日本 債券インデックス	23,601,367,986円	26,594,045,062円
ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)	6,701,446,457円	6,074,653,568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	1,691,971,743円	2,139,796,937円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	1,058,268,870円	965,018,800円
ダイワ投信倶楽部日本債券イ ンデックス	6,961,101,317円	6,784,763,908円
ダイワライフスタイル25	459,018,956円	477,075,499円
ダイワライフスタイル50	504,172,138円	581,511,996円
ダイワライフスタイル75	136,416,156円	155,524,136円
計	63,632,169,674円	66,960,247,306円
2. 期末日における受益権の総数	63,632,169,674口	66,960,247,306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 2020年12月1日 至 2021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	2021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	2020年11月30日現在	2021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	1,166,650,040	500,217,670
地方債証券	30,019,100	20,927,900
特殊債証券	22,302,900	11,147,300
社債証券	16,802,200	5,480,800
合計	1,235,774,240	526,812,070

（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12月3日から2020年11月30日まで、及び2020年12月1日から2021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

2020年11月30日現在	2021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）

	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.4185円	1.4199円
（1万口当たり純資産額）	（14,185円）	（14,199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 2 1 2年国債	600,000,000	601,614,000	
	4 2 3 2年国債	100,000,000	100,180,000	
	4 2 4 2年国債	500,000,000	500,955,000	
	4 2 5 2年国債	380,000,000	380,767,600	
	4 2 6 2年国債	390,000,000	390,830,700	
	4 2 7 2年国債	166,000,000	166,373,500	
	4 2 9 2年国債	40,000,000	40,099,200	
	1 3 4 5年国債	950,000,000	952,251,500	
	1 3 5 5年国債	1,550,000,000	1,554,526,000	
	1 3 6 5年国債	950,000,000	953,391,500	
	1 3 7 5年国債	800,000,000	803,392,000	
	1 3 8 5年国債	1,200,000,000	1,205,676,000	
	1 3 9 5年国債	900,000,000	904,770,000	
	1 4 0 5年国債	700,000,000	704,025,000	
	1 4 1 5年国債	1,120,000,000	1,127,078,400	
	1 4 2 5年国債	850,000,000	855,856,500	
	1 4 3 5年国債	700,000,000	705,215,000	
	1 4 4 5年国債	890,000,000	896,977,600	
	1 4 5 5年国債	1,100,000,000	1,109,031,000	
	1 4 6 5年国債	480,000,000	484,099,200	
	1 4 7 5年国債	840,000,000	843,981,600	
	1 4 8 5年国債	1,000,000,000	1,005,020,000	
	1 4 9 5年国債	220,000,000	221,060,400	
	1 4 0年国債	70,000,000	100,678,200	
	2 4 0年国債	110,000,000	153,078,200	
	3 4 0年国債	150,000,000	209,835,000	
	4 4 0年国債	180,000,000	253,659,600	
	6 4 0年国債	105,000,000	141,153,600	
	7 4 0年国債	121,000,000	156,797,850	
	8 4 0年国債	230,000,000	279,128,000	



9	40年国債	220,000,000	200,910,600	
10	40年国債	275,000,000	293,053,750	
11	40年国債	320,000,000	330,697,600	
12	40年国債	380,000,000	354,897,200	
13	40年国債	430,000,000	400,394,500	
14	40年国債	300,000,000	298,161,000	
326	10年国債	30,000,000	30,258,900	
327	10年国債	450,000,000	454,360,500	
328	10年国債	350,000,000	353,300,500	
329	10年国債	500,000,000	507,185,000	
330	10年国債	612,000,000	622,281,600	
331	10年国債	365,000,000	369,814,350	
332	10年国債	250,000,000	253,727,500	
333	10年国債	700,000,000	711,697,000	
334	10年国債	900,000,000	916,695,000	
335	10年国債	690,000,000	702,123,300	
336	10年国債	275,000,000	280,263,500	
337	10年国債	400,000,000	405,208,000	
338	10年国債	580,000,000	589,987,600	
339	10年国債	590,000,000	600,938,600	
340	10年国債	760,000,000	775,093,600	
341	10年国債	500,000,000	508,445,000	
342	10年国債	880,000,000	887,981,600	
343	10年国債	780,000,000	787,488,000	
344	10年国債	780,000,000	787,527,000	
345	10年国債	900,000,000	909,135,000	
346	10年国債	780,000,000	788,307,000	
347	10年国債	600,000,000	606,528,000	
348	10年国債	550,000,000	556,253,500	
349	10年国債	1,050,000,000	1,062,453,000	
350	10年国債	500,000,000	506,015,000	
351	10年国債	800,000,000	809,744,000	
352	10年国債	700,000,000	708,855,000	
353	10年国債	580,000,000	587,609,600	
354	10年国債	600,000,000	607,926,000	
355	10年国債	690,000,000	699,163,200	
356	10年国債	510,000,000	516,599,400	
357	10年国債	620,000,000	627,768,600	
358	10年国債	660,000,000	667,966,200	

359	10年国債	930,000,000	940,360,200
360	10年国債	900,000,000	909,117,000
361	10年国債	633,000,000	638,437,470
362	10年国債	710,000,000	715,268,200
363	10年国債	700,000,000	703,990,000
364	10年国債	520,000,000	522,277,600
1	30年国債	16,000,000	19,579,520
2	30年国債	24,000,000	28,854,240
3	30年国債	30,000,000	35,947,800
4	30年国債	36,000,000	45,364,320
5	30年国債	28,000,000	33,734,960
6	30年国債	24,000,000	29,580,240
7	30年国債	55,000,000	67,672,550
8	30年国債	27,000,000	31,965,570
9	30年国債	43,000,000	49,056,550
10	30年国債	45,000,000	49,915,800
11	30年国債	40,000,000	47,173,200
12	30年国債	60,000,000	73,740,000
13	30年国債	75,000,000	91,533,000
14	30年国債	82,000,000	104,279,400
15	30年国債	50,000,000	64,395,000
16	30年国債	250,000,000	323,187,500
17	30年国債	130,000,000	166,909,600
18	30年国債	80,000,000	102,026,400
19	30年国債	57,000,000	72,888,180
21	30年国債	60,000,000	77,168,400
22	30年国債	170,000,000	223,884,900
24	30年国債	92,000,000	121,895,400
25	30年国債	150,000,000	194,889,000
26	30年国債	180,000,000	237,198,600
27	30年国債	150,000,000	200,848,500
28	30年国債	170,000,000	228,825,100
29	30年国債	200,000,000	267,398,000
30	30年国債	220,000,000	291,638,600
31	30年国債	300,000,000	394,329,000
32	30年国債	285,000,000	380,899,650
33	30年国債	280,000,000	360,231,200
34	30年国債	270,000,000	358,030,800
35	30年国債	250,000,000	323,395,000

3 6	3 0 年国債	310,000,000	402,364,500	
3 7	3 0 年国債	350,000,000	448,668,500	
3 8	3 0 年国債	250,000,000	316,517,500	
3 9	3 0 年国債	230,000,000	296,389,500	
4 0	3 0 年国債	180,000,000	228,472,200	
4 1	3 0 年国債	170,000,000	212,629,200	
4 2	3 0 年国債	205,000,000	256,668,200	
4 3	3 0 年国債	200,000,000	250,668,000	
4 4	3 0 年国債	200,000,000	250,922,000	
4 5	3 0 年国債	200,000,000	242,592,000	
4 6	3 0 年国債	140,000,000	169,923,600	
4 7	3 0 年国債	400,000,000	494,788,000	
4 8	3 0 年国債	160,000,000	190,832,000	
4 9	3 0 年国債	120,000,000	143,187,600	
5 0	3 0 年国債	260,000,000	274,814,800	
5 1	3 0 年国債	240,000,000	226,044,000	
5 2	3 0 年国債	260,000,000	256,321,000	
5 3	3 0 年国債	250,000,000	251,920,000	
5 4	3 0 年国債	310,000,000	326,485,800	
5 5	3 0 年国債	260,000,000	273,639,600	
5 6	3 0 年国債	170,000,000	178,593,500	
5 7	3 0 年国債	230,000,000	241,451,700	
5 8	3 0 年国債	350,000,000	367,150,000	
5 9	3 0 年国債	300,000,000	306,870,000	
6 0	3 0 年国債	210,000,000	224,544,600	
6 1	3 0 年国債	200,000,000	203,706,000	
6 2	3 0 年国債	230,000,000	222,258,200	
6 3	3 0 年国債	230,000,000	216,057,400	
6 4	3 0 年国債	220,000,000	206,078,400	
6 5	3 0 年国債	200,000,000	187,026,000	
6 6	3 0 年国債	200,000,000	186,930,000	
6 7	3 0 年国債	230,000,000	226,412,000	
6 8	3 0 年国債	290,000,000	285,441,200	
6 9	3 0 年国債	259,000,000	261,843,820	
7 0	3 0 年国債	235,000,000	237,307,700	
7 1	3 0 年国債	240,000,000	242,373,600	
7 2	3 0 年国債	140,000,000	141,218,000	
5 9	2 0 年国債	45,000,000	45,862,650	
6 0	2 0 年国債	10,000,000	10,160,100	

6 1	2 0 年国債	100,000,000	101,463,000	
6 2	2 0 年国債	95,000,000	96,365,150	
6 3	2 0 年国債	130,000,000	133,887,000	
6 4	2 0 年国債	90,000,000	93,301,200	
6 5	2 0 年国債	175,000,000	182,290,500	
6 6	2 0 年国債	185,000,000	192,326,000	
6 7	2 0 年国債	55,000,000	57,560,800	
6 8	2 0 年国債	120,000,000	126,416,400	
6 9	2 0 年国債	110,000,000	115,628,700	
7 0	2 0 年国債	83,000,000	88,362,630	
7 1	2 0 年国債	125,000,000	132,436,250	
7 2	2 0 年国債	105,000,000	111,555,150	
7 3	2 0 年国債	120,000,000	127,792,800	
7 4	2 0 年国債	73,000,000	77,964,000	
7 5	2 0 年国債	80,000,000	85,881,600	
7 6	2 0 年国債	51,000,000	54,411,390	
7 7	2 0 年国債	130,000,000	139,126,000	
7 8	2 0 年国債	61,000,000	65,381,630	
7 9	2 0 年国債	50,000,000	53,770,000	
8 0	2 0 年国債	53,000,000	57,185,410	
8 2	2 0 年国債	87,000,000	94,341,930	
8 3	2 0 年国債	93,000,000	101,365,350	
8 5	2 0 年国債	58,000,000	63,536,100	
8 6	2 0 年国債	80,000,000	88,326,400	
8 7	2 0 年国債	55,000,000	60,487,350	
8 8	2 0 年国債	100,000,000	110,996,000	
8 9	2 0 年国債	78,000,000	86,220,420	
9 0	2 0 年国債	20,000,000	22,219,800	
9 2	2 0 年国債	310,000,000	344,627,000	
9 3	2 0 年国債	100,000,000	111,186,000	
9 4	2 0 年国債	130,000,000	145,234,700	
9 5	2 0 年国債	50,000,000	56,682,000	
9 6	2 0 年国債	55,000,000	61,736,400	
9 7	2 0 年国債	40,000,000	45,343,200	
9 8	2 0 年国債	320,000,000	360,876,800	
9 9	2 0 年国債	100,000,000	113,326,000	
1 0 0	2 0 年国債	155,000,000	177,426,950	
1 0 1	2 0 年国債	350,000,000	405,076,000	
1 0 3	2 0 年国債	170,000,000	196,642,400	

104	20年国債	10,000,000	11,435,500	
105	20年国債	126,000,000	144,787,860	
106	20年国債	150,000,000	173,392,500	
107	20年国債	90,000,000	103,914,000	
108	20年国債	300,000,000	342,126,000	
109	20年国債	55,000,000	62,971,700	
110	20年国債	260,000,000	301,498,600	
111	20年国債	200,000,000	234,462,000	
112	20年国債	150,000,000	174,708,000	
113	20年国債	310,000,000	362,634,900	
114	20年国債	70,000,000	82,200,300	
115	20年国債	180,000,000	212,828,400	
116	20年国債	200,000,000	237,400,000	
117	20年国債	200,000,000	235,734,000	
118	20年国債	95,000,000	111,531,900	
119	20年国債	93,000,000	107,588,910	
120	20年国債	317,000,000	361,294,410	
121	20年国債	200,000,000	233,758,000	
122	20年国債	200,000,000	231,996,000	
123	20年国債	200,000,000	237,910,000	
124	20年国債	300,000,000	354,150,000	
125	20年国債	130,000,000	156,302,900	
126	20年国債	110,000,000	130,214,700	
127	20年国債	250,000,000	293,620,000	
128	20年国債	250,000,000	294,380,000	
129	20年国債	200,000,000	233,600,000	
130	20年国債	140,000,000	163,899,400	
131	20年国債	150,000,000	174,142,500	
132	20年国債	40,000,000	46,531,200	
133	20年国債	430,000,000	504,506,100	
134	20年国債	30,000,000	35,288,400	
135	20年国債	92,000,000	107,278,440	
136	20年国債	300,000,000	346,755,000	
138	20年国債	100,000,000	114,796,000	
139	20年国債	370,000,000	428,615,400	
140	20年国債	300,000,000	351,486,000	
141	20年国債	200,000,000	234,850,000	
142	20年国債	240,000,000	284,443,200	
143	20年国債	210,000,000	244,782,300	

144	20年国債	240,000,000	277,072,800	
145	20年国債	420,000,000	495,318,600	
146	20年国債	350,000,000	413,633,500	
147	20年国債	320,000,000	375,148,800	
148	20年国債	530,000,000	616,029,600	
149	20年国債	402,000,000	467,988,300	
150	20年国債	180,000,000	207,610,200	
151	20年国債	400,000,000	451,740,000	
152	20年国債	460,000,000	520,260,000	
153	20年国債	430,000,000	492,401,600	
154	20年国債	550,000,000	623,034,500	
155	20年国債	350,000,000	387,208,500	
156	20年国債	270,000,000	275,969,700	
157	20年国債	360,000,000	357,220,800	
158	20年国債	350,000,000	362,229,000	
159	20年国債	170,000,000	178,243,300	
160	20年国債	360,000,000	382,741,200	
161	20年国債	320,000,000	335,008,000	
162	20年国債	350,000,000	366,117,500	
163	20年国債	340,000,000	355,347,600	
164	20年国債	500,000,000	514,340,000	
165	20年国債	300,000,000	308,244,000	
166	20年国債	350,000,000	370,615,000	
167	20年国債	300,000,000	307,488,000	
168	20年国債	320,000,000	322,083,200	
169	20年国債	320,000,000	316,044,800	
170	20年国債	220,000,000	216,882,600	
171	20年国債	300,000,000	295,197,000	
172	20年国債	100,000,000	100,000,000	
173	20年国債	410,000,000	409,290,700	
174	20年国債	420,000,000	418,534,200	
175	20年国債	400,000,000	405,284,000	
176	20年国債	340,000,000	343,933,800	
177	20年国債	365,000,000	362,043,500	
178	20年国債	150,000,000	151,363,500	
27	メキシコ国債	100,000,000	99,550,700	
11	フィリピン共和国	100,000,000	101,955,000	
国債証券 合計			85,097,080,600	
地方債証券	751 東京都公債	100,000,000	101,482,400	

1 6	東京都 2 0 年	100,000,000	113,930,900	
3 - 5	北海道公債	100,000,000	100,139,100	
2 2 2	神奈川県公債	100,000,000	100,259,300	
3 1	神奈川県 2 0 年	100,000,000	109,600,300	
4 2 0	大阪府公債	200,000,000	201,625,400	
2 6 - 1 7	兵庫県公債	100,000,000	101,447,500	
3	兵庫県公債 1 2 年	200,000,000	203,686,800	
1 9	兵庫県公債 2 0 年	100,000,000	115,382,300	
2 6 - 1 0	静岡県公債	100,000,000	101,504,600	
2 1 - 5	愛知県公債	100,000,000	116,763,100	
2 4 - 1 6	愛知県公債	100,000,000	100,888,000	
2 9 - 5	広島県公債	100,000,000	101,351,600	
4	埼玉県 3 0 年	100,000,000	115,929,000	
9	埼玉県 2 0 年	100,000,000	117,498,500	
2 9 - 1	福岡県公債	100,000,000	101,039,800	
2 2 - 1	福岡県 1 5 年	100,000,000	106,623,500	
1 6	千葉県 2 0 年	100,000,000	115,827,900	
2 8 - 2	新潟県公債	100,000,000	100,916,000	
1 2 6	共同発行地方	100,000,000	101,485,900	
1 3 1	共同発行地方	100,000,000	101,460,100	
1 6 8	共同発行地方	100,000,000	101,119,900	
2 7 - 1	滋賀県公債	100,000,000	101,874,400	
2 5 - 6	大阪市公債	200,000,000	202,723,400	
1 1	名古屋市 2 0 年	100,000,000	116,484,900	
2 0 - 1	神戸市 2 0 年	100,000,000	115,199,500	
4	川崎市公債 3 0 年	100,000,000	130,694,000	
2 3 - 4	福岡市 2 0 年	100,000,000	117,121,500	
2 4 - 4	福井県公債	100,000,000	100,639,600	
2 - 2	岡山県公債	100,000,000	100,154,300	
地方債証券 合計			3,514,853,500	
特殊債券	4 7 日本政策投資 C O	100,000,000	107,254,400	
	1 9 政保政策投資 C	100,000,000	100,916,300	
	2 4 7 道路機構	200,000,000	195,749,000	
	8 6 政保道路機構	100,000,000	115,190,200	
	1 8 6 政保道路機構	100,000,000	100,927,200	
	1 9 0 政保道路機構	100,000,000	100,960,000	
	2 2 3 政保道路機構	100,000,000	114,844,800	
	2 3 6 政保道路機構	100,000,000	101,108,500	
	2 6 1 政保道路機構	200,000,000	203,284,800	

	2 8 4 政保道路機構	200,000,000	195,373,200	
	2 9 8 政保道路機構	100,000,000	103,238,500	
	F 1 4 3 地方公共団体	100,000,000	107,540,300	
	1 地方公共団 1 5 年	100,000,000	107,919,000	
	4 8 地方公共団体	100,000,000	101,190,800	
	5 1 地方公共団体	100,000,000	101,467,100	
	3 1 地方公共団 2 0	100,000,000	117,162,600	
	6 5 地方公共団体	100,000,000	101,524,100	
	7 1 地方公共団体	100,000,000	101,547,000	
	2 5 政保日本政策	100,000,000	101,061,900	
	1 2 7 都市再生	100,000,000	100,191,600	
	8 0 住宅支援機構	100,000,000	107,467,200	
	1 2 3 住宅支援機構	100,000,000	116,970,400	
	1 9 利付商工債	100,000,000	100,201,000	
特殊債券 合計			2,703,089,900	
社債券	2 0 成田国際空港	100,000,000	100,249,700	
	6 3 中日本高速道	100,000,000	102,163,600	
	2 1 西日本高速道	100,000,000	101,538,800	
	1 2 アサヒグループHD	100,000,000	101,050,100	
	1 1 日本たばこ産業	100,000,000	101,889,000	
	5 野村不動産HD	100,000,000	102,551,900	
	2 3 森ビル	100,000,000	102,592,000	
	1 4 セブンアンドアイ	100,000,000	100,443,800	
	2 0 ZHD	100,000,000	99,967,000	
	1 8 楽天グループ	100,000,000	100,138,600	
	1 7 パナソニック	100,000,000	101,500,800	
	1 5 デンソー	100,000,000	100,656,100	
	1 日生 2 0 2 1 基金	100,000,000	100,018,400	
	7 凸版印刷	100,000,000	106,876,500	
	1 三菱UFJFG 劣後	100,000,000	101,659,800	
	1 6 NTTファイナンス	100,000,000	100,241,500	
	7 8 トヨタファイナンス	100,000,000	100,754,600	
	1 7 5 オリックス	100,000,000	101,961,600	
	7 三井住友海上	100,000,000	100,049,000	
	1 3 NTTファイナンス	100,000,000	106,692,400	
	1 0 7 東日本旅客鉄	100,000,000	116,343,100	
	4 1 東海旅客鉄道	100,000,000	114,360,300	
	1 5 ソフトバンク	100,000,000	99,989,300	
	5 0 9 関西電力	100,000,000	101,460,800	



4 8 2	九州電力	100,000,000	100,233,000	
3 3 2	北海道電力	100,000,000	104,791,400	
1 1	東京電力パワー	100,000,000	102,792,800	
6 5	東京瓦斯	100,000,000	100,444,400	
4	ファーストリテイリング	100,000,000	102,699,400	
社債券 合計			2,976,109,700	
合計			94,291,133,700	

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5期計算期間(2020年12月1日から2021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】

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4期 2020年11月30日現在	第5期 2021年11月30日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	10,430,258	17,793,811
親投資信託受益証券	3,989,839,661	5,174,345,100
未収入金	2,207,315	-
流動資産合計	4,002,477,234	5,192,138,911
資産合計	4,002,477,234	5,192,138,911
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	3,552,887	791,713
未払受託者報酬	425,942	557,770
未払委託者報酬	4,685,855	6,135,968
その他未払費用	159,654	209,103
流動負債合計	8,824,338	7,694,554
負債合計	8,824,338	7,694,554
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 3,599,799,209	1 4,813,778,100
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	393,853,687	370,666,257
(分配準備積立金)	285,891,990	240,956,918
元本等合計	3,993,652,896	5,184,444,357
純資産合計	3,993,652,896	5,184,444,357
負債純資産合計	4,002,477,234	5,192,138,911

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期 自 2019年12月3日 至 2020年11月30日	第5期 自 2020年12月1日 至 2021年11月30日
<b>営業収益</b>		
受取利息	27	1
有価証券売買等損益	194,264,334	104,509,492
営業収益合計	194,264,361	104,509,491
<b>営業費用</b>		
支払利息	3,634	4,015
受託者報酬	826,537	1,032,440
委託者報酬	9,092,633	11,357,799
その他費用	309,882	387,036
営業費用合計	10,232,686	12,781,290
営業利益又は営業損失（ ）	184,031,675	117,290,781
経常利益又は経常損失（ ）	184,031,675	117,290,781
当期純利益又は当期純損失（ ）	184,031,675	117,290,781
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	26,981,937	16,756,177
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	189,847,523	393,853,687
剰余金増加額又は欠損金減少額	99,530,900	152,344,990
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	99,530,900	152,344,990
剰余金減少額又は欠損金増加額	52,574,474	74,997,816
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	74,997,816
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	393,853,687	370,666,257

## (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5期	
	自 2020年12月1日	至 2021年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1. 1 期首元本額	3,349,305,616円	3,599,799,209円
期中追加設定元本額	1,133,997,978円	1,938,477,119円
期中一部解約元本額	883,504,385円	724,498,228円
2. 計算期間末日における受益権の総数	3,599,799,209口	4,813,778,100口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日	自 2020年12月1日 至 2021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(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>	<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(218,757,164円)及び分配準備積立金(240,956,918円)より分配対象額は459,714,082円(1万口当たり955.00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5期 自 2020年12月1日 至 2021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、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	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第5期
	2021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4期	第5期
	2020年11月30日現在	2021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	177,145,338	99,231,848
合計	177,145,338	99,231,848

## （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4期	第5期
2020年11月30日現在	2021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5期
自 2020年12月1日
至 2021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4期	第5期
	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.1094円	1.0770円
（1万口当たり純資産額）	（11,094円）	（10,770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	4,945,846,970	5,174,345,100	
親投資信託受益証券 合計			5,174,345,100	
合計			5,174,345,100	

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

	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	479,164,548	759,252,677
コール・ローン	1,436,753,003	630,287,908
国債証券	110,150,652,712	129,099,884,257



派生商品評価勘定		292,953,238	2,089,085,342
未収利息		639,128,168	731,941,321
前払費用		38,293,615	35,774,824
差入委託証拠金		226,631,580	240,386,498
流動資産合計		113,263,576,864	133,586,612,827
資産合計		113,263,576,864	133,586,612,827
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,456,290,993	1,537,759
未払金		-	592,781,697
未払解約金		2,207,315	-
流動負債合計		1,458,498,308	594,319,456
負債合計		1,458,498,308	594,319,456
純資産の部			
元本等			
元本	1	104,020,210,262	127,114,402,128
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		7,784,868,294	5,877,891,243
元本等合計		111,805,078,556	132,992,293,371
純資産合計		111,805,078,556	132,992,293,371
負債純資産合計		113,263,576,864	133,586,612,827

## 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>

<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。 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>
<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	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1. 1 期首	2019年12月3日	2020年12月1日
期首元本額	89,984,609,700円	104,020,210,262円
期中追加設定元本額	41,109,045,405円	36,354,862,011円
期中一部解約元本額	27,073,444,843円	13,260,670,145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	85,205,153,074円	103,094,342,209円
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	3,712,169,391円	4,945,846,970円
イン 外国債券インデックス		
（為替ヘッジあり）		

ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)(ラップ専用)	- 円	959,893円
ダイワバランスファンド 2020-07(適格機関投資家専用)	3,019,092,522円	3,285,353,528円
ダイワバランスファンド 2021-02(適格機関投資家専用)	- 円	3,362,089,827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)	12,083,795,275円	12,425,809,701円
計	104,020,210,262円	127,114,402,128円
2. 期末日における受益権の総数	104,020,210,262口	127,114,402,128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 2020年12月1日 至 2021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しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	---

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021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	2020年11月30日現在	2021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	453,372,386	365,563,764
合計	453,372,386	365,563,764

(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(2020年6月16日から2020年11月30日まで、及び2021年6月16日から2021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	2020年11月30日 現在				2021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)	うち 1年超	(円)	(円)	(円)	うち 1年超	(円)	(円)

市場取引 以外の取引								
為替予約 取引								
売 建	110,147,657,915	-	111,310,995,670	1,163,337,755	131,449,461,764	-	129,361,914,181	2,087,547,583
アメリカ・ド ル	48,517,480,784	-	48,225,490,690	291,990,094	61,830,345,724	-	61,696,074,456	134,271,268
イギリス・ポ ンド	7,361,207,558	-	7,546,135,260	184,927,702	8,107,969,951	-	7,867,782,720	240,187,231
イスラエル・ シケル	446,480,098	-	455,914,160	9,434,062	610,830,504	-	609,201,686	1,628,818
オーストラ リア・ドル	2,889,380,524	-	3,027,168,500	137,787,976	2,325,574,845	-	2,207,565,188	118,009,657
オフショ ア・人民元	-	-	-	-	266,020,350	-	267,268,500	1,248,150
カナダ・ド ル	2,123,973,551	-	2,166,294,060	42,320,509	2,602,730,485	-	2,527,170,380	75,560,105
シンガポー ル・ドル	521,469,287	-	529,311,520	7,842,233	555,965,324	-	547,263,288	8,702,036
スウェーデ ン・クロー ナ	350,202,913	-	364,412,620	14,209,707	371,157,834	-	350,344,592	20,813,242
デンマー ク・クロー ネ	597,472,751	-	610,232,490	12,759,739	658,382,410	-	640,825,744	17,556,666
ノル ウェー・ク ローネ	170,642,283	-	183,452,750	12,810,467	323,132,196	-	302,415,488	20,716,708
ポーラン ド・ズロチ	644,216,042	-	676,877,200	32,661,158	686,610,248	-	659,767,960	26,842,288
マレーシ ア・リンギッ ト	525,341,544	-	524,378,400	963,144	583,070,020	-	578,372,054	4,697,966
メキシコ・ ペソ	807,242,353	-	854,731,080	47,488,727	904,117,583	-	859,146,797	44,970,786
ユーロ	45,192,548,227	-	46,146,596,940	954,048,713	51,623,554,290	-	50,248,715,328	1,374,838,962
合計	110,147,657,915	-	111,310,995,670	1,163,337,755	131,449,461,764	-	129,361,914,181	2,087,547,583

## （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）

	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.0748円	1.0462円
（1万口当たり純資産額）	（10,748円）	（10,462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	1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	34,000,000.000	34,463,420.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	11,000,000.000	11,230,670.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	15,520,000.000	15,838,160.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	13,310,000.000	13,781,972.600	

2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	25,405,000.000	26,521,295.700	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	15,000,000.000	15,715,350.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	9,580,000.000	10,008,417.600	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	3,300,000.000	3,627,789.000	
6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	8,950,000.000	11,443,380.500	
5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	800,000.000	1,011,184.000	
5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	4,653,305.000	
6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	1,400,000.000	1,939,546.000	
5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	1,130,000.000	1,513,838.400	
5% United States Treasury Note/Bond 20370515	300,000.000	439,101.000	
3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	830,000.000	1,044,306.000	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,410,000.000	1,967,824.200	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,390,000.000	1,999,751.300	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	2,270,000.000	3,336,446.000	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	600,000.000	783,702.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	2,170,000.000	2,613,830.100	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	4,500,000.000	5,234,040.000	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	1,100,000.000	1,430,077.000	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,532,000.000	3,355,887.480	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	1,000,000.000	1,305,000.000	

3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,200,000.000	4,037,984.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	3,940,000.000	4,796,004.400	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	12,810,000.000	13,347,891.900	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	600,000.000	662,484.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	10,300,000.000	10,712,721.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	370,000.000	444,518.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	14,820,000.000	15,356,039.400	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	16,300,000.000	17,060,721.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	1,400,000.000	1,689,184.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	12,000,000.000	12,258,720.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	10,865,000.000	11,100,118.600	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	1,070,000.000	1,188,951.900	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	11,750,000.000	11,935,415.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	12,000,000.000	12,203,400.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	8,850,000.000	9,197,716.500	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	2,330,000.000	2,773,771.800	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	4,670,000.000	4,915,315.100	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,100,000.000	3,776,885.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	3,550,000.000	3,759,947.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,250,000.000	2,750,782.500	



2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	16,000,000.000	16,846,240.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	14,700,000.000	15,242,577.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,310,000.000	3,880,180.600	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	7,000,000.000	7,212,940.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	15,800,000.000	16,614,648.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,500,000.000	2,641,400.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	4,500,000.000	5,668,560.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	7,300,000.000	7,975,250.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	12,000,000.000	13,139,040.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	1,500,000.000	1,849,095.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	6,300,000.000	7,018,074.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	1,850,000.000	2,440,538.500	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	4,000,000.000	4,328,120.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	3,200,000.000	3,965,728.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	2,000,000.000	2,428,420.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	7,000,000.000	7,230,720.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	2,100,000.000	2,264,871.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,400,000.000	5,528,034.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	2,800,000.000	3,104,052.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	4,500,000.000	4,515,075.000	

2% United States Treasury Note/Bond 20500215	2,500,000.000	2,561,700.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	3,400,000.000	2,914,140.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	11,800,000.000	10,314,852.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	6,300,000.000	5,859,693.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	2,200,000.000	1,944,074.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	6,900,000.000	6,549,273.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	3,800,000.000	3,570,480.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	6,500,000.000	6,238,960.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	2,300,000.000	2,219,500.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	4,100,000.000	4,085,896.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	4,900,000.000	4,748,590.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	2,400,000.000	2,373,744.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	5,000,000.000	4,968,750.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	5,600,000.000	5,664,960.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	4,400,000.000	4,896,012.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,600,000.000	1,680,112.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	7,700,000.000	7,514,969.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	4,600,000.000	4,722,176.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	3,750,000.000	3,627,225.000	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 539,575,534.080	

(61,387,508,513)

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		1,424,142.000
2.5% United Kingdom Gilt 20650722	810,000.000		1,332,733.500
1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,875,000.000		1,956,187.500
1.5% United Kingdom Gilt 20470722	950,000.000		1,058,490.000
1.75% United Kingdom Gilt 20370907	920,000.000		1,016,406.800
1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,100,000.000		1,399,805.000
1.25% United Kingdom Gilt 20270722	350,000.000		362,792.500
1.625% United Kingdom Gilt 20281022	800,000.000		853,080.000
1.625% United Kingdom Gilt 20711022	597,000.000		841,805.820
1% United Kingdom Gilt 20240422	800,000.000		810,984.000
1.75% United Kingdom Gilt 20490122	800,000.000		949,024.000
1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000		1,018,351.000
0.875% United Kingdom Gilt 20291022	800,000.000		809,720.000
1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,000,000.000		1,035,330.000
0.125% United Kingdom Gilt 20230131	1,200,000.000		1,197,168.000
0.375% United Kingdom Gilt 20301022	700,000.000		675,563.000
0.5% United Kingdom Gilt 20611022	550,000.000		498,146.000
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	370,000.000		341,232.500
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,450,000.000		1,376,702.500

0.25% United Kingdom Gilt 20310731	1,200,000.000	1,133,460.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20460131	800,000.000	774,072.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	513,000.000	701,035.020	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,600,000.000	2,143,248.000	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,275,000.000	1,460,155.500	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	915,000.000	1,313,729.550	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	950,000.000	1,509,141.500	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	850,000.000	1,690,378.000	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	770,000.000	1,320,018.700	
4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,800,000.000	2,184,048.000	
4.5% United Kingdom Gilt 20421207	911,000.000	1,511,731.620	
4.75% United Kingdom Gilt 20301207	907,500.000	1,222,538.620	
4.25% United Kingdom Gilt 20491207	843,000.000	1,523,891.100	
4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,130,000.000	1,725,385.700	
4.5% United Kingdom Gilt 20340907	300,000.000	427,842.000	
4% United Kingdom Gilt 20600122	777,000.000	1,590,402.450	
4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,000,000.000	1,556,610.000	
3.75% United Kingdom Gilt 20520722	700,000.000	1,224,286.000	
3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,175,000.000	1,694,796.500	
2.25% United Kingdom Gilt 20230907	2,890,000.000	2,982,133.200	

	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	858,900.000	1,790,772.140	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,000,000.000	1,062,500.000	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	640,000.000	967,980.800	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 52,467,820.520 (7,952,022,878)	
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	
	4.25% Israel Government Bond - Fixed 20230331	3,500,000.000	3,697,715.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,200,000.000	1,945,608.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20240331	1,650,000.000	1,788,897.000	
	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	500,000.000	526,550.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	4,000,000.000	4,315,240.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	1,200,000.000	1,583,076.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	1,700,000.000	1,709,741.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,000,000.000	976,820.000	
イスラエル・シュケル 小計			イスラエル・シュケル 16,543,647.000 (595,756,580)	
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	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	1,083,000.000	1,160,423.670	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	889,000.000	1,044,370.530	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	1,156,000.000	1,213,464.760	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	320,000.000	357,507.200	

3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	3,000,000.000	3,217,020.000	
4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	359,000.000	459,419.480	
4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,398,000.000	2,703,625.100	
3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	725,000.000	886,573.500	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	800,000.000	877,200.000	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	684,000.000	789,568.560	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,300,000.000	1,396,252.000	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	658,000.000	688,471.980	
3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	575,000.000	643,206.500	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,250,000.000	1,349,837.500	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	200,000.000	204,034.000	
2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,100,000.000	2,240,406.000	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	510,000.000	547,332.000	
1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	1,800,000.000	1,764,918.000	
1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	1,350,000.000	1,283,661.000	
1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	3,800,000.000	3,575,686.000	
1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,000,000.000	869,360.000	
オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 27,272,337.780 (2,216,968,338)	
オフショア・人 民元		オフショア・人民元	オフショア・人民元

	3.25% China Government Bond 20281122	2,500,000.000	2,559,500.000	
	3.72% China Government Bond 20510412	1,600,000.000	1,687,312.000	
	3.02% China Government Bond 20310527	1,800,000.000	1,824,498.000	
	2.74% CHINA GOVERNMENT BOND 20260804	3,000,000.000	3,007,110.000	
	2.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20230520	5,500,000.000	5,510,505.000	
	オフショア・人民元 小計		オフショア・人民元 14,588,925.000 (260,121,992)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	2.75% Canada Government International Bond 20641201	860,000.000	1,035,861.400	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	907,000.000	1,181,385.640	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,050,000.000	1,486,621.500	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	300,000.000	428,295.000	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	620,000.000	832,852.200	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	140,000.000	182,366.800	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	4,038,000.000	4,078,097.340	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	730,000.000	755,564.600	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,100,000.000	1,288,980.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,492,000.000	1,544,309.520	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	1,220,000.000	1,227,466.400	
	1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	930,000.000	908,656.500	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	600,000.000	620,076.000	

	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	2,800,000.000	2,834,048.000	
	2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	1,520,000.000	1,540,869.600	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	300,000.000	316,674.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,000,000.000	1,027,190.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,414,560.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	1,700,000.000	1,664,283.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	900,000.000	874,008.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	1,700,000.000	1,547,544.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	1,300,000.000	1,286,402.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 28,076,111.500 (2,506,073,713)	
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	223,604.500	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	150,000.000	158,217.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	600,000.000	654,600.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	239,000.000	268,186.680	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	700,000.000	722,407.000	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	420,000.000	484,470.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	500,000.000	543,000.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	400,000.000	416,800.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	330,000.000	371,910.000	



	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	200,000.000	207,000.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	260,000.000	270,075.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	800,000.000	852,000.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	500,000.000	512,775.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	300,000.000	317,550.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	350,000.000	337,750.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	170,000.000	166,936.600	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 6,507,281.780 (541,470,917)	
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	2,520,000.000	3,792,726.000	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	4,150,000.000	4,295,250.000	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	3,820,000.000	4,170,408.600	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	4,780,000.000	5,018,139.600	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	2,550,000.000	2,660,083.500	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	500,000.000	604,725.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	3,000,000.000	3,144,810.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	4,000,000.000	3,965,720.000	
	スウェーデン・クローナ 小計		スウェーデン・クローナ 27,651,862.700 (346,477,840)	
デンマーク・ク ローネ		デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	

	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	6,740,000.000	12,190,368.400	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	2,670,000.000	2,784,062.400	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	4,330,000.000	4,720,392.800	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,200,000.000	5,464,680.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	4,700,000.000	4,967,054.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	1,900,000.000	1,910,146.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	1,500,000.000	1,508,100.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20241115	3,000,000.000	3,050,640.000	
	デンマーク・クローネ 小計		デンマーク・クローネ 36,595,443.600 (632,003,312)	
ノルウェー・ク ローネ	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	1,610,000.000	1,631,155.400	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	6,300,000.000	6,545,133.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	150,000.000	151,734.000	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	1,430,000.000	1,432,588.300	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,000,000.000	3,037,200.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	4,000,000.000	4,114,800.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	2,000,000.000	2,025,300.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	2,500,000.000	2,459,200.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	2,000,000.000	1,939,400.000	
	ノルウェー・クローネ 小計		ノルウェー・クローネ 23,336,510.700	

			(294,273,400)	
ポーランド・ズ ロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	2,640,000.000	2,568,931.200	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	1,815,000.000	1,746,465.600	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	3,000,000.000	3,001,020.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,900,000.000	2,875,060.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	2,300,000.000	2,233,967.000	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	1,000,000.000	980,250.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	1,800,000.000	1,539,972.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	400,000.000	346,640.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	600,000.000	703,764.000	
	4% Poland Government Bond 20231025	710,000.000	725,478.000	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	1,800,000.000	1,752,390.000	
3.25% Poland Government Bond 20250725	4,230,000.000	4,250,092.500		
ポーランド・ズロチ 小計		ポーランド・ズロチ 22,724,030.300 (624,129,126)		
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	1,873,273.600	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,000,000.000	1,048,320.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	1,950,000.000	2,013,316.500	
3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,400,000.000	1,405,586.000		

	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,500,000.000	1,527,720.000	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,150,000.000	1,194,010.500	
	3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,600,000.000	1,637,568.000	
	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	1,420,000.000	1,494,890.800	
	4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	2,000,000.000	2,076,020.000	
	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	500,000.000	515,525.000	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,000,000.000	1,066,760.000	
	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	1,500,000.000	1,552,950.000	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,200,000.000	1,230,096.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,281,800.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,400,000.000	1,326,864.000	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	900,000.000	865,395.000	
	マレーシア・リンギット 小計		マレーシア・リンギット 22,110,095.400 (593,693,649)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	24,200,000.000	22,771,474.000	
	8% Mexican Bonos 20471107	11,450,000.000	11,242,297.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	27,900,000.000	28,408,617.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	6,740,000.000	6,881,607.400	
	10% Mexican Bonos 20241205	6,340,000.000	6,799,586.600	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	20,800,000.000	20,849,504.000	
	10% Mexican Bonos 20361120	2,750,000.000	3,280,502.500	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	6,500,000.000	6,848,920.000	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	5,000,000.000	5,171,900.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	22,700,000.000	22,840,513.000	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	9,750,000.000	9,340,500.000	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	10,300,000.000	10,316,789.000	

メキシコ・ペソ 小計			メキシコ・ペソ 154,752,210.500 (812,897,887)
ユーロ		ユーロ	ユーロ
	0.75% Finland Government Bond 20310415	690,000.000	746,524.800
	0.875% Finland Government Bond 20250915	800,000.000	846,704.000
	0.5% Finland Government Bond 20260415	180,000.000	188,710.200
	1.375% Finland Government Bond 20470415	270,000.000	341,992.800
	0.5% Finland Government Bond 20270915	200,000.000	210,968.000
	1.125% Finland Government Bond 20340415	150,000.000	169,489.500
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	528,180.000
	0.5% Finland Government Bond 20290915	300,000.000	317,718.000
	0.125% Finland Government Bond 20360415	350,000.000	346,762.500
	0.25% Finland Government Bond 20400915	150,000.000	149,716.500
	0.125% Finland Government Bond 20520415	200,000.000	185,632.000
	FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	400,000.000	409,648.000
	1.2% Austria Government Bond 20251020	540,000.000	578,593.800
	0.75% Austria Government Bond 20261020	490,000.000	520,781.800
	1.5% Austria Government Bond 20470220	120,000.000	151,267.200
	1.5% Austria Government Bond 20861102	280,000.000	379,615.600
	0.5% Austria Government Bond 20270420	1,000,000.000	1,052,400.000
	2.1% Austria Government Bond 21170920	150,000.000	248,496.000

0.75% Austria Government Bond 20280220	600,000.000	641,886.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	700,000.000	738,262.000	
Austria Government Bond 20300220	450,000.000	455,355.000	
0.75% Austria Government Bond 20510320	600,000.000	641,052.000	
0.85% Austria Government Bond 21200630	50,000.000	46,994.000	
Austria Government Bond 20310220	500,000.000	502,815.000	
0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	200,000.000	199,708.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,170,000.000	1,230,278.400	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	610,000.000	755,924.200	
1% Belgium Government Bond 20260622	595,000.000	637,173.600	
1.6% Belgium Government Bond 20470622	764,000.000	925,104.680	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	570,000.000	832,792.800	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	400,000.000	407,372.000	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	730,000.000	780,968.600	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	500,000.000	517,815.000	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	310,000.000	444,419.100	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	700,000.000	812,357.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	580,000.000	624,039.400	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	500,000.000	567,375.000	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,100,000.000	1,195,700.000	

1.7% Belgium Government Bond 20500622	350,000.000	435,382.500	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	900,000.000	918,081.000	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	200,000.000	195,454.000	
Belgium Government Bond 20271022	800,000.000	819,136.000	
Belgium Government Bond 20311022	1,800,000.000	1,793,412.000	
0.65% Belgium Government Bond 20710622	170,000.000	149,239.600	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	455,000.000	641,804.800	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	800,000.000	1,113,296.000	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	800,000.000	1,089,304.000	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	3,296,000.000	5,151,252.480	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,660,000.000	2,585,300.600	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	3,270,000.000	5,418,749.700	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	1,490,000.000	2,469,302.500	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,020,000.000	1,843,558.200	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,810,000.000	3,522,495.300	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	456,000.000	785,149.920	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,648,000.000	2,655,900.320	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,150,000.000	1,182,786.500	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,460,000.000	1,531,540.000	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	3,800,000.000	4,017,398.000	

2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	1,775,000.000	2,938,672.250	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	990,000.000	1,046,509.200	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	2,000,000.000	2,097,500.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	1,190,000.000	1,238,623.400	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	4,800,000.000	5,110,752.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	883,000.000	928,059.490	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	3,850,000.000	3,973,508.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,550,000.000	1,621,548.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	3,100,000.000	3,297,625.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	1,260,000.000	1,700,559.000	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,050,000.000	1,120,833.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	2,800,000.000	2,950,864.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	1,400,000.000	1,478,680.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,600,000.000	1,607,824.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	700,000.000	726,222.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,600,000.000	1,660,000.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	600,000.000	620,964.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	200,000.000	203,894.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	400,000.000	406,556.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	300,000.000	309,528.000	



GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	300,000.000	298,662.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	1,650,000.000	1,668,876.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,000,000.000	1,015,670.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	500,000.000	509,470.000	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,415,000.000	4,307,510.250	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,200,000.000	3,574,230.000	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,210,000.000	3,543,403.500	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,232,000.000	2,412,243.680	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	1,265,000.000	2,029,439.500	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	1,200,000.000	1,315,584.000	
4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	1,943,000.000	3,407,186.510	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,000,000.000	2,058,640.000	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	4,540,000.000	5,352,569.200	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3,910,000.000	4,650,163.000	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	1,340,000.000	2,133,829.400	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	4,730,000.000	4,907,138.500	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	3,000,000.000	3,222,300.000	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	1,986,000.000	2,437,596.540	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	3,360,000.000	3,604,608.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,400,000.000	3,532,260.000	

1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	2,650,000.000	3,036,741.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,400,000.000	3,555,210.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	1,550,000.000	1,756,367.000	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,100,000.000	1,458,226.000	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	2,070,000.000	2,145,037.500	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	1,800,000.000	2,228,904.000	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	1,400,000.000	1,510,460.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	1,800,000.000	2,393,766.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	1,800,000.000	1,818,432.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	3,000,000.000	3,210,840.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	1,800,000.000	2,029,842.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	3,250,000.000	3,484,910.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	2,200,000.000	2,236,256.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	1,500,000.000	1,808,595.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	3,100,000.000	3,268,206.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	3,400,000.000	3,443,486.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	700,000.000	699,797.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	1,300,000.000	1,302,184.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	3,000,000.000	3,018,390.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	600,000.000	498,456.000	

0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	400,000.000	394,228.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	1,700,000.000	1,692,928.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	300,000.000	297,240.000	
5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	580,000.000	795,626.600	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,400,000.000	2,257,654.000	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,170,000.000	1,231,425.000	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,280,000.000	2,238,297.600	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	290,000.000	374,880.100	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	750,000.000	781,800.000	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,040,000.000	1,739,400.000	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	980,000.000	1,051,834.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	690,000.000	712,873.500	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,170,000.000	1,230,524.100	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	1,470,000.000	1,575,810.600	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	400,000.000	406,456.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	900,000.000	971,433.000	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	700,000.000	731,339.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	250,000.000	272,277.500	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	750,000.000	766,770.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	500,000.000	477,305.000	

NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	900,000.000	915,309.000	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	2,000,000.000	2,694,760.000	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	1,635,000.000	2,220,738.750	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	3,100,000.000	3,345,768.000	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,105,000.000	1,441,350.950	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	920,000.000	969,937.600	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,500,000.000	1,597,200.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	900,000.000	970,920.000	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,200,000.000	1,433,316.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	1,700,000.000	1,731,535.000	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	1,850,000.000	2,083,840.000	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	2,700,000.000	2,753,919.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	1,300,000.000	1,493,440.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,300,000.000	1,489,904.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,700,000.000	1,877,072.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	950,000.000	1,287,126.500	
2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	1,550,000.000	1,699,001.500	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	200,000.000	245,778.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,500,000.000	2,741,775.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	1,400,000.000	1,618,162.000	

2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,300,000.000	1,427,751.000	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	700,000.000	879,256.000	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	700,000.000	1,013,096.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,400,000.000	1,648,150.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	1,400,000.000	1,526,014.000	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	500,000.000	524,625.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	150,000.000	170,772.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	500,000.000	511,265.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	3,000,000.000	3,037,830.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	600,000.000	641,880.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	600,000.000	621,534.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	100,000.000	97,252.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	1,600,000.000	1,552,240.000	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	200,000.000	193,460.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	450,000.000	436,527.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	1,540,000.000	2,092,475.000	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	1,988,000.000	2,919,894.880	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,300,000.000	1,950,208.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	1,650,000.000	2,391,922.500	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	1,270,000.000	1,730,743.300	

5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,640,000.000	2,537,686.800	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	3,870,000.000	4,210,366.500	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,400,000.000	2,798,880.000	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,014,000.000	3,163,349.520	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	4,750,000.000	5,645,755.000	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	3,170,000.000	3,345,586.300	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	1,380,000.000	1,768,842.600	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,125,000.000	1,787,197.500	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,830,000.000	3,135,923.000	
3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,110,000.000	2,338,935.000	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,370,000.000	1,679,167.900	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,000,000.000	1,381,760.000	
5% Belgium Government Bond 20350328	750,000.000	1,222,335.000	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	965,000.000	1,627,694.450	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	700,000.000	857,703.000	
4% Belgium Government Bond 20320328	300,000.000	424,596.000	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,000,000.000	1,047,770.000	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	390,000.000	658,889.400	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	800,000.000	869,056.000	
3% Belgium Government Bond 20340622	300,000.000	405,315.000	

5.4% IRISH TREASURY 20250313	688,000.000	824,684.960	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	420,000.000	445,095.000	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	300,000.000	328,455.000	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	680,000.000	820,712.400	
2% IRISH TREASURY 20450218	710,000.000	923,582.200	
1% IRISH TREASURY 20260515	820,000.000	874,521.800	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	570,000.000	677,730.000	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	500,000.000	535,360.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	150,000.000	167,688.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	1,100,000.000	1,231,934.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	300,000.000	326,214.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	300,000.000	353,220.000	
IRISH TREASURY 20311018	200,000.000	196,556.000	
6.25% Austria Government Bond 20270715	380,000.000	527,105.600	
4.15% Austria Government Bond 20370315	700,000.000	1,122,289.000	
4.85% Austria Government Bond 20260315	700,000.000	865,774.000	
3.4% Austria Government Bond 20221122	860,000.000	894,425.800	
3.8% Austria Government Bond 20620126	370,000.000	791,611.300	
3.15% Austria Government Bond 20440620	830,000.000	1,343,106.000	
1.75% Austria Government Bond 20231020	1,280,000.000	1,341,862.400	
2.4% Austria Government Bond 20340523	630,000.000	811,188.000	
1.65% Austria Government Bond 20241021	880,000.000	940,887.200	
4% Finland Government Bond 20250704	200,000.000	234,292.000	
2.75% Finland Government Bond 20280704	120,000.000	145,210.800	
2.625% Finland Government Bond 20420704	210,000.000	311,465.700	
2% Finland Government Bond 20240415	350,000.000	373,285.500	

6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,420,000.000	2,030,443.800	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,100,000.000	2,248,323.000	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	1,410,000.000	1,616,734.200	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,565,000.000	2,821,859.100	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,400,000.000	1,540,056.000	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,189,000.000	1,654,041.680	
3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,530,000.000	2,401,885.800	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,049,000.000	2,207,428.680	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,100,000.000	1,200,716.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,320,000.000	1,589,517.600	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	1,670,000.000	1,822,788.300	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,150,000.000	2,345,134.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	650,000.000	881,855.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	500,000.000	550,160.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	1,400,000.000	1,608,936.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	1,500,000.000	1,553,610.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,000,000.000	1,023,300.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	100,000.000	94,392.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	1,800,000.000	1,953,252.000	
1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	950,000.000	986,679.500	



	0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	400,000.000	390,664.000	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	1,000,000.000	1,001,050.000	
	0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	500,000.000	499,335.000	
	0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	600,000.000	604,308.000	
	1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	200,000.000	200,090.000	
	5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,480,000.000	2,304,966.800	
	4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	900,000.000	1,351,368.000	
	4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	900,000.000	1,529,307.000	
	4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,043,000.000	1,755,973.940	
	5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,000,000.000	1,291,370.000	
	5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	3,810,000.000	4,078,947.900	
	4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	2,188,000.000	2,402,555.280	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,700,000.000	2,302,718.000	
	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,090,000.000	2,013,437.100	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	2,700,000.000	2,988,630.000	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,084,000.000	2,286,085.480	
	ユーロ 小計		ユーロ 391,998,178.590 (50,336,486,112)	
国債証券 合計			129,099,884,257 [129,099,884,257]	
合計			129,099,884,257 [129,099,884,257]	

（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 83銘柄	100%	47.5%
イギリス・ポンド	国債証券 42銘柄	100%	6.2%
イスラエル・シェケル	国債証券 8銘柄	100%	0.5%
オーストラリア・ドル	国債証券 21銘柄	100%	1.7%
オフショア・人民元	国債証券 5銘柄	100%	0.2%
カナダ・ドル	国債証券 22銘柄	100%	1.9%
シンガポール・ドル	国債証券 16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%	0.5%
ノルウェー・クローネ	国債証券 9銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 12銘柄	100%	0.5%
マレーシア・リングgit	国債証券 16銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 12銘柄	100%	0.6%
ユーロ	国債証券 260銘柄	100%	39.0%

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5期計算期間(2020年12月1日から2021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】

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4期 2020年11月30日現在	第5期 2021年11月30日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	6,624,049	11,653,159
親投資信託受益証券	2,460,578,515	3,291,001,472
未収入金	1,466,774	-
流動資産合計	2,468,669,338	3,302,654,631
資産合計		
	2,468,669,338	3,302,654,631
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,362,093	550,773
未払受託者報酬	263,649	357,140
未払委託者報酬	3,032,364	4,107,513
その他未払費用	98,800	133,856
流動負債合計	5,756,906	5,149,282
負債合計		
	5,756,906	5,149,282
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 2,237,982,504	1 2,901,476,819
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	224,929,928	396,028,530
（分配準備積立金）	134,435,722	192,327,925
元本等合計	2,462,912,432	3,297,505,349
純資産合計		
	2,462,912,432	3,297,505,349
負債純資産合計		
	2,468,669,338	3,302,654,631

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期		第5期	
	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日		自 2020年12月1日 至 2021年11月30日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		17		-
有価証券売買等損益		62,010,192		96,613,317
<b>営業収益合計</b>		<b>62,010,209</b>		<b>96,613,317</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		2,431		2,464
受託者報酬		557,137		654,894
委託者報酬		6,408,028		7,532,281
その他費用		208,839		245,446
<b>営業費用合計</b>		<b>7,176,435</b>		<b>8,435,085</b>
<b>営業利益</b>		<b>54,833,774</b>		<b>88,178,232</b>
経常利益		54,833,774		88,178,232
<b>当期純利益</b>		<b>54,833,774</b>		<b>88,178,232</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		11,099,252		9,822,757
期首剰余金又は期首欠損金( )		178,732,914		224,929,928
剰余金増加額又は欠損金減少額		56,202,927		136,793,749
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		56,202,927		136,793,749
剰余金減少額又は欠損金増加額		75,938,939		44,050,622
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		75,938,939		44,050,622
分配金		1 -		1 -
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>		<b>224,929,928</b>		<b>396,028,530</b>

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第5期	
	自 2020年12月1日	至 2021年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1. 1 期首元本額	2,655,013,152円	2,237,982,504円
期中追加設定元本額	695,143,661円	1,085,864,243円
期中一部解約元本額	1,112,174,309円	422,369,928円
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,237,982,504口	2,901,476,819口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日	自 2020年12月1日 至 2021年11月30日

1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(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。	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(78,356,116円)、投資信託約款に規定される収益調整金(203,702,967円)及び分配準備積立金(113,971,809円)より分配対象額は1,364.93円(1万口当たり)であり、分配を行っておりません。
------------	---	---

## (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5期 自 2020年12月1日 至 2021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。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第5期
	2021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4期	第5期
	2020年11月30日現在	2021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	69,390,782	92,130,794
合計	69,390,782	92,130,794

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第4期	第5期
2020年11月30日現在	2021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5期
自 2020年12月1日
至 2021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4期	第5期
	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.1005円	1.1365円
（1万口当たり純資産額）	（11,005円）	（11,365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	465,428,503	647,317,961	
	外国債券インデックスマザーファンド	842,742,592	2,643,683,511	
親投資信託受益証券 合計			3,291,001,472	
合計			3,291,001,472	

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

	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	635,260,286	700,635,449
コール・ローン	1,397,690,109	1,607,697,128

国債証券	215,573,016,059	230,341,773,353
派生商品評価勘定	162,494	431,286
未収入金	21,902,130	2,787,836
未収利息	1,222,948,097	1,240,818,660
前払費用	58,449,028	21,860,457
流動資産合計	218,909,428,203	233,916,004,169
資産合計	218,909,428,203	233,916,004,169
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	69,348	6,725,909
未払金	2,087,434	252,029,658
未払解約金	71,815,810	25,134,000
流動負債合計	73,972,592	283,889,567
負債合計	73,972,592	283,889,567
純資産の部		
元本等		
元本	1 72,688,498,430	74,475,307,643
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	146,146,957,181	159,156,806,959
元本等合計	218,835,455,611	233,632,114,602
純資産合計	218,835,455,611	233,632,114,602
負債純資産合計	218,909,428,203	233,916,004,169

## 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	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1. 1 期首	2019年12月3日	2020年12月1日
期首元本額	66,118,107,712円	72,688,498,430円
期中追加設定元本額	13,500,674,811円	10,294,827,028円
期中一部解約元本額	6,930,284,093円	8,508,017,815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	601,675,980円	498,388,691円
VA		

ダイワ国内重視バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	12,401,222円	10,756,510円
ダイワ国内重視バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	102,686,952円	79,498,163円
ダイワ国際分散バランスファン ド30VA(一般投資家私 募)	29,631,947円	22,023,940円
ダイワ国際分散バランスファン ド50VA(一般投資家私 募)	339,511,943円	312,397,465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)	90,339,707円	211,430,078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)	462,489,583円	505,972,682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)	1,814,096,236円	2,311,980,333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)	654,015,808円	842,742,592円
D-I's 外国債券インデッ クス	1,055,376円	744,003円
DCダイワ・ターゲットイ ヤー2050	957,155円	7,190,607円
iFree 外国債券イン デックス	691,990,376円	1,686,822,876円
iFree 8資産バランス	989,492,660円	1,443,360,479円
iFree 年金バランス	49,115,601円	229,923,693円
DCダイワ外国債券インデッ クス	48,408,053,236円	49,590,694,433円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	819,754,500円	964,870,268円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	459,770,424円	601,682,079円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	279,428,323円	393,993,399円

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	459,816,979円	578,219,728円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	336,784,366円	439,097,748円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	108,589,082円	160,496,213円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	8,547,742円	- 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	19,902,336円	28,543,954円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	4,844,467円	10,558,255円
ダイワつみたてインデックス外国債券	163,786,187円	599,439,774円
ダイワつみたてインデックスバランス30	3,047,233円	3,367,466円
ダイワつみたてインデックスバランス50	977,653円	1,453,811円
ダイワつみたてインデックスバランス70	951,206円	1,909,053円
ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ラップ専用)	- 円	317,987円
ダイワ世界バランスファンド40VA	174,483,363円	163,610,849円
ダイワ世界バランスファンド60VA	131,594,279円	135,308,646円
ダイワ・バランスファンド35VA	4,234,846,474円	3,912,241,392円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	250,419,145円	231,133,046円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	142,610,494円	143,219,876円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	34,513,413円	43,309,779円
ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	4,864,458,623円	2,367,106,464円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,832,536,410円	5,825,688,039円

ダイワライフスタイル25	33,396,711円	33,014,942円
ダイワライフスタイル50	59,767,812円	65,372,616円
ダイワライフスタイル75	16,157,426円	17,425,714円
計	72,688,498,430円	74,475,307,643円
2. 期末日における受益権の総数	72,688,498,430口	74,475,307,643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 2020年12月1日 至 2021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	2021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	2020年11月30日現在	2021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	6,708,826,689	9,023,697,557
合計	6,708,826,689	9,023,697,557

(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12月3日から2020年11月30日まで、及び2020年12月1日から2021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	2020年11月30日 現在				2021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	5,665,440	-	5,665,440	0	-	-	-	-
マレーシア・ リングgit	5,665,440	-	5,665,440	0	-	-	-	-
買 建	2,102,427,594	-	2,102,520,740	93,146	1,712,299,150	-	1,706,004,527	6,294,623
アメリカ・ドル	650,675,209	-	650,674,400	809	755,807,619	-	756,096,737	289,118
イギリス・ポ ンド	56,666,132	-	56,662,860	3,272	66,758,721	-	66,834,123	75,402

オーストラリア・ドル	28,675,523	-	28,678,740	3,217	-	-	-	-
カナダ・ドル	37,572,016	-	37,561,640	10,376	61,806,931	-	59,980,905	1,826,026
シンガポール・ドル	25,689,605	-	25,688,910	695	31,361,148	-	31,422,799	61,651
スウェーデン・クローナ	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	53,986,987	-	52,312,950	1,674,037
ユーロ	1,257,186,459	-	1,257,307,410	120,951	742,577,744	-	739,357,013	3,220,731
合計	2,108,093,034	-	2,108,186,180	93,146	1,712,299,150	-	1,706,004,527	6,294,623

## (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)

	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1口当たり純資産額	3.0106円	3.1370円
(1万口当たり純資産額)	(30,106円)	(31,370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	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	6,668,000.000	6,758,884.840	
		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	4,350,000.000	4,441,219.500	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	4,685,000.000	4,781,042.500	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	4,568,000.000	4,729,981.280	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	5,021,000.000	5,241,622.740	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,229,000.000	5,478,371.010	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	4,912,000.000	5,131,664.640	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	654,000.000	718,961.820	
		6% United States Treasury Note/Bond 20260215	855,000.000	1,029,266.100	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	709,000.000	906,520.310	
		5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	700,000.000	884,786.000	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	738,000.000	928,145.700	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	714,000.000	989,168.460	
		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	2,391,000.000	3,203,174.880	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	1,176,000.000	1,627,372.320	
		5% United States Treasury Note/Bond 20370515	847,000.000	1,239,728.490	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20380215	548,000.000	758,936.160			
4.5% United States Treasury Note/Bond 20380515	519,000.000	729,272.850			

3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	1,049,000.000	1,319,851.800	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20390515	1,121,000.000	1,540,321.260	
4.5% United States Treasury Note/Bond 20390815	1,060,000.000	1,500,472.400	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	1,210,000.000	1,688,700.200	
4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,010,000.000	1,453,056.700	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20400515	1,678,000.000	2,352,472.100	
3.875% United States Treasury Note/Bond 20400815	1,091,000.000	1,440,545.490	
4.25% United States Treasury Note/Bond 20401115	1,469,000.000	2,030,202.070	
4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,254,000.000	1,843,129.200	
4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	1,365,000.000	1,924,540.800	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20410815	1,517,000.000	1,981,459.890	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,742,943.500	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	1,954,952.190	
3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,601,708.460	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	2,231,000.000	2,541,421.340	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	1,858,314.100	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	3,168,426.560	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	2,298,000.000	2,672,849.760	
3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	4,178,424.980	
3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	2,758,136.590	

3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,307,000.000	4,315,635.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	4,198,241.490	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	6,430,848.060	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	2,348,094.540	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	6,169,622.790	
3% United States Treasury Note/Bond 20441115	2,746,000.000	3,284,902.500	
2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	5,946,244.770	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	2,829,910.820	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	6,019,925.160	
3% United States Treasury Note/Bond 20450515	2,835,000.000	3,405,969.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	5,950,724.310	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	1,873,000.000	2,209,690.480	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	6,112,552.800	
3% United States Treasury Note/Bond 20451115	659,000.000	795,123.040	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,597,444.360	
2% United States Treasury Note/Bond 20221130	6,287,000.000	6,399,222.950	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	4,992,000.000	5,094,136.320	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,866,000.000	4,970,910.960	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,605,510.180	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,148,000.000	3,496,231.760	

1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,962,000.000	3,006,992.780	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	3,623,000.000	3,680,569.470	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	7,729,000.000	7,896,255.560	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,107,922.400	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,823,000.000	3,136,832.910	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,547,150.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	3,047,460.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,485,212.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	2,780,000.000	2,955,473.600	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,819,503.800	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,439,552.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,547,459.750	
2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	5,508,237.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,554,575.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	1,500,000.000	1,785,690.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,570,427.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,588,275.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	3,640,000.000	3,831,209.200	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,569,503.200	
3% United States Treasury Note/Bond 20470215	2,845,000.000	3,466,205.750	

2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,379,143.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	4,550,000.000	4,706,929.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	6,778,496.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,000,000.000	2,445,140.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	3,097,380.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240531	5,300,000.000	5,473,257.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,479,776.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	6,212,051.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	3,110,730.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	2,950,000.000	3,458,167.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	2,060,840.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,594,800.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,541,300.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	5,797,770.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	3,500,000.000	4,104,835.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,646,685.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,324,224.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	2,919,420.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131	3,500,000.000	3,586,520.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	6,350,000.000	6,879,780.500	

2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,396,789.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,734,056.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	2,862,405.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,800,000.000	4,672,480.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,900,000.000	2,984,390.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	3,064,024.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	4,200,000.000	5,290,656.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	7,101,250.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,585,250.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	2,024,526.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,784,619.500	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,589,625.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,588,850.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	3,187,950.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	3,850,000.000	4,000,804.500	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	7,335,964.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,220,000.000	5,202,120.600	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,670,700.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,745,116.000	
2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	3,829,752.000	

3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,685,925.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	3,132,300.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,688,275.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	4,182,320.000	
3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	3,700,000.000	4,121,726.000	
3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	4,520,000.000	5,962,829.200	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	3,214,920.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,000,000.000	2,094,140.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	3,500,000.000	3,718,190.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,607,900.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	7,141,398.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	4,166,400.000	
2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,656,625.000	
3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	5,824,663.000	
2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,644,725.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,431,076.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,620,875.000	
2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	5,646,076.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	4,155,606.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,634,120.000	

2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	2,951,368.000	
2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	3,132,630.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,593,625.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	2,892,288.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	5,500,000.000	5,650,590.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,583,375.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	4,700,000.000	4,767,351.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	4,961,146.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,828,756.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	4,053,560.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,555,250.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	3,060,810.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	1,020,350.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	3,066,090.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	5,850,000.000	5,988,703.500	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	4,988,655.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	2,045,140.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	3,061,170.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20221215	3,000,000.000	3,043,710.000	
1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,571,775.000	



1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,569,900.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20230115	4,000,000.000	4,056,840.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	1,700,000.000	1,726,945.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20230215	2,250,000.000	2,280,757.500	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	5,000,000.000	5,016,750.000	
1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	3,200,000.000	3,250,496.000	
2% United States Treasury Note/Bond 20500215	5,400,000.000	5,533,272.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	298,662.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	5,200,000.000	5,241,028.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20230315	4,200,000.000	4,209,996.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	1,500,000.000	1,479,660.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20230415	3,200,000.000	3,197,248.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20270331	1,600,000.000	1,551,488.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300515	7,800,000.000	7,272,876.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230515	3,500,000.000	3,488,625.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20250430	2,700,000.000	2,649,564.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270430	2,400,000.000	2,306,808.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20500515	5,600,000.000	4,799,760.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400515	5,000,000.000	4,370,700.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270531	3,500,000.000	3,360,000.000	

0.25% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,000,000.000	2,926,170.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20230615	5,500,000.000	5,489,880.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250630	7,500,000.000	7,308,075.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270630	3,500,000.000	3,357,795.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230715	1,000,000.000	995,740.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250731	3,400,000.000	3,308,744.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230815	5,500,000.000	5,472,665.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20300815	10,000,000.000	9,301,100.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270731	5,000,000.000	4,760,900.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20500815	6,700,000.000	5,920,589.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20400815	6,000,000.000	5,227,500.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20270831	3,500,000.000	3,347,960.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230915	2,000,000.000	1,988,900.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250930	6,500,000.000	6,312,085.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20270930	4,000,000.000	3,794,680.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,500,000.000	3,400,460.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20231015	4,200,000.000	4,173,414.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20231115	7,700,000.000	7,663,579.000	
0.875% United States Treasury Note/Bond 20301115	9,800,000.000	9,301,866.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20221031	3,500,000.000	3,498,075.000	

0.25% United States Treasury Note/Bond 20251031	4,000,000.000	3,877,480.000	
0.5% United States Treasury Note/Bond 20271031	4,000,000.000	3,815,280.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20501115	6,800,000.000	6,389,280.000	
1.375% United States Treasury Note/Bond 20401115	5,100,000.000	4,635,390.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20221130	3,000,000.000	2,997,510.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251130	5,100,000.000	4,960,719.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271130	5,000,000.000	4,799,200.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20231215	3,000,000.000	2,975,250.000	
0.625% United States Treasury Note/Bond 20271231	5,000,000.000	4,793,350.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20251231	1,000,000.000	971,830.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	1,700,000.000	1,697,926.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20240115	4,000,000.000	3,963,120.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20280131	7,000,000.000	6,755,000.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20510215	5,900,000.000	5,879,704.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20310215	10,700,000.000	10,369,370.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20240215	5,000,000.000	4,950,950.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,000,000.000	1,997,260.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20260131	5,000,000.000	4,852,700.000	
1.125% United States Treasury Note/Bond 20280229	5,000,000.000	4,936,300.000	
1.875% United States Treasury Note/Bond 20410215	4,700,000.000	4,648,582.000	

0.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	3,000,000.000	2,924,280.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,000,000.000	1,996,320.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240315	2,000,000.000	1,983,500.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230331	3,000,000.000	2,992,590.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280331	7,000,000.000	6,956,250.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260331	4,000,000.000	3,937,480.000	
0.375% United States Treasury Note/Bond 20240415	3,000,000.000	2,980,170.000	
1.625% United States Treasury Note/Bond 20310515	8,700,000.000	8,800,920.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240515	5,100,000.000	5,046,807.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260430	4,500,000.000	4,426,695.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230430	3,400,000.000	3,390,038.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280430	6,000,000.000	5,956,860.000	
2.375% United States Treasury Note/Bond 20510515	6,100,000.000	6,787,653.000	
2.25% United States Treasury Note/Bond 20410515	3,800,000.000	3,990,266.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230531	1,000,000.000	996,480.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280531	4,000,000.000	3,968,400.000	
0.75% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	2,949,720.000	
0.25% United States Treasury Note/Bond 20240615	2,000,000.000	1,977,560.000	
0.125% United States Treasury Note/Bond 20230630	1,500,000.000	1,494,315.000	
1.25% United States Treasury Note/Bond 20280630	5,000,000.000	4,955,850.000	

0.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	5,000,000.000	4,939,800.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240715	5,500,000.000	5,450,775.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240815	3,000,000.000	2,971,260.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20310815	9,300,000.000	9,076,521.000	
2% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20510815	6,900,000.000	7,083,264.000	
1.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20410815	3,000,000.000	2,901,780.000	
0.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20230731	2,500,000.000	2,488,375.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260731	6,000,000.000	5,855,340.000	
1% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280731	5,000,000.000	4,871,850.000	
0.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20230831	3,000,000.000	2,984,520.000	
1.125% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280831	5,000,000.000	4,908,200.000	
0.75% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260831	5,000,000.000	4,904,450.000	
0.375% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20240915	7,500,000.000	7,421,775.000	
1.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20280930	7,000,000.000	6,926,710.000	
0.875% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20260930	3,500,000.000	3,451,175.000	
0.25% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20230930	1,500,000.000	1,494,780.000	
0.625% UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 20241015	2,000,000.000	1,991,480.000	
アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 955,962,463.000 (108,759,849,416)	
イギリス・ボンド	イギリス・ボンド	イギリス・ボンド	

2% United Kingdom Gilt 20250907	921,000.000	971,581.320	
2.5% United Kingdom Gilt 20650722	1,682,000.000	2,767,478.700	
1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,465,000.000	1,528,434.500	
1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,940,000.000	2,161,548.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20370907	2,350,000.000	2,596,256.500	
1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,810,000.000	2,303,315.500	
1.25% United Kingdom Gilt 20270722	1,410,000.000	1,461,535.500	
0.75% United Kingdom Gilt 20230722	3,000,000.000	3,017,790.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20281022	1,500,000.000	1,599,525.000	
1.625% United Kingdom Gilt 20711022	940,000.000	1,325,456.400	
1% United Kingdom Gilt 20240422	1,800,000.000	1,824,714.000	
1.75% United Kingdom Gilt 20490122	1,210,000.000	1,435,398.800	
1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	1,018,351.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20291022	800,000.000	809,720.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20250607	1,900,000.000	1,910,754.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20411022	1,190,000.000	1,232,042.700	
0.125% United Kingdom Gilt 20230131	2,300,000.000	2,294,572.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20301022	2,300,000.000	2,219,707.000	
0.5% United Kingdom Gilt 20611022	750,000.000	679,290.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20260130	1,500,000.000	1,474,380.000	

0.125% United Kingdom Gilt 20280131	1,600,000.000	1,551,104.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20501022	1,100,000.000	1,014,475.000	
0.625% United Kingdom Gilt 20350731	1,300,000.000	1,234,285.000	
0.125% United Kingdom Gilt 20240131	1,300,000.000	1,289,951.000	
0.25% United Kingdom Gilt 20310731	1,300,000.000	1,227,915.000	
0.875% United Kingdom Gilt 20460131	500,000.000	483,795.000	
0.375% United Kingdom Gilt 20261022	100,000.000	98,722.000	
1.25% United Kingdom Gilt 20510731	300,000.000	322,230.000	
0.25% UNITED KINGDOM GILT 20250131	100,000.000	99,045.000	
1.125% UNITED KINGDOM GILT 20390131	600,000.000	606,000.000	
0.5% UNITED KINGDOM GILT 20290131	100,000.000	98,430.000	
0.875% UNITED KINGDOM GILT 20330731	300,000.000	298,977.000	
1.5% UNITED KINGDOM GILT 20530731	300,000.000	348,462.000	
6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,296,846.460	
4.25% United Kingdom Gilt 20320607	2,240,000.000	3,000,547.200	
5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,685,763.840	
4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,662,000.000	2,386,249.740	
4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,357,000.000	2,155,689.490	
4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,908,000.000	3,794,401.440	
4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,366,000.000	2,341,747.460	

	4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,494,859.520	
	4.5% United Kingdom Gilt 20421207	2,416,000.000	4,009,158.720	
	4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,600,000.000	2,155,440.000	
	4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	2,427,741.100	
	4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	2,207,882.940	
	4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,560,000.000	2,224,778.400	
	4% United Kingdom Gilt 20600122	1,174,000.000	2,403,001.900	
	4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,454,773.970	
	3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	2,714,416.960	
	3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,166,000.000	3,124,195.080	
	2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,582,000.000	1,632,434.160	
	3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,386,000.000	2,889,754.560	
	2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,160,250.000	
	3.5% United Kingdom Gilt 20450122	1,724,000.000	2,607,498.280	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 93,472,673.140 (14,166,718,341)	
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	2,567,200.000	
	4.25% Israel Government Bond - Fixed 20230331	1,800,000.000	1,901,682.000	
	5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,900,000.000	3,080,546.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20240331	2,000,000.000	2,168,360.000	



	1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	2,300,000.000	2,422,130.000	
	2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,941,858.000	
	1.25% Israel Government Bond - Fixed 20221130	1,000,000.000	1,012,990.000	
	3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	2,400,000.000	3,166,152.000	
	2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,800,000.000	1,987,254.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20231130	1,500,000.000	1,541,265.000	
	1% Israel Government Bond - Fixed 20300331	2,400,000.000	2,413,752.000	
	0.5% Israel Government Bond - Fixed 20250430	1,600,000.000	1,611,840.000	
	1.5% Israel Government Bond - Fixed 20370531	1,700,000.000	1,660,594.000	
	0.15% Israel Government Bond - Fixed 20230731	2,000,000.000	2,002,720.000	
	0.5% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20260227	200,000.000	200,888.000	
	0.4% ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 20241031	900,000.000	905,121.000	
	イスラエル・シュケル 小計		イスラエル・シュケル 30,584,352.000 (1,101,379,217)	
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	
	5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	1,168,000.000	1,251,500.320	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	1,989,000.000	2,336,617.530	
	2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	1,973,000.000	2,071,077.830	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	1,754,000.000	1,959,586.340	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	1,798,000.000	1,928,067.320	

4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,609,887.760	
4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,748,000.000	3,098,232.600	
3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,361,043.180	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,307,000.000	1,433,125.500	
3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	914,237.280	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	1,672,000.000	1,795,794.880	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	1,178,000.000	1,232,553.180	
3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,252,000.000	1,400,512.240	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	1,800,000.000	1,943,766.000	
2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	1,350,000.000	1,377,229.500	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	1,900,000.000	2,060,303.000	
2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,870,000.000	3,061,888.200	
2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	1,390,000.000	1,491,748.000	
1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,784,648.400	
1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	1,300,000.000	1,236,118.000	
0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,353,992.000	
1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20301221	3,200,000.000	3,011,104.000	
1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20510621	1,400,000.000	1,217,104.000	
0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20251121	1,600,000.000	1,540,336.000	
1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20311121	2,500,000.000	2,330,875.000	

	0.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260921	1,200,000.000	1,153,548.000	
	1.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20321121	1,100,000.000	1,095,325.000	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 49,050,221.060 (3,987,292,470)	
オフショア・人 民元		オフショア・人民元	オフショア・人民元	
	3.72% China Government Bond 20510412	3,000,000.000	3,163,710.000	
	3.02% China Government Bond 20310527	3,800,000.000	3,851,718.000	
	2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	4,500,000.000	4,504,995.000	
	2.57% CHINA GOVERNMENT BOND 20230520	10,000,000.000	10,019,100.000	
	2.91% CHINA GOVERNMENT BOND 20281014	5,500,000.000	5,517,930.000	
オフショア・人民元 小計			オフショア・人民元 27,057,453.000 (482,437,093)	
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	487,818.450	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,280,377.160	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,581,482.110	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,444,781.800	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	913,000.000	1,226,442.030	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	961,000.000	1,251,817.820	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,265,442.290	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,454,203.100	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,566,696.600	

2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,196,529.360	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	974,930.280	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,211,542.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	650,000.000	671,749.000	
1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	4,300,000.000	4,352,288.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	1,300,000.000	1,324,518.000	
2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	3,710,000.000	3,760,938.300	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,287,807.600	
2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,232,628.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,414,560.000	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	3,450,000.000	3,377,515.500	
1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	700,000.000	701,183.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	2,890,000.000	2,806,536.800	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20221101	700,000.000	697,333.000	
0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,000,000.000	1,820,640.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260301	2,100,000.000	2,004,534.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240401	1,200,000.000	1,177,992.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230201	1,500,000.000	1,491,315.000	
0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230501	1,100,000.000	1,091,200.000	
1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260901	300,000.000	294,336.000	

	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20310601	2,400,000.000	2,374,896.000	
	0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230801	100,000.000	98,956.000	
	0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20241001	1,000,000.000	988,830.000	
	1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20531201	700,000.000	663,516.000	
	0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20231101	1,000,000.000	991,470.000	
	1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270301	200,000.000	197,736.000	
	0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240201	500,000.000	497,110.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20311201	300,000.000	295,002.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 50,556,653.200 (4,512,686,865)	
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	850,358.000	
	3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	923,000.000	973,561.940	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	809,000.000	882,619.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	448,848.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	671,000.000	692,478.710	
	3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	655,188.000	
	2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	678,750.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	546,008.000	
	2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	775,376.000	
	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	450,000.000	465,750.000	

	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	750,000.000	779,062.500	
	1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	450,000.000	456,030.000	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	585,750.000	
	2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	490,000.000	502,519.500	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	350,000.000	370,475.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20500301	710,000.000	685,150.000	
	0.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20251101	750,000.000	729,600.000	
	1.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20310701	300,000.000	297,486.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20511001	200,000.000	196,396.000	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 11,571,406.650 (962,856,747)	
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	7,006,007.750	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	8,025,000.000	8,305,875.000	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	7,595,000.000	8,291,689.350	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	7,180,000.000	7,537,707.600	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	5,050,000.000	5,268,008.500	
	2.25% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20320601	3,300,000.000	3,991,185.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20291112	7,400,000.000	7,757,198.000	
	0.125% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20310512	4,000,000.000	3,965,720.000	
	スウェーデン・クローナ 小計		スウェーデン・クローナ 52,123,391.200	

			(653,106,092)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	デンマーク・クローネ 13,662,000.000	デンマーク・クローネ 24,709,912.920	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,053,021.120	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	6,555,132.080	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	7,900,000.000	8,302,110.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	9,590,000.000	10,134,903.800	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20221115	4,300,000.000	4,338,399.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 20521115	2,700,000.000	2,714,418.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20311115	500,000.000	502,700.000	
	DANISH GOVERNMENT BOND 20241115	1,000,000.000	1,016,880.000	
デンマーク・クローネ 小計		デンマーク・クローネ 63,327,476.920 (1,093,665,526)		
ノルウェー・ク ローネ	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	ノルウェー・クローネ 8,204,000.000	ノルウェー・クローネ 8,311,800.560	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,254,336.450	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	5,395,000.000	5,457,366.200	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	4,340,000.000	4,347,855.400	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	4,450,000.000	4,505,180.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,600,450.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,850,000.000	3,898,702.500	

	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20300819	4,800,000.000	4,721,664.000	
	1.25% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20310917	3,500,000.000	3,393,950.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 42,491,305.110 (535,815,357)	
ポーランド・ズ ロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,259,171.160	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	3,050,300.800	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	3,850,000.000	3,851,309.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,870,000.000	2,845,318.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	4,840,000.000	4,701,043.600	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	3,400,000.000	3,332,850.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	2,000,000.000	1,853,100.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	3,000,000.000	2,566,620.000	
	Poland Government Bond 20230425	1,000,000.000	961,850.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	1,300,000.000	1,126,580.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	970,021.380	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,625,000.000	2,682,225.000	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	3,650,000.000	3,553,457.500	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	4,591,000.000	4,612,807.250	
ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 40,366,653.690 (1,108,694,364)	



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	2,401,665.840	
4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415		1,178,000.000	1,253,816.080	
4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415		1,514,000.000	1,595,301.800	
4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630		1,300,000.000	1,362,816.000	
3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315		731,000.000	754,735.570	
3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315		1,001,000.000	1,016,505.490	
3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415		1,427,000.000	1,432,693.730	
3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615		1,886,000.000	1,920,853.280	
4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930		800,000.000	864,304.000	
4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715		1,057,000.000	1,098,941.760	
3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915		1,737,000.000	1,803,474.990	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531		1,220,000.000	1,265,640.200	
3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817		1,302,000.000	1,332,570.960	
4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315		930,000.000	979,048.200	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130		650,000.000	672,841.000	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930		1,550,000.000	1,608,915.500	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116		1,190,000.000	1,226,949.500	
4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407		1,950,000.000	2,080,182.000	
3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314		1,200,000.000	1,241,928.000	

	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	1,700,000.000	1,734,000.000	
	4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	1,200,000.000	1,284,276.000	
	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	644,586.000	
	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	672,945.000	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,910,000.000	1,957,902.800	
	4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,200,000.000	1,297,140.000	
	3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	407,676.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,281,800.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,750,000.000	1,658,580.000	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	1,650,000.000	1,586,557.500	
	2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,300,000.000	1,207,973.000	
	マレーシア・リングット 小計		マレーシア・リングット 39,646,620.200 (1,064,579,152)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	31,290,000.000	29,442,951.300	
	8% Mexican Bonos 20471107	19,300,000.000	18,949,898.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	23,800,000.000	24,233,874.000	
	6.75% Mexican Bonos 20230309	17,200,000.000	17,281,184.000	
	5.5% MEXICAN BONOS 20270304	3,000,000.000	2,747,100.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	30,033,000.000	30,663,993.330	
	10% Mexican Bonos 20241205	23,919,000.000	25,652,888.310	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	27,968,000.000	28,034,563.840	
	10% Mexican Bonos 20361120	8,874,000.000	10,585,883.340	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	29,544,000.000	31,129,921.920	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	16,894,000.000	17,474,815.720	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	23,515,000.000	23,660,557.850	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	19,654,000.000	18,828,532.000	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	7,944,000.000	7,956,948.720	

メキシコ・ペソ 小計			メキシコ・ペソ 286,643,112.330 (1,505,707,605)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	364,000.000	393,818.880	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	295,288.020	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	811,000.000	850,244.290	
	Finland Government Bond 20230915	700,000.000	709,324.000	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	455,990.400	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	843,872.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	670,000.000	757,053.100	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	528,180.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	529,530.000	
	Finland Government Bond 20240915	200,000.000	203,988.000	
	0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	307,132.500	
	0.25% Finland Government Bond 20400915	400,000.000	399,244.000	
	Finland Government Bond 20300915	500,000.000	506,100.000	
	0.125% Finland Government Bond 20520415	400,000.000	371,264.000	
	0.125% Finland Government Bond 20310915	600,000.000	610,392.000	
	FINLAND GOVERNMENT BOND 20260915	200,000.000	204,824.000	
	1.2% Austria Government Bond 20251020	1,373,000.000	1,471,128.310	
	0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,196,735.320	

1.5% Austria Government Bond 20470220	784,000.000	988,279.040	
1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	325,384.800	
Austria Government Bond 20230715	900,000.000	911,277.000	
0.5% Austria Government Bond 20270420	1,280,000.000	1,347,072.000	
2.1% Austria Government Bond 21170920	540,000.000	894,585.600	
0.75% Austria Government Bond 20280220	1,200,000.000	1,283,772.000	
0.5% Austria Government Bond 20290220	980,000.000	1,033,566.800	
Austria Government Bond 20240715	800,000.000	814,520.000	
Austria Government Bond 20300220	980,000.000	991,662.000	
Austria Government Bond 20230420	1,000,000.000	1,009,990.000	
0.75% Austria Government Bond 20510320	700,000.000	747,894.000	
Austria Government Bond 20401020	400,000.000	374,352.000	
0.85% Austria Government Bond 21200630	350,000.000	328,958.000	
Austria Government Bond 20310220	1,200,000.000	1,206,756.000	
Austria Government Bond 20250420	480,000.000	489,768.000	
0.25% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20361020	600,000.000	599,124.000	
0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,699,000.000	1,786,532.480	
1% Belgium Government Bond 20310622	1,774,000.000	1,952,162.820	
1.9% Belgium Government Bond 20380622	1,058,000.000	1,311,094.760	
1% Belgium Government Bond 20260622	1,863,000.000	1,995,049.440	

1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	1,506,322.280	
2.15% Belgium Government Bond 20660622	640,000.000	935,065.600	
0.2% Belgium Government Bond 20231022	940,000.000	957,324.200	
0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,100,000.000	1,176,802.000	
0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,087,411.500	
2.25% Belgium Government Bond 20570622	580,000.000	831,493.800	
1.45% Belgium Government Bond 20370622	600,000.000	696,306.000	
0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,490,000.000	1,603,135.700	
1.25% Belgium Government Bond 20330422	650,000.000	737,587.500	
0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,500,000.000	1,630,500.000	
1.7% Belgium Government Bond 20500622	700,000.000	870,765.000	
0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,244,509.800	
0.4% Belgium Government Bond 20400622	660,000.000	644,998.200	
Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,228,704.000	
Belgium Government Bond 20311022	1,600,000.000	1,594,144.000	
0.65% Belgium Government Bond 20710622	680,000.000	596,958.400	
6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,120,723.360	
6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,646,123.520	
5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	2,162,000.000	3,008,682.440	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,293,548.500	

6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	1,951,000.000	3,049,178.880	
5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,448,000.000	5,369,949.680	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	2,305,000.000	3,819,638.550	
4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,571,000.000	5,918,039.750	
4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	2,394,818.250	
4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,739,000.000	3,384,320.070	
3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	2,574,000.000	4,431,964.680	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,808,000.000	4,525,344.720	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,450,199.100	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,879,741.010	
2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,677,351.000	
1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,650,304.810	
2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	4,435,325.610	
1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,684,985.520	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	4,042,000.000	4,239,047.500	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,283,646.840	
1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	3,134,000.000	3,336,895.160	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,368,000.000	2,488,839.040	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,497,633.600	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	4,200,000.000	4,393,872.000	

0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,446,625.000	
1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	2,770,000.000	3,738,530.500	
0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	2,028,174.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	3,100,000.000	3,267,028.000	
0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,200,000.000	2,323,640.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	3,000,000.000	3,112,110.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	2,250,000.000	2,261,002.500	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,750,000.000	1,815,555.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	1,900,000.000	1,946,664.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	2,000,000.000	2,070,140.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,800,000.000	1,867,500.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20300815	1,200,000.000	1,251,504.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310215	900,000.000	931,446.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20360515	900,000.000	917,523.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20281115	1,500,000.000	1,553,700.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,100,000.000	1,118,029.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	2,600,000.000	2,682,576.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20310815	700,000.000	724,332.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20221215	100,000.000	100,826.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230310	1,000,000.000	1,010,270.000	

GERMAN GOVERNMENT BOND 20230616	1,000,000.000	1,012,710.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230915	100,000.000	101,457.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20520815	700,000.000	696,878.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	5,730,000.000	5,795,551.200	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,900,000.000	1,929,773.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	1,920,000.000	1,956,364.800	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,738,012.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,460,408.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	2,300,000.000	2,364,607.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20251010	100,000.000	103,004.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20260410	2,200,000.000	2,266,550.000	
GERMAN GOVERNMENT BOND 20261009	1,300,000.000	1,340,560.000	
8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,985,000.000	2,243,605.800	
6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	3,815,583.750	
5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	4,758,369.850	
5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	3,227,000.000	5,242,745.550	
4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	4,263,307.650	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,764,000.000	3,453,894.360	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	3,808,608.200	
4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,997,000.000	5,478,311.040	



4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,664,000.000	6,425,080.480	
4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,717,000.000	3,534,684.880	
3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,646,000.000	4,298,561.080	
2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	5,699,000.000	6,777,820.700	
3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,588,000.000	4,121,157.080	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	4,047,000.000	4,198,560.150	
2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	5,086,000.000	5,462,872.600	
2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	5,087,000.000	6,243,732.930	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	4,899,000.000	5,255,647.200	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,627,838.800	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	5,101,000.000	5,421,750.880	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	5,420,000.000	6,210,994.800	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,787,000.000	3,959,876.550	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	4,169,000.000	4,724,060.660	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,387,000.000	1,838,690.420	
0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	4,050,000.000	4,196,812.500	
1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,570,000.000	3,182,379.600	
1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,668,260.000	
2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,850,000.000	3,790,129.500	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	2,400,000.000	2,424,576.000	

0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	4,400,000.000	4,709,232.000	
1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	4,454,375.500	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	4,950,000.000	5,307,786.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	3,400,000.000	3,456,032.000	
1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,950,000.000	3,556,903.500	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	4,350,000.000	4,586,031.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	3,830,000.000	3,909,319.300	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	4,253,718.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20230225	2,400,000.000	2,424,048.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	2,770,000.000	2,769,196.700	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	3,067,200.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20400525	2,200,000.000	2,203,696.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20301125	4,000,000.000	4,024,520.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20720525	880,000.000	731,068.800	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20240225	100,000.000	101,560.000	
0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20440625	1,000,000.000	985,570.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20311125	3,700,000.000	3,684,608.000	
FRENCH GOVERNMENT BOND 20270225	1,600,000.000	1,634,768.000	
0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20530525	700,000.000	693,560.000	
7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	599,988.760	

5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,562,446.030	
4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,555,000.000	2,507,608.550	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	832,527.500	
3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,729,000.000	3,023,450.430	
2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,509,861.920	
1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,443,724.000	
2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,929,000.000	3,226,252.500	
2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,624,976.200	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	1,791,000.000	1,850,371.650	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,938,000.000	2,038,252.740	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	2,200,000.000	2,358,356.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	1,400,000.000	1,422,596.000	
0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	1,350,000.000	1,457,149.500	
0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	1,200,000.000	1,253,724.000	
0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	900,000.000	980,199.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20300715	1,400,000.000	1,431,304.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270115	800,000.000	821,432.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20520115	1,050,000.000	1,002,340.500	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20310715	1,300,000.000	1,322,113.000	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20380115	900,000.000	892,260.000	

NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290115	600,000.000	613,950.000	
9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231101	906,000.000	1,069,705.140	
7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,110,000.000	1,495,591.800	
6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	2,392,000.000	3,248,934.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	1,814,000.000	1,957,813.920	
3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	1,509,000.000	1,968,324.510	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	2,487,000.000	2,621,994.360	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	2,065,000.000	2,198,812.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	1,891,000.000	2,040,010.800	
2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	1,610,000.000	1,923,032.300	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	1,359,000.000	1,384,209.450	
1.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260601	2,386,000.000	2,543,380.560	
2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	2,324,000.000	2,617,753.600	
1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,123,589.400	
0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	1,550,000.000	1,580,953.500	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	1,112,038.400	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,719,120.000	
2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,667,281.600	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,367,223.000	
3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,850,000.000	2,506,509.500	

2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	2,700,000.000	2,959,551.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,675,392.000	
2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,597,557.000	
2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,303,091.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,900,000.000	1,933,991.000	
1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,367,873.000	
2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	2,550,000.000	2,947,366.500	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	2,200,000.000	2,316,424.000	
2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,702,318.500	
3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,595,221.600	
3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,650,000.000	2,388,012.000	
3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	2,236,775.000	
1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	2,200,000.000	2,311,584.000	
2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	2,100,000.000	2,289,021.000	
3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	1,250,000.000	1,565,862.500	
1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,993,575.000	
0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230115	740,000.000	744,869.200	
0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,300,000.000	1,318,824.000	
0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,421,534.000	
2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,550,000.000	1,764,644.000	

1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,533,795.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230615	2,000,000.000	2,034,200.000	
1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	2,300,000.000	2,454,422.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	2,025,220.000	
1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20301201	2,400,000.000	2,567,520.000	
0.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,300,000.000	1,316,523.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270915	2,200,000.000	2,273,370.000	
0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260201	1,700,000.000	1,729,461.000	
1.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20410301	1,300,000.000	1,346,657.000	
0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310401	2,300,000.000	2,302,668.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240115	1,100,000.000	1,107,524.000	
1.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20510901	1,200,000.000	1,167,024.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20370301	700,000.000	661,633.000	
0.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280315	1,900,000.000	1,874,787.000	
0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20310801	2,700,000.000	2,619,405.000	
1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20450430	700,000.000	677,110.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260401	1,100,000.000	1,093,598.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240415	1,500,000.000	1,508,295.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20221129	100,000.000	100,511.000	
2.15% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20720301	460,000.000	446,227.600	

0.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280715	800,000.000	798,800.000	
0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20311201	1,900,000.000	1,895,250.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240815	2,000,000.000	2,008,060.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240130	500,000.000	502,775.000	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260801	1,100,000.000	1,089,638.000	
5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	3,254,000.000	4,421,372.500	
6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	2,849,000.000	4,184,497.240	
5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,805,000.000	2,707,788.800	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	2,298,000.000	3,331,295.700	
4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	2,740,000.000	3,734,044.600	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	2,044,000.000	3,162,824.280	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	2,251,000.000	2,448,975.450	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	2,118,000.000	2,470,011.600	
5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	2,243,000.000	3,523,035.240	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	2,070,000.000	2,460,360.600	
5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	1,960,000.000	2,068,564.400	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	2,410,000.000	3,089,065.700	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230501	1,894,000.000	2,029,496.760	
4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	1,813,000.000	2,880,168.060	
4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	2,194,000.000	2,431,171.400	

3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	2,201,000.000	2,439,808.500	
3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	2,318,000.000	2,841,103.060	
5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,357,282.560	
5% Belgium Government Bond 20350328	1,904,000.000	3,103,101.120	
4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	2,705,514.920	
4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,226,515.290	
4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	1,103,949.600	
2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,401,916.260	
3.75% Belgium Government Bond 20450622	843,000.000	1,424,214.780	
2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,634,911.600	
3% Belgium Government Bond 20340622	747,000.000	1,009,234.350	
5.4% IRISH TREASURY 20250313	1,031,000.000	1,235,828.770	
3.9% IRISH TREASURY 20230320	624,000.000	661,284.000	
3.4% IRISH TREASURY 20240318	607,000.000	664,573.950	
2.4% IRISH TREASURY 20300515	961,000.000	1,159,859.730	
2% IRISH TREASURY 20450218	931,000.000	1,211,063.420	
1% IRISH TREASURY 20260515	1,073,000.000	1,144,343.770	
1.7% IRISH TREASURY 20370515	550,000.000	653,950.000	
0.9% IRISH TREASURY 20280515	800,000.000	856,576.000	
1.3% IRISH TREASURY 20330515	750,000.000	838,440.000	
1.35% IRISH TREASURY 20310318	750,000.000	839,955.000	
1.1% IRISH TREASURY 20290515	950,000.000	1,033,011.000	
1.5% IRISH TREASURY 20500515	700,000.000	824,180.000	
0.4% IRISH TREASURY 20350515	350,000.000	351,890.000	
0.2% IRISH TREASURY 20270515	800,000.000	822,552.000	
0.2% IRISH TREASURY 20301018	800,000.000	811,280.000	
IRISH TREASURY 20311018	800,000.000	786,224.000	
0.55% IRISH TREASURY 20410422	400,000.000	398,576.000	



6.25% Austria Government Bond 20270715	825,000.000	1,144,374.000	
4.15% Austria Government Bond 20370315	1,373,000.000	2,201,289.710	
4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,082,217.500	
3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	906,906.160	
3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	723,147.620	
3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	1,008,138.600	
1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,005,348.470	
2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	992,739.600	
1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	996,485.080	
4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	781,363.820	
2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	470,725.010	
1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	460,312.140	
2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	603,650.190	
2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	564,194.370	
6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,652,000.000	3,792,068.280	
1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	2,189,438.350	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,352,864.240	
2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,411,506.880	
1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	2,733,000.000	3,006,409.320	
2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,952,000.000	2,715,466.240	

3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	1,550,000.000	2,433,283.000	
1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,630,000.000	2,833,351.600	
1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	2,073,964.000	
2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,750,000.000	2,107,315.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,237,554.500	
0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	1,600,000.000	1,617,888.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	2,400,000.000	2,617,824.000	
2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,300,000.000	1,763,710.000	
0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	2,400,000.000	2,439,624.000	
1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	2,900,000.000	3,171,991.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,600,000.000	1,760,512.000	
1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	1,850,000.000	2,126,094.000	
0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	2,300,000.000	2,346,299.000	
0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	2,800,000.000	2,900,072.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,360,000.000	1,391,688.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20230430	2,460,000.000	2,483,394.600	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	2,500,000.000	2,536,700.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,400,000.000	1,321,488.000	
0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,521,968.000	
1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,900,000.000	3,146,906.000	

1.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20401031	1,300,000.000	1,350,193.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20260131	500,000.000	506,350.000	
0.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20310430	2,200,000.000	2,148,652.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20240531	300,000.000	303,627.000	
1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20711031	650,000.000	594,152.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20280131	500,000.000	500,525.000	
0.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370730	900,000.000	898,803.000	
0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20311031	1,400,000.000	1,410,052.000	
1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20420730	600,000.000	600,270.000	
SPANISH GOVERNMENT BOND 20270131	300,000.000	302,373.000	
5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	2,179,000.000	3,393,596.390	
4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	2,254,000.000	3,384,426.080	
4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	2,158,000.000	3,666,938.340	
4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	1,881,838.420	
4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,973,000.000	3,321,703.340	
4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,789,000.000	3,311,296.030	
5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,537,542.050	
5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	1,958,000.000	2,096,215.220	
4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	2,087,412.060	
5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,397,535.800	

	5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	2,399,499.810	
	3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,180,593.000	
	2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,300,346.090	
	ユーロ 小計		ユーロ 704,049,412.880 (90,406,985,108)	
国債証券 合計			230,341,773,353 [230,341,773,353]	
合計			230,341,773,353 [230,341,773,353]	

- (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 255銘柄	100%	47.1%
イギリス・ポンド	国債証券 54銘柄	100%	6.2%
イスラエル・シュケル	国債証券 16銘柄	100%	0.5%
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	100%	1.7%
オフショア・人民元	国債証券 5銘柄	100%	0.2%
カナダ・ドル	国債証券 37銘柄	100%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券 19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 9銘柄	100%	0.5%
ノルウェー・クローネ	国債証券 9銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	100%	0.5%
マレーシア・リングgit	国債証券 30銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	100%	0.7%
ユーロ	国債証券 349銘柄	100%	39.2%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 「ダイワ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

	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	175,163,692	100,004,542
コール・ローン	169,116,291	542,091,267
国債証券	16,818,517,045	21,276,625,965
派生商品評価勘定	7,792,655	292,081
未収利息	261,621,976	319,491,159
前払費用	12,620,593	24,660,391
流動資産合計	17,444,832,252	22,263,165,405
資産合計	17,444,832,252	22,263,165,405
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	9,207,740
未払金	-	83,348,434
未払解約金	621,030	972,694
流動負債合計	621,030	93,528,868
負債合計	621,030	93,528,868
純資産の部		
元本等		
元本	1 12,662,214,054	15,940,538,445
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,781,997,168	6,229,098,092
元本等合計	17,444,211,222	22,169,636,537
純資産合計	17,444,211,222	22,169,636,537
負債純資産合計	17,444,832,252	22,263,165,405

## 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	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1. 1 期首	2019年12月3日	2020年12月1日
期首元本額	10,492,913,460円	12,662,214,054円
期中追加設定元本額	3,184,635,734円	3,908,197,223円
期中一部解約元本額	1,015,335,140円	629,872,832円

期末元本額の内訳 ファンド名		
新興国債券インデックスファン ド(FOFs用)(適格機関投 資家専用)	77,516,508円	189,176,823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)	252,359,389円	282,000,485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)	356,825,524円	465,428,503円
D-I's 新興国債券イン デックス	57,073,382円	59,229,933円
iFree 新興国債券イン デックス	3,104,279,120円	4,401,328,904円
iFree 8資産バランス	2,180,610,867円	3,170,229,988円
DCダイワ新興国債券イン デックスファンド	6,422,193,145円	7,189,020,897円
ダイワ・インデックスセレク ト 新興国債券	169,652,999円	151,785,240円
ダイワ・ノーロード 新興国 債券ファンド	41,703,120円	32,337,672円
計	12,662,214,054円	15,940,538,445円
2. 期末日における受益権の総数	12,662,214,054口	15,940,538,445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 2020年12月1日 至 2021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	2021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	2020年11月30日現在	2021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	59,013,920	777,592,418
合計	59,013,920	777,592,418



(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(2020年7月7日から2020年11月30日まで、及び2021年7月6日から2021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	2020年11月30日 現在				2021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	-	-	-	-	53,468,010	-	53,472,000	3,990
オフショア・ 人民元	-	-	-	-	53,468,010	-	53,472,000	3,990
買 建	214,471,135	-	222,263,790	7,792,655	293,497,596	-	284,585,927	8,911,669
チェコ・コルナ	-	-	-	-	46,486,583	-	45,731,287	755,296
トルコ・リラ	-	-	-	-	8,349,837	-	6,336,230	2,013,607
ハンガリー・ フォリント	25,927,782	-	26,784,770	856,988	6,737,757	-	6,547,433	190,324
ポーランド・ ズロチ	64,192,604	-	67,061,700	2,869,096	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	50,002,941	-	52,711,680	2,708,739	86,404,119	-	83,264,226	3,139,893
ルーマニア・ レイ	73,318,423	-	74,609,230	1,290,807	87,664,659	-	85,758,115	1,906,544
ロシア・ルーブ ル	-	-	-	-	18,168,000	-	18,236,400	68,400
南アフリカ・ ランド	1,029,385	-	1,096,410	67,025	39,686,641	-	38,712,236	974,405
合計	214,471,135	-	222,263,790	7,792,655	346,965,606	-	338,057,927	8,915,659

(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)

	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.3777円	1.3908円
(1万口当たり純資産額)	(13,777円)	(13,908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	9,274,567,500.000	
		8.75% Indonesia Treasury Bond 20310515	6,000,000,000.000	7,016,040,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20320815	5,500,000,000.000	5,913,215,000.000	
		7.5% Indonesia Treasury Bond 20380515	7,300,000,000.000	7,683,688,000.000	
		8.125% Indonesia Treasury Bond 20240515	10,000,000,000.000	10,949,500,000.000	

8.375% Indonesia Treasury Bond 20390415	7,200,000,000.000	8,169,912,000.000	
8.25% Indonesia Treasury Bond 20290515	12,000,000,000.000	13,544,520,000.000	
7% Indonesia Treasury Bond 20300915	14,300,000,000.000	14,997,125,000.000	
6.5% Indonesia Treasury Bond 20250615	16,000,000,000.000	16,909,120,000.000	
7.5% Indonesia Treasury Bond 20350615	9,300,000,000.000	9,893,991,000.000	
7.5% Indonesia Treasury Bond 20400415	10,000,000,000.000	10,596,500,000.000	
5.5% Indonesia Treasury Bond 20260415	15,400,000,000.000	15,685,208,000.000	
6.5% Indonesia Treasury Bond 20310215	15,800,000,000.000	16,107,310,000.000	
6.25% Indonesia Treasury Bond 20360615	4,300,000,000.000	4,304,687,000.000	
6.375% INDONESIA TREASURY BOND 20320415	6,100,000,000.000	6,238,043,000.000	
5.125% INDONESIA TREASURY BOND 20270415	6,000,000,000.000	6,070,200,000.000	
7.125% INDONESIA TREASURY BOND 20420615	4,000,000,000.000	4,146,520,000.000	
11% Indonesia Treasury Bond 20250915	3,600,000,000.000	4,349,772,000.000	
10.5% Indonesia Treasury Bond 20300815	2,180,000,000.000	2,785,734,800.000	
9.5% Indonesia Treasury Bond 20310715	2,970,000,000.000	3,621,677,400.000	
8.375% Indonesia Treasury Bond 20260915	12,824,000,000.000	14,543,698,400.000	
8.25% Indonesia Treasury Bond 20320615	4,750,000,000.000	5,384,647,500.000	
7% Indonesia Treasury Bond 20270515	10,330,000,000.000	11,100,411,400.000	
5.625% Indonesia Treasury Bond 20230515	10,910,000,000.000	11,202,606,200.000	
6.125% Indonesia Treasury Bond 20280515	11,450,000,000.000	11,705,449,500.000	

	6.625% Indonesia Treasury Bond 20330515	7,075,000,000.000	7,117,733,000.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20340315	12,520,000,000.000	14,183,782,800.000	
	8.375% Indonesia Treasury Bond 20240315	13,150,000,000.000	14,394,384,500.000	
	9% Indonesia Treasury Bond 20290315	8,120,000,000.000	9,495,609,200.000	
インドネシア・ルピア 小計			インドネシア・ルピア 277,385,653,200.000 (2,219,085,226)	
ウルグアイ・ペソ	8.5% Uruguay Government International Bond 20280315	2,800,000.000	2,805,600.000	
	8.25% Uruguay Government International Bond 20310521	7,000,000.000	6,734,000.000	
ウルグアイ・ペソ 小計			ウルグアイ・ペソ 9,539,600.000 (24,667,498)	
オフショア・人民元	3.29% China Government Bond 20231018	3,900,000.000	3,961,971.000	
	3.22% China Government Bond 20251206	3,700,000.000	3,780,364.000	
	3.25% China Government Bond 20281122	4,800,000.000	4,914,240.000	
	3.19% China Government Bond 20240411	5,300,000.000	5,385,383.000	
	3.29% China Government Bond 20290523	8,200,000.000	8,428,042.000	
	3.25% China Government Bond 20260606	6,800,000.000	6,958,508.000	
	3.12% China Government Bond 20261205	7,000,000.000	7,131,040.000	
	3.13% China Government Bond 20291121	7,000,000.000	7,107,380.000	
	2.94% China Government Bond 20241017	4,500,000.000	4,544,820.000	

	2.85% China Government Bond 20270604	8,600,000.000	8,626,316.000	
	2.68% China Government Bond 20300521	8,000,000.000	7,853,680.000	
	1.99% China Government Bond 20250409	6,500,000.000	6,359,990.000	
	2.36% China Government Bond 20230702	6,150,000.000	6,139,668.000	
	2.88% China Government Bond 20231105	4,900,000.000	4,937,828.000	
	3.02% China Government Bond 20251022	7,000,000.000	7,091,630.000	
	3.28% China Government Bond 20271203	5,000,000.000	5,141,500.000	
	3.27% China Government Bond 20301119	7,300,000.000	7,524,767.000	
	3.03% China Government Bond 20260311	1,700,000.000	1,724,786.000	
	3.81% China Government Bond 20500914	5,800,000.000	6,195,386.000	
	2.84% China Government Bond 20240408	2,500,000.000	2,518,425.000	
	3.01% China Government Bond 20280513	1,000,000.000	1,010,670.000	
	3.72% China Government Bond 20510412	1,000,000.000	1,054,570.000	
	3.02% China Government Bond 20310527	5,800,000.000	5,878,938.000	
	2.69% CHINA GOVERNMENT BOND 20260812	1,500,000.000	1,501,665.000	
	オフショア・人民元 小計		オフショア・人民元 125,771,567.000 (2,242,519,617)	
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	102,313,800.000	
	4.375% Colombia Government International Bond 20230321	45,000,000.000	44,840,700.000	
	10% Colombian TES 20240724	3,850,000,000.000	4,147,990,000.000	
	6% Colombian TES 20280428	4,290,000,000.000	3,849,803,100.000	

	7.5% Colombian TES 20260826	3,710,000,000.000	3,686,627,000.000	
	7.75% Colombian TES 20300918	2,700,000,000.000	2,602,584,000.000	
	7% Colombian TES 20320630	3,800,000,000.000	3,402,938,000.000	
	6.25% Colombian TES 20251126	2,700,000,000.000	2,603,043,000.000	
	7.25% Colombian TES 20341018	3,400,000,000.000	3,041,878,000.000	
	5.75% Colombian TES 20271103	2,400,000,000.000	2,153,880,000.000	
	7.25% Colombian TES 20501026	2,310,000,000.000	1,906,997,400.000	
	6.25% Colombian TES 20360709	1,200,000,000.000	958,620,000.000	
	7% COLOMBIAN TES 20310326	2,300,000,000.000	2,088,768,000.000	
コロンビア・ペソ 小計			コロンビア・ペソ 30,590,283,000.000 (862,707,161)	
タイ・パーツ		タイ・パーツ	タイ・パーツ	
	4.875% Thailand Government Bond 20290622	30,050,000.000	37,053,152.500	
	3.625% Thailand Government Bond 20230616	23,300,000.000	24,373,198.000	
	3.85% Thailand Government Bond 20251212	26,610,000.000	29,588,989.500	
	3.65% Thailand Government Bond 20310620	28,700,000.000	33,226,851.000	
	1.875% Thailand Government Bond 20220617	17,200,000.000	17,328,484.000	
	3.4% Thailand Government Bond 20360617	29,600,000.000	32,967,888.000	
	2.125% Thailand Government Bond 20261217	35,400,000.000	37,018,842.000	
	2% Thailand Government Bond 20221217	24,000,000.000	24,370,800.000	
	3.775% Thailand Government Bond 20320625	32,500,000.000	38,070,500.000	
	2.875% Thailand Government Bond 20460617	24,900,000.000	25,275,741.000	
	2.4% Thailand Government Bond 20231217	24,500,000.000	25,353,825.000	
	2.875% Thailand Government Bond 20281217	26,500,000.000	28,864,065.000	
	3.3% Thailand Government Bond 20380617	35,500,000.000	38,904,450.000	

	1.45% Thailand Government Bond 20241217	30,000,000.000	30,550,500.000	
	1.6% Thailand Government Bond 20291217	27,500,000.000	27,412,550.000	
	1.6% Thailand Government Bond 20350617	15,500,000.000	14,216,755.000	
	0.95% Thailand Government Bond 20250617	34,000,000.000	34,021,080.000	
	0.75% Thailand Government Bond 20240617	34,900,000.000	34,902,443.000	
	1.585% Thailand Government Bond 20351217	17,400,000.000	15,823,386.000	
	2% Thailand Government Bond 20311217	16,000,000.000	16,132,320.000	
	2% Thailand Government Bond 20420617	7,000,000.000	6,184,780.000	
	1% THAILAND GOVERNMENT BOND 20270617	12,000,000.000	11,822,160.000	
	タイ・パーツ 小計		タイ・パーツ 583,462,760.000 (1,972,104,129)	
チェコ・コロナ		チェコ・コロナ	チェコ・コロナ	
	2.5% Czech Republic Government Bond 20280825	15,600,000.000	15,522,156.000	
	5.7% Czech Republic Government Bond 20240525	8,600,000.000	9,200,022.000	
	4.7% Czech Republic Government Bond 20220912	8,700,000.000	8,845,464.000	
	2.4% Czech Republic Government Bond 20250917	16,100,000.000	15,890,539.000	
	1% Czech Republic Government Bond 20260626	17,900,000.000	16,614,780.000	
	0.95% Czech Republic Government Bond 20300515	16,000,000.000	14,087,680.000	
	0.45% Czech Republic Government Bond 20231025	9,900,000.000	9,462,717.000	
	0.25% Czech Republic Government Bond 20270210	15,500,000.000	13,697,660.000	
	2.75% Czech Republic Government Bond 20290723	15,000,000.000	15,118,350.000	

	2% Czech Republic Government Bond 20331013	17,000,000.000	16,040,010.000	
	1.2% Czech Republic Government Bond 20310313	16,200,000.000	14,384,628.000	
	0.05% Czech Republic Government Bond 20291129	6,000,000.000	4,940,940.000	
	4.2% Czech Republic Government Bond 20361204	9,500,000.000	11,391,640.000	
	1.75% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20320623	7,000,000.000	6,529,740.000	
	1.25% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20250214	14,000,000.000	13,381,200.000	
	1.5% CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 20400424	6,500,000.000	5,417,425.000	
	チェコ・コルナ 小計		チェコ・コルナ 190,524,951.000 (956,625,779)	
チリ・ペソ		チリ・ペソ	チリ・ペソ	
	4.5% BONOS TESORERIA PESOS 20260301	500,000,000.000	484,215,000.000	
	5% BONOS TESORERIA PESOS 20350301	570,000,000.000	530,880,900.000	
	6% BONOS TESORERIA PESOS 20430101	410,000,000.000	413,964,700.000	
	4.7% BONOS TESORERIA PESOS 20300901	535,000,000.000	501,557,150.000	
	4% BONOS TESORERIA PESOS 20230301	250,000,000.000	245,610,000.000	
	2.5% BONOS TESORERIA PESOS 20250301	650,000,000.000	594,477,000.000	
	2.3% BONOS TESORERIA PESOS 20281001	100,000,000.000	81,563,000.000	
	5% BONOS TESORERIA PESOS 20281001	200,000,000.000	193,804,000.000	
	チリ・ペソ 小計		チリ・ペソ 3,046,071,750.000 (411,371,990)	
トルコ・リラ		トルコ・リラ	トルコ・リラ	
	8.5% Turkey Government Bond 20220914	790,000.000	732,543.300	



	7.1% Turkey Government Bond 20230308	2,780,000.000	2,393,051.800	
	10.4% Turkey Government Bond 20240320	680,000.000	560,388.000	
	9% Turkey Government Bond 20240724	1,630,000.000	1,258,963.100	
	8% Turkey Government Bond 20250312	2,690,000.000	1,908,205.300	
	10.6% Turkey Government Bond 20260211	2,570,000.000	1,851,505.100	
	11% Turkey Government Bond 20270224	2,970,000.000	2,057,022.000	
	10.7% Turkey Government Bond 20220817	1,900,000.000	1,799,946.000	
	10.5% Turkey Government Bond 20270811	2,500,000.000	1,656,550.000	
	12.2% Turkey Government Bond 20230118	1,400,000.000	1,297,366.000	
	12.4% Turkey Government Bond 20280308	2,000,000.000	1,429,380.000	
	16.2% Turkey Government Bond 20230614	2,800,000.000	2,659,104.000	
	12.6% Turkey Government Bond 20251001	6,100,000.000	4,816,987.000	
	11.7% Turkey Government Bond 20301113	5,900,000.000	3,871,226.000	
	トルコ・リラ 小計		トルコ・リラ 28,292,237.600 (252,539,341)	
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 12,699,500.000	
ドミニカ・ペソ	小計		ドミニカ・ペソ 12,699,500.000 (25,520,915)	
ハンガリー・ フォリント	3% Hungary Government Bond 20240626	ハンガリー・フォリント 98,500,000.000	ハンガリー・フォリント 95,919,300.000	
	3% Hungary Government Bond 20271027	170,000,000.000	158,742,600.000	

	1.75% Hungary Government Bond 20221026	140,000,000.000	138,129,600.000	
	2.75% Hungary Government Bond 20261222	130,000,000.000	121,680,000.000	
	6.75% Hungary Government Bond 20281022	88,000,000.000	100,456,400.000	
	3% Hungary Government Bond 20300821	145,000,000.000	131,191,650.000	
	2.5% Hungary Government Bond 20241024	160,000,000.000	152,924,800.000	
	3.25% Hungary Government Bond 20311022	202,000,000.000	183,830,100.000	
	1.5% Hungary Government Bond 20230823	40,000,000.000	38,676,000.000	
	1% Hungary Government Bond 20251126	130,000,000.000	115,219,000.000	
	3% Hungary Government Bond 20381027	127,000,000.000	106,273,600.000	
	1.5% Hungary Government Bond 20260422	169,000,000.000	151,300,630.000	
	2% Hungary Government Bond 20290523	135,000,000.000	115,380,450.000	
	2.25% Hungary Government Bond 20330420	145,000,000.000	117,703,750.000	
	1.5% Hungary Government Bond 20260826	100,000,000.000	88,885,000.000	
	6% Hungary Government Bond 20231124	131,800,000.000	137,111,540.000	
	7% Hungary Government Bond 20220624	65,000,000.000	66,472,250.000	
	5.5% Hungary Government Bond 20250624	142,500,000.000	148,684,500.000	
	ハンガリー・フォリント 小計		ハンガリー・フォリント 2,168,581,170.000 (758,296,453)	
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 11,427,700.000	
フィリピン・ペソ	小計		フィリピン・ペソ 11,427,700.000	

			(25,809,461)	
ブラジル・リアル		ブラジル・リアル	ブラジル・リアル	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20230101	10,910,000.000	10,710,783.400	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20250101	10,690,000.000	10,283,352.400	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20270101	11,550,000.000	10,907,242.500	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20290101	5,300,000.000	4,928,788.000	
	10% Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 20310101	3,600,000.000	3,309,444.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20220701	10,300,000.000	9,681,588.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20230701	17,500,000.000	14,622,475.000	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional 20240101	26,700,000.000	21,165,624.000	
Brazil Letras do Tesouro Nacional 20240701	9,300,000.000	6,991,368.000		
ブラジル・リアル 小計		ブラジル・リアル 92,600,665.300 (1,878,728,597)		
ペルー・ソル		ペルー・ソル	ペルー・ソル	
	5.7% Peru Government Bond 20240812	730,000.000	754,017.000	
	6.35% Peru Government Bond 20280812	1,970,000.000	2,077,759.000	
	6.15% Peru Government Bond 20320812	1,850,000.000	1,860,582.000	
	5.94% Peru Government Bond 20290212	2,700,000.000	2,773,602.000	
	5.4% Peru Government Bond 20340812	2,050,000.000	1,869,251.500	
	5.35% Peru Government Bond 20400812	1,000,000.000	845,390.000	
	8.2% Peru Government Bond 20260812	1,565,000.000	1,781,987.250	
6.9% Peru Government Bond 20370812	2,065,000.000	2,089,408.300		

	6.95% Peru Government Bond 20310812	1,920,000.000	2,067,763.200	
ペルー・ソル 小計			ペルー・ソル 16,119,760.250 (451,638,606)	
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	3,718,047.300	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	5,990,000.000	5,828,749.200	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	4,140,000.000	3,983,673.600	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	4,500,000.000	4,501,530.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	4,700,000.000	4,659,580.000	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	6,450,000.000	6,264,820.500	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	3,700,000.000	3,626,925.000	
	0.75% Poland Government Bond 20250425	4,000,000.000	3,706,200.000	
	1.25% Poland Government Bond 20301025	4,600,000.000	3,935,484.000	
	0.25% Poland Government Bond 20261025	4,300,000.000	3,726,380.000	
	4% Poland Government Bond 20231025	3,530,000.000	3,606,954.000	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	5,000,000.000	4,867,750.000	
	3.25% Poland Government Bond 20250725	5,150,000.000	5,174,462.500	
ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 57,600,556.100 (1,582,033,834)	
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	
	4.258% Malaysia Government Investment Issue 20270726	1,800,000.000	1,884,024.000	

4.094% Malaysia Government Investment Issue 20231130	2,000,000.000	2,066,460.000	
4.369% Malaysia Government Investment Issue 20281031	1,700,000.000	1,793,177.000	
4.128% Malaysia Government Investment Issue 20250815	1,900,000.000	1,970,509.000	
4.13% Malaysia Government Investment Issue 20290709	1,600,000.000	1,660,240.000	
3.655% Malaysia Government Investment Issue 20241015	1,700,000.000	1,741,191.000	
3.726% Malaysia Government Investment Issue 20260331	3,300,000.000	3,380,289.000	
3.465% Malaysia Government Investment Issue 20301015	2,500,000.000	2,478,225.000	
3.422% Malaysia Government Investment Issue 20270930	2,200,000.000	2,204,774.000	
3.447% Malaysia Government Investment Issue 20360715	1,500,000.000	1,404,030.000	
4.417% MALAYSIA T-BILL 20410930	1,100,000.000	1,130,349.000	
3.502% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270531	1,750,000.000	1,771,140.000	
3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	2,500,000.000	2,538,725.000	
3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	3,250,000.000	3,310,060.000	
4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,740,000.000	1,809,043.200	
3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	3,850,000.000	3,997,339.500	
4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,800,000.000	1,867,338.000	
3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,400,000.000	1,432,872.000	
3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	2,000,000.000	2,070,280.000	
4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	3,020,000.000	3,134,790.200	
3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	2,520,000.000	2,598,246.000	

	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	2,600,000.000	2,773,576.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	1,400,000.000	1,428,000.000	
	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	2,000,000.000	2,070,600.000	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	2,950,000.000	3,023,986.000	
	3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	2,100,000.000	2,140,299.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	2,350,000.000	2,317,100.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	2,800,000.000	2,653,728.000	
	4.065% MALAYSIAN GOVERNMENT 20500615	2,800,000.000	2,692,340.000	
	2.632% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310415	1,900,000.000	1,765,499.000	
	マレーシア・リングgit 小計		マレーシア・リングgit 67,108,229.900 (1,801,970,057)	
メキシコ・ペソ		メキシコ・ペソ	メキシコ・ペソ	
	5.75% Mexican Bonos 20260305	42,400,000.000	39,897,128.000	
	8% Mexican Bonos 20471107	24,800,000.000	24,350,128.000	
	8% Mexican Bonos 20240905	29,000,000.000	29,528,670.000	
	6.75% Mexican Bonos 20230309	23,000,000.000	23,108,560.000	
	8% Mexican Bonos 20231207	27,250,000.000	27,822,522.500	
	10% Mexican Bonos 20241205	26,550,000.000	28,474,609.500	
	7.5% Mexican Bonos 20270603	34,230,000.000	34,311,467.400	
	10% Mexican Bonos 20361120	7,390,000.000	8,815,604.900	
	8.5% Mexican Bonos 20290531	30,730,000.000	32,379,586.400	
	8.5% Mexican Bonos 20381118	24,900,000.000	25,756,062.000	
	7.75% Mexican Bonos 20310529	30,950,000.000	31,141,580.500	
	6.5% Mexican Bonos 20220609	28,450,000.000	28,528,237.500	
	7.75% Mexican Bonos 20421113	23,120,000.000	22,148,960.000	
	7.75% Mexican Bonos 20341123	10,430,000.000	10,447,000.900	
メキシコ・ペソ	小計		メキシコ・ペソ 366,710,117.600 (1,926,291,576)	

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	1,458,886.000	
	4.75% Romania Government Bond 20250224	1,150,000.000	1,151,805.500	
	5.8% Romania Government Bond 20270726	2,100,000.000	2,166,864.000	
	3.5% Romania Government Bond 20221219	1,090,000.000	1,083,045.800	
	3.25% Romania Government Bond 20240429	1,600,000.000	1,555,728.000	
	4.25% Romania Government Bond 20230628	1,500,000.000	1,497,660.000	
	5% Romania Government Bond 20290212	2,600,000.000	2,543,294.000	
	4.85% Romania Government Bond 20260422	1,600,000.000	1,596,480.000	
	3.65% Romania Government Bond 20310924	1,400,000.000	1,207,374.000	
	4.5% Romania Government Bond 20240617	900,000.000	898,722.000	
	3.65% Romania Government Bond 20250728	1,500,000.000	1,447,740.000	
	4.15% Romania Government Bond 20280126	1,600,000.000	1,514,176.000	
	3.7% Romania Government Bond 20241125	1,300,000.000	1,268,462.000	
	3.25% Romania Government Bond 20260624	800,000.000	746,200.000	
4.15% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20301024	1,000,000.000	909,900.000		
4.75% ROMANIA GOVERNMENT BOND 20341011	800,000.000	735,928.000		
ルーマニア・レイ 小計			ルーマニア・レイ 21,782,265.300 (565,195,329)	
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	46,256,862.400		

7.6% Russian Federal Bond - OFZ 20220720	32,910,000.000	32,811,928.200	
7% Russian Federal Bond - OFZ 20230125	24,400,000.000	23,995,936.000	
7.05% Russian Federal Bond - OFZ 20280119	46,160,000.000	43,243,611.200	
7% Russian Federal Bond - OFZ 20230816	33,800,000.000	33,037,472.000	
8.5% Russian Federal Bond - OFZ 20310917	31,000,000.000	31,697,810.000	
7.75% Russian Federal Bond - OFZ 20260916	45,600,000.000	44,457,720.000	
7.4% Russian Federal Bond - OFZ 20221207	44,000,000.000	43,581,120.000	
7.7% Russian Federal Bond - OFZ 20330323	46,100,000.000	44,505,401.000	
7.1% Russian Federal Bond - OFZ 20241016	48,600,000.000	46,905,804.000	
6.5% Russian Federal Bond - OFZ 20240228	48,000,000.000	46,080,960.000	
7.25% Russian Federal Bond - OFZ 20340510	55,000,000.000	51,009,750.000	
6.9% Russian Federal Bond - OFZ 20290523	51,000,000.000	47,084,220.000	
7.95% Russian Federal Bond - OFZ 20261007	46,000,000.000	45,097,020.000	
7.4% Russian Federal Bond - OFZ 20240717	55,000,000.000	53,529,850.000	
7.15% Russian Federal Bond - OFZ 20251112	59,000,000.000	56,483,650.000	
7.65% Russian Federal Bond - OFZ 20300410	65,000,000.000	62,615,800.000	
7.7% Russian Federal Bond - OFZ 20390316	38,000,000.000	36,591,720.000	
6% Russian Federal Bond - OFZ 20271006	68,000,000.000	60,504,360.000	
4.5% Russian Federal Bond - OFZ 20250716	71,000,000.000	62,434,560.000	
6.1% Russian Federal Bond - OFZ 20350718	63,000,000.000	52,453,170.000	



	5.7% Russian Federal Bond - OFZ 20280517	65,000,000.000	56,615,000.000	
	6.9% RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 20310723	54,000,000.000	49,449,420.000	
	ロシア・ルーブル 小計		ロシア・ルーブル 1,070,443,144.800 (1,627,073,580)	
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	40,550,000.000	44,552,285.000	
	6.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20360331	11,220,000.000	7,638,015.000	
	6.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20410228	9,780,000.000	6,311,523.000	
	7% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20310228	16,040,000.000	13,111,096.000	
	7.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20230228	8,880,000.000	9,161,851.200	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20480228	38,020,000.000	30,893,151.000	
	8.5% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20370131	23,900,000.000	19,740,205.000	
	8% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20300131	35,400,000.000	31,870,620.000	
	8.75% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20440131	23,100,000.000	18,851,910.000	
	8.25% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20320331	25,600,000.000	22,328,576.000	
	8.875% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20350228	23,800,000.000	20,717,186.000	
	9% REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 20400131	17,600,000.000	14,886,960.000	
	南アフリカ・ランド 小計		南アフリカ・ランド 240,063,378.200 (1,692,446,816)	
国債証券 合計			21,276,625,965 [21,276,625,965]	
合計			21,276,625,965 [21,276,625,965]	

- (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 29銘柄	100%	10.4%
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 24銘柄	100%	10.5%
コロンビア・ペソ	国債証券 13銘柄	100%	4.1%
タイ・バーツ	国債証券 22銘柄	100%	9.3%
チェコ・コルナ	国債証券 16銘柄	100%	4.5%
チリ・ペソ	国債証券 8銘柄	100%	1.9%
トルコ・リラ	国債証券 14銘柄	100%	1.2%
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 18銘柄	100%	3.6%
フィリピン・ペソ	国債証券 1銘柄	100%	0.1%
ブラジル・リアル	国債証券 9銘柄	100%	8.8%
ペルー・ソル	国債証券 9銘柄	100%	2.1%
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	100%	7.4%
マレーシア・リングgit	国債証券 30銘柄	100%	8.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	100%	9.1%
ルーマニア・レイ	国債証券 16銘柄	100%	2.7%
ロシア・ルーブル	国債証券 23銘柄	100%	7.6%
南アフリカ・ランド	国債証券 12銘柄	100%	8.0%

## 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 J - REITインデックス】**

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間（2020年12月1日から2021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】

## 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4期 2020年11月30日現在	第5期 2021年11月30日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,943,024	3,401,115
親投資信託受益証券	1,176,557,004	1,678,496,673
未収入金	5,630,000	-
流動資産合計	1,185,130,028	1,681,897,788
資産合計	1,185,130,028	1,681,897,788
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	6,651,910	545,692
未払受託者報酬	123,200	186,684
未払委託者報酬	1,170,751	1,774,023
その他未払費用	30,722	46,584
流動負債合計	7,976,583	2,552,983
負債合計	7,976,583	2,552,983
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,110,904,033	1,291,974,799
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	66,249,412	387,370,006
（分配準備積立金）	215,394,846	250,151,187
元本等合計	1,177,153,445	1,679,344,805
純資産合計	1,177,153,445	1,679,344,805
負債純資産合計	1,185,130,028	1,681,897,788

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期 自 2019年12月3日 至 2020年11月30日	第5期 自 2020年12月1日 至 2021年11月30日
<b>営業収益</b>		
受取利息	9	-
有価証券売買等損益	217,453,016	270,479,669
<b>営業収益合計</b>	<b>217,453,007</b>	<b>270,479,669</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	1,045	747
受託者報酬	241,700	338,786
委託者報酬	2,296,950	3,219,399
その他費用	60,281	84,534
<b>営業費用合計</b>	<b>2,599,976</b>	<b>3,643,466</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>	<b>220,052,983</b>	<b>266,836,203</b>
経常利益又は経常損失( )	220,052,983	266,836,203
<b>当期純利益又は当期純損失( )</b>	<b>220,052,983</b>	<b>266,836,203</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	45,498,911	48,522,453
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>	<b>295,950,737</b>	<b>66,249,412</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額	18,779,927	125,956,141
<b>当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>18,779,927</b>	<b>125,956,141</b>
剰余金減少額又は欠損金増加額	73,927,180	23,149,297
<b>当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>73,927,180</b>	<b>23,149,297</b>
分配金	1 -	1 -
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>	<b>66,249,412</b>	<b>387,370,006</b>

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第5期	
	自 2020年12月1日	至 2021年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1. 1 期首元本額	887,949,644円	1,110,904,033円
期中追加設定元本額	494,302,320円	469,805,021円
期中一部解約元本額	271,347,931円	288,734,255円
2. 計算期間末日における受益権の総数	1,110,904,033口	1,291,974,799口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日	自 2020年12月1日 至 2021年11月30日

1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(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。	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(82,237,949円)、投資信託約款に規定される収益調整金(274,612,886円)及び分配準備積立金(167,913,238円)より分配対象額は524,764,073円(1万口当たり4,061.72円)であり、分配を行っておりません。
------------	--	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	第5期 自 2020年12月1日 至 2021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。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第5期
	2021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4期	第5期
	2020年11月30日現在	2021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	191,152,216	243,096,765
合計	191,152,216	243,096,765

## （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4期	第5期
2020年11月30日現在	2021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5期
自 2020年12月1日
至 2021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4期	第5期
	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1口当たり純資産額	1.0596円	1.2998円
（1万口当たり純資産額）	（10,596円）	（12,998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	506,440,779	1,678,496,673	
親投資信託受益証券 合計			1,678,496,673	
合計			1,678,496,673	

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

	2020年11月30日現在	2021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	7,415,307,202	9,111,247,907
投資証券	2 354,620,139,760	435,527,511,600
未収入金	-	530,183,103

未収配当金		2,644,533,611	2,669,289,420
前払金		55,594,060	574,899,100
流動資産合計		364,735,574,633	448,413,131,130
資産合計		364,735,574,633	448,413,131,130
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		105,960,070	681,915,100
未払金		1,102,948,832	-
未払解約金		30,108,000	996,864,000
流動負債合計		1,239,016,902	1,678,779,100
負債合計		1,239,016,902	1,678,779,100
純資産の部			
元本等			
元本	1	134,869,045,089	134,790,265,060
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		228,627,512,642	311,944,086,970
元本等合計		363,496,557,731	446,734,352,030
純資産合計		363,496,557,731	446,734,352,030
負債純資産合計		364,735,574,633	448,413,131,130

## 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11月30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られ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られ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、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	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1. 1 期首	2019年12月3日	2020年12月1日
期首元本額	111,967,387,978円	134,869,045,089円
期中追加設定元本額	48,494,130,185円	27,504,343,656円
期中一部解約元本額	25,592,473,074円	27,583,123,685円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワJ - REITオープン	5,777,163,787円	4,900,112,506円
ダイワJ - REITオープン	118,500,417,494円	118,635,086,252円
(毎月分配型)		
ダイワJ - REITオープン	350,789,457円	335,161,418円
(年1回決算型)		
DCダイワ・ターゲットイ	1,276,931円	9,251,429円
ヤー2050		
iFree J - REITイン	153,736,446円	565,753,538円
ンデックス		
iFree 8資産バランス	1,100,172,090円	1,335,042,888円
DC・ダイワJ - REIT	5,363,429,514円	5,312,636,720円
オープン		
DCダイワ・ターゲットイ	2,433,426円	- 円
ヤー2020		
DCダイワ・ターゲットイ	4,849,856円	5,737,602円
ヤー2030		
DCダイワ・ターゲットイ	2,918,990円	4,869,632円
ヤー2040		
ダイワ・ノーロード J - R	100,134,703円	98,265,717円
EITファンド		
ダイワファンドラップ J -	1,696,174,777円	1,870,565,573円
REITインデックス		

	ダイワJ-REITインデックス(ダイワSMA専用)	283,031,438円	245,517,154円
	ダイワファンドラップオンラインJ-REITインデックス	436,537,921円	506,440,779円
	ダイワ・インデックスセレクトJ-REIT	1,095,978,259円	965,823,852円
計		134,869,045,089円	134,790,265,060円
2.	期末日における受益権の総数	134,869,045,089口	134,790,265,060口
3.	2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。  投資証券 4,717,300,000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 5,601,750,000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 2020年12月1日 至 2021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	2021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	2020年11月30日現在	2021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	5,873,762,785	24,298,061,388
合計	5,873,762,785	24,298,061,388

（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（2020年9月16日から2020年11月30日まで、及び2021年9月16日から2021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	2020年11月30日 現在				2021年11月30日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								

不動産投信 指数先物取引								
買 建	8,952,191,560	-	8,846,808,000	105,383,560	11,895,299,100	-	11,214,000,000	681,299,100
合計	8,952,191,560	-	8,846,808,000	105,383,560	11,895,299,100	-	11,214,000,000	681,299,100

## (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)

	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1口当たり純資産額	2.6952円	3.3143円
(1万口当たり純資産額)	(26,952円)	(33,143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	7,996	1,086,656,400	
	サンケイリアルエステート	12,578	1,560,929,800	
	SOSILA物流リート投	16,669	2,667,040,000	
	東海道リート投資法	3,041	321,433,700	
	日本アコモデーションファンド投資法人	13,712	8,501,440,000	
	森ヒルズリート	46,696	7,023,078,400	
	産業ファンド	56,375	11,432,850,000	
	アドバンス・レジデンス	39,705	13,837,192,500	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	27,122	5,589,844,200	

A P I 投資法人	21,164	9,142,848,000	
G L P 投資法人	128,612	23,188,743,600	
コンフォリア・レジデンシャル	17,880	5,703,720,000	
日本プロロジスリート	62,913	23,246,353,500	
星野リゾート・リート	6,655	4,239,235,000	
ONE リート投資法人	6,891	2,027,332,200	
イオンリート投資	46,700	7,098,400,000	
ヒューリックリート投資法	37,045	6,175,401,500	
日本リート投資法人	12,253	5,164,639,500	
積水ハウス・リート投資	120,543	9,944,797,500	
トーセイ・リート投資法人	8,297	1,049,570,500	
ケネディクス商業リート	15,855	4,440,985,500	
ヘルスケア&メディカル投資	8,470	1,308,615,000	
サムティ・レジデンシャル	8,995	1,068,606,000	
野村不動産マスターF	128,415	20,726,181,000	
いちごホテルリート投資	6,579	538,820,100	
ラサールロジポート投資	48,613	9,100,353,600	
スターアジア不動産投	41,038	2,523,837,000	
マリモ地方創生リート	3,720	500,340,000	
三井不動産パーク	14,761	8,605,663,000	
大江戸温泉リート	6,409	480,675,000	
投資法人みらい	45,270	2,408,364,000	
森トラスト・ホテルリート投	9,317	1,180,463,900	
三菱地所物流REIT	10,092	4,773,516,000	
CREロジスティクスファンド	15,379	3,368,001,000	
ザイマックス・リート	5,764	639,804,000	
タカラレーベン不動産投	15,660	1,742,958,000	
伊藤忠アドバンスロジ	15,484	2,660,151,200	
日本ビルファンド	45,004	31,502,800,000	
ジャパンリアルエステイト	39,711	26,010,705,000	
日本都市ファンド投資法人	200,360	19,595,208,000	
オリックス不動産投資	79,122	14,281,521,000	
日本プライムリアルティ	26,097	10,556,236,500	
NTT都市開発リート投資法人	38,062	5,716,912,400	
東急リアル・エステート	26,624	4,962,713,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	27,575	3,286,940,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	89,395	12,926,517,000	
森トラスト総合リート	28,381	4,018,749,600	
インヴィンシブル投資法人	174,782	6,650,455,100	
フロンティア不動産投資	13,921	6,918,737,000	

平和不動産リート	25,725	3,876,757,500	
日本ロジスティクスファンド投資法人	25,946	8,147,044,000	
福岡リート投資法人	20,537	3,351,638,400	
ケネディクス・オフィス投資法人	12,284	8,463,676,000	
いちごオフィスリート投資法人	32,538	2,785,252,800	
大和証券オフィス投資法人	8,395	5,994,030,000	
阪急阪神リート投資法人	17,937	2,837,633,400	
スタートアップシード投資法人	6,184	1,393,873,600	
大和ハウスリート投資法人	59,625	19,288,687,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	121,655	7,128,983,000	
大和証券リビング投資法人	53,658	5,870,185,200	
ジャパンエクセレント投資法人	36,848	4,893,414,400	
投資証券 合計		435,527,511,600	
合計		435,527,511,600	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

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

日本プロロジスリート	3,500口	野村不動産マスターF	5,000口
日本ビルファンド	2,850口	ジャパンリアルエステイト	2,300口

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。



**【ダイワ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5期計算期間(2020年12月1日から2021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】

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4期 2020年11月30日現在	第5期 2021年11月30日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,744,262	1,908,735
親投資信託受益証券	822,816,971	1,052,306,701
派生商品評価勘定	4,460,770	10,138,600
未収入金	597,644	49,399
流動資産合計	829,619,647	1,064,403,435
資産合計	829,619,647	1,064,403,435
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,103,706	454
未払金	70,159	36,953
未払解約金	808,080	233,713
未払受託者報酬	81,847	110,607
未払委託者報酬	1,125,873	1,521,415
その他未払費用	20,377	27,569
流動負債合計	7,210,042	1,930,711
負債合計	7,210,042	1,930,711
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,797,988,165	1,788,413,204
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	24,421,440	274,059,520
(分配準備積立金)	73,575,145	241,597,576
元本等合計	822,409,605	1,062,472,724
純資産合計	822,409,605	1,062,472,724
負債純資産合計	829,619,647	1,064,403,435

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期		第5期	
	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日		自 2020年12月1日 至 2021年11月30日	
<b>営業収益</b>				
受取利息		18		-
有価証券売買等損益		113,051,771		328,899,730
為替差損益		25,495,043		80,165,331
<b>営業収益合計</b>		<b>87,556,710</b>		<b>248,734,399</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		824		293
受託者報酬		165,818		203,989
委託者報酬		2,281,302		2,806,029
その他費用		41,299		73,181
<b>営業費用合計</b>		<b>2,489,243</b>		<b>3,083,492</b>
営業利益又は営業損失（ ）		90,045,953		245,650,907
経常利益又は経常損失（ ）		90,045,953		245,650,907
当期純利益又は当期純損失（ ）		90,045,953		245,650,907
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		43,671,476		24,376,239
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		124,109,159		24,421,440
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		36,952,702
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		36,952,702
剰余金減少額又は欠損金増加額		53,313,242		8,589,290
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		34,530,997		8,589,290
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（ ）		24,421,440		274,059,520

## (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5期	
	自 2020年12月1日	至 2021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	外貨建取引等の処理基準  外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1. 1 期首元本額	715,401,824円	797,988,165円
期中追加設定元本額	336,517,235円	216,237,612円
期中一部解約元本額	253,930,894円	225,812,573円

2.	計算期間末日における受益権の総数	797,988,165口	788,413,204口
----	------------------	--------------	--------------

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日	自 2020年12月1日 至 2021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(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>	<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(186,626,873円)、投資信託約款に規定される収益調整金(72,637,864円)及び分配準備積立金(54,970,703円)より分配対象額は314,235,440円(1万口当たり3,985.67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5期 自 2020年12月1日 至 2021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	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第5期 2021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4期 2020年11月30日現在	第5期 2021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	74,835,738	289,455,736
合計	74,835,738	289,455,736

## （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

	第4期 2020年11月30日 現在	第5期 2021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		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売 建	728,481,899	-	729,124,835	642,936	1,063,029,517	-	1,052,891,371	10,138,146
アメリカ・ドル	542,901,697	-	538,555,563	4,346,134	808,201,480	-	806,140,283	2,061,197
イギリス・ポ ンド	40,820,300	-	41,783,664	963,364	60,177,464	-	58,517,316	1,660,148
イスラエル・ シケル	462,946	-	473,083	10,137	590,182	-	590,636	454
オーストラ リア・ドル	53,121,875	-	55,714,050	2,592,175	74,944,909	-	71,151,386	3,793,523
カナダ・ドル	13,981,395	-	14,253,302	271,907	20,811,723	-	20,180,781	630,942
シンガポ ール・ドル	28,980,523	-	29,417,416	436,893	34,044,123	-	33,505,847	538,276
ニュージ ーランド・ドル	3,887,363	-	4,115,530	228,167	4,362,726	-	4,139,728	222,998
ユーロ	30,856,323	-	31,455,702	599,379	44,810,535	-	43,648,937	1,161,598
香港・ドル	13,469,477	-	13,356,525	112,952	15,086,375	-	15,016,457	69,918
合計	728,481,899	-	729,124,835	642,936	1,063,029,517	-	1,052,891,371	10,138,146

## (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)

<p>第5期 自 2020年12月1日 至 2021年11月30日</p>
<p>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。</p>

(1口当たり情報)

	第4期 2020年11月30日現在	第5期 2021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)	1.0306円 (10,306円)	1.3476円 (13,476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	333,980,799	1,052,306,701	
親投資信託受益証券 合計			1,052,306,701	
合計			1,052,306,701	

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

	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	99,810,361	140,807,004
コール・ローン	327,488,117	610,755,443
投資信託受益証券	154,336,387	420,239,075
投資証券	28,032,952,855	47,151,826,564
派生商品評価勘定	34,699,627	11,879,108
未収入金	2,614,233	2,778,989
未収配当金	67,602,662	56,716,807
差入委託証拠金	246,329,361	385,353,829
流動資産合計	28,965,833,603	48,780,356,819
資産合計	28,965,833,603	48,780,356,819
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	764,038	3,711,901
未払金	52,121,743	145,487,910
未払株式払込金	5,533,125	2,215,073
未払解約金	7,567,800	1,000
流動負債合計	65,986,706	151,415,884
負債合計	65,986,706	151,415,884
純資産の部		
元本等		
元本	1 13,110,290,968	15,433,680,362
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	15,789,555,929	33,195,260,573
元本等合計	28,899,846,897	48,628,940,935

純資産合計	28,899,846,897	48,628,940,935
負債純資産合計	28,965,833,603	48,780,356,819

## 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11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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 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. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 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  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	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1. 1 期首	2019年12月3日	2020年12月1日
期首元本額	10,530,038,419円	13,110,290,968円
期中追加設定元本額	5,074,786,065円	5,480,584,788円
期中一部解約元本額	2,494,533,516円	3,157,195,394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)	6,132,754,799円	6,291,808,323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)	1,093,059,962円	1,162,934,430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)	373,261,192円	333,980,799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)	273,443,934円	289,623,388円
D-I's グローバルREITインデックス	1,889,346円	2,223,608円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	1,550,762円	8,326,903円
iFree 外国REITインデックス	123,942,403円	632,249,938円
iFree 8資産バランス	1,373,085,035円	1,462,352,614円
グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)	58,109,678円	236,948,723円
グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)	22,959,674円	113,742,003円
DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド	2,665,764,298円	3,300,676,766円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	3,110,210円	- 円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	6,033,482円	6,106,352円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	3,580,507円	5,186,807円
ダイワバランスファンド 2020-07(適格機関投資家専用)	249,211,041円	183,749,014円
ダイワバランスファンド 2021-02(適格機関投資家専用)	- 円	184,925,099円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	253,711,264円	243,151,995円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	52,204,021円	59,517,654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)	217,637,598円	912,182,345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)	204,981,762円	3,993,601円
計	13,110,290,968円	15,433,680,362円
2. 期末日における受益権の総数	13,110,290,968口	15,433,680,362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 2020年12月1日 至 2021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)における不動産投信指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021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	2020年11月30日現在	2021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	7,312,921	885,131
投資証券	3,274,154,878	9,295,917,870
合計	3,266,841,957	9,295,032,739

（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12月3日から2020年11月30日まで、及び2020年12月1日から2021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	2020年11月30日 現在				2021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	690,773,738	-	723,083,683	32,309,945	1,092,285,247	-	1,103,599,867	11,314,620
合計	690,773,738	-	723,083,683	32,309,945	1,092,285,247	-	1,103,599,867	11,314,620

## （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	2020年11月30日 現在				2021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	321,323,856	-	322,949,500	1,625,644	657,817,200	-	654,669,787	3,147,413
アメリカ・ドル	165,914,658	-	165,153,300	761,358	593,203,105	-	591,740,900	1,462,205
シンガポ ー ル・ドル	14,760,758	-	14,759,200	1,558	-	-	-	-
ユーロ	140,648,440	-	143,037,000	2,388,560	64,614,095	-	62,928,887	1,685,208
合計	321,323,856	-	322,949,500	1,625,644	657,817,200	-	654,669,787	3,147,413

### (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)

	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1口当たり純資産額	2,204円	3,150円
(1万口当たり純資産額)	(22,044円)	(31,508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	33,950,000	3,693,760,000	
		アメリカ・ドル 小計		3,693,760,000 (420,239,075)	
投資信託受益証券 合計				420,239,075 [420,239,075]	
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	33,200	714,132,000	
		URBAN EDGE PROPERTIES	28,682	499,927,260	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	28,800	461,664,000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	36,000	8,668,080,000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	84,847	13,570,429,180	
		BOSTON PROPERTIES INC	36,700	4,049,478,000	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	36,789	280,332,180	
		VORNADO REALTY TRUST	41,064	1,707,441,120	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	21,200	444,140,000	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	21,100	1,307,567,000	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	5,500	423,555,000	
		EQUITY RESIDENTIAL	88,000	7,587,360,000	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	54,800	843,372,000	
		EPR PROPERTIES	18,900	895,482,000	



BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	7,100	106,926.000	
CITY OFFICE REIT INC	10,900	184,101.000	
GLOBAL NET LEASE INC	25,933	374,472.520	
EQUINIX INC	23,200	19,024,000.000	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	19,829	539,348.800	
CHATHAM LODGING TRUST	10,800	133,056.000	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	8,800	129,184.000	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	14,200	1,153,324.000	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	31,400	558,292.000	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	6,000	261,060.000	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	13,100	60,653.000	
HOST HOTELS & RESORTS INC	184,300	3,026,206.000	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	70,708	2,874,280.200	
CORESITE REALTY CORP	11,400	1,953,618.000	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	39,400	973,180.000	
RLJ LODGING TRUST	41,871	540,554.610	
FARMLAND PARTNERS INC	6,700	78,993.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	56,100	1,015,971.000	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	15,700	224,196.000	
CYRUSONE INC	32,000	2,860,160.000	
KIMCO REALTY CORP	158,362	3,686,667.360	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	15,600	256,152.000	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	56,550	1,923,831.000	
WHITESTONE REIT	11,200	106,064.000	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	57,437	2,629,465.860	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	32,300	575,263.000	
PARK HOTELS & RESORTS INC	61,080	1,097,607.600	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	126,711	1,046,632.860	
INVITATION HOMES INC	148,797	6,140,852.190	
JBG SMITH PROPERTIES	29,932	857,851.120	
ALEXANDER & BALDWIN INC	18,700	417,571.000	
CLIPPER REALTY INC	1,400	12,544.000	
GLADSTONE LAND CORP	6,400	183,616.000	
AMERICOLD REALTY TRUST	67,400	2,183,760.000	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	16,900	376,363.000	
VICI PROPERTIES INC	157,400	4,427,662.000	
RETAIL VALUE INC	4,490	27,029.800	
BRT APARTMENTS CORP	2,900	54,694.000	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	6,100	1,619,855.000	

SAFEHOLD INC	3,300	233,805.000	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	29,600	239,464.000	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	30,500	834,785.000	
COREPOINT LODGING INC	10,700	165,529.000	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	7,400	225,552.000	
STORE CAPITAL CORP	63,100	2,128,994.000	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	5,900	41,772.000	
BROADSTONE NET LEASE INC	41,000	1,042,220.000	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	25,300	231,495.000	
LIFE STORAGE INC	20,250	2,708,437.500	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	13,200	464,904.000	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	26,582	664,018.360	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	12,200	165,554.000	
PARAMOUNT GROUP INC	40,200	332,856.000	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	36,500	346,020.000	
NETSTREIT CORP	9,900	216,711.000	
APARTMENT INCOME REIT CO	40,489	2,100,164.430	
CTO REALTY GROWTH INC	1,200	66,852.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	35,600	2,527,600.000	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	29,700	568,161.000	
STAG INDUSTRIAL INC	41,800	1,816,210.000	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	2,600	46,800.000	
INDUS REALTY TRUST INC	1,100	81,961.000	
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	3,200	56,352.000	
ORION OFFICE REIT INC	14,223	264,547.800	
VENTAS INC	101,629	4,992,016.480	
CARETRUST REIT INC	24,503	494,470.540	
GEO GROUP INC/THE	31,600	269,232.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	76,700	1,794,013.000	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	11,800	284,026.000	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	56,987	742,540.610	
UMH PROPERTIES INC	10,600	245,814.000	
IRON MOUNTAIN INC	74,700	3,500,442.000	
TERRENO REALTY CORP	18,200	1,389,206.000	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	30,720	1,406,976.000	
SUN COMMUNITIES INC	29,900	5,882,825.000	
ACADIA REALTY TRUST	22,811	487,242.960	

ALEXANDER'S INC	500	129,740.000	
PROLOGIS INC	190,919	29,264,064.320	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	35,800	7,348,308.000	
BRANDYWINE REALTY TRUST	43,300	578,488.000	
SAUL CENTERS INC	3,200	160,992.000	
MACK-CALI REALTY CORP	20,100	343,509.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	26,000	4,390,100.000	
COUSINS PROPERTIES INC	38,406	1,480,935.360	
SITE CENTERS CORP	46,278	722,862.360	
DUKE REALTY CORP	97,700	5,808,265.000	
EASTGROUP PROPERTIES INC	10,400	2,128,880.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	16,767	5,809,765.500	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	33,300	2,032,965.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	18,100	2,280,419.000	
GETTY REALTY CORP	9,803	302,716.640	
WELLTOWER INC	109,100	8,950,564.000	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	139,200	4,741,152.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	26,900	1,182,255.000	
SERVICE PROPERTIES TRUST	41,700	372,798.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	37,600	1,187,032.000	
EQUITY COMMONWEALTH	31,475	804,815.750	
KILROY REALTY CORP	27,100	1,762,855.000	
LTC PROPERTIES INC	9,600	306,336.000	
LEXINGTON REALTY TRUST	70,100	1,055,005.000	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	29,928	6,284,880.000	
MACERICH CO/THE	54,979	1,089,133.990	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	44,100	3,740,562.000	
NATL HEALTH INVESTORS INC	11,900	622,251.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	45,300	2,057,526.000	
REALTY INCOME CORP	142,239	9,928,282.200	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	28,500	731,595.000	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	17,000	20,740.000	
PUBLIC STORAGE	39,400	13,076,466.000	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	5,100	892,908.000	
REGENCY CENTERS CORP	39,520	2,796,435.200	
RPT REALTY	21,100	276,621.000	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	26,300	532,838.000	
SL GREEN REALTY CORP	17,357	1,222,800.650	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	57,500	162,725.000	

	URSTADT BIDDLE - CLASS A	7,600	144,704.000	
	UDR INC	72,000	4,137,840.000	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3,100	173,631.000	
	WP CAREY INC	47,600	3,748,500.000	
	WASHINGTON REIT	21,600	553,176.000	
	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	7,000	78,260.000	
	AGREE REALTY CORP	17,800	1,236,566.000	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	61,648	1,711,348.480	
	CUBESMART	52,100	2,862,895.000	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	56,326	636,483.800	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	72,978	12,317,956.620	
	CEDAR REALTY TRUST INC	3,100	68,417.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	34,500	7,005,225.000	
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	7,875	72,135.000	
	CENTERSPACE	3,660	377,346.000	
	KITE REALTY GROUP TRUST	55,741	1,133,214.530	
	MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	24,900	517,173.000	
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3,633	120,651.930	
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	35,900	1,884,750.000	
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	8,800	193,600.000	
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	54,342	498,316.140	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	153,800	3,305,162.000	
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	21,000	124,530.000	
	DOUGLAS EMMETT INC	45,300	1,517,550.000	
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	364,562	258,839.020	
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	193,400	152,786.000	
	EAGLE HOSPITALITY TRUST	90,000	3,082.500	
	PRIME US REIT	147,000	121,275.000	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 315,743,588.330 (35,922,148,044)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	ASSURA PLC	707,100	483,302.850	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	159,570	129,411.270	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	100,000	74,400.000	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	220,710	168,843.150	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	146,110	145,233.340	
	REGIONAL REIT LTD	111,310	100,067.690	

	NEWRIVER REIT PLC	69,330	61,287.720	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	224,810	374,083.840	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	155,490	143,050.800	
	CUSTODIAN REIT PLC	109,420	106,137.400	
	GCP STUDENT LIVING PLC	112,860	237,570.300	
	PRS REIT PLC/THE	119,640	123,229.200	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	90,900	107,989.200	
	LXI REIT PLC	180,188	269,200.870	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	98,200	93,191.800	
	AEW UK REIT PLC	49,610	55,761.640	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	201,120	206,349.120	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	207,000	251,505.000	
	HOME REIT PLC	60,000	70,500.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	198,461	1,490,442.110	
	SEGR0 PLC	317,050	4,494,183.750	
	HAMMERSON PLC	1,076,984	332,895.750	
	UNITE GROUP PLC/THE	105,390	1,143,481.500	
	BRITISH LAND CO PLC	247,760	1,291,820.640	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	67,061	483,509.810	
	DERWENT LONDON PLC	29,630	1,014,827.500	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	346,370	519,901.370	
	WORKSPACE GROUP PLC	32,260	263,241.600	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	54,570	731,238.000	
	SHAFTESBURY PLC	75,770	484,928.000	
	BIG YELLOW GROUP PLC	45,640	739,368.000	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	237,150	645,048.000	
	SCHR0DER REAL ESTATE INVESTM	121,600	63,718.400	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	454,530	1,088,144.820	
	イギリス・ポンド 小計		イギリス・ポンド 17,987,864.440 (2,726,240,735)	
イスラエル・ シュケル	REIT 1 LTD	48,840	イスラエル・シュケル 1,050,060.000	
	イスラエル・シュケル 小計		イスラエル・シュケル 1,050,060.000 (37,813,921)	
オーストラリ ア・ドル	DEXUS/AU	284,343	オーストラリア・ドル 3,085,121.550	

	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	93,380	344,572.200	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	371,284	317,447.820	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	144,870	533,121.600	
	AVENTUS GROUP	103,000	342,990.000	
	RURAL FUNDS GROUP	108,595	321,441.200	
	WAYPOINT REIT	202,491	532,551.330	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	149,458	720,387.560	
	CENTURIA OFFICE REIT	118,830	263,802.600	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	166,050	524,718.000	
	IRONGATE GROUP	149,630	235,667.250	
	HOME CONSORTIUM	48,000	363,360.000	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	130,340	183,779.400	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	291,520	816,256.000	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	79,167	323,001.360	
	NATIONAL STORAGE REIT	288,195	708,959.700	
	DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	54,670	179,317.600	
	GDI PROPERTY GROUP	123,310	135,024.450	
	SCENTRE GROUP	1,372,159	4,171,363.360	
	ARENA REIT	93,890	415,932.700	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	47,120	160,208.000	
	BWP TRUST	123,870	510,344.400	
	GPT GROUP	506,413	2,628,283.470	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	139,510	574,781.200	
	MIRVAC GROUP	1,042,307	3,022,690.300	
	STOCKLAND	631,087	2,745,228.450	
	ABACUS PROPERTY GROUP	107,930	385,310.100	
	GOODMAN GROUP	444,441	10,911,026.550	
	VICINITY CENTRES	1,022,946	1,733,893.470	
	CHARTER HALL GROUP	123,136	2,335,889.920	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	94,740	582,651.000	
	オーストラリア・ドル 小計		オーストラリア・ドル 40,109,122.540 (3,260,470,571)	
カナダ・ドル	INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	4,200	カナダ・ドル 39,858.000	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	9,400	38,446.000	

EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	11,400	50,160.000	
NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT UNITS	4,300	52,589.000	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	17,100	197,334.000	
SLATE GROCERY REIT	7,000	93,380.000	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	14,700	337,512.000	
SLATE OFFICE REIT	5,100	25,347.000	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4,200	93,114.000	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	28,000	382,200.000	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	22,200	514,818.000	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	11,200	81,536.000	
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	4,100	55,350.000	
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	8,500	858,415.000	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	27,000	452,790.000	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	17,500	298,200.000	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	27,600	508,392.000	
CHOICE PROPERTIES REIT	43,200	628,992.000	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4,200	75,264.000	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	14,100	244,071.000	
PLAZA RETAIL REIT	11,100	51,393.000	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	19,100	592,100.000	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	22,800	1,332,888.000	
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	21,790	252,328.200	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	38,166	620,197.500	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	42,000	929,040.000	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	7,200	162,000.000	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,900	325,267.000	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	12,300	216,849.000	
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	16,800	723,072.000	
カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 10,232,902.700 (913,388,895)	
シンガポール・ドル		シンガポール・ドル	
KEPPEL DC REIT	331,683	786,088.710	
FIRST REAL ESTATE INVNT TRUST	419,876	123,863.420	
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	583,900	589,739.000	
AIMS APAC REIT	119,000	166,600.000	
FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	783,990	1,160,305.200	

	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	134,000	119,260.000	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	208,900	181,743.000	
	EC WORLD REIT	57,000	46,740.000	
	IREIT GLOBAL	175,124	111,203.740	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	905,877	2,708,572.230	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,346,522	2,881,557.080	
	SUNTEC REIT	565,400	853,754.000	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	770,800	1,472,228.000	
	KEPPEL REIT	501,400	556,554.000	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	505,456	505,456.000	
	ESR-REIT	709,902	340,752.960	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	191,600	216,508.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	281,176	649,516.560	
	STARHILL GLOBAL REIT	383,800	247,551.000	
	CAPITALAND CHINA TRUST	269,442	320,635.980	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	98,300	491,500.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	513,769	1,376,900.920	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	354,500	317,277.500	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	579,884	1,211,957.560	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	248,100	145,138.500	
	SPH REIT	275,600	278,356.000	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	651,063	289,723.030	
	シンガポール・ドル 小計		シンガポール・ドル 18,149,482.390 (1,510,218,430)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	224,470	317,625.050	ニュージーランド・ドル
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	423,800	483,132.000	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	102,920	293,836.600	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	299,220	725,608.500	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	328,820	506,382.800	
	ニュージーランド・ドル 小計		ニュージーランド・ドル 2,326,584.950 (180,380,131)	
ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	9,887	176,977.300	ユーロ
	ALTAREA RIGHTS	10	23.290	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	43,860	853,954.200	
	HAMBORNER REIT AG	17,280	163,935.360	



	WERELDHAVE NV	8,970	107,729.700	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	28,680	1,720,800.000	
	NSI NV	4,131	141,073.650	
	VASTNED RETAIL NV	4,700	105,985.000	
	ICADE	7,670	488,195.500	
	CARMILA	11,800	151,512.000	
	ALTAREA	1,010	162,610.000	
	GECINA SA	13,391	1,598,215.850	
	KLEPIERRE	48,640	926,835.200	
	COVIVIO	11,652	854,790.720	
	MERCIALYS	12,130	102,316.550	
	AEDIFICA	8,886	1,060,099.800	
	COFINIMMO	6,880	961,136.000	
	BEFIMMO	5,860	186,055.000	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	5,480	148,234.000	
	RETAIL ESTATES	2,540	175,514.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	34,450	1,420,029.000	
	CARE PROPERTY INVEST	6,100	156,160.000	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	4,580	224,420.000	
	MONTEA NV	2,500	320,000.000	
	COIMA RES SPA	5,190	37,523.700	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	13,240	46,671.000	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	14,530	68,944.850	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	63,533	522,558.920	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	82,170	815,948.100	
	CROMWELL REIT EUR	80,920	204,727.600	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	102,050	156,340.600	
	HIBERNIA REIT PLC	159,240	207,012.000	
	ユーロ 小計		ユーロ 14,266,328.890 (1,831,939,293)	
韓国・ウォン			韓国・ウォン	
	ESR KENDALL SQUARE REIT LTD	13,160	987,000.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	11,440	91,520,000.000	
	LOTTE REIT CO LTD	34,375	192,500,000.000	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	25,060	122,418,100.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	5,600	32,704,000.000	
	JR REIT XXVII	31,290	168,340,200.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	8,500	55,760,000.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	27,000	175,500,000.000	

韓国・ウォン 小計			韓国・ウォン 839,729,300.000 (80,446,067)
香港・ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	398,000	1,337,280.000
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	250,000	1,135,000.000
	FORTUNE REIT	378,000	3,046,680.000
	PROSPERITY REIT	300,000	930,000.000
	LINK REIT	564,600	38,788,020.000
	CHAMPION REIT	481,000	1,972,100.000
香港・ドル 小計			香港・ドル 47,209,080.000 (688,780,477)
投資証券 合計			47,151,826,564 [47,151,826,564]
合計			47,572,065,639 [47,572,065,639]

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 157銘柄	1.2%	98.8%	76.3%
イギリス・ポンド	投資証券 34銘柄	-%	100%	5.7%
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%	6.9%
カナダ・ドル	投資証券 30銘柄	-%	100%	1.9%
シンガポール・ドル	投資証券 27銘柄	-%	100%	3.2%
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	-%	100%	0.4%
ユーロ	投資証券 32銘柄	-%	100%	3.9%
韓国・ウォン	投資証券 8銘柄	-%	100%	0.2%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	-%	100%	1.4%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワ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5期計算期間（2020年12月1日から2021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】

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4期 2020年11月30日現在	第5期 2021年11月30日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,122,631	1,680,433
親投資信託受益証券	602,779,808	912,545,370
未収入金	394,000	-
流動資産合計	604,296,439	914,225,803
<b>資産合計</b>		
604,296,439		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	575,308	186,371
未払受託者報酬	59,796	93,995
未払委託者報酬	822,816	1,293,242
その他未払費用	14,878	23,425
流動負債合計	1,472,798	1,597,033
<b>負債合計</b>		
1,472,798		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 604,694,831	1 642,622,346
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 1,871,190	2 270,006,424
（分配準備積立金）	59,405,112	244,719,821
元本等合計	602,823,641	912,628,770
<b>純資産合計</b>		
602,823,641		
<b>負債純資産合計</b>		
604,296,439		

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第4期 自 2019年12月3日 至 2020年11月30日	第5期 自 2020年12月1日 至 2021年11月30日
<b>営業収益</b>		
受取利息	1	-
有価証券売買等損益	73,500,071	264,037,562
<b>営業収益合計</b>	<b>73,500,070</b>	<b>264,037,562</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	285	146
受託者報酬	119,688	166,518
委託者報酬	1,647,064	2,291,056
その他費用	29,770	41,472
<b>営業費用合計</b>	<b>1,796,807</b>	<b>2,499,192</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>	<b>75,296,877</b>	<b>261,538,370</b>
経常利益又は経常損失( )	75,296,877	261,538,370
<b>当期純利益又は当期純損失( )</b>	<b>75,296,877</b>	<b>261,538,370</b>
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	26,508,473	25,013,507
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>	<b>87,636,190</b>	<b>1,871,190</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	37,091,730
<b>当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>-</b>	<b>37,091,730</b>
剰余金減少額又は欠損金増加額	40,718,976	1,738,979
<b>当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>21,046,258</b>	<b>1,738,979</b>
<b>当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>19,672,718</b>	<b>-</b>
<b>分配金</b>	<b>1 -</b>	<b>1 -</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>	<b>1,871,190</b>	<b>270,006,424</b>

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第5期	
	自 2020年12月1日	至 2021年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第4期	第5期
	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1. 1 期首元本額	508,116,057円	604,694,831円
期中追加設定元本額	262,282,042円	194,621,133円
期中一部解約元本額	165,703,268円	156,693,618円
2. 計算期間末日における受益権の総数	604,694,831口	642,622,346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4期	第5期
	自 2019年12月3日 至 2020年11月30日	自 2020年12月1日 至 2021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(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>	<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(198,866,305円)、投資信託約款に規定される収益調整金(75,898,156円)及び分配準備積立金(45,853,516円)より分配対象額は320,617,977円(1万口当たり4,989.21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5期 自 2020年12月1日 至 2021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、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5期
	2021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4期	第5期
	2020年11月30日現在	2021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	55,860,494	249,248,237
合計	55,860,494	249,248,237

## （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4期	第5期
2020年11月30日現在	2021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5期
自 2020年12月1日
至 2021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4期	第5期
	2020年11月30日現在	2021年11月30日現在
1口当たり純資産額	0.9969円	1.4202円
（1万口当たり純資産額）	（9,969円）	（14,202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	289,623,388	912,545,370	
親投資信託受益証券 合計			912,545,370	
合計			912,545,370	

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。

## 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11月30日

資産総額	3,526,719,023円
負債総額	5,157,769円
純資産総額（ - ）	3,521,561,254円
発行済数量	2,547,528,267口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3823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11月30日

資産総額	187,880,194,267円
負債総額	5,216,902,565円
純資産総額（ - ）	182,663,291,702円
発行済数量	139,094,932,448口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3132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11月30日

資産総額	3,380,881,193円
負債総額	6,212,789円
純資産総額（ - ）	3,374,668,404円
発行済数量	1,833,901,672口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.8402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11月30日

資産総額	82,299,363,797円
------	-----------------

負債総額	23,539,767円
純資産総額( - )	82,275,824,030円
発行済数量	27,761,727,263口
1単位当たり純資産額( / )	2.9636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11月30日

資産総額	2,635,375,847円
負債総額	6,426,476円
純資産総額( - )	2,628,949,371円
発行済数量	1,473,643,378口
1単位当たり純資産額( / )	1.7840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11月30日

資産総額	250,978,162,380円
負債総額	200,951,017円
純資産総額( - )	250,777,211,363円
発行済数量	61,024,141,090口
1単位当たり純資産額( / )	4.1095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11月30日

資産総額	16,218,281,946円
負債総額	92,281,455円
純資産総額( - )	16,126,000,491円
発行済数量	8,761,904,042口
1単位当たり純資産額( / )	1.8405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11月30日

資産総額	3,043,649,365円
負債総額	2,324,894円
純資産総額( - )	3,041,324,471円
発行済数量	2,995,991,358口
1単位当たり純資産額( / )	1.0151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11月30日

資産総額	95,197,080,993円
負債総額	117,470,022円
純資産総額( - )	95,079,610,971円
発行済数量	66,960,247,306口
1単位当たり純資産額( / )	1.4199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11月30日

資産総額	5,192,138,911円
負債総額	7,694,554円
純資産総額( - )	5,184,444,357円
発行済数量	4,813,778,100口
1単位当たり純資産額( / )	1.0770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11月30日

資産総額	133,586,612,827円
負債総額	594,319,456円
純資産総額( - )	132,992,293,371円
発行済数量	127,114,402,128口
1単位当たり純資産額( / )	1.0462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11月30日

資産総額	3,302,654,631円
負債総額	5,149,282円
純資産総額( - )	3,297,505,349円
発行済数量	2,901,476,819口
1単位当たり純資産額( / )	1.1365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11月30日

資産総額	233,916,004,169円
負債総額	283,889,567円
純資産総額( - )	233,632,114,602円
発行済数量	74,475,307,643口
1単位当たり純資産額( / )	3.1370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11月30日

資産総額	22,263,165,405円
負債総額	93,528,868円
純資産総額( - )	22,169,636,537円
発行済数量	15,940,538,445口
1単位当たり純資産額( / )	1.3908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11月30日

資産総額	1,681,897,788円
負債総額	2,552,983円

純資産総額( - )	1,679,344,805円
発行済数量	1,291,974,799口
1単位当たり純資産額( / )	1.2998円

## (参考) ダイワJ-REITマザーファンド

## 純資産額計算書

2021年11月30日

資産総額	448,413,131,130円
負債総額	1,678,779,100円
純資産総額( - )	446,734,352,030円
発行済数量	134,790,265,060口
1単位当たり純資産額( / )	3.3143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11月30日

資産総額	1,064,403,435円
負債総額	1,930,711円
純資産総額( - )	1,062,472,724円
発行済数量	788,413,204口
1単位当たり純資産額( / )	1.3476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11月30日

資産総額	48,780,356,819円
負債総額	151,415,884円
純資産総額( - )	48,628,940,935円
発行済数量	15,433,680,362口
1単位当たり純資産額( / )	3.1508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11月30日

資産総額	914,225,803円
負債総額	1,597,033円
純資産総額( - )	912,628,770円
発行済数量	642,622,346口
1単位当たり純資産額( / )	1.4202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。

## 第二部【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11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11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	60	175,229
追加型株式投資信託	772	21,068,563
株式投資信託 合計	832	21,243,792
単位型公社債投資信託	78	215,962
追加型公社債投資信託	14	1,474,160
公社債投資信託 合計	92	1,690,122
総合計	924	22,933,914

## 3【委託会社等の経理状況】

1．当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

なお、当中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）は、改政府令附則第3条第1項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2．当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第62期事業年度（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。

また、第63期事業年度に係る中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

3．財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

## (1)【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (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	217	1	224
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					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,052	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 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	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
	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	363	363	38,430
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	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) その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

### (1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	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いません。

(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、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

内国籍証券投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

### 3. 主要な顧客ごとの情報

営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

#### [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度(自 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	(株)大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取 (注)	19,300 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(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	16,953	未払手数料	2,984
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)	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(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)	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す。

(注2) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3) 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㈱	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)	14,917	未払手数 料	3,321
						本社ビルの 管理	不動産の 賃借料 (注4)	527	長期差入 保証金	1,054
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)	883	未払費用	179
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)	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す。

(注2)証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3)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。

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

（単位：百万円）

		当中間会計期間 （2021年9月30日）
資産の部		
流動資産		
現金・預金		2,139
有価証券		250
未収委託者報酬		13,857
関係会社短期貸付金		16,300
その他		369
流動資産合計		32,916
固定資産		



有形固定資産	1	211
無形固定資産		
ソフトウェア		1,633
その他		134
無形固定資産合計		1,768
投資その他の資産		
投資有価証券		11,373
関係会社株式		3,705
繰延税金資産		786
その他		1,246
投資その他の資産合計		17,111
固定資産合計		19,091
資産合計		52,007

(単位:百万円)

当中間会計期間  
(2021年9月30日)

## 負債の部

## 流動負債

未払金		7,322
未払費用		3,879
未払法人税等		795
賞与引当金		711
その他	2	927

流動負債合計		13,635
--------	--	--------

## 固定負債

退職給付引当金		2,475
役員退職慰労引当金		92
その他		2

固定負債合計		2,571
--------	--	-------

## 負債合計

負債合計		16,206
------	--	--------

## 純資産の部

## 株主資本

資本金		15,174
資本剰余金		
資本準備金		11,495
資本剰余金合計		11,495

利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	7,594
利益剰余金合計	7,968
株主資本合計	34,638
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,162
評価・換算差額等合計	1,162
純資産合計	35,801
負債・純資産合計	52,007

## (2)中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		37,075
その他営業収益		295
営業収益合計		37,371
営業費用		
支払手数料		15,707
その他営業費用		6,525
営業費用合計		22,233
一般管理費	1	5,737
営業利益		9,400
営業外収益	2	228
営業外費用	3	87
経常利益		9,540
特別利益		-
特別損失	4	129
税引前中間純利益		9,411
法人税、住民税及び事業税		2,910
法人税等調整額		92
中間純利益		6,407

## (3)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

(単位:百万円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	9,388	9,388	9,388
中間純利益	-	-	-	6,407	6,407	6,407
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	2,980	2,980	2,980
当中間期末残高	15,174	11,495	374	7,594	7,968	34,638

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	947	947	38,566
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	9,388
中間純利益	-	-	6,407
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額(純額)	214	214	214
当中間期変動額合計	214	214	2,765
当中間期末残高	1,162	1,162	35,801

## 注記事項

(重要な会計方針)

## 1．有価証券の評価基準及び評価方法

### （１）子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

### （２）その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2．固定資産の減価償却の方法

### （１）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
----	--------

器具備品	4～20年
------	-------

### （２）無形固定資産

定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（５年間）に基づく定額法によっております。

## 3．引当金の計上基準

### （１）賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

### （２）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員・参与及び上席参事についても、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

### （３）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

## 4．収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

当社は投資信託の信託約款に基づき、証券投資信託の運用について履行義務を負っております。

当社の日々のサービス提供時に当履行義務が充足されるため、一定期間にわたり収益を認識しております。

#### 5. 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。

#### 6. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

#### 7. 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。

#### (会計方針の変更)

##### (収益認識に関する会計基準等の適用)

「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。)等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当中間会計期間の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当中間会計期間の期首の利益剰余金に加減し、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。これによる当中間会計期間の損益及び期首利益剰余金に与える影響はありません。

#### (中間貸借対照表関係)

##### 1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (2021年9月30日現在)
有形固定資産	307百万円

##### 2 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

##### 3 保証債務

当中間会計期間(2021年9月30日現在)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,726百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 2021年 4月 1日 至 2021年 9月30日)
有形固定資産	12百万円
無形固定資産	289百万円

2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2021年 4月 1日 至 2021年 9月30日)
投資有価証券売却益	117百万円
時効成立分配金・償還金	28百万円
受取配当金	26百万円

3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2021年 4月 1日 至 2021年 9月30日)
投資有価証券売却損	58百万円
未収入金清算費用	9百万円

4 特別損失の項目

	当中間会計期間 (自 2021年 4月 1日 至 2021年 9月30日)
投資有価証券評価損	102百万円
出資金評価損	27百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 2021年 4月 1日 至 2021年 9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608

合計	2,608	-	-	2,608
----	-------	---	---	-------

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
2021年6月22日 定時株主総会	普通株式	9,388	3,599	2021年3月31日	2021年6月23日

(金融商品関係)

当中間会計期間(2021年9月30日)

## 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、2019年7月4日公表の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、「2019年適用指針」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。

## (1) 時価をもって中間貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券(1)	85			85
資産合計	85			85

(1) 2019年適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券250百万円、投資有価証券10,621百万円は上記の表に含めておりません。

## (2) 時価をもって中間貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、短期貸付金、未払金及び未払費用は、短期間(1年以内)で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

## 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、2019年適用指針第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格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中間貸借対照表計上額は次のとおりであり、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中の投資有価証券には含めておりません。

（単位：百万円）

区分	当中間会計期間
非上場株式等	666
子会社株式	1,677
関連会社株式	2,027

（有価証券関係）

当中間会計期間（2021年9月30日）

### 1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額 1,677百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 2,027百万円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

### 2. その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額（百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	85	55	30
（2）その他	7,691	5,841	1,850
小計	7,777	5,896	1,881
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	3,179	3,398	219
小計	3,179	3,398	219
合計	10,956	9,294	1,661

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額 666百万円）については、市場価格がないことから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（収益認識関係）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報

注記事項（セグメント情報等）に記載のとおり、単一のサービス区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えており、かつ、内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、セグメント情報に追加しての記載は行っておりません。



## 〔セグメント情報等〕

## 〔セグメント情報〕

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

当社は、資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

## 〔関連情報〕

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

## 1. サービスごとの情報

単一のサービス区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 3. 主要な顧客ごとの情報

営業収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

## 〔報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報〕

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報〕

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

## 〔報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報〕

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

該当事項はありません。

## 〔1株当たり情報〕

当中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1株当たり純資産額	13,724.67円

1株当たり中間純利益

2,456.52円

(注1) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。

(注2) 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
中間純利益(百万円)	6,407
普通株式に係る中間純利益(百万円)	6,407
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

通常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 (2021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	(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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が関東財務局長に提出されております。

(提出年月日)	(書類名)
2021年2月19日	有価証券報告書、有価証券届出書
2021年8月24日	半期報告書、有価証券届出書

**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**

2022年1月7日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 深井 康治指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 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2021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 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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**

2022年1月7日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 深井 康治  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 竹内 知明  
業務執行社員**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2021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 . 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）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**

2022年1月7日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 深井 康治指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 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2021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 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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**

2022年1月7日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 深井 康治指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 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2021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 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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**

2022年1月7日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井 康治
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹内 知明
--------------------	-------	-------

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 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2021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 . 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）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**

2022年1月7日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井 康治
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹内 知明
--------------------	-------	-------

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 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2021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 . 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）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**

2022年1月7日

大和アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井 康治
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	竹内 知明
--------------------	-------	-------

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックスの2020年12月1日から2021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2021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 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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**

2022年1月7日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 深井 康治指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン 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2021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 . 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）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**

2022年1月7日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 深井 康治指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 竹内 知明**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップオンライン J-REITインデックスの2020年12月1日から2021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2021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 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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11月25日

大和アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	間瀬	友未
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井	康治

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第63期事業年度の中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和アセットマネジメント株式会社の2021年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

## 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1. 上記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。